

**华夏中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	78
7.1 期末基金资产组合情况.....	78
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	78
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	79
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	92
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	94
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	94
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	94
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	94
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	94
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	94
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	95
7.12 投资组合报告附注.....	95
§8 基金份额持有人信息.....	96
§9 开放式基金份额变动.....	98
§10 重大事件揭示.....	98
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
§12 备查文件目录.....	102

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500（扩位证券简称：500ETF 基金）
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,120,808,794 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为“中证 500 指数”。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	李申
	联系电话	400-818-6666	021-60637102
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637111
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	365,995,569.10
本期利润	362,397,041.21
加权平均基金份额本期利润	0.3250
本期加权平均净值利润率	9.71%
本期基金份额净值增长率	8.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-1,145,079,417.35
期末可供分配基金份额利润	-1.0217
期末基金资产净值	3,975,412,712.88
期末基金份额净值	3.5469
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-22.36%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

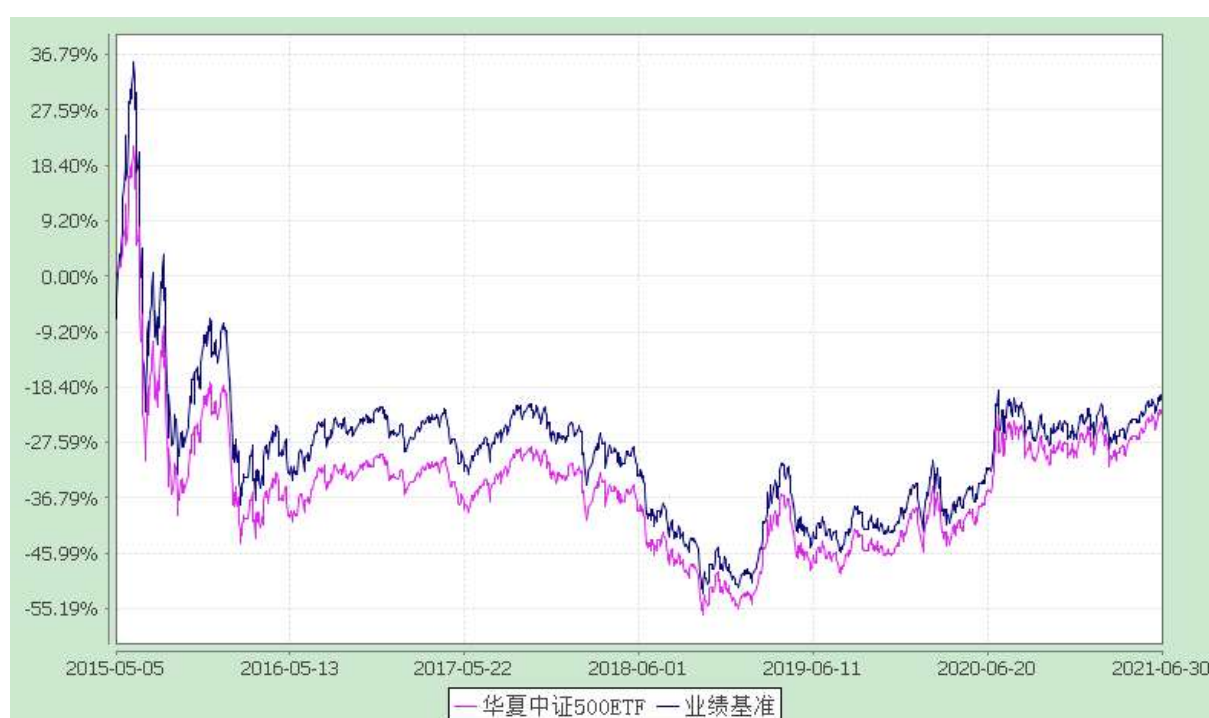
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.74%	1.18%	0.73%	0.50%	0.01%

过去三个月	9.85%	0.68%	8.86%	0.68%	0.99%	0.00%
过去六个月	8.08%	0.99%	6.93%	0.99%	1.15%	0.00%
过去一年	18.88%	1.25%	16.09%	1.25%	2.79%	0.00%
过去三年	37.99%	1.47%	30.48%	1.48%	7.51%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-22.36%	1.72%	-20.00%	1.76%	-2.36%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 5 月 5 日至 2021 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资

原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理上证 50ETF(510050)、300ETF 基金(510330)、MSCIA 股 ETF(512990)、500ETF 基金(512500)、中小 100(159902)、双创基金(159783)、创业板 HX(159957)、科创 50ETF(588000)、中证 1000(159845)、央企改革 ETF(512950)、四川国改(159962)、浙江国资 ETF(515760)、战略新兴 ETF(512770)、5GETF(515050)、人工智能 AIETF(515070)、芯片 ETF(159995)、新能源车 ETF(515030)、智能车(159888)、高端装备 ETF(516320)、大湾区(159983)、沪港深 ETF(517170)、消费 ETF 基金(510630)、金融地产 ETF(510650)、医药卫生 ETF(510660)、食品饮料 ETF(515170)、券商 ETF 基金(515010)、银行 ETF 华夏(515020)、房地产 ETF 基金(515060)、大数据 50ETF(516000)、生物科技 ETF(516500)、新能源 80ETF(516850)、游戏 ETF(159869)、有色 50ETF(516650)、创蓝筹(159966)、创成长(159967)、恒生 ETF(513660)、恒生 ETF(159920)、恒生科技指数 ETF(513180)、恒生互联网 ETF(513330)、H 股 50(159850)、日经 ETF(513520)、纳斯达克 ETF(513300)、中期信用 ETF(511280)、豆粕 ETF(159985)、黄金 ETF9999(518850)，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏新时代混合（QDII）排序第 1/36、华夏移动互联混合（QDII）排序第 4/36；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票排序第 2/36；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合(A 类)排序第 2/21；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 37/226；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏回报混合(A 类)排序第 25/139、华夏回报二号混合排序第 27/139；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%60%）（A 类）中华夏军工安全混合排序第 39/491；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 15/491、华夏稳盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 9/566、华夏行业龙头混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 11/168、华夏兴华混合(A 类)

排序第 32/168、华夏大盘精选混合(A 类)排序第 40/168；在偏债型基金(A 类)中华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 44/149。FOF 类产品中，在养老目标风险 FOF（权益资产 0-30%）(A 类)中华夏稳健养老一年持有混合（FOF）排序第 4/20；在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）(A 类)排序第 10/36；

固收与固收+产品：在普通债券型基金（可投转债）(A 类)中华夏聚利债券排序第 1/196、华夏双债债券(A 类)排序第 3/196、华夏债券(A/B 类)排序第 12/196；在可转换债券型基金（A 类）中华夏可转债增强债券(A 类)排序第 3/34；在定期开放式纯债债券型基金（摊余成本法）(A 类)中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/73；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 12/53；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 18/149；在普通债券型基金（二级）(A 类)中华夏安康债券(A 类)排序第 40/248、华夏鼎利债券(A 类)排序第 41/248。在 QDII 债券型基金（非 A 类）中华夏收益债券（QDII）(A 类)(美元)排序第 2/35、华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)（美元）排序第 4/35；

指数与量化产品：在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/22、华夏创蓝筹 ETF 排序第 6/22；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/90、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 排序第 26/90；在行业指数股票 ETF 基金中华夏消费 ETF 排序第 4/39、华夏医药 ETF 排序第 5/39；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强(A 类)排序第 6/93；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/88、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/88、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 11/88。

在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动上，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，荣膺四大奖项：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金 股票型基金三年期奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”，华夏能源革新股票荣获“金基金 社会责任投资（ESG）基金奖”。

在客户服务方面，2021 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端上线理财小管家和微信登录等功能，方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息，也为客户提供了多样的登录方式；（2）华夏基金公众号上线选基助手微信小程序，包含花样选基、目标选基、我的实验田等 5 大功能模块，帮助客户进行产品筛选；（3）与民商基金销售、众惠基金等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“都 2021 年了，你还要自己记么？”、“震荡市需要口服镇心丸”、“风往哪吹”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的基金 经理、投委会 成员	2016-10-20	-	11 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金 管理有限公司。曾任研究发 展部高级产品经理, 数量投资 部研究员、投资经理、基金经 理助理、MSCI 中国 A 股交易 型开放式指数证券投资基金 基金经理 (2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、 MSCI 中国 A 股交易型开放式 指数证券投资基金联接基金 基金经理 (2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间)、 上证主要消费交易型开放式 指数发起式证券投资基金基 金经理 (2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)、华夏 智胜价值成长股票型发起式 证券投资基金基金经理 (2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间)等。

注: ①上述任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的, 其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同, 本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合, 制定并严格遵守相应的制度和流程, 通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内, 本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 41 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

上半年，各国加快推进疫苗接种，疫情对经济的边际影响逐步减弱，世界经济趋于好转，但各国疫情时有反复，加上新型变种的出现，形势依然复杂严峻。美国大规模财政刺激与货币宽松共振使得市场的关注点迅速从通缩转向通胀，美债收益率对经济复苏预期予以了反应，美联储 6 月议息会议决定维持利率政策按兵不动，但大幅提高通胀和经济增长预期，过多数委员预测 2023 年底前可能会加息两次；欧洲国家疫情反复，欧洲央行维持再融资利率、存款利率、边际贷款利率不变，符合市场预期；日本央行坚持实施更有效和可持续的货币宽松政策，日元略有贬值。

国内方面，上半年经济运行延续稳定恢复态势，社融信贷增速虽同比下降，但经济仍显活力，在生产需求持续恢复、就业物价总体稳定的同时，创新驱动战略实施成效继续显现，高技术产业发展向好，新业态持续保持迅猛发展态势；海外输入型通胀隐忧随着 5 月经济数据的落定有所缓解，政策稳定性凸显，流动性整体维持相对宽松。

市场方面，A 股主要股指开年全线上扬，并在春节前步步走高；春节后，在经济复苏预期下，全球资金利率明显上行，全球资本市场波动共振加剧，A 股市场一些对资金利率较为敏感的板块出现较大幅度的调整。2 季度企稳后，市场震荡向上，个股板块分化，但总体韧性较强。受“碳达峰、碳中和”政策逐步落地、全球芯片短缺加剧等利好因素的催化，电气设备、汽车、电子这几个 1 季度跌幅较大的成长板块涨幅靠前，突破或接近去年以来的新高；采掘、化工、有色等板块也延续了 1 季度的相对强势；医药生物、国防军工、食品饮料等板块也实现了回调后的反弹；休闲服务、房地产、家用电器以及农林牧渔板块表现则相对弱势。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东方证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、海通证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.5469 元，本报告期份额净值增长率为 8.08%，同期业绩比较基准增长率 6.93%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.15%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着新冠疫苗全球逐步普及，全球经济或将延续稳步复苏态势，美国上半年的通货膨胀超预期，美联储维持当前宽松货币政策的压力增加，但后续政策收紧压力一定程度上已被市场预期，对经济和货币相对强势的中国市场或影响有限。国内方面，经济增长保持在较高水平，经济同比增速或将下降，货币、信贷政策收紧预期得到一定缓解，新经济板块仍获得国家政策支持。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	12,773,529.56	10,387,934.44
结算备付金		85,506,999.47	121,262,477.91
存出保证金		17,054,656.85	21,460,250.64
交易性金融资产	6.4.7.2	3,870,349,164.56	5,260,476,612.48
其中：股票投资		3,870,349,164.56	5,260,457,612.48

基金投资		-	-
债券投资		-	19,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,502,867.12	144,833,041.52
应收利息	6.4.7.5	369,711.09	226,482.34
应收股利		1,217,771.44	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,996,774,700.09	5,558,646,799.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,549,191.22	128,186,151.79
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,569,674.63	2,347,348.27
应付托管费		313,934.91	469,469.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,998,255.94	6,354,188.39
应交税费		19,144.39	16,973.49
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,911,786.12	18,046,127.84
负债合计		21,361,987.21	155,420,259.43
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	5,120,492,130.23	7,521,731,909.79
未分配利润	6.4.7.10	-1,145,079,417.35	-2,118,505,369.89
所有者权益合计		3,975,412,712.88	5,403,226,539.90
负债和所有者权益总计		3,996,774,700.09	5,558,646,799.33

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.5469 元，基金份额总额 1,120,808,794.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		382,635,513.63	708,695,908.79
1.利息收入		4,829,388.30	3,831,640.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	851,232.27	1,431,897.60
债券利息收入		577.86	2,235.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,602.74	1,032.88
证券出借利息收入		3,966,975.43	2,396,474.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		367,895,460.49	557,163,669.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	326,897,097.55	497,650,067.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	405,664.76	2,845,665.04
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	8,511,650.48	20,083,723.79
股利收益	6.4.7.17	32,081,047.70	36,584,213.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,598,527.89	158,731,224.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	13,509,192.73	-11,030,625.75
减：二、费用		20,238,472.42	26,134,850.74
1.管理人报酬		9,259,767.71	13,775,343.86
2.托管费		1,851,953.43	2,755,068.78
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	8,386,985.21	8,566,443.00
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		37,439.82	67,447.92
7.其他费用	6.4.7.21	702,326.25	970,547.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		362,397,041.21	682,561,058.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		362,397,041.21	682,561,058.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,521,731,909.79	-2,118,505,369.89	5,403,226,539.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	362,397,041.21	362,397,041.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,401,239,779.56	611,028,911.33	-1,790,210,868.23
其中：1.基金申购款	6,191,324,488.95	-1,709,295,848.28	4,482,028,640.67
2.基金赎回款	-8,592,564,268.51	2,320,324,759.61	-6,272,239,508.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,120,492,130.23	-1,145,079,417.35	3,975,412,712.88
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,641,477,405.98	-4,043,818,189.03	5,597,659,216.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	682,561,058.05	682,561,058.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,211,116,871.67	783,367,522.96	-1,427,749,348.71
其中：1.基金申购款	7,759,257,209.62	-3,149,142,461.73	4,610,114,747.89
2.基金赎回款	-9,970,374,081.29	3,932,509,984.69	-6,037,864,096.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,430,360,534.31	-2,577,889,608.02	4,852,470,926.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]113 号《关于准予华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 2,134,343,230 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2015 年 5 月 22 日中证 500 指数收盘值的两千万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 2,134,473,505 份，本次基金份额折算比例为 0.21889230，折算后基金份额总额为 467,208,794 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。
- (9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。
- (10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。
- (11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	12,773,529.56
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	12,773,529.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,667,486,449.74	3,870,349,164.56	202,862,714.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,667,486,449.74	3,870,349,164.56	202,862,714.82

