

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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 2022 年 03 月 24 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20

§ 8 投资组合报告	71
8.1 期末基金资产组合情况	71
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	71
8.3 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	73
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	88
8.6 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	88
8.7 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	88
8.8 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	88
8.9 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	88
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	89
8.12 投资组合报告附注	89
§ 9 基金份额持有人信息	91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	91
9.2 期末上市基金前十名持有人	91
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	92
9.4 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情况	92
§ 10 开放式基金份额变动	92
§ 11 重大事件揭示	92
11.1 基金份额持有人大会决议	92
11.2 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	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	93
11.4 基金投资策略的改变	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	93
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
11.8 其他重大事件	97
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	98
12.1 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	98
§ 13 备查文件目录	98
13.1 备查文件目录	98
13.2 存放地点	99
13.3 查阅方式	99

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 嘉实
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
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	449,131,868.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采取完全复制法，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进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的；</p> <p>本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%；本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约；</p> <p>本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的；</p>
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	李申
	联系电话	(010)65215588	021-60637102
	电子邮箱	service@jsfund.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	021-60637111
传真		(010)65215588	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100005	100033
法定代表人		经雷	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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	423,544,426.72	921,499,740.31	-33,945,605.04
本期利润	537,720,658.45	833,969,075.34	473,996,397.93
加权平均基金份额本期利润	1.3526	1.7109	1.0364
本期加权平均净值利润率	17.92%	27.17%	19.75%
本期基金	17.96%	25.02%	28.00%

份额净值增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	2,089,051,047.09	1,794,960,434.33	1,255,320,111.22
期末可供分配基金份额利润	4.6513	3.4000	2.0055
期末基金资产净值	3,690,907,858.29	3,677,862,359.06	3,487,745,146.67
期末基金份额净值	8.2179	6.9665	5.5721
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	130.42%	95.33%	56.23%

注：（1）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。

（2）上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。

（3）期末可供分配利润采用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
过去三个月	3.52%	0.76%	3.60%	0.76%	-0.08%	0.00%
过去六个月	8.78%	0.96%	8.10%	0.96%	0.68%	0.00%
过去一年	17.96%	0.97%	15.58%	0.97%	2.38%	0.00%

过去三年	88.78%	1.38%	76.57%	1.38%	12.21%	0.00%
过去五年	30.31%	1.33%	17.49%	1.33%	12.82%	0.00%
自基金合同生效起至今	130.42%	1.62%	109.04%	1.64%	21.38%	-0.02%

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

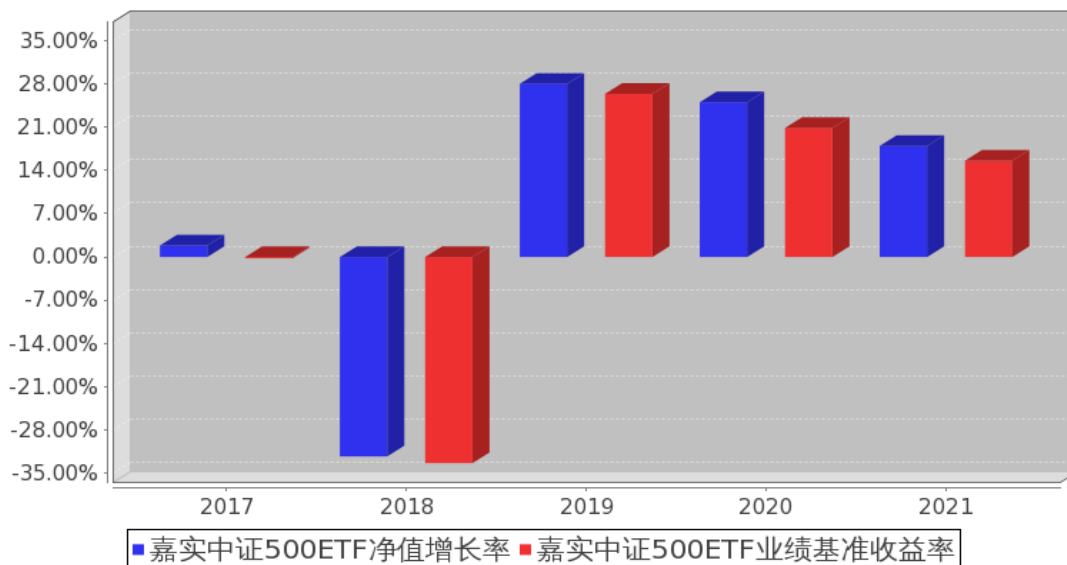
嘉实中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年02月06日至2021年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2021年12月31日，基金管理人共管理258只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		

何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接基金经理	2016年1月5日	-	15年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。
李直	本基金、嘉实基本面50指数 (LOF)、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证500ETF联接、嘉实创业板ETF、嘉实基本面50ETF、嘉实中证沪港深互联网ETF、嘉实中证大农业ETF、嘉实医药健康100ETF联接、嘉实	2021年9月24日	-	7年	2014年7月加入嘉实基金管理有限公司,从事指数基金投资研究工作,现任基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。

	恒生科技 ETF (QDII)、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接基金经理				
陈正宪	本基金基金经理	2016 年 1 月 5 日	2021 年 9 月 24 日	17 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管

理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 2 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪标的指数需要与其他组合发生反向交易，另 1 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，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.43%。

本基金的跟踪误差主要来源于基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红以及样本股调整的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 8.2179 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.96%，业绩比较基准收益率为 15.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，其中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势。随着未来中国经济发展更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也将较多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。

作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，新产品新业务从战略规划到具体产品方案、业务模式，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表及调查、专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

无。

§ 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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23854 号
--------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实中证 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实中证 500ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	16,855,551.78	18,218,332.37
结算备付金		32,975,602.17	22,036,574.87
存出保证金		12,528,623.06	10,939,944.44
交易性金融资产	7.4.7.2	3,600,899,564.62	3,601,549,153.64
其中：股票投资		3,600,651,564.62	3,601,461,953.64
基金投资		-	-
债券投资		248,000.00	87,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	31,000,000.00	54,000,000.00
应收证券清算款		4,722,652.91	112,011,486.57
应收利息	7.4.7.5	167,434.88	197,314.19
应收股利		1,680.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,699,151,109.42	3,818,952,806.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,316,479.15	138,483,256.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		421,187.25	439,077.34
应付托管费		140,395.77	146,359.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	897,188.81	1,169,741.86
应交税费		12,728.57	412,923.24
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	455,271.58	439,088.96
负债合计		8,243,251.13	141,090,447.02
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,601,856,811.20	1,882,901,924.73
未分配利润	7.4.7.10	2,089,051,047.09	1,794,960,434.33
所有者权益合计		3,690,907,858.29	3,677,862,359.06
负债和所有者权益总计		3,699,151,109.42	3,818,952,806.08

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 8.2179 元，基金份额总额 449,131,868.00

份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		552,835,805.51	853,020,503.49
1. 利息收入		11,620,367.50	7,342,620.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	545,351.96	624,976.63
债券利息收入		807.93	3,750.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		764,765.15	1,360,523.37
证券出借利息收入		10,309,442.46	5,353,370.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		417,927,925.52	926,025,517.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	364,272,427.91	854,649,248.25
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	782,663.43	3,772,521.85
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	16,693,760.78	37,889,088.03
股利收益	7.4.7.16	36,179,073.40	29,714,659.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	114,176,231.73	-87,530,664.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	9,111,280.76	7,183,030.50
减：二、费用		15,115,147.06	19,051,428.15
1. 管理人报酬	-	4,499,526.31	4,601,963.98
2. 托管费	-	1,499,842.00	1,533,988.01
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,875,328.67	11,604,998.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		111,596.53	142,611.37
7. 其他费用	7.4.7.20	1,128,853.55	1,167,866.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		537,720,658.45	833,969,075.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		537,720,658.45	833,969,075.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	1,882,901,924.73	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	537,720,658.45	537,720,658.45
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）	-281,045,113.53	-243,630,045.69	-524,675,159.22
其中：1. 基金申购款	2,937,420,752.84	3,175,631,854.99	6,113,052,607.83
2. 基金赎回款	-3,218,465,866.37	-3,419,261,900.68	-6,637,727,767.05
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）	1,601,856,811.20	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	2,232,425,035.45	1,255,320,111.22	3,487,745,146.67

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	833,969,075.34	833,969,075.34
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)	-349,523,110.72	-294,328,752.23	-643,851,862.95
其中：1. 基金申购款	6,585,300,726.58	5,408,385,702.97	11,993,686,429.55
2. 基金赎回款	-6,934,823,837.30	-5,702,714,455.20	-12,637,538,292.50
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)	1,882,901,924.73	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、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》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括

卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[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[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《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得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，暂减按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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	16,855,551.78	18,218,332.37
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	16,855,551.78	18,218,332.37

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,435,494,686.78	3,600,651,564.62	165,156,877.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	248,000.00	248,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	248,000.00	248,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,435,742,686.78	3,600,899,564.62	165,156,877.84
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,547,952,307.53	3,601,461,953.64	53,509,646.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	87,200.00	87,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	87,200.00	87,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,548,039,507.53	3,601,549,153.64	53,509,646.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	83,242,000.00	-	-	
其中：股指期货投资	83,242,000.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	83,242,000.00	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	71,330,200.00	-	-	
其中：股指期货投资	71,330,200.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	71,330,200.00	-	-	

注：股指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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金买入 IC2203 持仓量为 60 手，对应合约市值 87,669,600.00 元，公允价值变动 4,427,600.00 元，公允价值变动总额合计 4,427,600.00 元，可抵消期货暂收款 4,427,600.00 元，股指期货投资净额为零(于 2020 年 12 月 31 日：买入 IC2106 持仓量为 60 手，对应合约市值 73,228,800.00 元，公允价值变动 1,898,600.00 元，公允价值变动总额合计 1,898,600.00 元，可抵消期货暂收款 1,898,600.00 元，股指期货投资净额为零)。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	31,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	31,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	54,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	54,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	2,335.23	3,198.15
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	18,482.24	11,559.23
应收债券利息	29.77	8.03
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-10,285.43	-7,458.91
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	156,747.01	189,667.13
其他	126.06	340.56
合计	167,434.88	197,314.19

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	897,188.81	1,169,741.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	897,188.81	1,169,741.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	212,000.00	220,000.00

应付指数使用费	243,271.58	219,088.96
合计	455,271.58	439,088.96

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	527,931,868.00	1,882,901,924.73
本期申购	823,600,000.00	2,937,420,752.84
本期赎回（以“-”号填列）	-902,400,000.00	-3,218,465,866.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	449,131,868.00	1,601,856,811.20

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	2,320,148,736.14	-525,188,301.81	1,794,960,434.33
本期利润	423,544,426.72	114,176,231.73	537,720,658.45
本期基金份额交易产生的变动数	-287,798,272.29	44,168,226.60	-243,630,045.69
其中：基金申购款	3,957,524,845.74	-781,892,990.75	3,175,631,854.99
基金赎回款	-4,245,323,118.03	826,061,217.35	-3,419,261,900.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,455,894,890.57	-366,843,843.48	2,089,051,047.09

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	81,278.09
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	455,452.94	429,474.54
其他	8,620.93	8,218.73
合计	545,351.96	624,976.63

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	277,445,886.55	403,783,399.64
股票投资收益——赎回差价收入	86,826,541.36	450,865,848.61
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	364,272,427.91	854,649,248.25

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	4,548,940,679.75	7,122,707,964.11
减：卖出股票成本总额	4,271,494,793.20	6,718,924,564.47
买卖股票差价收入	277,445,886.55	403,783,399.64

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	6,637,727,767.05	12,637,538,292.50
减：现金支付赎回款总额	3,123,086,948.05	5,678,623,506.50
减：赎回股票成本总额	3,427,814,277.64	6,508,048,937.39
赎回差价收入	86,826,541.36	450,865,848.61

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	782,663.43	3,772,521.85
债券投资收益——赎回 差价收入	—	—
债券投资收益——申购 差价收入	—	—
合计	782,663.43	3,772,521.85

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总额	5,429,565.67	24,161,902.12
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	4,646,100.00	20,364,531.90
减：应收利息总额	802.24	24,848.37
买卖债券差价收入	782,663.43	3,772,521.85

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	16,693,760.78	37,889,088.03

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	日
股票投资产生的股利收益	36,179,073.40	29,714,659.62
其中：证券出借权益补偿收入	5,986,576.45	4,988,575.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	36,179,073.40	29,714,659.62

7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	111,647,231.73	-81,016,824.29
股票投资	111,647,231.73	-81,016,824.29
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	2,529,000.00	-6,513,840.68
权证投资	-	-
期货投资	2,529,000.00	-6,513,840.68
3. 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	114,176,231.73	-87,530,664.97

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	9,111,280.76	7,183,030.50
合计	9,111,280.76	7,183,030.50

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	7,875,328.67	11,604,998.09
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,875,328.67	11,604,998.09

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	92,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	16,407.18	27,005.01
指数使用费	899,905.37	920,392.69
其他	541.00	469.00
合计	1,128,853.55	1,167,866.70

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规、基金合同及公告，2022 年 2 月 17 日本基金进行份额拆分。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	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
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 联接”）	本基金的联接基金

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,499,526.31	4,601,963.98
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,499,842.00	1,533,988.01

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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12月31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（%）
嘉实中证 500ETF联接	265,970,831.00	59.22	226,543,731.00	42.91