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	97,326,080.00	-	-	-
其中：股指期货	97,326,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	97,326,080.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位： 手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2109	中证 500 股指期货 IC2109 合约	46	61,336,400.00	2,709,600.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投

					资目标。
IC2107	中证 500 股指期货 IC2107 合约	14	18,948,160.00	597,520.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2112	中证 500 股指期货 IC2112 合约	12	15,650,880.00	702,440.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2108	中证 500 股指期货 IC2108 合约	4	5,369,600.00	-30,600.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计					3,978,960.00
股指期货投资本期收益					8,511,650.48
股指期货投资本期公允价值变动					2,042,480.00

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,676.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	42,487.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	324,510.20
其他	1,037.20
合计	369,711.09

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,998,255.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,998,255.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
应付指数使用费	279,696.38
应退替代款	2,518,034.40
合计	2,911,786.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,646,408,794.00	7,521,731,909.79
本期申购	1,355,200,000.00	6,191,324,488.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,880,800,000.00	-8,592,564,268.51
本期末	1,120,808,794.00	5,120,492,130.23

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-350,619,887.76	-1,767,885,482.13	-2,118,505,369.89
本期利润	365,995,569.10	-3,598,527.89	362,397,041.21
本期基金份额交易产生的变动数	102,220,824.94	508,808,086.39	611,028,911.33
其中：基金申购款	-56,017,137.79	-1,653,278,710.49	-1,709,295,848.28
基金赎回款	158,237,962.73	2,162,086,796.88	2,320,324,759.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,596,506.28	-1,262,675,923.63	-1,145,079,417.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,428.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	787,529.32
其他	21,274.46
合计	851,232.27

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	204,359,428.61
股票投资收益——赎回差价收入	122,537,668.94
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	326,897,097.55

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,283,755,000.38
减：卖出股票成本总额	4,079,395,571.77
买卖股票差价收入	204,359,428.61

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	6,272,239,508.90
减：现金支付赎回款总额	3,286,275,208.90
减：赎回股票成本总额	2,863,426,631.06
赎回差价收入	122,537,668.94

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,719,556.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,313,300.00
减：应收利息总额	591.25
买卖债券差价收入	405,664.76

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	8,511,650.48
合计	8,511,650.48

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	32,081,047.70
其中：证券出借权益补偿收入	3,297,722.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	32,081,047.70

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-5,641,007.89
——股票投资	-5,641,007.89
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	2,042,480.00
——权证投资	-
——期货投资	2,042,480.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,598,527.89

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	13,509,192.73
合计	13,509,192.73

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	8,386,985.21
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	8,386,985.21
----	--------------

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	32,684.86
指数使用费	555,586.05
合计	702,326.25

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏中证 500ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

中信证券	4,091,973,658.92	52.62%	641,970,111.55	7.96%
------	------------------	--------	----------------	-------

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	4,694,556.01	66.93%	2,168,902.10	10.80%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	15,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	1,764,898.34	52.62%	247,612.96	3.54%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	276,881.15	7.95%	233,882.85	5.54%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,259,767.71	13,775,343.86
其中：支付销售机构的客户维护费	130,441.41	183,935.34

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,851,953.43	2,755,068.78

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	363,721,914.13	500,489.18	737,492.00	203.24
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日				

关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	323,619,113.20	501,571.90	1,856,624.00	294,325.10

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2021021800001091	捷成股份	2021-02-18	30,400.00	10,000.00	14	3.50	41.38	-	-
中信证券	2021021800040142	神州泰岳	2021-02-18	190,965.00	43,900.00	28	3.40	505.00	-	-
中信证券	2021021800040144	捷成股份	2021-02-18	142,576.00	46,900.00	28	3.30	365.95	-	-
中信证券	2021021800040146	欣旺达	2021-02-18	678,405.00	24,500.00	28	3.40	1,794.00	-	-
中信证券	2021021800040148	利亚德	2021-02-18	262,890.00	38,100.00	28	3.40	695.20	-	-
中信证券	2021021800040150	长信科技	2021-02-18	430,674.00	53,700.00	28	3.40	1,138.89	-	-
中信证券	2021021800040152	三聚环保	2021-02-18	215,490.00	33,000.00	28	3.40	569.85	-	-
中信	2021021800040154	机器	2021-02-18	327,600.00	28,000.00	28	3.40	866.32	-	-

证券		人								
中信证券	2021021800040156	阳光电源	2021-02-18	2,713,780.00	23,500.00	28	3.40	7,176.44	-	-
中信证券	2021021800040158	万达信息	2021-02-18	370,512.00	18,600.00	28	3.50	1,008.62	-	-
中信证券	2021021800040160	旋极信息	2021-02-18	88,404.00	27,800.00	28	3.10	213.15	-	-
中信证券	2021021800040170	华宇软件	2021-02-18	267,618.00	14,600.00	28	3.40	707.70	-	-
中信证券	2021021800040870	华峰超纤	2021-02-18	155,960.00	28,000.00	28	3.40	412.43	-	-
中信证券	2021021800044038	蓝色光标	2021-02-18	273,564.00	44,700.00	28	3.40	723.42	-	-
中信证券	2021021800044040	特锐德	2021-02-18	447,576.00	13,600.00	28	3.40	1,183.59	-	-
中信证券	2021021800044042	网宿科技	2021-02-18	287,760.00	43,600.00	28	3.40	760.97	-	-
中信证券	2021021800044044	红日药业	2021-02-18	164,024.00	40,600.00	28	3.40	433.75	-	-
中信证券	2021021800044046	长盈精密	2021-02-18	315,112.00	13,600.00	28	3.20	784.28	-	-
中信	2021021800044048	碧水	2021-02-18	367,500.00	49,000.00	28	3.40	971.83	-	-

证券		源									
中信证券	2021021800044050	昆仑万维	2021-02-18	421,544.00	18,400.00	28	3.40	1,114.75	-	-	
中信证券	2021021800044052	华策影视	2021-02-18	187,094.00	27,800.00	28	3.40	494.76	-	-	
中信证券	2021021800044054	晶盛机电	2021-02-18	598,230.00	13,800.00	28	3.40	1,581.99	-	-	
中信证券	2021021800044056	东方国信	2021-02-18	173,850.00	19,000.00	28	3.40	459.74	-	-	
中信证券	2021021800044058	汤臣倍健	2021-02-18	390,720.00	17,600.00	28	3.40	1,033.24	-	-	
中信证券	2021021800044060	安科生物	2021-02-18	343,785.00	21,500.00	28	3.40	909.12	-	-	
中信证券	2021021800044062	豆神教育	2021-02-18	116,405.00	15,500.00	28	3.40	307.83	-	-	
中信证券	2021021800044064	掌趣科技	2021-02-18	336,072.00	62,700.00	28	3.40	888.72	-	-	
中信证券	2021021800044066	国瓷材料	2021-02-18	960,500.00	17,000.00	28	3.40	2,539.99	-	-	
中信证券	2021021800044068	华测检测	2021-02-18	1,112,535.00	36,900.00	28	3.40	2,942.04	-	-	
中信	2021030400034849	捷成	2021-03-04	32,000.00	10,000.00	14	3.50	43.56	-	-	

证券		股份									
中信证券	2021031000007096	中科 创达	2021-03-10	1,679,600.00	15,200.00	28	3.30	4,310.97	-	-	
中信证券	2021031000007098	我武 生物	2021-03-10	981,240.00	17,000.00	28	3.40	2,594.83	-	-	
中信证券	2021031000007100	迪安 诊断	2021-03-10	723,060.00	23,400.00	28	3.30	1,855.85	-	-	
中信证券	2021031000007102	易华 录	2021-03-10	436,975.00	17,500.00	28	3.30	1,121.57	-	-	
中信证券	2021031000007104	顺网 科技	2021-03-10	322,875.00	22,500.00	28	3.30	828.71	-	-	
中信证券	2021031000007106	大富 科技	2021-03-10	202,446.00	20,700.00	28	3.50	551.10	-	-	
中信证券	2021031000007108	万孚 生物	2021-03-10	849,594.00	11,100.00	28	3.30	2,180.62	-	-	
中信证券	2021031000007110	欧普 康视	2021-03-10	1,270,672.00	16,400.00	28	3.60	3,557.88	-	-	
中信证券	2021031000007112	开山 股份	2021-03-10	277,315.00	18,500.00	28	3.30	711.78	-	-	
中信证券	2021031800037544	旋极 信息	2021-03-18	98,690.00	27,800.00	28	3.40	260.98	-	-	
中信	2021031800037546	华宇	2021-03-18	280,904.00	14,600.00	28	3.30	720.99	-	-	

证券		软件								
中信证券	2021031800037548	三聚环保	2021-03-18	240,240.00	33,000.00	28	3.20	597.93	-	-
中信证券	2021031800037550	长信科技	2021-03-18	405,435.00	53,700.00	28	3.40	1,072.15	-	-
中信证券	2021031800037552	阳光电源	2021-03-18	1,694,115.00	23,500.00	28	3.50	4,611.76	-	-
中信证券	2021031800037554	机器人	2021-03-18	317,520.00	28,000.00	28	3.30	814.97	-	-
中信证券	2021031800037556	万达信息	2021-03-18	269,514.00	18,600.00	28	3.50	733.68	-	-
中信证券	2021031800037558	捷成股份	2021-03-18	158,522.00	46,900.00	28	3.40	419.20	-	-
中信证券	2021031800037560	利亚德	2021-03-18	273,939.00	38,100.00	28	3.20	681.80	-	-
中信证券	2021031800037562	欣旺达	2021-03-18	508,865.00	24,500.00	28	3.30	1,306.09	-	-
中信证券	2021031800037564	神州泰岳	2021-03-18	208,525.00	43,900.00	28	4.10	664.96	-	-
中信证券	2021031800037570	捷成股份	2021-03-18	33,800.00	10,000.00	14	3.50	46.01	-	-
中信	2021031800037572	华峰	2021-03-18	180,320.00	28,000.00	28	3.20	448.80	-	-

证券		超纤									
中信证券	2021031800037574	蓝色光标	2021-03-18	262,389.00	44,700.00	28	3.30	673.47	-	-	
中信证券	2021031800037576	红日药业	2021-03-18	166,054.00	40,600.00	28	3.30	426.21	-	-	
中信证券	2021031800037578	特锐德	2021-03-18	357,544.00	13,600.00	28	3.40	945.51	-	-	
中信证券	2021031800037580	网宿科技	2021-03-18	276,860.00	43,600.00	28	3.40	732.14	-	-	
中信证券	2021031800037582	汤臣倍健	2021-03-18	485,760.00	17,600.00	28	3.40	1,284.57	-	-	
中信证券	2021031800037584	安科生物	2021-03-18	307,020.00	21,500.00	28	3.30	788.02	-	-	
中信证券	2021031800037586	掌趣科技	2021-03-18	326,667.00	62,700.00	28	3.50	889.26	-	-	
中信证券	2021031800037588	长盈精密	2021-03-18	288,456.00	13,600.00	28	3.30	740.37	-	-	
中信证券	2021031800037590	豆神教育	2021-03-18	137,330.00	15,500.00	28	4.40	469.97	-	-	
中信证券	2021031800037592	国瓷材料	2021-03-18	683,230.00	17,000.00	28	3.20	1,700.48	-	-	
中信	2021031800037594	东方	2021-03-18	170,430.00	19,000.00	28	3.40	450.69	-	-	

证券		国信									
中信证券	2021031800037596	晶盛机电	2021-03-18	460,230.00	13,800.00	28	3.50	1,252.85	-	-	
中信证券	2021031800037598	华测检测	2021-03-18	959,769.00	36,900.00	28	3.30	2,463.41	-	-	
中信证券	2021031800037600	碧水源	2021-03-18	382,200.00	49,000.00	28	3.30	980.98	-	-	
中信证券	2021031800037602	昆仑万维	2021-03-18	433,136.00	18,400.00	28	3.40	1,145.40	-	-	
中信证券	2021031800037604	华策影视	2021-03-18	169,858.00	27,800.00	28	3.30	435.97	-	-	
中信证券	2021040100030471	捷成股份	2021-04-01	32,800.00	10,000.00	14	3.50	44.64	-	-	
中信证券	2021040700009549	汤臣倍健	2021-03-18	12,320.00	-	28	3.40	-	-	-	
中信证券	2021041500032466	昆仑万维	2021-04-15	367,264.00	18,400.00	28	3.40	971.21	-	-	
中信证券	2021041500032472	蓝色光标	2021-04-15	275,799.00	44,700.00	28	3.40	729.34	-	-	
中信证券	2021041500032474	碧水源	2021-04-15	374,360.00	49,000.00	28	3.40	989.97	-	-	
中信	2021041500032476	长信	2021-04-15	388,251.00	53,700.00	28	3.40	1,026.71	-	-	

证券		科技									
中信证券	2021041500032478	长盈精密	2021-04-15	264,792.00	13,600.00	28	3.40	700.23	-	-	
中信证券	2021041500032480	三聚环保	2021-04-15	189,750.00	33,000.00	28	3.50	516.54	-	-	
中信证券	2021041500032482	红日药业	2021-04-15	159,558.00	40,600.00	28	3.40	421.94	-	-	
中信证券	2021041500032484	安科生物	2021-04-15	387,645.00	21,500.00	28	3.40	1,025.11	-	-	
中信证券	2021041500032486	神州泰岳	2021-04-15	190,526.00	43,900.00	28	3.40	503.84	-	-	
中信证券	2021041500032488	特锐德	2021-04-15	328,304.00	13,600.00	28	3.10	791.58	-	-	
中信证券	2021041500032490	豆神教育	2021-04-15	115,785.00	15,500.00	28	3.40	306.19	-	-	
中信证券	2021041500032492	机器人	2021-04-15	283,080.00	28,000.00	28	3.40	748.59	-	-	
中信证券	2021041500032494	网宿科技	2021-04-15	270,320.00	43,600.00	28	3.40	714.85	-	-	
中信证券	2021041500032496	华测检测	2021-04-15	1,133,199.00	36,900.00	28	3.40	2,996.68	-	-	
中信	2021041500032498	华策	2021-04-15	182,924.00	27,800.00	28	3.40	483.73	-	-	