7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	16,855,551.78	81,278.09	18,218,332.37	187,283.36

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2021年1月1日至2021年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新发未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合	2021年	2022年	新股锁	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

	达	7月14日	1月24日	定							
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84		-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63		-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76		-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32		-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65		-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18		-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18		-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64		-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91		-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95		-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10		-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32		-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42		-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28		-

301053	远信工业	2021年 8月25 日	2022年 3月1 日	新股锁 定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股锁 定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301058	中粮工科	2021年 9月1 日	2022年 3月9 日	新股锁 定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 3月14 日	新股锁 定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301063	海锅股份	2021年 9月9 日	2022年 3月24 日	新股锁 定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年 9月13 日	2022年 3月22 日	新股锁 定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股锁 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 3月30 日	新股锁 定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年 9月30 日	2022年 4月14 日	新股锁 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11 日	2022年 4月19 日	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 4月20 日	新股锁 定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜智能	2021年 10月13 日	2022年 4月21 日	新股锁 定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年 10月15 日	2022年 4月25 日	新股锁 定	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-

		日	日								
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60		-
301090	华润材料	2021年 10月19 日	2022年 4月26 日	新股锁 定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08		-
301091	深城交	2021年 10月20 日	2022年 4月29 日	新股锁 定	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44		-
301092	争光股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96		-
301093	华兰股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65		-
301127	天源环保	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股锁 定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20		-
301136	招标股份	2021年 12月31 日	2022年 1月11 日	新发未 上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44		-
301149	隆华新材	2021年 11月3 日	2022年 5月10 日	新股锁 定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64		-
301166	优宁维	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50		-
301189	奥尼电子	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70		-
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50		-
688167	炬光科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38		-
688227	品高股份	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股锁 定	37.09	30.76	4,164	154,442.76	128,084.64		-
688257	新锐股份	2021年 10月19 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	62.30	61.10	2,899	180,607.70	177,128.90		-
688262	国芯	2021年	2022年	新发未	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42		-

	科技	12月28日	1月6日	上市						
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110084	贵燃转债	2021年12月28日	2022年1月18日	新债未上市	100.00	100.00	750	75,000.00	75,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债未上市	100.00	100.00	1,730	173,000.00	173,000.00	-

注：1. 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。

2. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

7.4.12.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项停牌	30.12	2022年1月4日	31.00	201,650	6,199,383.10	6,073,698.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 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	002340	格林美	2022年1月7日-2022年	10.35	509,600	5,274,360

			1月14日			.00
2	600522	中天科技	2022年1月7日-2022年1月14日	16.96	282,800	4,796,288.00
3	000733	振华科技	2022年1月7日-2022年1月14日	124.28	38,400	4,772,352.00
4	000723	美锦能源	2022年1月7日-2022年1月14日	16.23	273,000	4,430,790.00
5	601615	明阳智能	2022年1月7日-2022年1月14日	26.10	166,600	4,348,260.00
6	600157	永泰能源	2022年1月7日-2022年1月14日	1.82	2,366,000	4,306,120.00
7	600885	宏发股份	2022年1月7日-2022年1月14日	74.64	55,500	4,142,520.00
8	600884	杉杉股份	2022年1月7日-2022年1月14日	32.77	123,200	4,037,264.00
9	000009	中国宝安	2022年1月7日-2022年1月14日	14.43	274,400	3,959,592.00
10	002384	东山精密	2022年1月7日-2022年1月14日	27.10	145,600	3,945,760.00
11	601117	中国化学	2022年1月7日-2022年1月14日	12.00	324,800	3,897,600.00
12	002013	中航机电	2022年1月7日-2022年1月14日	18.18	206,500	3,754,170.00
13	002385	大北农	2022年1月7日-2022年1月14日	10.49	352,800	3,700,872.00
14	300285	国瓷材料	2022年1月7日-2022年1月14日	42.57	85,400	3,635,478.00
15	002268	卫士通	2022年1月7日-2022年1月14日	55.94	63,000	3,524,220.00
16	300088	长信科技	2022年1月7日-2022年1月14日	13.28	261,100	3,467,408.00
17	300037	新宙邦	2022年1月7日-2022年1月14日	113.00	30,100	3,401,300.00
18	600765	中航重机	2022年1月7日-2022年1月14日	50.49	67,200	3,392,928.00
19	688099	晶晨股份	2022年1月7日-2022年1月14日	130.20	25,900	3,372,180.00
20	600563	法拉电子	2022年1月7日	232.40	14,300	3,323,320.00
21	688005	容百科技	2022年1月7日-2022年1月14日	115.58	28,000	3,236,240.00
22	300751	迈为股份	2022年1月7日-2022年1月14日	642.30	5,000	3,211,500.00
23	600256	广汇能	2022年1月7日-2022年	6.54	489,300	3,200,022.00

		源	1月14日			.00
24	600298	安琪酵母	2022年1月7日-2022年1月14日	60.36	53,000	3,199,080.00
25	002028	思源电气	2022年1月7日-2022年1月14日	49.21	64,800	3,188,808.00
26	002180	纳思达	2022年1月7日-2022年1月14日	47.76	66,600	3,180,816.00
27	600862	中航高科	2022年1月7日-2022年1月14日	35.76	88,900	3,179,064.00
28	600141	兴发集团	2022年1月7日-2022年1月14日	37.88	82,600	3,128,888.00
29	300363	博腾股份	2022年1月7日-2022年1月14日	89.45	34,300	3,068,135.00
30	300253	卫宁健康	2022年1月7日-2022年1月14日	16.76	182,000	3,050,320.00
31	600487	亨通光电	2022年1月7日-2022年1月14日	15.12	200,900	3,037,608.00
32	002185	华天科技	2022年1月7日-2022年1月14日	12.71	238,700	3,033,877.00
33	000988	华工科技	2022年1月7日-2022年1月14日	27.86	107,100	2,983,806.00
34	603456	九洲药业	2022年1月7日-2022年1月14日	56.26	53,000	2,981,780.00
35	601636	旗滨集团	2022年1月7日-2022年1月14日	17.10	171,500	2,932,650.00
36	600392	盛和资源	2022年1月7日-2022年1月14日	19.62	149,100	2,925,342.00
37	300058	蓝色光标	2022年1月7日-2022年1月14日	10.73	265,300	2,846,669.00
38	600754	锦江酒店	2022年1月7日-2022年1月14日	58.60	48,400	2,836,240.00
39	600418	江淮汽车	2022年1月7日-2022年1月14日	17.40	161,000	2,801,400.00
40	300699	光威复材	2022年1月7日-2022年1月14日	84.48	32,900	2,779,392.00
41	601168	西部矿业	2022年1月7日-2022年1月14日	13.61	202,300	2,753,303.00
42	603613	国联股份	2022年1月7日-2022年1月14日	107.50	25,600	2,752,000.00
43	000630	铜陵有色	2022年1月7日-2022年1月14日	3.48	785,400	2,733,192.00
44	300223	北京君正	2022年1月7日-2022年1月14日	134.00	20,300	2,720,200.00
45	603589	口子窖	2022年1月7日-2022年1月14日	70.87	38,100	2,700,147.00

			1月14日			.00
46	603267	鸿远电子	2022年1月14日	179.44	14,800	2,655,712.00
47	600516	方大炭素	2022年1月7日-2022年1月14日	10.82	242,900	2,628,178.00
48	002797	第一创业	2022年1月7日-2022年1月14日	7.32	358,400	2,623,488.00
49	002138	顺络电子	2022年1月7日-2022年1月14日	38.18	68,400	2,611,512.00
50	300136	信维通信	2022年1月7日-2022年1月14日	25.32	102,900	2,605,428.00
51	000998	隆平高科	2022年1月7日-2022年1月14日	23.26	112,000	2,605,120.00
52	600486	扬农化工	2022年1月7日	131.20	19,800	2,597,760.00
53	601077	渝农商行	2022年1月7日-2022年1月14日	3.85	659,400	2,538,690.00
54	688536	思瑞浦	2022年1月7日-2022年1月14日	768.00	3,300	2,534,400.00
55	600875	东方电气	2022年1月7日-2022年1月14日	21.42	118,300	2,533,986.00
56	300308	中际旭创	2022年1月7日-2022年1月14日	42.50	59,500	2,528,750.00
57	601555	东吴证券	2022年1月7日	8.86	283,200	2,509,152.00
58	000728	国元证券	2022年1月7日-2022年1月14日	7.70	325,500	2,506,350.00
59	600038	中直股份	2022年1月7日-2022年1月14日	80.30	31,200	2,505,360.00
60	601689	拓普集团	2022年1月7日-2022年1月14日	53.00	46,800	2,480,400.00
61	002409	雅克科技	2022年1月7日-2022年1月14日	81.17	30,300	2,459,451.00
62	002353	杰瑞股份	2022年1月7日-2022年1月14日	40.00	61,200	2,448,000.00
63	300146	汤臣倍健	2022年1月7日-2022年1月14日	26.96	90,300	2,434,488.00
64	002080	中材科技	2022年1月7日-2022年1月14日	34.02	71,400	2,429,028.00
65	600233	圆通速递	2022年1月7日-2022年1月14日	16.68	145,600	2,428,608.00
66	002212	天融信	2022年1月7日-2022年1月14日	19.17	126,000	2,415,420.00
67	002223	鱼跃医	2022年1月7日-2022年	37.80	63,600	2,404,080

		疗	1月14日			.00
68	000519	中兵红 箭	2022年1月7日-2022年 1月14日	26.67	88,900	2,370,963 .00
69	300418	昆仑万 维	2022年1月7日-2022年 1月14日	23.15	101,500	2,349,725 .00
70	300474	景嘉微	2022年1月7日-2022年 1月14日	152.20	15,400	2,343,880 .00
71	688065	凯赛生 物	2022年1月7日-2022年 1月14日	184.28	12,600	2,321,928 .00
72	002673	西部证 券	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.07	285,600	2,304,792 .00
73	600733	北汽蓝 谷	2022年1月7日-2022年 1月14日	10.02	228,200	2,286,564 .00
74	000547	航天发 展	2022年1月7日-2022年 1月14日	16.70	136,500	2,279,550 .00
75	688208	道通科 技	2022年1月7日-2022年 1月14日	79.40	28,700	2,278,780 .00
76	000636	风华高 科	2022年1月7日-2022年 1月14日	29.80	76,300	2,273,740 .00
77	600705	中航产 融	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.97	570,500	2,264,885 .00
78	600482	中国动 力	2022年1月7日-2022年 1月14日	19.70	114,800	2,261,560 .00
79	002439	启明星 辰	2022年1月7日-2022年 1月14日	28.53	79,100	2,256,723 .00
80	000932	华菱钢 铁	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.11	441,000	2,253,510 .00
81	603077	和邦生 物	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.41	659,400	2,248,554 .00
82	000039	中集集 团	2022年1月7日-2022年 1月14日	17.16	130,200	2,234,232 .00
83	600699	均胜电 子	2022年1月7日-2022年 1月14日	21.97	101,500	2,229,955 .00
84	603605	珀莱雅	2022年1月7日	208.31	10,700	2,228,917 .00
85	000807	云铝股 份	2022年1月7日-2022年 1月14日	11.17	199,500	2,228,415 .00
86	600739	辽宁成 大	2022年1月7日-2022年 1月14日	19.52	114,100	2,227,232 .00
87	600188	兖矿能 源	2022年1月7日-2022年 1月14日	23.53	94,500	2,223,585 .00
88	002444	巨星科 技	2022年1月7日-2022年 1月14日	30.51	72,800	2,221,128 .00
89	300296	利亚德	2022年1月7日-2022年	10.25	216,300	2,217,075

			1月14日			.00
90	600529	山东药玻	2022年1月7日-2022年1月14日	43.90	50,500	2,216,950.00
91	688002	睿创微纳	2022年1月7日-2022年1月14日	78.57	28,000	2,199,960.00
92	000739	普洛药业	2022年1月7日-2022年1月14日	35.09	62,400	2,189,616.00
93	002465	海格通信	2022年1月7日-2022年1月14日	10.92	196,000	2,140,320.00
94	002507	涪陵榨菜	2022年1月7日-2022年1月14日	37.80	56,500	2,135,700.00
95	000738	航发控制	2022年1月7日-2022年1月14日	30.28	70,000	2,119,600.00
96	600988	赤峰黄金	2022年1月7日-2022年1月14日	14.90	141,400	2,106,860.00
97	002030	达安基因	2022年1月7日-2022年1月14日	20.06	104,300	2,092,258.00
98	601016	节能风电	2022年1月7日-2022年1月14日	6.51	319,900	2,082,549.00
99	000960	锡业股份	2022年1月7日-2022年1月14日	19.53	106,400	2,077,992.00
100	600521	华海药业	2022年1月7日-2022年1月14日	21.66	95,200	2,062,032.00
101	600637	东方明珠	2022年1月7日-2022年1月14日	9.45	217,700	2,057,265.00
102	002273	水晶光电	2022年1月7日-2022年1月14日	17.39	118,300	2,057,237.00
103	600549	厦门钨业	2022年1月7日-2022年1月14日	22.63	90,300	2,043,489.00
104	600177	雅戈尔	2022年1月7日-2022年1月14日	6.89	295,400	2,035,306.00
105	688521	芯原股份	2022年1月7日-2022年1月14日	77.36	25,900	2,003,624.00
106	601198	东兴证券	2022年1月7日-2022年1月14日	11.63	171,500	1,994,545.00
107	002557	洽洽食品	2022年1月7日-2022年1月14日	61.36	32,400	1,988,064.00
108	002078	太阳纸业	2022年1月7日-2022年1月14日	11.49	171,500	1,970,535.00
109	600704	物产中大	2022年1月7日-2022年1月14日	5.92	331,800	1,964,256.00
110	603127	昭衍新药	2022年1月7日	115.43	17,000	1,962,310.00
111	600201	生物股	2022年1月7日-2022年	16.35	119,700	1,957,095.00