证券		影视								
中信证券	2021041500032500	利亚德	2021-04-15	294,132.00	38,100.00	28	3.40	777.82	-	-
中信证券	2021041500032502	国瓷材料	2021-04-15	751,740.00	17,000.00	28	3.40	1,987.93	-	-
中信证券	2021041500032504	阳光电源	2021-04-15	1,621,500.00	23,500.00	28	3.50	4,414.08	-	-
中信证券	2021041500032508	掌趣科技	2021-04-15	314,127.00	62,700.00	28	3.40	830.69	-	-
中信证券	2021041500032510	旋极信息	2021-04-15	96,744.00	27,800.00	28	3.50	263.36	-	-
中信证券	2021041500032512	晶盛机电	2021-04-15	444,084.00	13,800.00	28	3.40	1,174.36	-	-
中信证券	2021041500032514	华宇软件	2021-04-15	269,078.00	14,600.00	28	3.40	711.56	-	-
中信证券	2021041500032986	万达信息	2021-04-15	246,450.00	18,600.00	28	3.50	670.89	-	-
中信证券	2021041500032988	东方国信	2021-04-15	179,170.00	19,000.00	28	3.50	487.74	-	-
中信证券	2021041500032990	汤臣倍健	2021-04-15	506,176.00	17,600.00	28	3.40	1,338.55	-	-
中信	2021041500032992	华峰	2021-04-15	155,960.00	28,000.00	28	3.40	412.43	-	-

证券		超纤									
中信证券	2021041500032994	欣旺达	2021-04-15	539,000.00	24,500.00	28	3.40	1,425.36	-	-	
中信证券	2021041500032996	捷成股份	2021-04-15	32,400.00	10,000.00	14	3.50	44.10	-	-	
中信证券	2021041500032998	捷成股份	2021-04-15	151,956.00	46,900.00	28	3.40	401.84	-	-	
中信证券	2021041500033356	国瓷材料	2021-04-15	1,700.00	-	28	3.40	-	-	-	
中信证券	2021042900023945	捷成股份	2021-04-29	35,100.00	10,000.00	14	3.50	47.78	-	-	
中信证券	2021051300025346	神州泰岳	2021-05-13	202,379.00	43,900.00	28	3.40	535.18	-	-	
中信证券	2021051300027668	华策影视	2021-05-13	173,194.00	27,800.00	28	3.60	484.94	-	-	
中信证券	2021051300027670	华峰超纤	2021-05-13	152,600.00	28,000.00	28	3.60	427.28	-	-	
中信证券	2021051300027672	掌趣科技	2021-05-13	275,880.00	62,700.00	28	3.40	729.55	-	-	
中信证券	2021051300027674	豆神教育	2021-05-13	125,240.00	15,500.00	28	4.20	409.12	-	-	
中信	2021051300027676	华宇	2021-05-13	263,822.00	14,600.00	28	3.40	697.66	-	-	

证券		软件								
中信证券	2021051300027678	安科生物	2021-05-13	442,470.00	21,500.00	28	3.40	1,170.09	-	-
中信证券	2021051300027680	利亚德	2021-05-13	266,319.00	38,100.00	28	3.40	704.27	-	-
中信证券	2021051300027682	国瓷材料	2021-05-13	801,720.00	17,000.00	28	3.40	2,120.10	-	-
中信证券	2021051300027684	特锐德	2021-05-13	318,920.00	13,600.00	28	3.40	843.37	-	-
中信证券	2021051300027686	华测检测	2021-05-13	1,200,357.00	36,900.00	28	3.50	3,267.64	-	-
中信证券	2021051300027688	昆仑万维	2021-05-13	335,248.00	18,400.00	28	3.40	886.54	-	-
中信证券	2021051300027690	长信科技	2021-05-13	419,934.00	53,700.00	28	3.40	1,110.49	-	-
中信证券	2021051300027692	汤臣倍健	2021-05-13	587,840.00	17,600.00	28	3.40	1,554.51	-	-
中信证券	2021051300027694	阳光电源	2021-05-13	1,878,355.00	23,500.00	28	3.50	5,113.30	-	-
中信证券	2021051300027696	晶盛机电	2021-05-13	496,800.00	13,800.00	28	3.40	1,313.76	-	-
中信	2021051300027698	欣旺	2021-05-13	511,070.00	24,500.00	28	4.20	1,669.50	-	-

证券		达								
中信证券	2021051300027700	蓝色光标	2021-05-13	286,080.00	44,700.00	28	3.40	756.52	-	-
中信证券	2021051300027702	捷成股份	2021-05-13	38,400.00	10,000.00	14	3.50	52.27	-	-
中信证券	2021051300027704	长盈精密	2021-05-13	246,976.00	13,600.00	28	3.40	653.11	-	-
中信证券	2021051300027706	碧水源	2021-05-13	342,510.00	49,000.00	28	3.40	905.75	-	-
中信证券	2021051300027708	捷成股份	2021-05-13	180,096.00	46,900.00	28	3.40	476.25	-	-
中信证券	2021051300027710	东方国信	2021-05-13	175,180.00	19,000.00	28	4.00	545.00	-	-
中信证券	2021051300027712	网宿科技	2021-05-13	246,340.00	43,600.00	28	3.40	651.43	-	-
中信证券	2021051300027714	三聚环保	2021-05-13	178,200.00	33,000.00	28	4.20	582.12	-	-
中信证券	2021051300027716	红日药业	2021-05-13	185,948.00	40,600.00	28	3.40	491.73	-	-
中信证券	2021051300027718	机器人	2021-05-13	263,200.00	28,000.00	28	3.40	696.02	-	-
中信	2021051300027720	万达	2021-05-13	280,116.00	18,600.00	28	4.20	915.05	-	-

证券		信息									
中信证券	2021051300027722	旋极信息	2021-05-13	91,740.00	27,800.00	28	3.40	242.60	-	-	
中信证券	2021051300028378	安科生物	2021-05-13	-	4,300.00	28	3.40	-	-	-	
中信证券	2021051300029715	安科生物	2021-05-13	4,300.00	-	28	3.40	-	-	-	
中信证券	2021052000019529	华测检测	2021-05-13	1,291.50	-	28	3.50	-	-	-	
中信证券	2021052100007060	利亚德	2021-05-13	762.00	-	28	3.40	-	-	-	
中信证券	2021052700018813	捷成股份	2021-05-27	41,000.00	10,000.00	14	3.40	54.21	-	-	
中信证券	2021052700020901	华策影视	2021-05-13	583.80	-	28	3.60	-	-	-	
中信证券	2021052700021221	阳光电源	2021-05-13	3,290.00	-	28	3.50	-	-	-	
中信证券	2021060100002977	华宇软件	2021-05-13	517.47	-	28	3.40	-	-	-	
中信证券	2021060300011656	长盈精密	2021-05-13	1,360.00	-	28	3.40	-	-	-	
中信	2021060300011824	长盈	2021-05-13	-	2,720.00	28	3.40	-	-	-	

证券		精密								
中信证券	2021060300012168	欣旺达	2021-05-13	1,716.27	-	28	4.20	-	-	-
中信证券	2021060700005669	碧水源	2021-05-13	2,695.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	2021060900005903	网宿科技	2021-05-13	436.30	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	2021060900006013	红日药业	2021-05-13	1,624.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	2021061000008622	捷成股份	2021-06-10	43,600.00	10,000.00	14	3.50	59.34	-	-
中信证券	2021062400009375	捷成股份	2021-06-24	46,700.00	10,000.00	14	3.50	27.24	49,900.00	27.24
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:股)	出借期限 (单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏中证 500ETF 联接	658,340,902.00	58.74%	710,706,802.00	43.17%
中信证券	10,569,162.00	0.94%	11,234,900.00	0.68%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	12,773,529.56	42,428.49	43,489,421.14	146,524.99

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688819	天能股份	网下申购	28,382	1,186,083.78
中信证券	688660	电气风电	网下申购	51,238	278,734.72
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39

中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	002500	山西证券	配股	486,360	2,431,800.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 171,091,160.00 元（上年度可比期间：1,215,639,440.00 元），支付给中信期货的佣金为 4,191.67 元（上年度可比期间为：29,783.28 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新发流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
300957	贝泰	2021-03-18	2021-09-27	新发	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-

	妮			流通受限						
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	新发流通受限	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688059	华锐精密	2021-02-01	2021-08-09	新发流通受限	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688619	罗普特	2021-02-08	2021-08-23	新发流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新发流通受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新发流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新发流通	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

				受限						
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	新发流通受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	新发流通受限	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	新发流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新发流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新发流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新发流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-

300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新发流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688517	金冠电气	2021-06-10	2021-12-20	新发流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新发流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新发流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新发流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾	2021-06-28	2021-07-07	新发	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

	电气			流通受限						
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新发流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新发流通	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

				受限						
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新发流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新发流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-

300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新发流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水	2021-03-23	2021-09-30	新发	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-

	海纳			流通受限						
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新发流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新发流通	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

				受限						
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新发流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新发流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新发流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉	2021-06-23	2022-01-05	新发	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

	平民			流通受限						
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新发流通	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

				受限						
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不

低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项	3.05	2021-07-14	3.36	1,883,041	6,736,932.54	5,743,275.05	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	500,316	13,723,268.21	28,192,806.60	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	600089	特变电工	2021年7月8日 -2021年7月16日	12.85	318,800.00	4,096,580.00
2	000009	中国宝安	2021年7月8日 -2021年7月16日	18.27	218,500.00	3,991,995.00
3	002709	天赐材料	2021年7月15日 -2021年7月16日	106.58	36,100.00	3,847,538.00
4	002074	国轩高科	2021年7月8日 -2021年7月16日	43.56	88,200.00	3,841,992.00
5	600460	士兰微	2021年7月8日 -2021年7月16日	56.35	66,800.00	3,764,180.00
6	002340	格林美	2021年7月8日 -2021年7月16日	9.35	388,500.00	3,632,475.00
7	300285	国瓷材料	2021年7月8日 -2021年7月16日	48.75	68,400.00	3,334,500.00

8	601233	桐昆股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	24.09	134,900.00	3,249,741.00
9	300207	欣旺达	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	32.56	96,600.00	3,145,296.00
10	002353	杰瑞股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	44.70	64,000.00	2,860,800.00
11	002185	华天科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	15.39	185,100.00	2,848,689.00
12	600885	宏发股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	62.70	44,600.00	2,796,420.00
13	300316	晶盛机电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	50.50	55,100.00	2,782,550.00
14	000799	酒鬼酒	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	255.60	10,000.00	2,556,000.00
15	600733	北汽蓝谷	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.48	184,900.00	2,492,452.00
16	300146	汤臣倍健	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	32.90	70,000.00	2,303,000.00
17	600884	杉杉股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	23.32	98,100.00	2,287,692.00
18	600219	南山铝业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.60	619,400.00	2,229,840.00
19	300037	新宙邦	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	100.10	21,800.00	2,182,180.00
20	002223	鱼跃医疗	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	38.13	57,100.00	2,177,223.00
21	002648	卫星石化	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	39.19	54,200.00	2,124,098.00
22	002138	顺络电子	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	38.77	54,600.00	2,116,842.00
23	000547	航天发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	18.87	108,900.00	2,054,943.00
24	002797	第一创业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.14	275,200.00	1,964,928.00
25	601168	西部矿业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.93	164,300.00	1,960,099.00
26	601099	太平洋	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.39	576,800.00	1,955,352.00
27	600739	辽宁成大	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.81	93,600.00	1,947,816.00
28	600704	物产中大	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.87	243,800.00	1,918,706.00
29	000988	华工科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	23.52	80,400.00	1,891,008.00

30	600392	盛和资源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	17.36	108,600.00	1,885,296.00
31	002212	天融信	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	19.77	94,900.00	1,876,173.00
32	000807	云铝股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.90	157,600.00	1,875,440.00
33	601636	旗滨集团	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	18.56	100,300.00	1,861,568.00
34	002444	巨星科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	34.08	54,500.00	1,857,360.00
35	002385	大北农	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.80	273,100.00	1,857,080.00
36	002572	索菲亚	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	24.20	76,000.00	1,839,200.00
37	000636	风华高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	30.22	60,600.00	1,831,332.00
38	600862	中航高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	30.78	59,000.00	1,816,020.00
39	600699	均胜电子	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	25.52	70,600.00	1,801,712.00
40	000830	鲁西化工	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	18.73	94,900.00	1,777,477.00
41	002250	联化科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	27.90	63,200.00	1,763,280.00
42	002078	太阳纸业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.35	131,700.00	1,758,195.00
43	300253	卫宁健康	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	16.27	107,700.00	1,752,279.00
44	300699	光威复材	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	75.95	22,800.00	1,731,660.00
45	002507	涪陵榨菜	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	37.66	45,500.00	1,713,530.00
46	300088	长信科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.26	207,000.00	1,709,820.00
47	000630	铜陵有色	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.72	628,500.00	1,709,520.00
48	600201	生物股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	17.45	95,600.00	1,668,220.00
49	002013	中航机电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.07	165,000.00	1,661,550.00
50	000039	中集集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	18.18	90,900.00	1,652,562.00
51	002075	沙钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.91	149,500.00	1,631,045.00