		份	1月14日			.00
112	300383	光环新网	2022年1月7日-2022年 1月14日	14.84	130,900	1,942,556 .00
113	600642	申能股份	2022年1月7日-2022年 1月14日	7.37	261,800	1,929,466 .00
114	601128	常熟银行	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.61	291,900	1,929,459 .00
115	002156	通富微电	2022年1月7日-2022年 1月14日	19.43	98,700	1,917,741 .00
116	002299	圣农发展	2022年1月7日-2022年 1月14日	24.17	79,100	1,911,847 .00
117	600879	航天电子	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.24	231,000	1,903,440 .00
118	600497	驰宏锌锗	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.99	380,100	1,896,699 .00
119	300357	我武生物	2022年1月7日-2022年 1月14日	57.30	32,900	1,885,170 .00
120	600369	西南证券	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.29	353,500	1,870,015 .00
121	600027	华电国际	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.35	346,500	1,853,775 .00
122	600160	巨化股份	2022年1月7日-2022年 1月14日	12.91	143,500	1,852,585 .00
123	000830	鲁西化工	2022年1月7日-2022年 1月14日	15.26	121,100	1,847,986 .00
124	600039	四川路桥	2022年1月7日-2022年 1月14日	12.04	152,600	1,837,304 .00
125	600372	中航电子	2022年1月7日-2022年 1月14日	22.39	81,900	1,833,741 .00
126	002739	万达电影	2022年1月7日-2022年 1月14日	15.48	118,300	1,831,284 .00
127	002092	中泰化学	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.54	191,800	1,829,772 .00
128	000623	吉林敖东	2022年1月7日-2022年 1月14日	18.47	98,700	1,822,989 .00
129	002508	老板电器	2022年1月7日-2022年 1月14日	36.02	50,500	1,819,010 .00
130	000983	山西焦煤	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.27	217,700	1,800,379 .00
131	300618	寒锐钴业	2022年1月7日-2022年 1月14日	80.18	22,400	1,796,032 .00
132	600316	洪都航空	2022年1月7日-2022年 1月14日	39.06	45,600	1,781,136 .00
133	600580	卧龙电	2022年1月7日-2022年	18.29	97,300	1,779,617

		驱	1月14日			.00
134	000629	攀钢钒钛	2022年1月7日-2022年1月14日	3.89	457,100	1,778,119.00
135	300115	长盈精密	2022年1月7日-2022年1月14日	19.84	89,600	1,777,664.00
136	601997	贵阳银行	2022年1月7日-2022年1月14日	6.51	272,300	1,772,673.00
137	002249	大洋电机	2022年1月7日-2022年1月14日	8.79	201,600	1,772,064.00
138	002131	利欧股份	2022年1月7日-2022年1月14日	2.46	718,900	1,768,494.00
139	603198	迎驾贡酒	2022年1月7日-2022年1月14日	69.45	25,400	1,764,030.00
140	002373	千方科技	2022年1月7日-2022年1月14日	14.95	117,600	1,758,120.00
141	002603	以岭药业	2022年1月7日-2022年1月14日	19.60	88,900	1,742,440.00
142	300017	网宿科技	2022年1月7日-2022年1月14日	6.69	260,400	1,742,076.00
143	002422	科伦药业	2022年1月7日-2022年1月14日	18.93	90,300	1,709,379.00
144	600170	上海建工	2022年1月7日-2022年1月14日	3.60	474,600	1,708,560.00
145	000825	太钢不锈	2022年1月7日-2022年1月14日	7.04	242,200	1,705,088.00
146	300070	碧水源	2022年1月7日-2022年1月14日	7.19	235,900	1,696,121.00
147	000050	深天马A	2022年1月7日-2022年1月14日	13.02	130,200	1,695,204.00
148	000887	中鼎股份	2022年1月7日-2022年1月14日	21.81	77,700	1,694,637.00
149	600118	中国卫星	2022年1月7日-2022年1月14日	27.15	62,400	1,694,160.00
150	600859	王府井	2022年1月7日-2022年1月14日	27.00	62,400	1,684,800.00
151	600166	福田汽车	2022年1月7日-2022年1月14日	3.44	489,300	1,683,192.00
152	603218	日月股份	2022年1月7日-2022年1月14日	32.95	51,000	1,680,450.00
153	000400	许继电气	2022年1月7日-2022年1月14日	26.10	64,200	1,675,620.00
154	600803	新奥股份	2022年1月7日-2022年1月14日	18.36	91,000	1,670,760.00
155	000750	国海证	2022年1月7日-2022年	4.11	406,000	1,668,660

		券	1月14日			.00
156	600867	通化东宝	2022年1月7日-2022年1月14日	10.96	151,200	1,657,152.00
157	600153	建发股份	2022年1月7日-2022年1月14日	9.07	182,700	1,657,089.00
158	002506	协鑫集成	2022年1月7日-2022年1月14日	3.80	435,400	1,654,520.00
159	002191	劲嘉股份	2022年1月7日-2022年1月14日	15.13	109,200	1,652,196.00
160	002372	伟星新材	2022年1月7日-2022年1月14日	24.32	67,800	1,648,896.00
161	002926	华西证券	2022年1月7日-2022年1月14日	9.85	167,300	1,647,905.00
162	600258	首旅酒店	2022年1月7日-2022年1月14日	26.13	63,000	1,646,190.00
163	300168	万达信息	2022年1月7日-2022年1月14日	13.02	126,000	1,640,520.00
164	000027	深圳能源	2022年1月7日-2022年1月14日	8.10	202,300	1,638,630.00
165	300001	特锐德	2022年1月7日-2022年1月14日	24.87	65,800	1,636,446.00
166	002266	浙富控股	2022年1月7日-2022年1月14日	7.12	228,900	1,629,768.00
167	603707	健友股份	2022年1月7日-2022年1月14日	42.00	38,700	1,625,400.00
168	002056	横店东磁	2022年1月7日-2022年1月14日	18.87	86,100	1,624,707.00
169	600909	华安证券	2022年1月7日-2022年1月14日	5.41	300,300	1,624,623.00
170	600236	桂冠电力	2022年1月7日-2022年1月14日	6.42	251,300	1,613,346.00
171	300251	光线传媒	2022年1月7日-2022年1月14日	12.85	125,300	1,610,105.00
172	002002	鸿达兴业	2022年1月7日-2022年1月14日	6.06	265,300	1,607,718.00
173	600008	首创环保	2022年1月7日-2022年1月14日	3.41	468,300	1,596,903.00
174	300009	安科生物	2022年1月7日-2022年1月14日	13.09	121,800	1,594,362.00
175	002065	东华软件	2022年1月7日-2022年1月14日	7.80	204,400	1,594,320.00
176	000513	丽珠集团	2022年1月7日-2022年1月14日	40.21	39,600	1,592,316.00
177	600066	宇通客	2022年1月7日-2022年	11.02	144,200	1,589,084

		车	1月14日			.00
178	000997	新大陆	2022年1月7日-2022年1月14日	18.12	87,500	1,585,500.00
179	600271	航天信息	2022年1月7日-2022年1月14日	13.39	118,300	1,584,037.00
180	000021	深科技	2022年1月7日-2022年1月14日	15.84	99,400	1,574,496.00
181	600536	中国软件	2022年1月7日-2022年1月14日	49.93	31,500	1,572,795.00
182	002152	广电运通	2022年1月7日-2022年1月14日	11.90	131,600	1,566,040.00
183	002408	齐翔腾达	2022年1月7日-2022年1月14日	10.50	149,100	1,565,550.00
184	002203	海亮股份	2022年1月7日-2022年1月14日	12.43	125,300	1,557,479.00
185	600171	上海贝岭	2022年1月7日-2022年1月14日	25.66	60,600	1,554,996.00
186	000975	银泰黄金	2022年1月7日-2022年1月14日	8.78	177,100	1,554,938.00
187	002221	东华能源	2022年1月7日-2022年1月14日	12.59	123,200	1,551,088.00
188	300244	迪安诊断	2022年1月7日-2022年1月14日	33.57	46,200	1,550,934.00
189	000656	金科股份	2022年1月7日-2022年1月14日	4.48	340,900	1,527,232.00
190	600535	天士力	2022年1月7日-2022年1月14日	15.85	95,900	1,520,015.00
191	603156	养元饮品	2022年1月7日-2022年1月14日	28.41	53,500	1,519,935.00
192	600348	华阳股份	2022年1月7日-2022年1月14日	11.85	128,100	1,517,985.00
193	002500	山西证券	2022年1月7日-2022年1月14日	6.60	229,600	1,515,360.00
194	002572	索菲亚	2022年1月7日-2022年1月14日	22.20	67,800	1,505,160.00
195	300630	普利制药	2022年1月7日-2022年1月14日	55.04	27,300	1,502,592.00
196	300026	红日药业	2022年1月7日-2022年1月14日	7.83	191,800	1,501,794.00
197	601005	重庆钢铁	2022年1月7日-2022年1月14日	2.09	714,700	1,493,723.00
198	300024	机器人	2022年1月7日-2022年1月14日	11.17	133,000	1,485,610.00
199	300212	易华录	2022年1月7日-2022年	35.35	42,000	1,484,700

			1月14日			.00
200	600998	九州通	2022年1月7日-2022年 1月14日	14.72	99,400	1,463,168 .00
201	603568	伟明环 保	2022年1月7日-2022年 1月14日	36.53	40,000	1,461,200 .00
202	600315	上海家 化	2022年1月7日	40.41	36,000	1,454,760 .00
203	000012	南玻 A	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.93	146,300	1,452,759 .00
204	000878	云南铜 业	2022年1月7日-2022年 1月14日	13.37	108,500	1,450,645 .00
205	000970	中科三 环	2022年1月7日-2022年 1月14日	16.05	90,300	1,449,315 .00
206	002127	南极电 商	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.90	209,300	1,444,170 .00
207	601699	潞安环 能	2022年1月7日-2022年 1月14日	11.31	127,400	1,440,894 .00
208	002195	二三四 五	2022年1月7日-2022年 1月14日	2.34	611,100	1,429,974 .00
209	002745	木林森	2022年1月7日-2022年 1月14日	15.13	94,500	1,429,785 .00
210	300315	掌趣科 技	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.86	294,000	1,428,840 .00
211	000999	华润三 九	2022年1月7日-2022年 1月14日	34.24	41,600	1,424,384 .00
212	600673	东阳光	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.88	160,300	1,423,464 .00
213	000537	广宇发 展	2022年1月7日-2022年 1月14日	24.10	59,000	1,421,900 .00
214	603712	七一二	2022年1月7日-2022年 1月14日	43.30	32,700	1,415,910 .00
215	600415	小商品 城	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.85	291,900	1,415,715 .00
216	601872	招商轮 船	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.10	345,100	1,414,910 .00
217	002250	联化科 技	2022年1月7日-2022年 1月14日	17.97	78,400	1,408,848 .00
218	002511	中顺洁 柔	2022年1月7日-2022年 1月14日	16.71	83,300	1,391,943 .00
219	600801	华新水 泥	2022年1月7日-2022年 1月14日	19.30	72,100	1,391,530 .00
220	300182	捷成股 份	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.33	218,400	1,382,472 .00
221	002019	亿帆医	2022年1月7日-2022年	17.62	78,400	1,381,408

		药	1月14日			.00
222	300463	迈克生物	2022年1月7日-2022年 1月14日	29.19	46,900	1,369,011 .00
223	002153	石基信息	2022年1月7日-2022年 1月14日	28.74	47,600	1,368,024 .00
224	600863	内蒙华电	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.94	347,200	1,367,968 .00
225	000690	宝新能源	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.92	231,000	1,367,520 .00
226	600208	新湖中宝	2022年1月7日-2022年 1月14日	2.98	457,100	1,362,158 .00
227	688006	杭可科技	2022年1月7日-2022年 1月14日	107.58	12,600	1,355,508 .00
228	600970	中材国际	2022年1月7日-2022年 1月14日	11.43	117,600	1,344,168 .00
229	000060	中金岭南	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.91	272,300	1,336,993 .00
230	600517	国网英大	2022年1月7日-2022年 1月14日	7.29	182,700	1,331,883 .00
231	000686	东北证券	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.78	149,100	1,309,098 .00
232	600380	健康元	2022年1月7日-2022年 1月14日	12.84	101,500	1,303,260 .00
233	600839	四川长虹	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.31	393,400	1,302,154 .00
234	601866	中远海发	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.25	400,400	1,301,300 .00
235	600498	烽火通信	2022年1月7日-2022年 1月14日	17.98	72,100	1,296,358 .00
236	300482	万孚生物	2022年1月7日-2022年 1月14日	39.38	32,900	1,295,602 .00
237	000930	中粮科技	2022年1月7日-2022年 1月14日	10.87	119,000	1,293,530 .00
238	002505	鹏都农牧	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.82	338,100	1,291,542 .00
239	600155	华创阳安	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.96	129,500	1,289,820 .00
240	002294	信立泰	2022年1月7日-2022年 1月14日	27.32	47,200	1,289,504 .00
241	002939	长城证券	2022年1月7日-2022年 1月14日	12.95	98,700	1,278,165 .00
242	603858	步长制药	2022年1月7日-2022年 1月14日	21.09	60,600	1,278,054 .00
243	600390	五矿资	2022年1月7日-2022年	5.32	239,400	1,273,608