52	601997	贵阳银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 16 日	7.16	227,100.00	1,626,036.00
53	002030	达安基因	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	21.24	76,400.00	1,622,736.00
54	300001	特锐德	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	30.11	53,500.00	1,610,885.00
55	002028	思源电气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	30.79	51,600.00	1,588,764.00
56	002511	中顺洁柔	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	27.55	55,500.00	1,529,025.00
57	002092	中泰化学	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.27	148,000.00	1,519,960.00
58	600549	厦门钨业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.83	72,700.00	1,514,341.00
59	000021	深科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	19.14	78,800.00	1,508,232.00
60	002080	中材科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	26.17	57,400.00	1,502,158.00
61	002465	海格通信	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.46	157,900.00	1,493,734.00
62	601005	重庆钢铁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.67	557,300.00	1,487,991.00
63	002273	水晶光电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.69	101,100.00	1,485,159.00
64	002603	以岭药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	29.16	50,900.00	1,484,244.00
65	300618	寒锐钴业	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	78.84	18,800.00	1,482,192.00
66	000739	普洛药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	29.40	50,400.00	1,481,760.00
67	600171	上海贝岭	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	30.43	48,600.00	1,478,898.00
68	000825	太钢不锈	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.49	196,800.00	1,474,032.00
69	600867	通化东宝	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.94	121,100.00	1,445,934.00
70	000983	山西焦煤	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.31	173,900.00	1,445,109.00
71	601128	常熟银行	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.20	232,200.00	1,439,640.00
72	002299	圣农发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	23.88	60,100.00	1,435,188.00
73	600516	方大炭素	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.44	192,200.00	1,429,968.00

74	002422	科伦药业	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	19.95	71,400.00	1,424,430.00
75	000960	锡业股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.03	88,500.00	1,418,655.00
76	600418	江淮汽车	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.43	113,500.00	1,410,805.00
77	000050	深天马 A	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.18	98,700.00	1,399,566.00
78	600827	百联股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.15	69,100.00	1,392,365.00
79	300009	安科生物	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.90	93,200.00	1,388,680.00
80	000998	隆平高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.04	86,000.00	1,379,440.00
81	600879	航天电子	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.52	182,800.00	1,374,656.00
82	300070	碧水源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.31	187,900.00	1,373,549.00
83	600380	健康元	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.73	100,000.00	1,373,000.00
84	000750	国海证券	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.24	322,900.00	1,369,096.00
85	000975	银泰黄金	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.51	143,700.00	1,366,587.00
86	002152	广电运通	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.03	104,500.00	1,361,635.00
87	300482	万孚生物	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	64.69	21,000.00	1,358,490.00
88	300168	万达信息	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.60	92,900.00	1,356,340.00
89	600166	福田汽车	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.45	391,900.00	1,352,055.00
90	002131	利欧股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.34	575,200.00	1,345,968.00
91	002156	通富微电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	24.04	55,900.00	1,343,836.00
92	300308	中际旭创	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	38.52	34,800.00	1,340,496.00
93	002439	启明星辰	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	29.01	46,200.00	1,340,262.00
94	300357	我武生物	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	64.12	20,800.00	1,333,696.00
95	000932	华菱钢铁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.60	196,800.00	1,298,880.00

96	601117	中国化学	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	8.76	147,600.00	1,292,976.00
97	300271	华宇软件	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	19.25	67,100.00	1,291,675.00
98	002373	千方科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.70	77,100.00	1,287,570.00
99	002180	纳思达	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	32.20	39,800.00	1,281,560.00
100	600642	申能股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.14	207,200.00	1,272,208.00
101	600068	葛洲坝	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	7.49	169,700.00	1,271,053.00
102	300296	利亚德	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.82	161,700.00	1,264,494.00
103	601615	明阳智能	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.19	77,000.00	1,246,630.00
104	002500	山西证券	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.71	182,300.00	1,223,233.00
105	000623	吉林敖东	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	15.49	78,900.00	1,222,161.00
106	300630	普利制药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	52.40	23,100.00	1,210,440.00
107	601699	潞安环能	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.81	102,200.00	1,206,982.00
108	300115	长盈精密	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.60	58,500.00	1,205,100.00
109	600895	张江高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	18.27	65,700.00	1,200,339.00
110	000012	南 玻 A	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.24	116,500.00	1,192,960.00
111	002127	南极电商	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	9.77	122,100.00	1,192,917.00
112	600153	建发股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.10	145,700.00	1,180,170.00
113	600415	小商品城	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.15	226,100.00	1,164,415.00
114	600188	兖州煤业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	15.36	74,900.00	1,150,464.00
115	300418	昆仑万维	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.38	70,000.00	1,146,600.00
116	600256	广汇能源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.33	343,900.00	1,145,187.00
117	600535	天士力	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.81	76,600.00	1,134,446.00

118	000027	深圳能源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.17	123,600.00	1,133,412.00
119	600177	雅戈尔	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	6.59	171,800.00	1,132,162.00
120	600667	太极实业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.10	124,100.00	1,129,310.00
121	600008	首创环保	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.01	373,200.00	1,123,332.00
122	000878	云南铜业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.83	87,500.00	1,122,625.00
123	002670	国盛金控	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.39	98,200.00	1,118,498.00
124	300024	机器人	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.67	104,500.00	1,115,015.00
125	002372	伟星新材	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.67	53,900.00	1,114,113.00
126	600060	海信视像	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.90	65,900.00	1,113,710.00
127	600988	赤峰黄金	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	14.99	73,300.00	1,098,767.00
128	600155	华创阳安	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.70	102,400.00	1,095,680.00
129	300463	迈克生物	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	42.09	26,000.00	1,094,340.00
130	002382	蓝帆医疗	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.85	52,300.00	1,090,455.00
131	603858	步长制药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	22.49	48,400.00	1,088,516.00
132	002019	亿帆医药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	17.25	63,100.00	1,088,475.00
133	600765	中航重机	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	22.65	47,900.00	1,084,935.00
134	000718	苏宁环球	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.29	129,900.00	1,076,871.00
135	002221	东华能源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.95	98,300.00	1,076,385.00
136	002174	游族网络	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	17.17	62,600.00	1,074,842.00
137	600497	驰宏锌锗	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.31	249,300.00	1,074,483.00
138	600409	三友化工	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.11	106,200.00	1,073,682.00
139	600372	中航电子	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.55	64,700.00	1,070,785.00

140	300244	迪安诊断	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	38.30	27,800.00	1,064,740.00
141	600066	宇通客车	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	12.49	84,800.00	1,059,152.00
142	002390	信邦制药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.48	99,600.00	1,043,808.00
143	600170	上海建工	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.76	376,700.00	1,039,692.00
144	600637	东方明珠	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	8.19	126,600.00	1,036,854.00
145	600141	兴发集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	18.83	54,900.00	1,033,767.00
146	600875	东方电气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.97	94,000.00	1,031,180.00
147	300058	蓝色光标	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.05	169,600.00	1,026,080.00
148	601717	郑煤机	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.63	88,200.00	1,025,766.00
149	600160	巨化股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.84	115,400.00	1,020,136.00
150	000997	新大陆	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.59	61,400.00	1,018,626.00
151	600369	西南证券	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	4.87	208,200.00	1,013,934.00
152	600801	华新水泥	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	17.57	57,700.00	1,013,789.00
153	000738	航发控制	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.83	48,600.00	1,012,338.00
154	000723	美锦能源	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	7.56	133,400.00	1,008,504.00
154	002506	协鑫集成	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.48	289,800.00	1,008,504.00
156	600258	首旅酒店	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	23.86	42,200.00	1,006,892.00
157	000686	东北证券	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.45	118,900.00	1,004,705.00
158	600487	亨通光电	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	11.40	87,600.00	998,640.00
159	300002	神州泰岳	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 16 日	4.85	205,500.00	996,675.00
160	002195	二三四五	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.03	486,500.00	987,595.00
161	600707	彩虹股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.41	104,900.00	987,109.00

162	300315	掌趣科技	2021年7月8日 -2021年7月16日	4.25	231,600.00	984,300.00
163	600909	华安证券	2021年7月15日 -2021年7月16日	5.57	176,100.00	980,877.00
164	002249	大洋电机	2021年7月8日 -2021年7月16日	5.25	186,800.00	980,700.00
165	002268	卫士通	2021年7月8日 -2021年7月16日	19.48	50,200.00	977,896.00
166	000540	中天金融	2021年7月8日 -2021年7月16日	2.73	356,600.00	973,518.00
167	000060	中金岭南	2021年7月8日 -2021年7月16日	4.52	213,900.00	966,828.00
168	300383	光环新网	2021年7月15日 -2021年7月16日	14.39	67,000.00	964,130.00
169	600325	华发股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	6.74	142,900.00	963,146.00
170	300017	网宿科技	2021年7月8日 -2021年7月16日	5.85	164,200.00	960,570.00
171	000158	常山北明	2021年7月8日 -2021年7月16日	11.49	83,600.00	960,564.00
172	002081	金螳螂	2021年7月8日 -2021年7月16日	7.92	119,800.00	948,816.00
173	601992	金隅集团	2021年7月8日 -2021年7月16日	2.69	352,400.00	947,956.00
174	603077	和邦生物	2021年7月8日 -2021年7月16日	2.08	454,700.00	945,776.00
175	600567	山鹰国际	2021年7月8日 -2021年7月16日	3.45	273,700.00	944,265.00
176	688099	晶晨股份	2021年7月15日 -2021年7月15日	112.20	8,400.00	942,480.00
177	002408	齐翔腾达	2021年7月8日 -2021年7月16日	12.42	75,700.00	940,194.00
178	600282	南钢股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	3.56	263,600.00	938,416.00
179	601198	东兴证券	2021年7月15日 -2021年7月16日	10.93	85,500.00	934,515.00
180	601866	中远海发	2021年7月15日 -2021年7月16日	3.75	247,300.00	927,375.00
181	002065	东华软件	2021年7月15日 -2021年7月16日	7.93	116,800.00	926,224.00
182	002429	兆驰股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	6.07	152,100.00	923,247.00
183	600500	中化国际	2021年7月8日 -2021年7月16日	7.86	117,400.00	922,764.00

184	688002	睿创微纳	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 15 日	99.83	9,200.00	918,436.00
185	600216	浙江医药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	16.01	57,300.00	917,373.00
186	000898	鞍钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.45	205,700.00	915,365.00
187	300182	捷成股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.99	183,400.00	915,166.00
188	002056	横店东磁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.00	70,100.00	911,300.00
189	002926	华西证券	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 15 日	9.63	94,600.00	910,998.00
190	600528	中铁工业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.10	112,400.00	910,440.00
191	600737	中粮糖业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.01	90,600.00	906,906.00
192	600271	航天信息	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	13.03	69,500.00	905,585.00
193	002191	劲嘉股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.64	85,000.00	904,400.00
194	600598	北大荒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.96	60,400.00	903,584.00
195	603156	养元饮品	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	28.58	31,600.00	903,128.00
196	600839	四川长虹	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.91	309,100.00	899,481.00
197	000709	河钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.46	362,600.00	891,996.00
198	600998	九州通	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	15.37	58,000.00	891,460.00
199	002203	海亮股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.64	83,600.00	889,504.00
200	600580	卧龙电驱	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.30	66,800.00	888,440.00
201	000581	威孚高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	20.83	42,600.00	887,358.00
202	600728	佳都科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.41	119,300.00	884,013.00
203	601016	节能风电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.74	234,600.00	877,404.00
204	600808	马钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.29	203,900.00	874,731.00
205	000729	燕京啤酒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.24	119,800.00	867,352.00

206	300166	东方国信	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.36	69,800.00	862,728.00
207	002010	传化智联	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.71	111,500.00	859,665.00
208	000930	中粮科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.01	94,600.00	852,346.00
209	000488	晨鸣纸业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.14	104,600.00	851,444.00
210	002004	华邦健康	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.21	136,100.00	845,181.00
211	600820	隧道股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.29	159,400.00	843,226.00
212	002745	木林森	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	13.40	62,900.00	842,860.00
213	002294	信立泰	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	32.90	25,600.00	842,240.00
214	600755	厦门国贸	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.21	102,500.00	841,525.00
215	000629	攀钢钒钛	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.29	364,700.00	835,163.00
216	600039	四川路桥	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.27	133,000.00	833,910.00
217	600390	五矿资本	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	5.98	139,400.00	833,612.00
218	601880	辽港股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	1.71	486,200.00	831,402.00
219	002048	宁波华翔	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	19.50	42,400.00	826,800.00
220	600970	中材国际	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.17	89,600.00	821,632.00
221	002563	森马服饰	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.95	68,500.00	818,575.00
222	600208	新潮中宝	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	3.04	268,500.00	816,240.00
223	600037	歌华有线	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.61	83,600.00	803,396.00
224	603000	人民网	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	17.19	46,700.00	802,773.00
225	600022	山东钢铁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	1.72	466,600.00	802,552.00
226	002387	维信诺	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.43	76,800.00	801,024.00
227	600398	海澜之家	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.24	110,500.00	800,020.00

228	002124	天邦股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.01	113,100.00	792,831.00
229	000598	兴蓉环境	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.21	151,700.00	790,357.00
230	300223	北京君正	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 15 日	100.92	7,800.00	787,176.00
231	601106	中国一重	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.39	232,000.00	786,480.00
232	600498	烽火通信	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	18.63	42,200.00	786,186.00
233	300251	光线传媒	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	10.81	72,700.00	785,887.00
234	600881	亚泰集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.85	275,600.00	785,460.00
235	000883	湖北能源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.59	168,200.00	772,038.00
236	603885	吉祥航空	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	15.26	50,400.00	769,104.00
237	600811	东方集团	2021 年 7 月 14 日 -2021 年 7 月 16 日	3.05	251,800.00	767,990.00
238	600782	新钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.58	136,800.00	763,344.00
239	000401	冀东水泥	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	12.35	61,700.00	761,995.00
240	002146	荣盛发展	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	5.64	135,100.00	761,964.00
241	000778	新兴铸管	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.72	203,700.00	757,764.00
242	000028	国药一致	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	37.84	20,000.00	756,800.00
243	000690	宝新能源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.11	147,800.00	755,258.00
244	000887	中鼎股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.08	62,500.00	755,000.00
245	600597	光明乳业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	14.41	52,300.00	753,643.00
246	600260	凯乐科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.88	84,600.00	751,248.00
247	600348	华阳股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.42	100,400.00	744,968.00
248	002701	奥瑞金	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.14	144,800.00	744,272.00
249	601118	海南橡胶	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.09	145,600.00	741,104.00