		本	1月14日			.00
244	000729	燕京啤酒	2022年1月7日-2022年1月14日	8.47	149,800	1,268,806.00
245	600667	太极实业	2022年1月7日-2022年1月14日	8.08	156,800	1,266,944.00
246	002701	奥瑞金	2022年1月7日-2022年1月14日	7.00	180,600	1,264,200.00
247	600511	国药股份	2022年1月7日-2022年1月14日	31.53	40,000	1,261,200.00
248	601992	金隅集团	2022年1月7日-2022年1月14日	2.84	443,800	1,260,392.00
249	600500	中化国际	2022年1月7日-2022年1月14日	8.56	147,000	1,258,320.00
250	000401	冀东水泥	2022年1月7日-2022年1月14日	11.96	105,000	1,255,800.00
251	600718	东软集团	2022年1月7日-2022年1月14日	13.56	92,400	1,252,944.00
252	600728	佳都科技	2022年1月7日-2022年1月14日	8.33	149,800	1,247,834.00
253	600895	张江高科	2022年1月7日-2022年1月14日	15.06	81,900	1,233,414.00
254	600158	中体产业	2022年1月7日-2022年1月14日	15.12	81,200	1,227,744.00
255	002430	杭氧股份	2022年1月7日-2022年1月14日	30.01	40,800	1,224,408.00
256	002004	华邦健康	2022年1月7日-2022年1月14日	7.24	168,700	1,221,388.00
257	002382	蓝帆医疗	2022年1月7日-2022年1月14日	16.29	74,900	1,220,121.00
258	600764	中国海防	2022年1月7日-2022年1月14日	40.66	30,000	1,219,800.00
259	600216	浙江医药	2022年1月7日-2022年1月14日	17.08	71,400	1,219,512.00
260	601179	中国西电	2022年1月7日-2022年1月14日	5.55	218,400	1,212,120.00
261	600282	南钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	3.70	326,900	1,209,530.00
262	000598	兴蓉环境	2022年1月7日-2022年1月14日	6.32	191,100	1,207,752.00
263	002128	电投能源	2022年1月7日-2022年1月14日	14.85	81,200	1,205,820.00
264	603225	新凤鸣	2022年1月7日-2022年1月14日	14.85	81,200	1,205,820.00
265	300072	三聚环	2022年1月7日-2022年	7.93	150,500	1,193,465

		保	1月14日			.00
266	002174	游族网络	2022年1月7日-2022年1月14日	15.24	77,700	1,184,148.00
267	000540	中天金融	2022年1月7日-2022年1月14日	2.64	448,000	1,182,720.00
268	002670	国盛金控	2022年1月7日-2022年1月14日	9.60	123,200	1,182,720.00
269	600985	淮北矿业	2022年1月7日-2022年1月14日	11.18	105,700	1,181,726.00
270	002368	太极股份	2022年1月7日-2022年1月14日	27.54	42,800	1,178,712.00
271	002595	豪迈科技	2022年1月7日-2022年1月14日	27.76	42,400	1,177,024.00
272	688029	南微医学	2022年1月7日-2022年1月14日	212.67	5,500	1,169,685.00
273	002396	星网锐捷	2022年1月7日-2022年1月14日	23.57	49,600	1,169,072.00
274	600528	中铁工业	2022年1月7日-2022年1月14日	8.21	141,400	1,160,894.00
275	688188	柏楚电子	2022年1月7日-2022年1月14日	385.46	3,000	1,156,380.00
276	000581	威孚高科	2022年1月7日-2022年1月14日	21.54	53,500	1,152,390.00
277	600297	广汇汽车	2022年1月7日-2022年1月14日	2.67	430,500	1,149,435.00
278	603866	桃李面包	2022年1月7日-2022年1月14日	28.40	40,400	1,147,360.00
279	002048	宁波华翔	2022年1月7日-2022年1月14日	21.63	53,000	1,146,390.00
280	600409	三友化工	2022年1月7日-2022年1月14日	8.70	131,600	1,144,920.00
281	002958	青农商行	2022年1月7日-2022年1月14日	3.86	296,100	1,142,946.00
282	603638	艾迪精密	2022年1月7日	31.92	35,700	1,139,544.00
283	601717	郑煤机	2022年1月7日-2022年1月14日	11.59	98,000	1,135,820.00
284	600755	厦门国贸	2022年1月7日-2022年1月14日	7.21	157,500	1,135,575.00
285	002010	传化智联	2022年1月7日-2022年1月14日	8.70	130,200	1,132,740.00
286	600567	山鹰国际	2022年1月7日-2022年1月14日	3.29	343,700	1,130,773.00
287	600827	百联股	2022年1月7日-2022年	13.33	84,700	1,129,051.00

		份	1月14日			.00
288	002925	盈趣科技	2022年1月7日-2022年1月14日	34.03	33,000	1,122,990.00
289	600060	海信视像	2022年1月7日-2022年1月14日	13.45	83,300	1,120,385.00
290	300271	华宇软件	2022年1月7日-2022年1月14日	12.70	87,500	1,111,250.00
291	000709	河钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	2.46	451,500	1,110,690.00
292	603885	吉祥航空	2022年1月7日-2022年1月14日	17.75	62,400	1,107,600.00
293	000778	新兴铸管	2022年1月7日-2022年1月14日	4.33	255,500	1,106,315.00
294	600131	国网信通	2022年1月7日-2022年1月14日	21.85	50,500	1,103,425.00
295	002183	怡亚通	2022年1月7日-2022年1月14日	6.62	165,200	1,093,624.00
296	600598	北大荒	2022年1月7日-2022年1月14日	14.56	74,900	1,090,544.00
297	002075	沙钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	5.83	186,900	1,089,627.00
298	000883	湖北能源	2022年1月7日-2022年1月14日	5.24	207,900	1,089,396.00
299	600967	内蒙一机	2022年1月7日-2022年1月14日	11.95	90,300	1,079,085.00
300	002690	美亚光电	2022年1月7日-2022年1月14日	37.46	28,800	1,078,848.00
301	600325	华发股份	2022年1月7日-2022年1月14日	6.02	179,200	1,078,784.00
302	600820	隧道股份	2022年1月7日-2022年1月14日	5.38	200,200	1,077,076.00
303	600507	方大特钢	2022年1月7日-2022年1月14日	7.80	137,900	1,075,620.00
304	600737	中粮糖业	2022年1月7日-2022年1月14日	9.40	114,100	1,072,540.00
305	600782	新钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	5.28	203,000	1,071,840.00
306	600566	济川药业	2022年1月7日-2022年1月14日	28.34	37,800	1,071,252.00
307	600021	上海电力	2022年1月7日-2022年1月14日	12.82	83,300	1,067,906.00
308	603883	老百姓	2022年1月7日	49.38	21,600	1,066,608.00
309	601456	国联证	2022年1月7日-2022年	13.97	76,300	1,065,911.00

		券	1月14日			.00
310	000990	诚志股份	2022年1月7日-2022年1月14日	15.82	66,000	1,044,120.00
311	600022	山东钢铁	2022年1月7日-2022年1月14日	1.79	583,100	1,043,749.00
312	002281	光迅科技	2022年1月7日-2022年1月14日	23.29	44,800	1,043,392.00
313	002434	万里扬	2022年1月7日-2022年1月14日	14.74	70,700	1,042,118.00
314	601880	辽港股份	2022年1月7日-2022年1月14日	1.73	602,000	1,041,460.00
315	600707	彩虹股份	2022年1月7日-2022年1月14日	6.82	152,600	1,040,732.00
316	000987	越秀金控	2022年1月7日-2022年1月14日	8.70	118,300	1,029,210.00
317	600663	陆家嘴	2022年1月7日-2022年1月14日	10.86	93,800	1,018,668.00
318	601106	中国一重	2022年1月7日-2022年1月14日	3.48	292,600	1,018,248.00
319	600435	北方导航	2022年1月7日-2022年1月14日	10.68	95,200	1,016,736.00
320	002146	荣盛发展	2022年1月7日-2022年1月14日	4.35	231,700	1,007,895.00
321	601577	长沙银行	2022年1月7日-2022年1月14日	7.81	128,800	1,005,928.00
322	002124	天邦股份	2022年1月7日-2022年1月14日	6.44	156,100	1,005,284.00
323	600446	金证股份	2022年1月7日-2022年1月14日	14.32	70,000	1,002,400.00
324	600572	康恩贝	2022年1月7日-2022年1月14日	5.00	199,500	997,500.00
325	002390	信邦制药	2022年1月7日-2022年1月14日	7.42	129,500	960,890.00
326	000898	鞍钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	3.75	255,500	958,125.00
327	601118	海南橡胶	2022年1月7日-2022年1月14日	5.28	181,300	957,264.00
328	600329	中新药业	2022年1月7日-2022年1月14日	31.41	30,300	951,723.00
329	600811	东方集团	2022年1月7日-2022年1月14日	3.01	315,700	950,257.00
330	000877	天山股份	2022年1月7日-2022年1月14日	15.31	61,800	946,158.00
331	600259	广晟有	2022年1月7日	49.24	19,200	945,408.00

		色				0
332	000488	晨鸣纸业	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	7.24	130,200	942,648.00
333	600597	光明乳业	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	14.52	64,800	940,896.00
334	600808	马钢股份	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	3.69	254,800	940,212.00
335	002440	闰土股份	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	9.59	98,000	939,820.00
336	603228	景旺电子	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	34.53	27,200	939,216.00
337	002233	塔牌集团	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	10.58	88,200	933,156.00
338	002429	兆驰股份	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	4.86	191,800	932,148.00
339	002155	湖南黄金	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	10.36	89,600	928,256.00
340	688088	虹软科技	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	44.06	21,000	925,260.00
341	300166	东方国信	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	10.80	85,400	922,320.00
342	001914	招商积余	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	20.26	44,800	907,648.00
343	688321	微芯生物	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	35.01	25,900	906,759.00
344	002416	爱施德	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	11.38	79,100	900,158.00
345	600037	歌华有线	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	8.68	103,600	899,248.00
346	002085	万丰奥威	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	5.49	163,100	895,419.00
347	000559	万向钱潮	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	6.37	140,000	891,800.00
348	600373	中文传媒	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	12.36	72,100	891,156.00
349	002110	三钢闽光	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	6.80	130,200	885,360.00
350	600398	海澜之家	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	6.41	137,200	879,452.00
351	600026	中远海能	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	5.92	147,700	874,384.00
352	600167	联美控股	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	9.01	96,600	870,366.00
353	002705	新宝股	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	24.70	35,100	866,970.00

		份	1月14日			0
354	601000	唐山港	2022年1月7日-2022年 1月14日	2.75	315,000	866,250.0 0
355	002081	金螳螂	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.08	142,100	863,968.0 0
356	600064	南京高科	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.34	92,400	863,016.0 0
357	600546	山煤国际	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.21	105,000	862,050.0 0
358	601991	大唐发电	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.24	264,600	857,304.0 0
359	000528	柳工	2022年1月7日-2022年 01月28日	7.71	109,900	847,329.0 0
360	600195	中牧股份	2022年1月7日-2022年 1月14日	13.07	64,800	846,936.0 0
361	603000	人民网	2022年1月7日-2022年 1月14日	14.42	58,500	843,570.0 0
362	000961	中南建设	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.14	203,700	843,318.0 0
363	601611	中国核建	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.97	84,000	837,480.0 0
364	601718	际华集团	2022年1月7日-2022年 1月14日	2.98	280,700	836,486.0 0
365	000685	中山公用	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.85	94,500	836,325.0 0
366	601608	中信重工	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.46	185,500	827,330.0 0
367	002038	双鹭药业	2022年1月7日-2022年 1月14日	10.81	76,300	824,803.0 0
368	000158	常山北明	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.92	118,300	818,636.0 0
369	002387	维信诺	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.28	88,200	818,496.0 0
370	600120	浙江东方	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.42	184,800	816,816.0 0
371	300133	华策影视	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.77	120,400	815,108.0 0
372	000959	首钢股份	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.73	142,100	814,233.0 0
373	000090	天健集团	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.87	138,600	813,582.0 0
374	601333	广深铁路	2022年1月7日-2022年 1月14日	2.24	362,600	812,224.0 0
375	000758	中色股	2022年1月7日-2022年	5.46	147,000	802,620.0

		份	1月14日			0
376	000089	深圳机场	2022年1月7日-2022年1月14日	7.32	109,200	799,344.00
377	000671	阳光城	2022年1月7日-2022年1月14日	3.02	263,900	796,978.00
378	600376	首开股份	2022年1月7日-2022年1月14日	5.66	137,200	776,552.00
379	600582	天地科技	2022年1月7日-2022年1月14日	4.38	176,400	772,632.00
380	000415	渤海租赁	2022年1月7日-2022年1月14日	2.91	264,600	769,986.00
381	000718	苏宁环球	2022年1月7日-2022年1月14日	4.71	160,300	755,013.00
382	601598	中国外运	2022年1月7日-2022年1月14日	4.48	168,000	752,640.00
383	002242	九阳股份	2022年1月7日-2022年1月14日	23.20	32,400	751,680.00
384	688289	圣湘生物	2022年1月7日-2022年1月14日	59.00	12,600	743,400.00
385	600062	华润双鹤	2022年1月7日-2022年1月14日	13.37	55,500	742,035.00
386	000967	盈峰环境	2022年1月7日-2022年1月14日	7.33	100,800	738,864.00
387	601975	招商南油	2022年1月7日-2022年1月14日	2.01	366,800	737,268.00
388	600126	杭钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	5.13	143,500	736,155.00
389	600307	酒钢宏兴	2022年1月7日-2022年1月14日	2.20	332,500	731,500.00
390	601098	中南传媒	2022年1月7日-2022年1月14日	9.57	76,300	730,191.00
391	002458	益生股份	2022年1月7日-2022年1月14日	11.31	63,600	719,316.00
392	000402	金融街	2022年1月7日-2022年1月14日	5.66	126,700	717,122.00
393	002683	广东宏大	2022年1月4日	30.12	23,800	716,856.00
394	601958	金钼股份	2022年1月7日-2022年1月14日	6.85	102,900	704,865.00
395	600959	江苏有线	2022年1月7日-2022年1月14日	3.29	213,500	702,415.00
396	600643	爱建集团	2022年1月7日-2022年1月14日	6.76	102,900	695,604.00
397	002399	海普瑞	2022年1月7日-2022年	17.10	40,000	684,000.00

			1月14日			0
398	000563	陕国投 A	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.23	210,000	678,300.0 0
399	600056	中国医 药	2022年1月7日-2022年 1月14日	11.81	57,000	673,170.0 0
400	003035	南网能 源	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.29	80,500	667,345.0 0
401	300257	开山股 份	2022年1月7日-2022年 1月14日	15.88	42,000	666,960.0 0
402	002563	森马服 饰	2022年1月7日-2022年 1月14日	7.73	86,100	665,553.0 0
403	601928	凤凰传 媒	2022年1月7日-2022年 1月14日	8.09	81,200	656,908.0 0
404	601860	紫金银 行	2022年1月7日-2022年 1月14日	3.35	193,900	649,565.0 0
405	600266	城建发 展	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.50	144,200	648,900.0 0
406	600717	天津港	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.19	154,000	645,260.0 0
407	600901	江苏租 赁	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.09	126,700	644,903.0 0
408	600968	海油发 展	2022年1月7日-2022年 1月14日	2.93	217,000	635,810.0 0
409	000937	冀中能 源	2022年1月7日-2022年 1月14日	5.51	112,700	620,977.0 0
410	002244	滨江集 团	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.66	132,300	616,518.0 0
411	000717	韶钢松 山	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.75	129,500	615,125.0 0
412	600928	西安银 行	2022年1月7日-2022年 1月14日	4.30	142,100	611,030.0 0
413	002468	申通快 递	2022年1月7日-2022年 1月14日	9.09	64,800	589,032.0 0
414	000028	国药一 致	2022年1月7日	36.98	15,900	587,982.0 0
415	600776	东方通 信	2022年1月7日-2022年 1月14日	11.51	50,500	581,255.0 0
416	600787	中储股 份	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.24	93,100	580,944.0 0
417	600006	东风汽 车	2022年1月7日-2022年 1月14日	6.81	84,700	576,807.0 0
418	002424	贵州百 灵	2022年1月7日-2022年 1月14日	7.60	75,600	574,560.0 0
419	000062	深圳华	2022年1月7日-2022年	17.23	33,300	573,759.0

		强	1月14日			0
420	600729	重庆百货	2022年1月7日	26.02	21,600	562,032.00
421	600649	城投控股	2022年1月7日-2022年1月14日	4.11	135,100	555,261.00
422	600623	华谊集团	2022年1月7日-2022年1月14日	9.10	60,600	551,460.00
423	600339	中油工程	2022年1月7日-2022年1月14日	3.08	177,800	547,624.00
424	600835	上海机电	2022年1月7日-2022年1月14日	15.92	34,200	544,464.00
425	601139	深圳燃气	2022年1月7日-2022年1月14日	8.83	61,200	540,396.00
426	002375	亚厦股份	2022年1月7日-2022年1月14日	7.49	71,400	534,786.00
427	600299	安迪苏	2022年1月7日-2022年1月14日	12.32	42,800	527,296.00
428	600648	外高桥	2022年1月7日-2022年1月14日	13.23	39,600	523,908.00
429	601969	海南矿业	2022年1月7日-2022年1月14日	12.01	42,800	514,028.00
430	300869	康泰医学	2022年1月7日-2022年1月14日	40.55	12,600	510,930.00
431	000031	大悦城	2022年1月7日-2022年1月14日	3.73	136,500	509,145.00
432	000156	华数传媒	2022年1月7日-2022年1月14日	8.46	58,500	494,910.00
433	600639	浦东金桥	2022年1月7日-2022年1月14日	12.77	36,300	463,551.00
434	600871	石化油服	2022年1月7日-2022年1月14日	2.14	216,300	462,882.00
435	002653	海思科	2022年1月7日-2022年1月14日	20.40	22,600	461,040.00
436	000869	张裕A	2022年1月14日	31.86	14,400	458,784.00
437	600377	宁沪高速	2022年1月7日-2022年1月14日	8.62	52,500	452,550.00
438	603379	三美股份	2022年1月7日	22.78	19,400	441,932.00
439	601828	美凯龙	2022年1月7日-2022年1月14日	8.81	50,000	440,500.00
440	601228	广州港	2022年1月7日-2022年1月14日	3.33	131,600	438,228.00
441	601298	青岛港	2022年1月7日-2022年	5.69	74,900	426,181.00

			1月14日			0
442	603708	家家悦	2022年1月7日	16.64	25,600	425,984.00
443	002302	西部建设	2022年1月7日-2022年1月14日	8.03	53,000	425,590.00
444	601869	长飞光纤	2022年1月7日	32.74	12,800	419,072.00
445	000046	泛海控股	2022年1月7日-2022年1月14日	1.88	220,500	414,540.00
446	001872	招商港口	2022年1月7日-2022年1月14日	16.95	23,800	403,410.00
447	600823	世茂股份	2022年1月7日-2022年1月14日	3.28	119,700	392,616.00
448	603355	莱克电气	2022年1月7日	29.32	12,200	357,704.00
449	600657	信达地产	2022年1月7日-2022年1月14日	3.73	91,700	342,041.00
450	600350	山东高速	2022年1月7日-2022年1月14日	5.16	66,000	340,560.00
451	600466	蓝光发展	2022年1月7日-2022年1月14日	2.04	161,700	329,868.00
452	603515	欧普照明	2022年1月7日	20.76	15,800	328,008.00
453	601003	柳钢股份	2022年1月7日-2022年1月14日	5.22	55,000	287,100.00
454	600917	重庆燃气	2022年1月7日-2022年1月14日	8.39	33,600	281,904.00
455	600903	贵州燃气	2022年1月7日	9.68	24,200	234,256.00
合计	-	-	-	-	67,507,700	696,367,661.00

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金

的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 Risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、Risk 管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	248,000.00	87,200.00
未评级	-	-
合计	248,000.00	87,200.00

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注

7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,855,551.78	-	-	-	16,855,551.78
结算备付金	32,975,602.17	-	-	-	32,975,602.17
存出保证金	254,879.06	-	-	12,273,744.00	12,528,623.06
交易性金融资产	-	-	248,000.00	3,600,651,564.62	3,600,899,564.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	31,000,000.00	-	-	-	31,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	4,722,652.91	4,722,652.91
应收利息	-	-	-	167,434.88	167,434.88
应收股利	-	-	-	1,680.00	1,680.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	81,086,033.01	-	248,000.00	3,617,817,076.41	3,699,151,109.42
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	6,316,479.15	6,316,479.15
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	421,187.25	421,187.25
应付托管费	-	-	-	140,395.77	140,395.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	897,188.81	897,188.81
应付税费	-	-	-	12,728.57	12,728.57
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	455,271.58	455,271.58
负债总计	-	-	-	8,243,251.13	8,243,251.13
利率敏感度缺口	81,086,033.01	-	248,000.00	3,609,573,825.28	3,690,907,858.29
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,218,332.37	-	-	-	18,218,332.37
结算备付金	22,036,574.87	-	-	-	22,036,574.87
存出保证金	687,912.44	-	-	10,252,032.00	10,939,944.44
交易性金融资产	-	-	87,200.00	3,601,461,953.64	3,601,549,153.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	54,000,000.00	-	-	-	54,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	112,011,486.57	112,011,486.57
应收利息	-	-	-	197,314.19	197,314.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	94,942,819.68	-	87,200.00	3,723,922,786.40	3,818,952,806.08
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	138,483,256.52	138,483,256.52
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	439,077.34	439,077.34

应付托管费	-	-	-	146,359.10	146,359.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,169,741.86	1,169,741.86
应付税费	-	-	-	412,923.24	412,923.24
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	439,088.96	439,088.96
负债总计	-	-	-	141,090,447.02	141,090,447.02
利率敏感度缺口	94,942,819.68	-	-	87,200.00	3,582,832,339.38
					3,677,862,359.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-3,494.75	-1,237.13
	市场利率下降 25 个基点	3,553.82	1,258.18

7.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）

			31 日)
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	3,600,651,564.62	97.55	3,601,461,953.64	97.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	3,600,651,564.62	97.55	3,601,461,953.64	97.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	184,238,016.06	182,815,340.60
	业绩比较基准下降 5%	-184,238,016.06	-182,815,340.60

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,592,785,780.60 元，属于第二层次的余额为 8,113,784.02 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 3,594,514,417.13 元，第二层次 7,034,736.51 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：

无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,600,651,564.62	97.34
	其中：股票	3,600,651,564.62	97.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	248,000.00	0.01
	其中：债券	248,000.00	0.01
	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	31,000,000.00	0.84
	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	49,831,153.95	1.35
8	其他各项资产	17,420,390.85	0.47
9	合计	3,699,151,109.42	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. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 696,367,661.00 元，占基金资产净值的比例为 18.87%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	40,026,675.85	1.08

B	采矿业	117,070,476.41	3.17
C	制造业	2,178,999,801.49	59.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,730,488.66	3.65
E	建筑业	68,342,607.88	1.85
F	批发和零售业	110,877,352.64	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	84,520,196.81	2.29
H	住宿和餐饮业	21,221,926.60	0.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	308,247,073.04	8.35
J	金融业	258,620,993.83	7.01
K	房地产业	93,287,788.51	2.53
L	租赁和商务服务业	44,022,183.89	1.19
M	科学研究和技术服务业	12,693,323.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	30,824,092.96	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,467,411.51	0.20
R	文化、体育和娱乐业	46,533,918.08	1.26
S	综合	41,317,590.03	1.12
	合计	3,598,803,901.19	97.50

8.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,124,208.98	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	33,086.34	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	427,360.06	0.01
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	141,486.70	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	44,659.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,844,694.29	0.05

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002340	格林美	2,450,606	25,363,772.10	0.69
2	600522	中天科技	1,362,900	23,114,784.00	0.63
3	000733	振华科技	184,600	22,942,088.00	0.62
4	000723	美锦能源	1,312,461	21,301,242.03	0.58
5	601615	明阳智能	801,800	20,926,980.00	0.57
6	600157	永泰能源	11,381,700	20,714,694.00	0.56
7	600399	抚顺特钢	808,300	20,021,591.00	0.54
8	600885	宏发股份	267,164	19,941,120.96	0.54
9	600884	杉杉股份	593,424	19,446,504.48	0.53
10	000009	中国宝安	1,321,217	19,065,161.31	0.52
11	002384	东山精密	700,800	18,991,680.00	0.51
12	601117	中国化学	1,564,900	18,778,800.00	0.51
13	601555	东吴证券	2,067,370	18,316,898.20	0.50
14	002013	中航机电	995,073	18,090,427.14	0.49
15	002385	大北农	1,697,348	17,805,180.52	0.48
16	300285	国瓷材料	411,236	17,506,316.52	0.47
17	002180	纳思达	361,400	17,260,464.00	0.47
18	002268	卫士通	303,355	16,969,678.70	0.46
19	300751	迈为股份	26,300	16,892,490.00	0.46
20	605358	立昂微	140,400	16,849,404.00	0.46