250	002958	青农商行	2021年7月15日 -2021年7月16日	4.28	172,500.00	738,300.00
251	600195	中牧股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	11.96	61,700.00	737,932.00
252	002183	怡亚通	2021年7月8日 -2021年7月16日	5.73	128,600.00	736,878.00
253	600663	陆家嘴	2021年7月15日 -2021年7月16日	13.32	55,200.00	735,264.00
254	600967	内蒙一机	2021年7月8日 -2021年7月16日	10.12	72,000.00	728,640.00
255	600718	东软集团	2021年7月8日 -2021年7月16日	9.78	74,500.00	728,610.00
256	600026	中远海能	2021年7月8日 -2021年7月16日	6.16	118,000.00	726,880.00
257	600410	华胜天成	2021年7月8日 -2021年7月16日	7.76	93,500.00	725,560.00
258	002002	鸿达兴业	2021年7月8日 -2021年7月16日	3.93	184,400.00	724,692.00
259	002085	万丰奥威	2021年7月8日 -2021年7月16日	5.60	128,000.00	716,800.00
260	600529	山东药玻	2021年7月8日 -2021年7月16日	33.95	21,100.00	716,345.00
261	601179	中国西电	2021年7月8日 -2021年7月16日	4.12	173,200.00	713,584.00
262	300212	易华录	2021年7月15日 -2021年7月16日	26.91	26,400.00	710,424.00
263	600572	康恩贝	2021年7月8日 -2021年7月16日	4.44	159,000.00	705,960.00
264	002110	三钢闽光	2021年7月8日 -2021年7月16日	6.74	104,700.00	705,678.00
265	600446	金证股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	14.44	48,700.00	703,228.00
266	600126	杭钢股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	5.13	136,300.00	699,219.00
267	000877	天山股份	2021年7月8日 -2021年7月16日	13.03	53,600.00	698,408.00
268	600167	联美控股	2021年7月8日 -2021年7月16日	8.93	77,900.00	695,647.00
269	000961	中南建设	2021年7月15日 -2021年7月16日	5.92	117,300.00	694,416.00
270	300072	三聚环保	2021年7月8日 -2021年7月16日	5.74	120,900.00	693,966.00
271	600027	华电国际	2021年7月15日 -2021年7月16日	3.44	201,600.00	693,504.00

272	000970	中科三环	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.55	72,600.00	693,330.00
273	000402	金融街	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.75	101,500.00	685,125.00
274	002266	浙富控股	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.99	137,000.00	683,630.00
275	600064	南京高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.29	73,400.00	681,886.00
276	002128	露天煤业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.41	65,300.00	679,773.00
277	603589	口子窖	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	67.69	10,000.00	676,900.00
278	600158	中体产业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.41	59,300.00	676,613.00
279	000990	诚志股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.73	53,100.00	675,963.00
280	601598	中国外运	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.05	133,800.00	675,690.00
281	000089	深圳机场	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.77	86,500.00	672,105.00
282	601577	长沙银行	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	8.94	74,800.00	668,712.00
283	601127	小康股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	66.67	10,000.00	666,700.00
284	000959	首钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.62	118,300.00	664,846.00
285	000671	阳光城	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	5.20	127,800.00	664,560.00
286	000400	许继电气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.66	51,500.00	651,990.00
287	300026	红日药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.25	153,200.00	651,100.00
288	688208	道通科技	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 15 日	86.99	7,400.00	643,726.00
289	000519	中兵红箭	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.72	59,500.00	637,840.00
290	601975	招商南油	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.14	294,400.00	630,016.00
291	600307	酒钢宏兴	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.32	270,300.00	627,096.00
292	600435	北方导航	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.94	78,900.00	626,466.00
293	002233	塔牌集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.28	60,900.00	626,052.00

294	600507	方大特钢	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.78	91,200.00	618,336.00
295	000090	天健集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.53	111,600.00	617,148.00
296	000685	中山公用	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.16	75,200.00	613,632.00
297	600376	首开股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.60	109,200.00	611,520.00
298	002683	宏大爆破	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	27.77	22,000.00	610,940.00
299	601333	广深铁路	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.12	287,800.00	610,136.00
300	601000	唐山港	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.41	252,200.00	607,802.00
301	300474	景嘉微	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 15 日	97.92	6,200.00	607,104.00
302	601718	际华集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.82	213,500.00	602,070.00
303	600315	上海家化	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	60.14	10,000.00	601,400.00
304	600120	浙江东方	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.28	140,200.00	600,056.00
305	000559	万向钱潮	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.31	111,800.00	593,658.00
306	600804	鹏博士	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.84	121,500.00	588,060.00
307	600517	国网英大	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.81	86,200.00	587,022.00
308	002839	张家港行	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.44	107,200.00	583,168.00
309	600803	新奥股份	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	16.51	35,300.00	582,803.00
310	002440	闰土股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.85	65,800.00	582,330.00
311	300133	华策影视	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.92	98,300.00	581,936.00
312	600673	东阳光	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.49	127,800.00	573,822.00
313	002505	鹏都农牧	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.24	255,000.00	571,200.00
314	600754	锦江酒店	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	56.95	10,000.00	569,500.00
315	600536	中国软件	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	56.93	10,000.00	569,300.00

316	600373	中文传媒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.86	57,700.00	568,922.00
317	601860	紫金银行	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.63	155,300.00	563,739.00
318	002690	美亚光电	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	55.76	10,000.00	557,600.00
319	000758	中色股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.75	117,200.00	556,700.00
320	002155	湖南黄金	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.75	71,800.00	556,450.00
321	000967	盈峰环境	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.87	80,400.00	552,348.00
322	002038	双鹭药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.53	52,300.00	550,719.00
323	600056	中国医药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.15	45,300.00	550,395.00
324	601608	中信重工	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.74	146,900.00	549,406.00
325	600643	爱建集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.98	78,600.00	548,628.00
326	600388	龙净环保	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.52	63,800.00	543,576.00
327	600582	天地科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.90	139,000.00	542,100.00
328	000563	陕国投 A	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.22	167,800.00	540,316.00
329	601098	中南传媒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.82	60,600.00	534,492.00
330	002416	爱施德	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	10.03	53,000.00	531,590.00
331	601958	金钼股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.48	81,800.00	530,064.00
332	600038	中直股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	52.74	10,000.00	527,400.00
333	000528	柳 工	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	8.20	64,300.00	527,260.00
334	603883	老百姓	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	52.68	10,000.00	526,800.00
335	600062	华润双鹤	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.91	44,200.00	526,422.00
336	600901	江苏租赁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.20	101,200.00	526,240.00
337	600928	西安银行	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.66	112,900.00	526,114.00

338	300180	华峰超纤	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.95	106,200.00	525,690.00
339	600959	江苏有线	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.05	169,800.00	517,890.00
340	600006	东风汽车	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.30	70,100.00	511,730.00
341	600649	城投控股	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.76	107,200.00	510,272.00
342	600094	大名城	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.77	134,600.00	507,442.00
343	000415	渤海租赁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.42	209,100.00	506,022.00
344	002458	益生股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	9.97	50,400.00	502,488.00
345	600021	上海电力	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.91	72,700.00	502,357.00
346	000513	丽珠集团	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	50.02	10,000.00	500,200.00
347	600546	山煤国际	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.18	68,500.00	491,830.00
348	601611	中国核建	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.22	67,400.00	486,628.00
349	600717	天津港	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.92	122,520.00	480,278.40
350	600633	浙数文化	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.18	66,600.00	478,188.00
351	002317	众生药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.61	55,400.00	476,994.00
352	000717	韶钢松山	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.59	103,100.00	473,229.00
353	688321	微芯生物	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 15 日	46.19	10,200.00	471,138.00
354	002244	滨江集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.19	112,100.00	469,699.00
355	688088	虹软科技	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 15 日	55.75	8,400.00	468,300.00
356	002434	万里扬	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.11	57,400.00	465,514.00
357	601928	凤凰传媒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.14	64,400.00	459,816.00
358	600863	内蒙华电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.33	197,000.00	459,010.00
359	000078	海王生物	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.26	140,300.00	457,378.00

360	002375	亚厦股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.92	57,500.00	455,400.00
361	603719	良品铺子	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	45.00	10,000.00	450,000.00
362	603198	迎驾贡酒	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	44.30	10,000.00	443,000.00
363	002424	贵州百灵	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.36	60,000.00	441,600.00
364	600968	海油发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.59	168,600.00	436,674.00
365	002557	洽洽食品	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	43.10	10,000.00	431,000.00
366	603638	艾迪精密	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	42.87	10,000.00	428,700.00
367	600623	华谊集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	8.81	47,900.00	421,999.00
368	603707	健友股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	41.75	10,000.00	417,500.00
369	600266	城建发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.74	87,100.00	412,854.00
370	601991	大唐发电	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	2.64	154,700.00	408,408.00
371	600312	平高电气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.84	69,300.00	404,712.00
372	002468	申通快递	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.62	52,500.00	400,050.00
373	600339	中油工程	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.84	140,600.00	399,304.00
374	600787	中储股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.33	74,600.00	397,618.00
375	000681	视觉中国	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	12.93	30,400.00	393,072.00
376	002583	海能达	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.04	77,800.00	392,112.00
377	000031	大悦城	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.60	108,700.00	391,320.00
378	300113	顺网科技	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	12.94	30,100.00	389,494.00
379	002925	盈趣科技	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	38.91	10,000.00	389,100.00
380	600823	世茂股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.04	95,600.00	386,224.00
381	600316	洪都航空	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	38.48	10,000.00	384,800.00

382	600466	蓝光发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.95	129,900.00	383,205.00
383	300257	开山股份	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	14.37	26,400.00	379,368.00
384	601689	拓普集团	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	37.43	10,000.00	374,300.00
385	601298	青岛港	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.18	59,300.00	366,474.00
386	000156	华数传媒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.71	47,000.00	362,370.00
387	603712	七一二	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	36.10	10,000.00	361,000.00
388	000937	冀中能源	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.93	90,300.00	354,879.00
389	000813	德展健康	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.54	75,800.00	344,132.00
390	002302	西部建设	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	7.90	43,000.00	339,700.00
391	601228	广州港	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.18	104,700.00	332,946.00
392	600511	国药股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	33.06	10,000.00	330,600.00
393	300010	豆神教育	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.67	58,000.00	328,860.00
394	600350	山东高速	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.15	53,000.00	325,950.00
395	002242	九阳股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	32.49	10,000.00	324,900.00
396	601139	深圳燃气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.56	48,900.00	320,784.00
397	000061	农产品	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.52	58,000.00	320,160.00
398	600871	石化油服	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	1.97	160,600.00	316,382.00
399	603866	桃李面包	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	31.20	10,000.00	312,000.00
400	000046	泛海控股	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.30	132,100.00	303,830.00
401	600377	宁沪高速	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	9.76	30,700.00	299,632.00
402	600859	王府井	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	28.88	10,000.00	288,800.00
403	000826	启迪环境	2021 年 7 月 15 日 -2021 年 7 月 16 日	5.35	53,400.00	285,690.00

404	600764	中国海防	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	28.30	10,000.00	283,000.00
405	600329	中新药业	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	28.09	10,000.00	280,900.00
406	600729	重庆百货	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	27.45	10,000.00	274,500.00
407	000999	华润三九	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	26.75	10,000.00	267,500.00
408	002595	豪迈科技	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	26.70	10,000.00	267,000.00
409	002705	新宝股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	26.25	10,000.00	262,500.00
410	603228	景旺电子	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	26.20	10,000.00	262,000.00
411	600776	东方通信	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.40	20,900.00	259,160.00
412	601003	柳钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.90	43,900.00	259,010.00
413	600657	信达地产	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	3.48	72,800.00	253,344.00
414	000537	广宇发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	5.23	47,400.00	247,902.00
415	002281	光迅科技	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	24.60	10,000.00	246,000.00
416	601869	长飞光纤	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	24.36	10,000.00	243,600.00
417	601828	美凯龙	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	12.00	20,100.00	241,200.00
418	000501	鄂武商 A	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	11.70	20,500.00	239,850.00
419	601801	皖新传媒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	4.72	50,500.00	238,360.00
420	600645	中源协和	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	22.95	10,000.00	229,500.00
421	603568	伟明环保	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	22.83	10,000.00	228,300.00
422	002396	星网锐捷	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	21.35	10,000.00	213,500.00
423	603888	新华网	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	21.17	10,000.00	211,700.00
424	002368	太极股份	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	20.06	10,000.00	200,600.00
425	000732	泰禾集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	2.16	85,600.00	184,896.00

426	600566	济川药业	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	17.90	10,000.00	179,000.00
427	603708	家家悦	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	17.37	10,000.00	173,700.00
428	001914	招商积余	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	17.18	10,000.00	171,800.00
429	001872	招商港口	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	16.92	10,000.00	169,200.00
430	000062	深圳华强	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	16.91	10,000.00	169,100.00
431	600835	上海机电	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	16.25	10,000.00	162,500.00
432	002399	海普瑞	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	15.93	10,000.00	159,300.00
433	600648	外高桥	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	14.78	10,000.00	147,800.00
434	002635	安洁科技	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	14.63	10,000.00	146,300.00
435	002419	天虹股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 16 日	6.56	21,200.00	139,072.00
436	600639	浦东金桥	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	13.65	10,000.00	136,500.00
437	600131	国网信通	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	13.24	10,000.00	132,400.00
438	600640	号百控股	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	12.19	10,000.00	121,900.00
439	601969	海南矿业	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	11.63	10,000.00	116,300.00
440	603377	东方时尚	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	10.69	10,000.00	106,900.00
441	600903	贵州燃气	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	9.20	10,000.00	92,000.00
442	600917	重庆燃气	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 16 日	8.17	10,000.00	81,700.00
合计	-	-	-	-	47,517,520.00	420,117,414.40

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理

架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回

申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,870,349,164.56	97.36	5,260,457,612.48	97.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	19,000.00	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,870,349,164.56	97.36	5,260,476,612.48	97.36

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-193,517,458.23	-240,925,705.21
	+5%	193,517,458.23	240,925,705.21

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(2) 各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 3,863,387,325.25 元，第二层次的余额为 6,961,839.31 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 5,251,492,860.02 元，第二层次的余额为 8,983,752.46 元，第三层次的余额为 0 元。）

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

(4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,870,349,164.56	96.84
	其中：股票	3,870,349,164.56	96.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	98,280,529.03	2.46
8	其他各项资产	28,145,006.50	0.70
9	合计	3,996,774,700.09	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 420,117,414.40 元, 占本基金期末资产净值的 10.57%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	37,884,631.80	0.95
B	采矿业	134,576,035.76	3.39
C	制造业	2,447,624,207.44	61.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,454,595.95	2.48
E	建筑业	71,374,803.91	1.80
F	批发和零售业	132,048,028.43	3.32
G	交通运输、仓储和邮政业	74,607,797.52	1.88
H	住宿和餐饮业	20,564,479.08	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	320,806,654.78	8.07
J	金融业	226,211,324.25	5.69
K	房地产业	126,089,149.21	3.17

L	租赁和商务服务业	51,084,298.83	1.29
M	科学研究和技术服务业	10,316,577.05	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	32,861,902.59	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,452,114.96	0.06
Q	卫生和社会工作	10,497,378.90	0.26
R	文化、体育和娱乐业	38,892,716.39	0.98
S	综合	34,002,467.71	0.86
	合计	3,870,349,164.56	97.36

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002709	天赐材料	360,559	38,428,378.22	0.97
2	000799	酒鬼酒	143,600	36,704,160.00	0.92
3	603486	科沃斯	144,574	32,974,437.92	0.83
4	600089	特变电工	2,343,804	30,117,881.40	0.76
5	000009	中国宝安	1,627,432	29,733,182.64	0.75
6	002340	格林美	3,018,442	28,222,432.70	0.71
7	600460	士兰微	500,316	28,192,806.60	0.71
8	002074	国轩高科	646,250	28,150,650.00	0.71
9	300285	国瓷材料	506,505	24,692,118.75	0.62
10	601233	桐昆股份	1,010,700	24,347,763.00	0.61
11	300207	欣旺达	695,211	22,636,070.16	0.57
12	002185	华天科技	1,383,200	21,287,448.00	0.54
13	600885	宏发股份	329,285	20,646,169.50	0.52
14	300316	晶盛机电	405,571	20,481,335.50	0.52
15	601636	旗滨集团	1,017,300	18,881,088.00	0.47
16	600733	北汽蓝谷	1,352,588	18,232,886.24	0.46
17	300037	新宙邦	181,700	18,188,170.00	0.46
18	300146	汤臣倍健	536,431	17,648,579.90	0.44
19	300253	卫宁健康	1,077,100	17,524,417.00	0.44
20	002648	卫星石化	434,260	17,018,649.40	0.43
21	002625	光启技术	815,700	16,974,717.00	0.43
22	002223	鱼跃医疗	442,919	16,888,501.47	0.42
23	600884	杉杉股份	719,308	16,774,262.56	0.42
24	603737	三棵树	94,843	16,692,368.00	0.42
25	600219	南山铝业	4,524,500	16,288,200.00	0.41
26	601127	小康股份	244,280	16,286,147.60	0.41
27	002353	杰瑞股份	362,399	16,199,235.30	0.41
28	002138	顺络电子	406,990	15,779,002.30	0.40
29	600779	水井坊	123,226	15,569,605.10	0.39

30	603589	口子窖	226,900	15,358,861.00	0.39
31	000547	航天发展	810,351	15,291,323.37	0.38
32	002797	第一创业	2,121,000	15,143,940.00	0.38
33	600704	物产中大	1,916,555	15,083,287.85	0.38
34	300699	光威复材	196,526	14,926,149.70	0.38
35	000988	华工科技	634,263	14,917,865.76	0.38
36	002212	天融信	747,595	14,779,953.15	0.37
37	002444	巨星科技	433,068	14,758,957.44	0.37
38	603893	瑞芯微	105,000	14,643,300.00	0.37
39	688099	晶晨股份	130,371	14,627,626.20	0.37
40	601099	太平洋	4,300,680	14,579,305.20	0.37
41	603444	吉比特	27,359	14,500,270.00	0.36
42	002422	科伦药业	719,700	14,358,015.00	0.36
43	601168	西部矿业	1,202,736	14,348,640.48	0.36
44	002385	大北农	2,090,700	14,216,760.00	0.36
45	000807	云铝股份	1,184,100	14,090,790.00	0.35
46	600739	辽宁成大	675,600	14,059,236.00	0.35
47	688002	睿创微纳	139,781	13,954,337.23	0.35
48	300308	中际旭创	359,700	13,855,644.00	0.35
49	002439	启明星辰	471,600	13,681,116.00	0.34
50	000636	风华高科	452,081	13,661,887.82	0.34
51	601117	中国化学	1,556,600	13,635,816.00	0.34
52	600862	中航高科	439,700	13,533,966.00	0.34
53	000830	鲁西化工	721,200	13,508,076.00	0.34
54	600392	盛和资源	775,057	13,454,989.52	0.34
55	600563	法拉电子	84,873	13,440,488.28	0.34
56	002078	太阳纸业	993,872	13,268,191.20	0.33
57	002030	达安基因	619,553	13,159,305.72	0.33
58	600754	锦江酒店	230,444	13,123,785.80	0.33
59	600699	均胜电子	513,975	13,116,642.00	0.33
60	600486	扬农化工	117,276	13,107,938.52	0.33
61	002180	纳思达	406,800	13,098,960.00	0.33
62	600068	葛洲坝	1,743,202	13,056,582.98	0.33
63	002250	联化科技	466,355	13,011,304.50	0.33
64	600315	上海家化	213,548	12,842,776.72	0.32
65	300088	长信科技	1,549,250	12,796,805.00	0.32
66	002507	涪陵榨菜	336,356	12,667,166.96	0.32
67	000630	铜陵有色	4,649,567	12,646,822.24	0.32
68	603605	珀莱雅	63,800	12,550,098.00	0.32
69	600201	生物股份	710,747	12,402,535.15	0.31
70	002013	中航机电	1,225,615	12,341,943.05	0.31
71	000039	中集集团	674,060	12,254,410.80	0.31
72	002075	沙钢股份	1,114,031	12,154,078.21	0.31

73	002127	南极电商	1,239,300	12,107,961.00	0.30
74	300223	北京君正	118,262	11,935,001.04	0.30
75	300001	特锐德	393,902	11,860,389.22	0.30
76	002028	思源电气	383,576	11,810,305.04	0.30
77	000513	丽珠集团	235,150	11,762,203.00	0.30
78	601997	贵阳银行	1,614,800	11,561,968.00	0.29
79	600177	雅戈尔	1,752,379	11,548,177.61	0.29
80	002511	中顺洁柔	413,902	11,403,000.10	0.29
81	000021	深科技	591,100	11,313,654.00	0.28
82	601005	重庆钢铁	4,231,100	11,297,037.00	0.28
83	002273	水晶光电	768,051	11,282,669.19	0.28
84	002299	圣农发展	471,400	11,257,032.00	0.28
85	600549	厦门钨业	537,020	11,186,126.60	0.28
86	002092	中泰化学	1,083,500	11,127,545.00	0.28
87	002080	中材科技	423,600	11,085,612.00	0.28
88	600988	赤峰黄金	735,200	11,020,648.00	0.28
89	002465	海格通信	1,163,600	11,007,656.00	0.28
90	000050	深天马 A	775,200	10,992,336.00	0.28
91	002603	以岭药业	376,300	10,972,908.00	0.28
92	300168	万达信息	749,707	10,945,722.20	0.28
93	600171	上海贝岭	359,600	10,942,628.00	0.28
94	000739	普洛药业	371,614	10,925,451.60	0.27
95	300482	万孚生物	168,697	10,913,008.93	0.27
96	300009	安科生物	723,878	10,785,782.20	0.27
97	300618	寒锐钴业	136,748	10,781,212.32	0.27
98	000825	太钢不锈	1,438,100	10,771,369.00	0.27
99	000983	山西焦煤	1,292,070	10,737,101.70	0.27
100	601128	常熟银行	1,729,900	10,725,380.00	0.27
101	600867	通化东宝	898,119	10,723,540.86	0.27
102	600516	方大炭素	1,441,274	10,723,078.56	0.27
103	600066	宇通客车	856,900	10,702,681.00	0.27
104	600536	中国软件	187,500	10,674,375.00	0.27
105	000998	隆平高科	664,729	10,662,253.16	0.27
106	300357	我武生物	165,311	10,599,741.32	0.27
107	600637	东方明珠	1,292,292	10,583,871.48	0.27
108	300244	迪安诊断	274,083	10,497,378.90	0.26
109	600316	洪都航空	271,457	10,445,665.36	0.26
110	601689	拓普集团	278,215	10,413,587.45	0.26
111	600418	江淮汽车	836,314	10,395,383.02	0.26
112	300463	迈克生物	245,801	10,345,764.09	0.26
113	600879	航天电子	1,372,734	10,322,959.68	0.26
114	300070	碧水源	1,397,900	10,218,649.00	0.26
115	000932	华菱钢铁	1,547,220	10,211,652.00	0.26

116	600369	西南证券	2,096,700	10,210,929.00	0.26
117	002152	广电运通	783,300	10,206,399.00	0.26
118	600529	山东药玻	300,500	10,201,975.00	0.26
119	600487	亨通光电	894,700	10,199,580.00	0.26
120	000750	国海证券	2,405,240	10,198,217.60	0.26
121	600827	百联股份	506,037	10,196,645.55	0.26
122	000723	美锦能源	1,348,400	10,193,904.00	0.26
123	600380	健康元	741,063	10,174,794.99	0.26
124	000960	锡业股份	631,500	10,122,945.00	0.25
125	002156	通富微电	419,387	10,082,063.48	0.25
126	300271	华宇软件	523,038	10,068,481.50	0.25
127	300296	利亚德	1,283,900	10,040,098.00	0.25
128	600166	福田汽车	2,904,400	10,020,180.00	0.25
129	002373	千方科技	598,757	9,999,241.90	0.25
130	000975	银泰黄金	1,051,085	9,995,818.35	0.25
131	002131	利欧股份	4,262,314	9,973,814.76	0.25
132	601615	明阳智能	615,900	9,971,421.00	0.25
133	688208	道通科技	114,160	9,930,778.40	0.25
134	600909	华安证券	1,782,243	9,927,093.51	0.25
135	600038	中直股份	186,227	9,821,611.98	0.25
136	300383	光环新网	681,600	9,808,224.00	0.25
137	002572	索菲亚	403,000	9,752,600.00	0.25
138	603290	斯达半导	30,476	9,752,320.00	0.25
139	002926	华西证券	994,000	9,572,220.00	0.24
140	002690	美亚光电	170,844	9,526,261.44	0.24
141	600642	申能股份	1,549,930	9,516,570.20	0.24
142	601198	东兴证券	870,378	9,513,231.54	0.24
143	601866	中远海发	2,502,038	9,382,642.50	0.24
144	300115	长盈精密	454,947	9,371,908.20	0.24
145	002065	东华软件	1,179,200	9,351,056.00	0.24
146	300474	景嘉微	94,831	9,285,851.52	0.23
147	002294	信立泰	281,371	9,257,105.90	0.23
148	600271	航天信息	701,600	9,141,848.00	0.23
149	603156	养元饮品	319,691	9,136,768.78	0.23
150	002500	山西证券	1,359,060	9,119,292.60	0.23
151	000623	吉林敖东	587,297	9,097,230.53	0.23
152	603638	艾迪精密	212,083	9,091,998.21	0.23
153	600998	九州通	591,400	9,089,818.00	0.23
154	600415	小商品城	1,732,500	8,922,375.00	0.22
155	600895	张江高科	488,343	8,922,026.61	0.22
156	601699	潞安环能	755,400	8,921,274.00	0.22
157	000012	南玻 A	866,590	8,873,881.60	0.22
158	600153	建发股份	1,084,053	8,780,829.30	0.22

159	300630	普利制药	165,606	8,677,754.40	0.22
160	600188	兖州煤业	563,100	8,649,216.00	0.22
161	600707	彩虹股份	905,400	8,519,814.00	0.21
162	600256	广汇能源	2,556,880	8,514,410.40	0.21
163	600390	五矿资本	1,419,400	8,488,012.00	0.21
164	600535	天士力	572,800	8,483,168.00	0.21
165	300418	昆仑万维	517,593	8,478,173.34	0.21
166	600667	太极实业	930,200	8,464,820.00	0.21
167	300024	机器人	787,400	8,401,558.00	0.21
168	600060	海信视像	495,160	8,368,204.00	0.21
169	600008	首创环保	2,779,370	8,365,903.70	0.21
170	002670	国盛金控	732,886	8,347,571.54	0.21
171	600497	驰宏锌锗	1,927,600	8,307,956.00	0.21
172	002372	伟星新材	401,763	8,304,441.21	0.21
173	002557	洽洽食品	192,239	8,285,500.90	0.21
174	002382	蓝帆医疗	396,463	8,266,253.55	0.21
175	000027	深圳能源	900,280	8,255,567.60	0.21
176	000878	云南铜业	643,300	8,253,539.00	0.21
177	600208	新湖中宝	2,713,700	8,249,648.00	0.21
178	600155	华创阳安	768,100	8,218,670.00	0.21
179	603858	步长制药	359,955	8,095,387.95	0.20
180	002019	亿帆医药	467,700	8,067,825.00	0.20
181	600765	中航重机	355,455	8,051,055.75	0.20
182	600372	中航电子	486,400	8,049,920.00	0.20
183	002390	信邦制药	767,900	8,047,592.00	0.20
184	300251	光线传媒	740,700	8,006,967.00	0.20
185	600498	烽火通信	428,500	7,982,955.00	0.20
186	002221	东华能源	728,569	7,977,830.55	0.20
187	600141	兴发集团	423,640	7,977,141.20	0.20
188	002174	游族网络	462,600	7,942,842.00	0.20
189	000718	苏宁环球	957,400	7,936,846.00	0.20
190	600409	三友化工	781,400	7,899,954.00	0.20
191	688029	南微医学	25,314	7,890,120.66	0.20
192	002683	宏大爆破	283,763	7,880,098.51	0.20
193	600511	国药股份	237,859	7,863,618.54	0.20
194	600170	上海建工	2,809,700	7,754,772.00	0.20
195	002146	荣盛发展	1,371,900	7,737,516.00	0.19
196	002966	苏州银行	1,051,400	7,727,790.00	0.19
197	002506	协鑫集成	2,217,000	7,715,160.00	0.19
198	000401	冀东水泥	624,104	7,707,684.40	0.19
199	000997	新大陆	464,300	7,702,737.00	0.19
200	600875	东方电气	701,643	7,697,023.71	0.19
201	601717	郑煤机	657,700	7,649,051.00	0.19