21	300088	长信科技	1,257,700	16,702,256.00	0.45
22	300037	新宙邦	147,100	16,622,300.00	0.45
23	688099	晶晨股份	126,111	16,419,652.20	0.44
24	600765	中航重机	323,207	16,318,721.43	0.44
25	600563	法拉电子	69,131	16,066,044.40	0.44
26	688005	容百科技	137,508	15,893,174.64	0.43
27	600298	安琪酵母	256,000	15,452,160.00	0.42
28	600256	广汇能源	2,354,300	15,397,122.00	0.42
29	002028	思源电气	312,685	15,387,228.85	0.42
30	600862	中航高科	428,100	15,308,856.00	0.41
31	600141	兴发集团	398,541	15,096,733.08	0.41
32	300363	博腾股份	167,100	14,947,095.00	0.40
33	300253	卫宁健康	878,010	14,715,447.60	0.40
34	600487	亨通光电	968,000	14,636,160.00	0.40
35	002185	华天科技	1,149,200	14,606,332.00	0.40
36	603456	九洲药业	256,000	14,402,560.00	0.39
37	000988	华工科技	514,922	14,345,726.92	0.39
38	601636	旗滨集团	825,500	14,116,050.00	0.38
39	600392	盛和资源	719,170	14,110,115.40	0.38
40	600754	锦江酒店	234,103	13,718,435.80	0.37
41	300058	蓝色光标	1,276,000	13,691,480.00	0.37
42	600418	江淮汽车	783,186	13,627,436.40	0.37
43	300699	光威复材	159,100	13,440,768.00	0.36
44	601168	西部矿业	976,542	13,290,736.62	0.36
45	603613	国联股份	123,300	13,254,750.00	0.36
46	300223	北京君正	98,700	13,225,800.00	0.36
47	000630	铜陵有色	3,774,900	13,136,652.00	0.36
48	603589	口子窖	184,374	13,066,585.38	0.35
49	603267	鸿远电子	71,400	12,812,016.00	0.35
50	600516	方大炭素	1,169,700	12,656,154.00	0.34
51	002138	顺络电子	330,429	12,615,779.22	0.34
52	002797	第一创业	1,722,100	12,605,772.00	0.34
53	688536	思瑞浦	16,369	12,571,392.00	0.34
54	000998	隆平高科	539,697	12,553,352.22	0.34
55	300136	信维通信	495,500	12,546,060.00	0.34
56	600486	扬农化工	95,230	12,494,176.00	0.34
57	300724	捷佳伟创	106,900	12,218,670.00	0.33
58	601077	渝农商行	3,171,200	12,209,120.00	0.33
59	600875	东方电气	569,500	12,198,690.00	0.33
60	300308	中际旭创	286,741	12,186,492.50	0.33
61	600038	中直股份	151,061	12,130,198.30	0.33
62	000728	国元证券	1,564,900	12,049,730.00	0.33

63	601689	拓普集团	225,765	11,965,545.00	0.32
64	002409	雅克科技	146,300	11,875,171.00	0.32
65	688065	凯赛生物	63,945	11,783,784.60	0.32
66	002353	杰瑞股份	294,351	11,774,040.00	0.32
67	300146	汤臣倍健	435,421	11,738,950.16	0.32
68	600233	圆通速递	703,700	11,737,716.00	0.32
69	300474	景嘉微	77,098	11,734,315.60	0.32
70	300763	锦浪科技	50,600	11,716,430.00	0.32
71	002080	中材科技	343,850	11,697,777.00	0.32
72	603893	瑞芯微	85,350	11,684,415.00	0.32
73	002223	鱼跃医疗	308,060	11,644,668.00	0.32
74	002212	天融信	607,268	11,641,327.56	0.32
75	000519	中兵红箭	427,999	11,414,733.33	0.31
76	300418	昆仑万维	490,642	11,358,362.30	0.31
77	002673	西部证券	1,373,600	11,084,952.00	0.30
78	600733	北汽蓝谷	1,098,100	11,002,962.00	0.30
79	000547	航天发展	657,200	10,975,240.00	0.30
80	688208	道通科技	138,004	10,957,517.60	0.30
81	000636	风华高科	366,977	10,935,914.60	0.30
82	002439	启明星辰	382,400	10,909,872.00	0.30
83	600482	中国动力	553,400	10,901,980.00	0.30
84	600705	中航产融	2,741,700	10,884,549.00	0.29
85	000932	华菱钢铁	2,123,520	10,851,187.20	0.29
86	603077	和邦生物	3,166,748	10,798,610.68	0.29
87	000039	中集集团	628,978	10,793,262.48	0.29
88	600699	均胜电子	490,640	10,779,360.80	0.29
89	600188	兖矿能源	457,100	10,755,563.00	0.29
90	688002	睿创微纳	136,554	10,729,047.78	0.29
91	002444	巨星科技	351,484	10,723,776.84	0.29
92	603605	珀莱雅	51,408	10,708,800.48	0.29
93	600739	辽宁成大	548,500	10,706,720.00	0.29
94	600529	山东药玻	243,885	10,706,551.50	0.29
95	300296	利亚德	1,041,900	10,679,475.00	0.29
96	000739	普洛药业	301,805	10,590,337.45	0.29
97	002507	涪陵榨菜	272,931	10,316,791.80	0.28
98	002465	海格通信	944,300	10,311,756.00	0.28
99	000738	航发控制	336,800	10,198,304.00	0.28
100	600988	赤峰黄金	681,900	10,160,310.00	0.28
101	002030	达安基因	503,110	10,092,386.60	0.27
102	601016	节能风电	1,540,873	10,031,083.23	0.27
103	000960	锡业股份	512,793	10,014,847.29	0.27
104	603290	斯达半导	26,100	9,944,100.00	0.27

105	600521	华海药业	458,500	9,931,110.00	0.27
106	000807	云铝股份	888,367	9,923,059.39	0.27
107	600637	东方明珠	1,049,300	9,915,885.00	0.27
108	002273	水晶光电	569,890	9,910,387.10	0.27
109	600549	厦门钨业	435,980	9,866,227.40	0.27
110	600177	雅戈尔	1,422,800	9,803,092.00	0.27
111	688521	芯原股份	126,580	9,792,228.80	0.27
112	600732	爱旭股份	417,200	9,745,792.00	0.26
113	601198	东兴证券	827,800	9,627,314.00	0.26
114	002557	洽洽食品	155,894	9,565,655.84	0.26
115	002078	太阳纸业	825,707	9,487,373.43	0.26
116	603127	昭衍新药	82,100	9,476,803.00	0.26
117	600704	物产中大	1,596,900	9,453,648.00	0.26
118	002985	北摩高科	78,440	9,448,882.40	0.26
119	600201	生物股份	576,961	9,433,312.35	0.26
120	300383	光环新网	632,300	9,383,332.00	0.25
121	601128	常熟银行	1,403,993	9,280,393.73	0.25
122	603444	吉比特	21,979	9,271,841.15	0.25
123	600642	申能股份	1,258,000	9,271,460.00	0.25
124	002156	通富微电	476,690	9,262,086.70	0.25
125	002299	圣农发展	382,257	9,239,151.69	0.25
126	300357	我武生物	161,052	9,228,279.60	0.25
127	600879	航天电子	1,114,384	9,182,524.16	0.25
128	600497	驰宏锌锗	1,825,600	9,109,744.00	0.25
129	600369	西南证券	1,701,900	9,003,051.00	0.24
130	600027	华电国际	1,670,600	8,937,710.00	0.24
131	000830	鲁西化工	585,383	8,932,944.58	0.24
132	600160	巨化股份	691,527	8,927,613.57	0.24
133	300618	寒锐钴业	110,940	8,895,169.20	0.24
134	002739	万达电影	571,400	8,845,272.00	0.24
135	600372	中航电子	394,980	8,843,602.20	0.24
136	600039	四川路桥	733,784	8,834,759.36	0.24
137	002092	中泰化学	923,742	8,812,498.68	0.24
138	000623	吉林敖东	476,688	8,804,427.36	0.24
139	002508	老板电器	243,100	8,756,462.00	0.24
140	000983	山西焦煤	1,049,070	8,675,808.90	0.24
141	600580	卧龙电驱	471,719	8,627,740.51	0.23
142	600316	洪都航空	220,400	8,608,824.00	0.23
143	000629	攀钢钒钛	2,198,950	8,553,915.50	0.23
144	300115	长盈精密	430,644	8,543,976.96	0.23
145	603198	迎驾贡酒	122,970	8,540,266.50	0.23
146	601997	贵阳银行	1,311,000	8,534,610.00	0.23

147	002249	大洋电机	969,384	8,520,885.36	0.23
148	002131	利欧股份	3,460,179	8,512,040.34	0.23
149	002373	千方科技	566,872	8,474,736.40	0.23
150	300017	网宿科技	1,253,800	8,387,922.00	0.23
151	002603	以岭药业	427,828	8,385,428.80	0.23
152	002936	郑州银行	2,634,678	8,325,582.48	0.23
153	002422	科伦药业	438,100	8,293,233.00	0.22
154	600118	中国卫星	302,788	8,220,694.20	0.22
155	000825	太钢不锈	1,167,072	8,216,186.88	0.22
156	600170	上海建工	2,280,700	8,210,520.00	0.22
157	000050	深天马 A	629,384	8,194,579.68	0.22
158	000887	中鼎股份	375,300	8,185,293.00	0.22
159	603218	日月股份	247,820	8,165,669.00	0.22
160	600166	福田汽车	2,358,000	8,111,520.00	0.22
161	000400	许继电气	309,795	8,085,649.50	0.22
162	300070	碧水源	1,117,138	8,032,222.22	0.22
163	600803	新奥股份	437,300	8,028,828.00	0.22
164	000750	国海证券	1,952,291	8,023,916.01	0.22
165	600867	通化东宝	729,200	7,992,032.00	0.22
166	600153	建发股份	880,100	7,982,507.00	0.22
167	002506	协鑫集成	2,099,800	7,979,240.00	0.22
168	002191	劲嘉股份	527,319	7,978,336.47	0.22
169	300001	特锐德	319,826	7,954,072.62	0.22
170	002926	华西证券	806,900	7,947,965.00	0.22
171	002372	伟星新材	326,223	7,933,743.36	0.21
172	300168	万达信息	608,227	7,919,115.54	0.21
173	000027	深圳能源	974,784	7,895,750.40	0.21
174	002056	横店东磁	416,516	7,859,656.92	0.21
175	603707	健友股份	186,930	7,851,060.00	0.21
176	002266	浙富控股	1,100,315	7,834,242.80	0.21
177	600859	王府井	290,100	7,832,700.00	0.21
178	600909	华安证券	1,443,870	7,811,336.70	0.21
179	600236	桂冠电力	1,211,400	7,777,188.00	0.21
180	002002	鸿达兴业	1,277,872	7,743,904.32	0.21
181	300251	光线传媒	601,200	7,725,420.00	0.21
182	600008	首创环保	2,256,130	7,693,403.30	0.21
183	300009	安科生物	587,594	7,691,605.46	0.21
184	002065	东华软件	985,200	7,684,560.00	0.21
185	000513	丽珠集团	191,035	7,681,517.35	0.21
186	600066	宇通客车	695,600	7,665,512.00	0.21
187	000997	新大陆	422,874	7,662,476.88	0.21
188	600271	航天信息	569,500	7,625,605.00	0.21

189	000021	深科技	479,741	7,599,097.44	0.21
190	600536	中国软件	152,100	7,594,353.00	0.21
191	002152	广电运通	636,000	7,568,400.00	0.21
192	002408	齐翔腾达	719,263	7,552,261.50	0.20
193	002203	海亮股份	604,294	7,511,374.42	0.20
194	600258	首旅酒店	287,160	7,503,490.80	0.20
195	600171	上海贝岭	292,075	7,494,644.50	0.20
196	000975	银泰黄金	853,322	7,492,167.16	0.20
197	300244	迪安诊断	222,443	7,467,411.51	0.20
198	002221	东华能源	591,355	7,445,159.45	0.20
199	300630	普利制药	134,322	7,393,082.88	0.20
200	600535	天士力	465,000	7,370,250.00	0.20
201	603156	养元饮品	259,400	7,369,554.00	0.20
202	000656	金科股份	1,641,200	7,352,576.00	0.20
203	600348	华阳股份	615,900	7,298,415.00	0.20
204	002500	山西证券	1,103,314	7,281,872.40	0.20
205	002572	索菲亚	327,164	7,263,040.80	0.20
206	300212	易华录	204,659	7,234,695.65	0.20
207	300026	红日药业	923,500	7,231,005.00	0.20
208	601005	重庆钢铁	3,434,600	7,178,314.00	0.19
209	300024	机器人	639,373	7,141,796.41	0.19
210	600998	九州通	480,000	7,065,600.00	0.19
211	603568	伟明环保	193,059	7,052,445.27	0.19
212	600315	上海家化	173,977	7,030,410.57	0.19
213	000012	南玻 A	703,392	6,984,682.56	0.19
214	000878	云南铜业	522,300	6,983,151.00	0.19
215	000970	中科三环	433,958	6,965,025.90	0.19
216	002127	南极电商	1,006,100	6,942,090.00	0.19
217	601699	潞安环能	612,800	6,930,768.00	0.19
218	002745	木林森	456,236	6,902,850.68	0.19
219	000537	广宇发展	286,200	6,897,420.00	0.19
220	000999	华润三九	200,541	6,866,523.84	0.19
221	300315	掌趣科技	1,412,559	6,865,036.74	0.19
222	002195	二三四五	2,932,578	6,862,232.52	0.19
223	600673	东阳光	771,994	6,855,306.72	0.19
224	603712	七一二	158,300	6,854,390.00	0.19
225	600415	小商品城	1,406,400	6,821,040.00	0.18
226	601872	招商轮船	1,661,400	6,811,740.00	0.18
227	002250	联化科技	378,450	6,800,746.50	0.18
228	600801	华新水泥	348,825	6,732,322.50	0.18
229	002511	中顺洁柔	402,483	6,725,490.93	0.18
230	002019	亿帆医药	379,400	6,685,028.00	0.18