202	300058	蓝色光标	1,257,571	7,608,304.55	0.19
203	002408	齐翔腾达	608,070	7,552,229.40	0.19
204	600801	华新水泥	429,767	7,551,006.19	0.19
205	600160	巨化股份	851,930	7,531,061.20	0.19
206	000738	航发控制	361,206	7,523,920.98	0.19
207	002958	青农商行	1,752,600	7,501,128.00	0.19
208	603866	桃李面包	240,158	7,492,929.60	0.19
209	000686	东北证券	886,459	7,490,578.55	0.19
210	600258	首旅酒店	311,848	7,440,693.28	0.19
211	600663	陆家嘴	555,353	7,397,301.96	0.19
212	300315	掌趣科技	1,739,800	7,394,150.00	0.19
213	603707	健友股份	177,000	7,389,750.00	0.19
214	002195	二三四五	3,612,668	7,333,716.04	0.18
215	603260	合盛硅业	94,660	7,280,300.60	0.18
216	002268	卫士通	373,622	7,278,156.56	0.18
217	300017	网宿科技	1,237,500	7,239,375.00	0.18
218	000540	中天金融	2,651,750	7,239,277.50	0.18
219	600325	华发股份	1,068,576	7,202,202.24	0.18
220	688088	虹软科技	128,747	7,177,645.25	0.18
221	603225	新凤鸣	353,380	7,173,614.00	0.18
222	600732	爱旭股份	513,770	7,151,678.40	0.18
223	688321	微芯生物	154,619	7,141,851.61	0.18
224	000060	中金岭南	1,577,200	7,128,944.00	0.18
225	601016	节能风电	1,897,811	7,097,813.14	0.18
226	601992	金隅集团	2,631,112	7,077,691.28	0.18
227	600027	华电国际	2,056,000	7,072,640.00	0.18
228	600859	王府井	244,757	7,068,582.16	0.18
229	000961	中南建设	1,192,300	7,058,416.00	0.18
230	603712	七一二	195,105	7,043,290.50	0.18
231	600567	山鹰国际	2,038,800	7,033,860.00	0.18
232	002831	裕同科技	236,358	7,017,469.02	0.18
233	000158	常山北明	605,509	6,957,298.41	0.18
234	603077	和邦生物	3,343,764	6,955,029.12	0.17
235	002429	兆驰股份	1,142,800	6,936,796.00	0.17
236	600282	南钢股份	1,941,900	6,913,164.00	0.17
237	603927	中科软	160,600	6,897,770.00	0.17
238	002191	劲嘉股份	646,800	6,881,952.00	0.17
239	600500	中化国际	872,887	6,860,891.82	0.17
240	600216	浙江医药	426,400	6,826,664.00	0.17
241	600528	中铁工业	841,225	6,813,922.50	0.17
242	601577	长沙银行	761,000	6,803,340.00	0.17
243	603883	老百姓	128,932	6,792,137.76	0.17
244	300212	易华录	252,080	6,783,472.80	0.17

245	600839	四川长虹	2,330,300	6,781,173.00	0.17
246	000671	阳光城	1,299,600	6,757,920.00	0.17
247	600737	中粮糖业	674,753	6,754,277.53	0.17
248	002056	横店东磁	518,400	6,739,200.00	0.17
249	002595	豪迈科技	252,255	6,735,208.50	0.17
250	000898	鞍钢股份	1,513,232	6,733,882.40	0.17
251	600598	北大荒	448,851	6,714,810.96	0.17
252	603198	迎驾贡酒	151,500	6,711,450.00	0.17
253	002081	金螳螂	846,745	6,706,220.40	0.17
254	000999	华润三九	246,984	6,606,822.00	0.17
255	000581	威孚高科	316,959	6,602,255.97	0.17
256	000709	河钢股份	2,679,800	6,592,308.00	0.17
257	600580	卧龙电驱	495,300	6,587,490.00	0.17
258	002203	海亮股份	617,400	6,569,136.00	0.17
259	600728	佳都科技	886,452	6,568,609.32	0.17
260	002124	天邦股份	928,240	6,506,962.40	0.16
261	002281	光迅科技	264,015	6,494,769.00	0.16
262	300182	捷成股份	1,300,200	6,487,998.00	0.16
263	600808	马钢股份	1,506,300	6,462,027.00	0.16
264	002010	传化智联	834,800	6,436,308.00	0.16
265	000729	燕京啤酒	888,852	6,435,288.48	0.16
266	000930	中粮科技	706,500	6,365,565.00	0.16
267	300166	东方国信	511,139	6,317,678.04	0.16
268	002387	维信诺	604,400	6,303,892.00	0.16
269	002242	九阳股份	193,896	6,299,681.04	0.16
270	600820	隧道股份	1,190,800	6,299,332.00	0.16
271	000488	晨鸣纸业	772,500	6,288,150.00	0.16
272	002396	星网锐捷	294,495	6,287,468.25	0.16
273	002745	木林森	468,555	6,278,637.00	0.16
274	002004	华邦健康	999,664	6,207,913.44	0.16
275	000629	攀钢钒钛	2,709,900	6,205,671.00	0.16
276	002048	宁波华翔	315,334	6,149,013.00	0.15
277	002563	森马服饰	510,500	6,100,475.00	0.15
278	600755	厦门国贸	737,153	6,052,026.13	0.15
279	600970	中材国际	657,686	6,030,980.62	0.15
280	603000	人民网	349,254	6,003,676.26	0.15
281	300002	神州泰岳	1,237,500	6,001,875.00	0.15
282	600022	山东钢铁	3,453,760	5,940,467.20	0.15
283	600803	新奥股份	358,900	5,925,439.00	0.15
284	600398	海澜之家	817,677	5,919,981.48	0.15
285	600037	歌华有线	615,100	5,911,111.00	0.15
286	000598	兴蓉环境	1,130,800	5,891,468.00	0.15
287	601106	中国一重	1,730,600	5,866,734.00	0.15

288	600881	亚泰集团	2,050,079	5,842,725.15	0.15
289	002925	盈趣科技	148,019	5,759,419.29	0.14
290	600811	东方集团	1,883,041	5,743,275.05	0.14
291	002002	鸿达兴业	1,447,657	5,689,292.01	0.14
292	603885	吉祥航空	372,030	5,677,177.80	0.14
293	600039	四川路桥	903,756	5,666,550.12	0.14
294	000883	湖北能源	1,231,900	5,654,421.00	0.14
295	601880	辽港股份	3,305,490	5,652,387.90	0.14
296	601456	国联证券	366,167	5,638,971.80	0.14
297	600348	华阳股份	758,473	5,627,869.66	0.14
298	000778	新兴铸管	1,511,000	5,620,920.00	0.14
299	600782	新钢股份	1,006,300	5,615,154.00	0.14
300	000690	宝新能源	1,098,430	5,612,977.30	0.14
301	600260	凯乐科技	629,680	5,591,558.40	0.14
302	000887	中鼎股份	462,500	5,587,000.00	0.14
303	600597	光明乳业	386,200	5,565,142.00	0.14
304	601118	海南橡胶	1,080,003	5,497,215.27	0.14
305	002701	奥瑞金	1,067,720	5,488,080.80	0.14
306	002249	大洋电机	1,044,619	5,484,249.75	0.14
307	002867	周大生	276,700	5,470,359.00	0.14
308	002705	新宝股份	208,315	5,468,268.75	0.14
309	600126	杭钢股份	1,065,307	5,465,024.91	0.14
310	600908	无锡银行	939,653	5,449,987.40	0.14
311	600967	内蒙一机	537,315	5,437,627.80	0.14
312	603568	伟明环保	237,719	5,427,124.77	0.14
313	600645	中源协和	235,983	5,415,809.85	0.14
314	002085	万丰奥威	966,000	5,409,600.00	0.14
315	600026	中远海能	875,247	5,391,521.52	0.14
316	600410	华胜天成	693,322	5,380,178.72	0.14
317	002183	怡亚通	937,500	5,371,875.00	0.14
318	600718	东软集团	548,800	5,367,264.00	0.14
319	000528	柳工	651,430	5,341,726.00	0.13
320	601179	中国西电	1,294,057	5,331,514.84	0.13
321	603650	彤程新材	110,800	5,329,480.00	0.13
322	600985	淮北矿业	432,900	5,285,709.00	0.13
323	600572	康恩贝	1,178,535	5,232,695.40	0.13
324	002110	三钢闽光	773,904	5,216,112.96	0.13
325	000877	天山股份	396,931	5,172,010.93	0.13
326	600167	联美控股	577,706	5,158,914.58	0.13
327	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.13
328	600446	金证股份	356,200	5,143,528.00	0.13
329	000970	中科三环	537,704	5,135,073.20	0.13
330	002368	太极股份	255,890	5,133,153.40	0.13

331	300072	三聚环保	889,900	5,108,026.00	0.13
332	000402	金融街	754,800	5,094,900.00	0.13
333	600329	中新药业	181,200	5,089,908.00	0.13
334	601200	上海环境	424,827	5,085,179.19	0.13
335	002266	浙富控股	1,016,813	5,073,896.87	0.13
336	600064	南京高科	545,920	5,071,596.80	0.13
337	002128	露天煤业	484,649	5,045,196.09	0.13
338	000990	诚志股份	395,200	5,030,896.00	0.13
339	000089	深圳机场	646,800	5,025,636.00	0.13
340	601598	中国外运	995,100	5,025,255.00	0.13
341	600517	国网英大	721,900	4,916,139.00	0.12
342	600158	中体产业	423,855	4,836,185.55	0.12
343	300026	红日药业	1,137,600	4,834,800.00	0.12
344	000400	许继电气	381,600	4,831,056.00	0.12
345	003035	南网能源	478,400	4,755,296.00	0.12
346	002985	北摩高科	48,540	4,732,650.00	0.12
347	000519	中兵红箭	439,495	4,711,386.40	0.12
348	300376	易事特	584,100	4,696,164.00	0.12
349	600120	浙江东方	1,096,581	4,693,366.68	0.12
350	601718	际华集团	1,662,800	4,689,096.00	0.12
351	601975	招商南油	2,182,900	4,671,406.00	0.12
352	002233	塔牌集团	451,600	4,642,448.00	0.12
353	000959	首钢股份	823,400	4,627,508.00	0.12
354	600507	方大特钢	680,211	4,611,830.58	0.12
355	600195	中牧股份	384,407	4,597,507.72	0.12
356	001914	招商积余	267,600	4,597,368.00	0.12
357	600307	酒钢宏兴	1,975,700	4,583,624.00	0.12
358	000090	天健集团	825,314	4,563,986.42	0.11
359	600376	首开股份	813,842	4,557,515.20	0.11
360	000685	中山公用	558,490	4,557,278.40	0.11
361	601333	广深铁路	2,139,689	4,536,140.68	0.11
362	601000	唐山港	1,869,412	4,505,282.92	0.11
363	002505	鹏都农牧	2,010,840	4,504,281.60	0.11
364	002440	闰土股份	507,942	4,495,286.70	0.11
365	600435	北方导航	563,900	4,477,366.00	0.11
366	000559	万向钱潮	833,920	4,428,115.20	0.11
367	600804	鹏博士	904,270	4,376,666.80	0.11
368	002839	张家港行	798,500	4,343,840.00	0.11
369	600643	爱建集团	614,401	4,288,518.98	0.11
370	600673	东阳光	950,843	4,269,285.07	0.11
371	300133	华策影视	719,931	4,261,991.52	0.11
372	603228	景旺电子	161,663	4,235,570.60	0.11
373	600373	中文传媒	427,587	4,216,007.82	0.11

374	601860	紫金银行	1,154,664	4,191,430.32	0.11
375	000758	中色股份	869,414	4,129,716.50	0.10
376	601991	大唐发电	1,563,950	4,128,828.00	0.10
377	000967	盈峰环境	598,989	4,115,054.43	0.10
378	002155	湖南黄金	530,900	4,114,475.00	0.10
379	601608	中信重工	1,095,294	4,096,399.56	0.10
380	002038	双鹭药业	388,800	4,094,064.00	0.10
381	600056	中国医药	336,681	4,090,674.15	0.10
382	600582	天地科技	1,044,300	4,072,770.00	0.10
383	002936	郑州银行	1,106,370	4,060,377.90	0.10
384	600266	城建发展	854,524	4,050,443.76	0.10
385	000563	陕国投 A	1,250,700	4,027,254.00	0.10
386	600388	龙净环保	471,813	4,019,846.76	0.10
387	000681	视觉中国	309,662	4,003,929.66	0.10
388	601098	中南传媒	453,575	4,000,531.50	0.10
389	600131	国网信通	301,844	3,996,414.56	0.10
390	300113	顺网科技	306,854	3,970,690.76	0.10
391	601958	金钼股份	611,100	3,959,928.00	0.10
392	600095	湘财股份	338,100	3,959,151.00	0.10
393	300741	华宝股份	77,374	3,924,409.28	0.10
394	600062	华润双鹤	329,468	3,923,963.88	0.10
395	600901	江苏租赁	754,200	3,921,840.00	0.10
396	600928	西安银行	841,400	3,920,924.00	0.10
397	002416	爱施德	390,841	3,920,135.23	0.10
398	003022	联泓新科	126,310	3,877,717.00	0.10
399	600259	广晟有色	114,147	3,859,310.07	0.10
400	600959	江苏有线	1,262,316	3,850,063.80	0.10
401	300180	华峰超纤	777,600	3,849,120.00	0.10
402	600764	中国海防	134,500	3,806,350.00	0.10
403	600649	城投控股	797,922	3,798,108.72	0.10
404	600094	大名城	1,005,094	3,789,204.38	0.10
405	000415	渤海租赁	1,560,500	3,776,410.00	0.09
406	002399	海普瑞	235,937	3,758,476.41	0.09
407	002458	益生股份	375,329	3,742,030.13	0.09
408	600776	东方通信	301,740	3,741,576.00	0.09
409	600006	东风汽车	504,600	3,683,580.00	0.09
410	601611	中国核建	501,300	3,619,386.00	0.09
411	600556	天下秀	342,600	3,617,856.00	0.09
412	300257	开山股份	250,704	3,602,616.48	0.09
413	600546	山煤国际	500,100	3,590,718.00	0.09
414	600717	天津港	913,559	3,581,151.28	0.09
415	000028	国药一致	93,970	3,555,824.80	0.09
416	002317	众生药业	411,100	3,539,571.00	0.09

417	600633	浙数文化	492,630	3,537,083.40	0.09
418	600729	重庆百货	128,175	3,518,403.75	0.09
419	000717	韶钢松山	763,100	3,502,629.00	0.09
420	600648	外高桥	235,778	3,484,798.84	0.09
421	601928	凤凰传媒	481,381	3,437,060.34	0.09
422	002434	万里扬	422,845	3,429,272.95	0.09
423	600021	上海电力	495,177	3,421,673.07	0.09
424	600863	内蒙华电	1,465,866	3,415,467.78	0.09
425	000501	鄂武商 A	291,260	3,407,742.00	0.09
426	000078	海王生物	1,041,205	3,394,328.30	0.09
427	601828	美凯龙	279,530	3,354,360.00	0.08
428	000062	深圳华强	198,343	3,353,980.13	0.08
429	002375	亚厦股份	422,800	3,348,576.00	0.08
430	600968	海油发展	1,282,400	3,321,416.00	0.08
431	600835	上海机电	203,200	3,302,000.00	0.08
432	002244	滨江集团	785,094	3,289,543.86	0.08
433	002424	贵州百灵	445,400	3,278,144.00	0.08
434	603355	莱克电气	52,107	3,242,618.61	0.08
435	605358	立昂微	27,900	3,224,682.00	0.08
436	000869	张裕 A	85,535	3,176,769.90	0.08
437	600623	华谊集团	356,985	3,145,037.85	0.08
438	600377	宁沪高速	313,200	3,056,832.00	0.08
439	600566	济川药业	168,300	3,012,570.00	0.08
440	600339	中油工程	1,056,700	3,001,028.00	0.08
441	600312	平高电气	513,600	2,999,424.00	0.08
442	600787	中储股份	555,300	2,959,749.00	0.07
443	002468	申通快递	386,214	2,942,950.68	0.07
444	002583	海能达	580,600	2,926,224.00	0.07
445	600639	浦东金桥	214,271	2,924,799.15	0.07
446	000031	大悦城	811,295	2,920,662.00	0.07
447	000826	启迪环境	541,600	2,897,560.00	0.07
448	600823	世茂股份	710,194	2,869,183.76	0.07
449	601969	海南矿业	246,500	2,866,795.00	0.07
450	601778	晶科科技	523,423	2,857,889.58	0.07
451	600466	蓝光发展	957,520	2,824,684.00	0.07
452	603317	天味食品	95,226	2,802,501.18	0.07
453	603888	新华网	130,995	2,773,164.15	0.07
454	002815	崇达技术	220,700	2,754,336.00	0.07
455	601298	青岛港	442,500	2,734,650.00	0.07
456	002532	天山铝业	323,100	2,710,809.00	0.07
457	000156	华数传媒	350,405	2,701,622.55	0.07
458	603708	家家悦	153,596	2,667,962.52	0.07
459	000937	冀中能源	668,800	2,628,384.00	0.07

460	002635	安洁科技	177,253	2,593,211.39	0.07
461	002948	青岛银行	519,749	2,583,152.53	0.06
462	000813	德展健康	565,800	2,568,732.00	0.06
463	000553	安道麦 A	274,800	2,547,396.00	0.06
464	002302	西部建设	318,800	2,518,520.00	0.06
465	601228	广州港	782,100	2,487,078.00	0.06
466	300010	豆神教育	438,500	2,486,295.00	0.06
467	603377	东方时尚	229,384	2,452,114.96	0.06
468	600640	号百控股	201,113	2,451,567.47	0.06
469	603515	欧普照明	95,010	2,438,906.70	0.06
470	600350	山东高速	394,600	2,426,790.00	0.06
471	001872	招商港口	142,972	2,419,086.24	0.06
472	601139	深圳燃气	362,800	2,379,968.00	0.06
473	000061	农产品	428,400	2,364,768.00	0.06
474	600871	石化油服	1,198,500	2,361,045.00	0.06
475	000046	泛海控股	983,800	2,262,740.00	0.06
476	002653	海思科	101,500	2,184,280.00	0.05
477	603379	三美股份	115,489	2,160,799.19	0.05
478	601568	北元集团	250,500	2,144,280.00	0.05
479	603056	德邦股份	194,000	2,132,060.00	0.05
480	603786	科博达	27,887	2,105,468.50	0.05
481	002901	大博医疗	28,227	2,057,466.03	0.05
482	002419	天虹股份	303,089	1,988,263.84	0.05
483	601003	柳钢股份	323,700	1,909,830.00	0.05
484	601512	中新集团	189,400	1,886,424.00	0.05
485	600657	信达地产	539,804	1,878,517.92	0.05
486	601869	长飞光纤	76,658	1,867,388.88	0.05
487	000537	广宇发展	352,300	1,842,529.00	0.05
488	601801	皖新传媒	376,400	1,776,608.00	0.04
489	601187	厦门银行	183,400	1,738,632.00	0.04
490	603983	丸美股份	33,100	1,724,841.00	0.04
491	002946	新乳业	109,300	1,655,895.00	0.04
492	600917	重庆燃气	198,600	1,622,562.00	0.04
493	603719	良品铺子	35,600	1,602,000.00	0.04
494	000732	泰禾集团	627,930	1,356,328.80	0.03
495	600903	贵州燃气	143,660	1,321,672.00	0.03
496	603868	飞科电器	30,380	1,277,782.80	0.03
497	002818	富森美	94,688	1,141,937.28	0.03
498	002423	中粮资本	116,200	1,051,610.00	0.03
499	600956	新天绿能	88,600	1,037,506.00	0.03
500	603256	宏和科技	110,650	1,011,341.00	0.03
501	601068	中铝国际	193,400	667,230.00	0.02
502	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01

503	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.00
504	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.00
505	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.00
506	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.00
507	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
508	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
509	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
510	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.00
511	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.00
512	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
513	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
514	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
515	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
516	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
517	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
518	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
519	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
520	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
521	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
522	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
523	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
524	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
525	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
526	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
527	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
528	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
529	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
530	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
531	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
532	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
533	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
534	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
535	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
536	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
537	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
538	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
539	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
540	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
541	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
542	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
543	300925	法本信息	353	9,280.37	0.00
544	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
545	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

546	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
547	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
548	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
549	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
550	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
551	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
552	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
553	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
554	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
555	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
556	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
557	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
558	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
559	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
560	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
561	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
562	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
563	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
564	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
565	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
566	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
567	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
568	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
569	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
570	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
571	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
572	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
573	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
574	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
575	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
576	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
577	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
578	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	69,617,108.59	1.29
2	002709	天赐材料	39,103,850.61	0.72
3	300012	华测检测	36,957,976.37	0.68
4	000799	酒鬼酒	35,714,754.20	0.66

5	002791	坚朗五金	35,371,598.58	0.65
6	300285	国瓷材料	35,354,555.35	0.65
7	002340	格林美	33,345,641.88	0.62
8	002074	国轩高科	32,308,354.72	0.60
9	300496	中科创达	24,772,157.38	0.46
10	002507	涪陵榨菜	24,628,630.63	0.46
11	002385	大北农	23,962,367.55	0.44
12	002444	巨星科技	23,745,422.48	0.44
13	002353	杰瑞股份	23,261,690.52	0.43
14	002185	华天科技	22,369,005.46	0.41
15	002625	光启技术	21,868,751.91	0.40
16	300618	寒锐钴业	21,373,722.42	0.40
17	300207	欣旺达	21,356,431.22	0.40
18	300146	汤臣倍健	21,203,512.63	0.39
19	002797	第一创业	20,776,719.66	0.38
20	000547	航天发展	20,591,333.94	0.38

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	154,013,898.58	2.85
2	300012	华测检测	85,235,425.16	1.58
3	300496	中科创达	64,181,181.05	1.19
4	300595	欧普康视	56,635,521.61	1.05
5	002791	坚朗五金	55,860,519.28	1.03
6	002709	天赐材料	50,106,162.99	0.93
7	002568	百润股份	49,566,715.63	0.92
8	002074	国轩高科	46,377,023.85	0.86
9	300285	国瓷材料	45,109,995.88	0.83
10	002340	格林美	37,838,088.65	0.70
11	002920	德赛西威	34,065,576.13	0.63
12	002507	涪陵榨菜	33,118,559.72	0.61
13	000547	航天发展	32,612,736.73	0.60
14	002185	华天科技	32,191,767.82	0.60
15	300207	欣旺达	31,887,250.29	0.59
16	002385	大北农	31,306,377.84	0.58
17	600426	华鲁恒升	31,112,725.77	0.58
18	603882	金域医学	29,831,860.74	0.55
19	002353	杰瑞股份	29,628,996.69	0.55
20	002064	华峰化学	29,406,866.34	0.54

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,508,870,121.94
卖出股票的收入（成交）总额	4,283,755,000.38

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2109	中证 500 股指期货 IC2109 合约	46	61,336,400.00	2,709,600.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2107	中证 500 股指期货 IC2107 合约	14	18,948,160.00	597,520.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2112	中证 500 股指期货 IC2112 合约	12	15,650,880.00	702,440.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IC2108	中证 500 股指期货 IC2108 合约	4	5,369,600.00	-30,600.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投

					资目标。
公允价值变动总额合计					3,978,960.00
股指期货投资本期收益					8,511,650.48
股指期货投资本期公允价值变动					2,042,480.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国轩高科股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，国轩高科系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,054,656.85
2	应收证券清算款	9,502,867.12
3	应收股利	1,217,771.44
4	应收利息	369,711.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,145,006.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	24,428,626.60	0.61	重大事项
2	600089	特变电工	4,096,580.00	0.10	转融通出借证券受限
3	000009	中国宝安	3,991,995.00	0.10	转融通出借证券受限
4	002709	天赐材料	3,847,538.00	0.10	转融通出借证券受限
5	002074	国轩高科	3,841,992.00	0.10	转融通出借证券受限
6	600460	士兰微	3,764,180.00	0.09	转融通出借证券受限
7	002340	格林美	3,632,475.00	0.09	转融通出借证券受限
8	300285	国瓷材料	3,334,500.00	0.08	转融通出借证券受限
9	601233	桐昆股份	3,249,741.00	0.08	转融通出借证券受限
10	000799	酒鬼酒	2,556,000.00	0.06	转融通出借证券受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
24,545	45,663.43	262,751,363.00	23.44%	199,716,529.00	17.82%	658,340,902.00	58.74%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	28,901,700.00	2.58%
2	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	28,900,000.00	2.58%
3	中信建投证券股份有限公司融券专用证券账户	21,600,400.00	1.93%
4	中泰证券股份有限公司融券专用证券账户	19,071,666.00	1.70%
5	广发证券股份有限公司融券专用证券账户	16,068,788.00	1.43%
6	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—银保账户	15,927,700.00	1.42%
7	中信证券股份有限公司	10,569,162.00	0.94%
8	招商证券股份有限公司	10,073,913.00	0.90%
9	国泰君安证券股份有限公司	10,000,810.00	0.89%
10	中国国际金融股份有限公司	9,677,113.00	0.86%
11	中国建设银行股份有限公司—华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	658,340,902.00	58.74%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	2,134,473,505
本报告期期初基金份额总额	1,646,408,794
本报告期基金总申购份额	1,355,200,000
减：本报告期基金总赎回份额	1,880,800,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,120,808,794

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成	佣金	占当期佣金总	

			交总额的 比例		量的比 例	
中信证券	12	4,091,973,658.92	52.62%	1,764,898.34	52.62%	-
招商证券	2	1,230,703,653.08	15.82%	530,819.67	15.82%	-
中泰证券	2	810,340,360.92	10.42%	349,508.53	10.42%	-
国盛证券	1	426,713,715.92	5.49%	184,039.99	5.49%	-
东兴证券	1	391,312,058.89	5.03%	168,775.65	5.03%	-
东方证券	1	388,021,320.84	4.99%	167,354.40	4.99%	-
中金公司	4	309,332,208.03	3.98%	133,416.17	3.98%	-
光大证券	5	103,042,419.86	1.32%	44,443.12	1.32%	-
申万宏源证券	2	25,731,148.57	0.33%	11,097.96	0.33%	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、东北证券、方正证券、国泰君安、国泰君安证券、海通证券、华泰证券、华西证券、申万宏源、万联证券、银河证券、粤开证券、浙商证券、中信建投、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期回购成交总

		额的比例		额的比例
中信证券	4,694,556.01	66.93%	15,000,000.00	100.00%
招商证券	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
中国银河证券	2,319,300.00	33.07%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-04
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-09
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
4	华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-27
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-01
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分上交所ETF新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-19
10	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
13	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2021-04-21

	关联方承销证券的公告	网站	
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-08
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
20	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
22	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华夏中证 500ETF 联接	1	2021-01-01 至 2021-06-30	710,706,802.00	87,599,600.00	139,965,500.00	658,340,902.00	58.74%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资							

产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。
在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日