231	300182	捷成股份	1,055,100	6,678,783.00	0.18
232	300463	迈克生物	228,014	6,655,728.66	0.18
233	688006	杭可科技	61,859	6,654,791.22	0.18
234	002153	石基信息	230,400	6,621,696.00	0.18
235	601866	中远海发	2,030,600	6,599,450.00	0.18
236	000690	宝新能源	1,114,654	6,598,751.68	0.18
237	600863	内蒙华电	1,671,800	6,586,892.00	0.18
238	600208	新湖中宝	2,202,600	6,563,748.00	0.18
239	600970	中材国际	568,377	6,496,549.11	0.18
240	000060	中金岭南	1,308,771	6,426,065.61	0.17
241	002831	裕同科技	190,659	6,423,301.71	0.17
242	600517	国网英大	878,800	6,406,452.00	0.17
243	601778	晶科科技	741,200	6,322,436.00	0.17
244	000686	东北证券	719,216	6,314,716.48	0.17
245	300482	万孚生物	159,638	6,286,544.44	0.17
246	600380	健康元	488,123	6,267,499.32	0.17
247	600839	四川长虹	1,891,900	6,262,189.00	0.17
248	600498	烽火通信	347,800	6,253,444.00	0.17
249	002294	信立泰	228,400	6,239,888.00	0.17
250	002505	鹏都农牧	1,632,630	6,236,646.60	0.17
251	000930	中粮科技	573,527	6,234,238.49	0.17
252	600155	华创阳安	623,700	6,212,052.00	0.17
253	002939	长城证券	477,000	6,177,150.00	0.17
254	603858	步长制药	292,348	6,165,619.32	0.17
255	600390	五矿资本	1,151,900	6,128,108.00	0.17
256	000729	燕京啤酒	721,730	6,113,053.10	0.17
257	600667	太极实业	755,200	6,102,016.00	0.17
258	600511	国药股份	193,209	6,091,879.77	0.17
259	002701	奥瑞金	869,845	6,088,915.00	0.16
260	000401	冀东水泥	508,000	6,075,680.00	0.16
261	002683	宏大爆破	201,650	6,073,698.00	0.16
262	601992	金隅集团	2,136,100	6,066,524.00	0.16
263	600500	中化国际	708,510	6,064,845.60	0.16
264	600718	东软集团	445,500	6,040,980.00	0.16
265	600728	佳都科技	720,400	6,000,932.00	0.16
266	600895	张江高科	396,600	5,972,796.00	0.16
267	300376	易事特	592,600	5,955,630.00	0.16
268	600158	中体产业	393,084	5,943,430.08	0.16
269	688188	柏楚电子	15,392	5,933,000.32	0.16
270	002430	杭氧股份	197,600	5,929,976.00	0.16
271	600216	浙江医药	346,100	5,911,388.00	0.16
272	002382	蓝帆医疗	361,204	5,884,013.16	0.16

273	600764	中国海防	144,683	5,882,810.78	0.16
274	002004	华邦健康	811,493	5,875,209.32	0.16
275	002128	电投能源	393,637	5,845,509.45	0.16
276	600282	南钢股份	1,577,600	5,837,120.00	0.16
277	601179	中国西电	1,050,200	5,828,610.00	0.16
278	002532	天山铝业	714,700	5,824,805.00	0.16
279	603225	新凤鸣	391,716	5,816,982.60	0.16
280	688029	南微医学	27,283	5,802,275.61	0.16
281	000598	兴蓉环境	917,900	5,801,128.00	0.16
282	002966	苏州银行	853,684	5,779,440.68	0.16
283	300072	三聚环保	722,055	5,725,896.15	0.16
284	002368	太极股份	207,795	5,722,674.30	0.16
285	002174	游族网络	375,463	5,722,056.12	0.16
286	002670	国盛金控	594,888	5,710,924.80	0.15
287	002595	豪迈科技	204,885	5,687,607.60	0.15
288	000540	中天金融	2,153,025	5,683,986.00	0.15
289	600985	淮北矿业	508,200	5,681,676.00	0.15
290	002396	星网锐捷	239,029	5,633,913.53	0.15
291	600528	中铁工业	682,810	5,605,870.10	0.15
292	002048	宁波华翔	256,705	5,552,529.15	0.15
293	600297	广汇汽车	2,077,500	5,546,925.00	0.15
294	603866	桃李面包	195,118	5,541,351.20	0.15
295	000581	威孚高科	257,190	5,539,872.60	0.15
296	600409	三友化工	634,356	5,518,897.20	0.15
297	603638	艾迪精密	172,340	5,501,092.80	0.15
298	002958	青农商行	1,423,000	5,492,780.00	0.15
299	600827	百联股份	410,863	5,476,803.79	0.15
300	002010	传化智联	629,300	5,474,910.00	0.15
301	600755	厦门国贸	759,311	5,474,632.31	0.15
302	601717	郑煤机	470,771	5,456,235.89	0.15
303	002925	盈趣科技	160,320	5,455,689.60	0.15
304	600567	山鹰国际	1,655,300	5,445,937.00	0.15
305	600060	海信视像	402,067	5,407,801.15	0.15
306	300271	华宇软件	424,671	5,393,321.70	0.15
307	603885	吉祥航空	302,100	5,362,275.00	0.15
308	600131	国网信通	245,000	5,353,250.00	0.15
309	000709	河钢股份	2,175,800	5,352,468.00	0.15
310	000778	新兴铸管	1,226,675	5,311,502.75	0.14
311	600598	北大荒	364,300	5,304,208.00	0.14
312	002183	怡亚通	798,300	5,284,746.00	0.14
313	002075	沙钢股份	904,400	5,272,652.00	0.14
314	000883	湖北能源	1,000,100	5,240,524.00	0.14

315	600325	华发股份	867,577	5,222,813.54	0.14
316	600967	内蒙一机	436,432	5,215,362.40	0.14
317	600820	隧道股份	966,320	5,198,801.60	0.14
318	002690	美亚光电	138,522	5,189,034.12	0.14
319	600782	新钢股份	980,000	5,174,400.00	0.14
320	600507	方大特钢	662,673	5,168,849.40	0.14
321	603883	老百姓	104,637	5,166,975.06	0.14
322	600021	上海电力	402,200	5,156,204.00	0.14
323	600566	济川药业	181,800	5,152,212.00	0.14
324	600737	中粮糖业	547,786	5,149,188.40	0.14
325	601456	国联证券	367,200	5,129,784.00	0.14
326	600597	光明乳业	353,123	5,127,345.96	0.14
327	000990	诚志股份	320,900	5,076,638.00	0.14
328	002434	万里扬	343,242	5,059,387.08	0.14
329	600022	山东钢铁	2,803,720	5,018,658.80	0.14
330	600707	彩虹股份	735,200	5,014,064.00	0.14
331	002281	光迅科技	215,023	5,007,885.67	0.14
332	601880	辽港股份	2,893,649	5,006,012.77	0.14
333	603927	中科软	182,376	4,989,807.36	0.14
334	000987	越秀金控	571,200	4,969,440.00	0.13
335	600663	陆家嘴	450,793	4,895,611.98	0.13
336	601106	中国一重	1,405,100	4,889,748.00	0.13
337	600435	北方导航	457,810	4,889,410.80	0.13
338	002124	天邦股份	753,618	4,853,299.92	0.13
339	002146	荣盛发展	1,113,700	4,844,595.00	0.13
340	600446	金证股份	337,400	4,831,568.00	0.13
341	601577	长沙银行	617,900	4,825,799.00	0.13
342	600572	康恩贝	956,315	4,781,575.00	0.13
343	601118	海南橡胶	876,900	4,630,032.00	0.13
344	002390	信邦制药	622,968	4,622,422.56	0.13
345	603650	彤程新材	91,800	4,619,376.00	0.13
346	600329	中新药业	146,909	4,614,411.69	0.13
347	000898	鞍钢股份	1,228,500	4,606,875.00	0.12
348	688088	虹软科技	104,278	4,594,488.68	0.12
349	000877	天山股份	299,347	4,583,002.57	0.12
350	600811	东方集团	1,522,232	4,581,918.32	0.12
351	600259	广晟有色	92,811	4,570,013.64	0.12
352	000488	晨鸣纸业	627,212	4,541,014.88	0.12
353	002233	塔牌集团	427,481	4,522,748.98	0.12
354	603228	景旺电子	130,980	4,522,739.40	0.12
355	002440	闰土股份	471,540	4,522,068.60	0.12
356	600808	马钢股份	1,222,900	4,512,501.00	0.12

357	002429	兆驰股份	927,743	4,508,830.98	0.12
358	002155	湖南黄金	431,017	4,465,336.12	0.12
359	300166	东方国信	413,096	4,461,436.80	0.12
360	688321	微芯生物	125,988	4,410,839.88	0.12
361	001914	招商积余	217,234	4,401,160.84	0.12
362	601200	上海环境	344,798	4,341,006.82	0.12
363	002416	爱施德	381,041	4,336,246.58	0.12
364	600037	歌华有线	498,926	4,330,677.68	0.12
365	600908	无锡银行	762,900	4,325,643.00	0.12
366	000559	万向钱潮	676,961	4,312,241.57	0.12
367	002085	万丰奥威	784,168	4,305,082.32	0.12
368	600373	中文传媒	347,100	4,290,156.00	0.12
369	002110	三钢闽光	627,859	4,269,441.20	0.12
370	600398	海澜之家	663,800	4,254,958.00	0.12
371	600906	财达证券	332,400	4,241,424.00	0.11
372	600167	联美控股	468,850	4,224,338.50	0.11
373	600026	中远海能	710,419	4,205,680.48	0.11
374	601000	唐山港	1,517,766	4,173,856.50	0.11
375	600546	山煤国际	507,600	4,167,396.00	0.11
376	002081	金螳螂	684,293	4,160,501.44	0.11
377	600064	南京高科	443,184	4,139,338.56	0.11
378	601991	大唐发电	1,269,900	4,114,476.00	0.11
379	002705	新宝股份	166,565	4,114,155.50	0.11
380	603000	人民网	283,100	4,082,302.00	0.11
381	600195	中牧股份	312,082	4,078,911.74	0.11
382	000528	柳工	528,952	4,078,219.92	0.11
383	000961	中南建设	980,100	4,057,614.00	0.11
384	601611	中国核建	406,900	4,056,793.00	0.11
385	601718	际华集团	1,349,900	4,022,702.00	0.11
386	000685	中山公用	453,363	4,012,262.55	0.11
387	002867	周大生	224,598	3,993,352.44	0.11
388	002038	双鹭药业	368,506	3,983,549.86	0.11
389	000158	常山北明	573,245	3,966,855.40	0.11
390	601608	中信重工	889,143	3,965,577.78	0.11
391	300133	华策影视	584,400	3,956,388.00	0.11
392	002387	维信诺	424,909	3,943,155.52	0.11
393	600120	浙江东方	890,227	3,934,803.34	0.11
394	000090	天健集团	670,054	3,933,216.98	0.11
395	000959	首钢股份	684,947	3,924,746.31	0.11
396	601333	广深铁路	1,737,200	3,891,328.00	0.11
397	000758	中色股份	706,312	3,856,463.52	0.10
398	000089	深圳机场	525,191	3,844,398.12	0.10

399	000671	阳光城	1,272,500	3,842,950.00	0.10
400	600376	首开股份	660,669	3,739,386.54	0.10
401	003022	联泓新科	102,600	3,738,744.00	0.10
402	600582	天地科技	847,900	3,713,802.00	0.10
403	000415	渤海租赁	1,267,143	3,687,386.13	0.10
404	000718	苏宁环球	777,291	3,661,040.61	0.10
405	002242	九阳股份	157,218	3,647,457.60	0.10
406	688289	圣湘生物	61,642	3,636,878.00	0.10
407	601598	中国外运	807,800	3,618,944.00	0.10
408	600062	华润双鹤	267,346	3,574,416.02	0.10
409	000967	盈峰环境	486,245	3,564,175.85	0.10
410	601975	招商南油	1,772,200	3,562,122.00	0.10
411	600126	杭钢股份	692,040	3,550,165.20	0.10
412	600307	酒钢宏兴	1,604,100	3,529,020.00	0.10
413	601098	中南传媒	368,100	3,522,717.00	0.10
414	000402	金融街	612,300	3,465,618.00	0.09
415	002458	益生股份	304,742	3,446,632.02	0.09
416	600556	天下秀	277,700	3,429,595.00	0.09
417	001965	招商公路	443,100	3,398,577.00	0.09
418	601958	金钼股份	495,700	3,395,545.00	0.09
419	600959	江苏有线	1,024,770	3,371,493.30	0.09
420	600643	爱建集团	498,359	3,368,906.84	0.09
421	000563	陕国投 A	1,015,379	3,279,674.17	0.09
422	002399	海普瑞	191,652	3,277,249.20	0.09
423	600056	中国医药	273,819	3,233,802.39	0.09
424	300257	开山股份	203,515	3,231,818.20	0.09
425	003035	南网能源	388,000	3,216,520.00	0.09
426	002563	森马服饰	413,900	3,199,447.00	0.09
427	601928	凤凰传媒	391,000	3,163,190.00	0.09
428	601860	紫金银行	937,500	3,140,625.00	0.09
429	600266	城建发展	693,648	3,121,416.00	0.08
430	600901	江苏租赁	611,800	3,114,062.00	0.08
431	603317	天味食品	115,908	3,107,493.48	0.08
432	600717	天津港	741,112	3,105,259.28	0.08
433	600968	海油发展	1,041,300	3,051,009.00	0.08
434	002815	崇达技术	179,342	3,021,912.70	0.08
435	300741	华宝股份	63,000	3,014,550.00	0.08
436	000937	冀中能源	543,000	2,991,930.00	0.08
437	002244	滨江集团	637,470	2,970,610.20	0.08
438	600095	湘财股份	292,400	2,959,088.00	0.08
439	000717	韶钢松山	619,600	2,943,100.00	0.08
440	600928	西安银行	683,100	2,937,330.00	0.08

441	002423	中粮资本	354,100	2,868,210.00	0.08
442	002468	申通快递	313,600	2,850,624.00	0.08
443	000028	国药一致	76,394	2,825,050.12	0.08
444	600776	东方通信	244,900	2,818,799.00	0.08
445	600787	中储股份	450,770	2,812,804.80	0.08
446	600006	东风汽车	409,732	2,790,274.92	0.08
447	000062	深圳华强	160,821	2,770,945.83	0.08
448	002424	贵州百灵	361,528	2,747,612.80	0.07
449	600729	重庆百货	104,137	2,709,644.74	0.07
450	600649	城投控股	647,900	2,662,869.00	0.07
451	600339	中油工程	857,900	2,642,332.00	0.07
452	600623	华谊集团	290,000	2,639,000.00	0.07
453	600835	上海机电	165,175	2,629,586.00	0.07
454	601139	深圳燃气	294,700	2,602,201.00	0.07
455	002375	亚厦股份	343,211	2,570,650.39	0.07
456	600299	安迪苏	206,000	2,537,920.00	0.07
457	600648	外高桥	191,500	2,533,545.00	0.07
458	300869	康泰医学	61,700	2,501,935.00	0.07
459	601969	海南矿业	207,100	2,487,271.00	0.07
460	000031	大悦城	658,683	2,456,887.59	0.07
461	000156	华数传媒	284,700	2,408,562.00	0.07
462	002653	海思科	109,990	2,243,796.00	0.06
463	600871	石化油服	1,042,800	2,231,592.00	0.06
464	600639	浦东金桥	174,159	2,224,010.43	0.06
465	000869	张裕 A	69,662	2,219,431.32	0.06
466	600377	宁沪高速	254,200	2,191,204.00	0.06
467	603379	三美股份	93,876	2,138,495.28	0.06
468	601828	美凯龙	240,696	2,120,531.76	0.06
469	601228	广州港	634,400	2,112,552.00	0.06
470	002302	西部建设	258,700	2,077,361.00	0.06
471	603708	家家悦	124,700	2,075,008.00	0.06
472	601298	青岛港	359,100	2,043,279.00	0.06
473	601869	长飞光纤	62,383	2,042,419.42	0.06
474	000046	泛海控股	1,064,600	2,001,448.00	0.05
475	001872	招商港口	116,011	1,966,386.45	0.05
476	002948	青岛银行	423,200	1,959,416.00	0.05
477	601156	东航物流	89,500	1,958,260.00	0.05
478	600823	世茂股份	576,500	1,890,920.00	0.05
479	002945	华林证券	138,300	1,889,178.00	0.05
480	000553	安道麦 A	223,000	1,882,120.00	0.05
481	603786	科博达	22,600	1,814,780.00	0.05
482	001203	大中矿业	115,800	1,746,264.00	0.05

483	603719	良品铺子	41,100	1,745,517.00	0.05
484	603355	莱克电气	58,798	1,723,957.36	0.05
485	601568	北元集团	203,400	1,653,642.00	0.04
486	600350	山东高速	320,300	1,652,748.00	0.04
487	600657	信达地产	438,254	1,634,687.42	0.04
488	603056	德邦股份	157,867	1,614,979.41	0.04
489	603515	欧普照明	77,265	1,604,021.40	0.04
490	600466	蓝光发展	777,320	1,585,732.80	0.04
491	601665	齐鲁银行	258,200	1,440,756.00	0.04
492	002946	新乳业	88,900	1,417,066.00	0.04
493	601003	柳钢股份	262,647	1,371,017.34	0.04
494	600917	重庆燃气	161,100	1,351,629.00	0.04
495	600956	新天绿能	72,100	1,240,841.00	0.03
496	002901	大博医疗	22,800	1,154,136.00	0.03
497	600903	贵州燃气	116,600	1,128,688.00	0.03
498	603868	飞科电器	24,605	1,068,349.10	0.03
499	601187	厦门银行	148,800	1,026,720.00	0.03
500	603983	丸美股份	26,800	854,116.00	0.02

8.3.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688167	炬光科技	2,014	355,813.38	0.01
2	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
3	688257	新锐股份	2,899	177,128.90	0.00
4	688227	品高股份	4,164	128,084.64	0.00
5	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
6	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
7	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
8	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
9	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
10	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
11	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
12	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
13	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
14	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
15	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
16	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
17	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
18	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
19	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
20	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00

21	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
22	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
23	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
24	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
25	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
26	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
27	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
28	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
29	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
30	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
31	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
32	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
33	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
34	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
35	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
36	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
37	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
38	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
39	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
40	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
41	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
42	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
43	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
44	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
45	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
46	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
47	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
48	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
49	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
50	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
51	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
52	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
53	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
54	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
55	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
56	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
57	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
58	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600089	特变电工	40,141,351.83	1.09

2	603345	安井食品	33,198,855.44	0.90
3	601233	桐昆股份	32,105,266.78	0.87
4	600885	宏发股份	31,662,908.65	0.86
5	600563	法拉电子	27,681,682.75	0.75
6	601799	星宇股份	27,456,867.46	0.75
7	600426	华鲁恒升	26,964,988.45	0.73
8	600460	士兰微	25,622,980.19	0.70
9	000799	酒鬼酒	24,066,259.70	0.65
10	603486	科沃斯	23,872,183.72	0.65
11	601615	明阳智能	23,687,219.26	0.64
12	603806	福斯特	23,181,314.43	0.63
13	600219	南山铝业	23,092,196.92	0.63
14	600143	金发科技	22,802,390.25	0.62
15	603589	口子窖	22,114,896.14	0.60
16	600486	扬农化工	22,069,014.01	0.60
17	600884	杉杉股份	21,933,651.01	0.60
18	600754	锦江酒店	21,842,144.76	0.59
19	600522	中天科技	21,800,054.86	0.59
20	601168	西部矿业	21,102,727.48	0.57

8.4.2 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	600089	特变电工	99,468,333.07	2.70
2	600426	华鲁恒升	60,428,958.80	1.64
3	600460	士兰微	59,782,567.38	1.63
4	601233	桐昆股份	59,610,834.38	1.62
5	603486	科沃斯	51,922,454.76	1.41
6	603345	安井食品	51,847,277.39	1.41
7	600219	南山铝业	48,980,076.22	1.33
8	600143	金发科技	48,735,375.40	1.33
9	601799	星宇股份	47,365,021.72	1.29
10	603806	福斯特	44,694,394.86	1.22
11	603882	金城医学	44,637,382.33	1.21
12	600885	宏发股份	43,379,996.65	1.18
13	300274	阳光电源	42,665,647.64	1.16
14	600132	重庆啤酒	40,925,624.15	1.11
15	002709	天赐材料	38,773,125.34	1.05
16	601099	太平洋	37,245,183.43	1.01
17	600563	法拉电子	37,222,587.23	1.01
18	603816	顾家家居	36,984,836.45	1.01
19	600779	水井坊	36,230,679.00	0.99

20	601966	玲珑轮胎	36,198,577.56	0.98
----	--------	------	---------------	------

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,736,143,863.43
卖出股票收入（成交）总额	4,548,940,679.75

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	248,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	248,000.00	0.01

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113634	珀莱转债	1,730	173,000.00	0.00
2	110084	贵燃转债	750	75,000.00	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

8.7 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

无。

8.8 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

无。

8.9 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

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2203	IC2203	60	87,669,600.0 0	4,427,600.00	-
公允价值变动总额合计(元)					4,427,600.00
股指期货投资本期收益(元)					16,693,760.78
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,529,000.00

8.10.2 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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	12,528,623.06
2	应收证券清算款	4,722,652.91

3	应收股利	1,680.00
4	应收利息	167,434.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,420,390.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资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	002340	格林美	5,274,360.00	0.14	转融通出借证券
2	600522	中天科技	4,796,288.00	0.13	转融通出借证券
3	000733	振华科技	4,772,352.00	0.13	转融通出借证券
4	000723	美锦能源	4,430,790.00	0.12	转融通出借证券
5	601615	明阳智能	4,348,260.00	0.12	转融通出借证券
6	600157	永泰能源	4,306,120.00	0.12	转融通出借证券
7	600885	宏发股份	4,142,520.00	0.11	转融通出借证券
8	600884	杉杉股份	4,037,264.00	0.11	转融通出借证券
9	000009	中国宝安	3,959,592.00	0.11	转融通出借证券

8.12.5.2 期末积极投资前五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	688167	炬光科技	355,813.38	0.01	新股锁定
2	688262	国芯科技	299,275.42	0.01	新发未上市
3	688257	新锐股份	177,128.90	0.00	新股锁定

4	688227	品高股份	128,084.64	0.00	新股锁定
5	301136	招标股份	75,449.44	0.00	新发未上市

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
14,066	31,930.32	399,207,477.00	88.88	49,924,391.00	11.12

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	265,970,831.00	59.22

9.2 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	中国中金财富证券有 限公司转融通担保证 券明细账户	31,108,800.00	6.93
2	中国平安人寿保险股 份有限公司一万能一 个险万能	14,090,500.00	3.14
3	上海展弘投资管理有 限公司一展弘稳泰套 利运作 1 号私募证券投 资基金	9,856,000.00	2.19
4	中信证券股份有限公司	7,937,049.00	1.77
5	中信建投证券股份有 限公司融券专用证券	7,800,000.00	1.74
6	华泰证券股份有限公 司融券专用证券账户	6,604,700.00	1.47
7	东方财富证券股份有 限公司融券专用证券 账户	6,284,500.00	1.40

8	广发证券股份有限公司	5,436,925.00	1.21
9	东方财富证券股份有限公司	4,765,600.00	1.06
10	韩国产业银行—自有资金（交易所）	4,160,400.00	0.93
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	265,970,831.00	59.22

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 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	1,200.00	0.00

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	527,931,868.00
本报告期基金总申购份额	823,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	902,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	449,131,868.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2021年5月29日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，杨竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

2021 年 7 月 23 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚康先生任公司副总经理。

2021 年 9 月 24 日本基金管理人发布《关于嘉实中证 500ETF 基金经理变更的公告》，增聘李直先生担任本基金基金经理，陈正宪先生不再担任本基金基金经理职务，本基金由李直先生、何如女士共同管理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 92,000.00 元，该审计机构已连续 9 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	4	5,503,304,571.08	66.64%	687,183.13	27.52%	-
广发证券股份有限公司	3	844,910,439.55	10.23%	539,341.77	21.60%	-

申万宏源 证券有限 公司	2	457,658,232.67	5.54%	320,363.69	12.83%	-
海通证券 股份有限 公司	1	402,030,552.65	4.87%	281,502.97	11.27%	-
西部证券 股份有限 公司	2	315,459,551.51	3.82%	199,151.67	7.98%	-
开源证券 股份有限 公司	2	235,818,800.66	2.86%	148,873.97	5.96%	-
兴业证券 股份有限 公司	2	168,255,983.08	2.04%	106,219.91	4.25%	-
长江证券 股份有限 公司	1	107,980,741.97	1.31%	68,169.50	2.73%	-
华西证券 股份有限 公司	2	101,700,000.31	1.23%	64,207.98	2.57%	-
招商证券 股份有限 公司	1	81,949,547.93	0.99%	57,365.19	2.30%	-
光大证券 股份有限 公司	1	38,812,463.53	0.47%	24,503.06	0.98%	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

财信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 财信证券有限责任公司更名为财信证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中信证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：华西证券股份有限公司新增交易单元 2 个，开源证券股份有限公司新增交易单元 2 个，长江证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中信建投证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	818,897.30	15.08%	2,799,000,000.00	34.85%	-	-
申万宏源证券有限公司	1,957,525.14	36.05%	927,000,000.00	11.54%	-	-
海通证券股份有限公司	764,099.40	14.07%	1,635,000,000.00	20.36%	-	-
西部证券股份有限公司	631,517.13	11.63%	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	886,866.70	16.33%	35,000,000.00	0.44%	-	-
兴业证券股份有限公司	113,185.80	2.08%	664,000,000.00	8.27%	-	-
长江证券股份有限公司	257,474.20	4.74%	434,000,000.00	5.40%	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	890,000,000.00	11.08%	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	647,000,000.00	8.06%	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 18 日
2	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分指数基金基金合同等法律文件的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
3	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 29 日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 23 日
6	嘉实基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 21 日
7	嘉实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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 1 日
8	嘉实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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 18 日
9	关于嘉实中证 500ETF 基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 24 日
10	嘉实基金管理有限公司关于继续在网上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 28 日
11	嘉实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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 21 日
12	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 16 日

13	嘉实基金管理有限公司关于对中国邮政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 3 日
14	嘉实基金管理有限公司关于对中信银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 3 日
15	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 (%)
联接基金	1	2021-01-01 至 2021-12-31	226,543,731.00	390,287,000.00	350,859,900.00	265,970,831.00	59.22
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

- 1) 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司
- 2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日