

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由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 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>69</b>
7.1 期末基金资产组合情况	69
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	69
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	71
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	84
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	86
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	86
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	86
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	86
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	86
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	87
7.12 投资组合报告附注 .....	87
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>88</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	88
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	89
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	89
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	89
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>89</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>90</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	90
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	90
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	90
10.4 基金投资策略的改变 .....	90
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	90
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	90
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	90
10.8 其他重大事件 .....	93
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>94</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	94
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>94</b>
12.1 备查文件目录 .....	94
12.2 存放地点 .....	95
12.3 查阅方式 .....	95

## § 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	500,669,931.00 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%。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-230,955,407.75
本期利润	-380,224,910.78
加权平均基金份额本期利润	-0.8039
本期加权平均净值利润率	-12.28%
本期基金份额净值增长率	-11.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	1,675,782,313.45
期末可供分配基金份额利润	3.3471
期末基金资产净值	3,273,886,762.38
期末基金份额净值	6.5390
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)

基金份额累计净值增长率	104.87%
-------------	---------

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

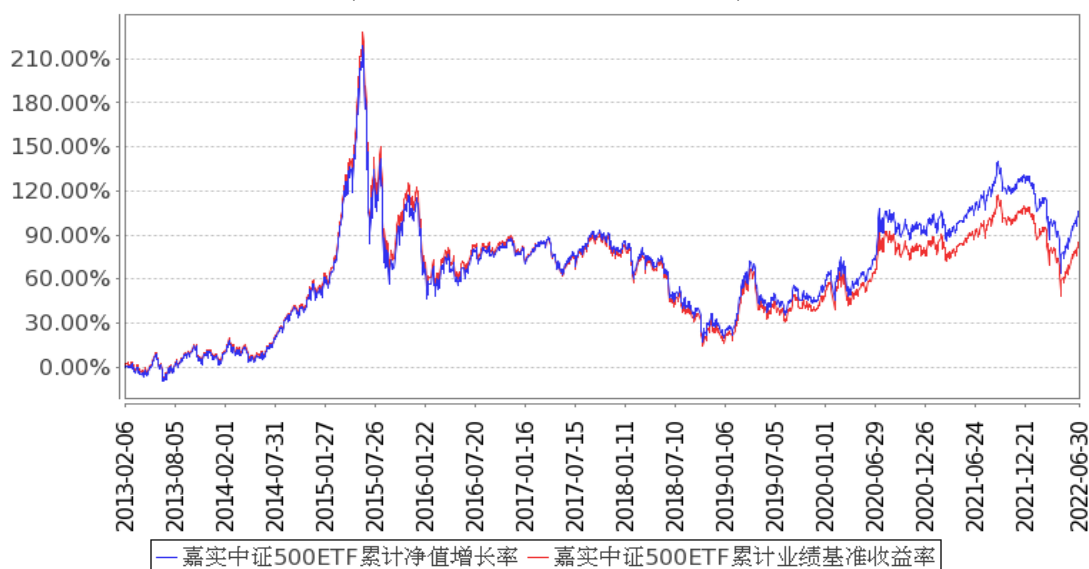
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	7.94%	1.10%	7.10%	1.10%	0.84%	0.00%
过去三个月	3.34%	1.75%	2.04%	1.75%	1.30%	0.00%
过去六个月	-11.09%	1.63%	-12.30%	1.63%	1.21%	0.00%
过去一年	-3.28%	1.33%	-5.20%	1.33%	1.92%	0.00%
过去三年	40.73%	1.34%	30.37%	1.35%	10.36%	-0.01%
自基金合同生效起至今	104.87%	1.62%	83.32%	1.64%	21.55%	-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2022年06月30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。

### 3.3 其他指标

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2022年6月30日，基金管理人共管理277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)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接基金经理	2016年1月5日	-	16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、嘉实基本面50ETF、嘉实中证大农业ETF、嘉实恒生科技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、嘉实中证	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。

	信息安全主题 ETF、嘉实中证医疗指数发起式、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实上海金 ETF 基金经理				
--	---	--	--	--	--

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行业协会相关规定。

#### 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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

##### 4.3.2 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 4 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 3 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

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差为 0.41%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

### 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 6.5390 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.09%，业绩比较基准收益率为-12.30%。

## 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。

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，我们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，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。

## 4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金利润分配符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,677,117.03	16,855,551.78
结算备付金		21,668,613.73	32,975,602.17
存出保证金		11,150,525.34	12,528,623.06
交易性金融资产	6.4.7.2	3,194,948,258.87	3,600,899,564.62
其中：股票投资		3,194,770,325.34	3,600,651,564.62
基金投资		-	-
债券投资		177,933.53	248,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	37,000,000.00	31,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	4,722,652.91
应收股利		1,666,890.54	1,680.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	349,651.23	167,434.88
资产总计		3,287,461,056.74	3,699,151,109.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		11,409,378.41	6,316,479.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		377,848.84	421,187.25
应付托管费		125,949.58	140,395.77
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,406.59	12,728.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,649,710.94	1,352,460.39
负债合计		13,574,294.36	8,243,251.13
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,598,104,448.93	1,601,856,811.20
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,675,782,313.45	2,089,051,047.09
净资产合计		3,273,886,762.38	3,690,907,858.29
负债和净资产总计		3,287,461,056.74	3,699,151,109.42

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 6.5390 元，基金份额总额 500,669,931.00 份。

## 6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-376,563,961.41	257,400,052.88
1. 利息收入		5,300,125.98	5,653,510.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	248,575.74	232,397.36
债券利息收入		-	492.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		274,953.36	389,522.96
证券出借利息收入		4,776,596.88	5,031,097.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-235,564,225.90	181,534,788.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-262,959,304.64	150,084,426.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	396,539.82	293,872.85
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-6,638,954.67	8,675,495.15
股利收益	6.4.7.19	33,637,493.59	22,480,993.50
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-149,269,503.03	63,669,055.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	2,969,641.54	6,542,697.80
<b>减：二、营业总支出</b>		3,660,949.37	7,874,976.77
1. 管理人报酬		2,307,528.74	2,089,966.14
2. 托管费		769,176.23	696,655.32
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		17,201.38	49,347.56
8. 其他费用	6.4.7.23	567,043.02	5,039,007.75
<b>三、利润总额（亏损总额以</b>		<b>-380,224,910.78</b>	<b>249,525,076.11</b>

“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-380,224,910.78	249,525,076.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-380,224,910.78	249,525,076.11

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,752,362.27	-	-413,268,733.64	-417,021,095.91
(一)、综合收益总额	-	-	-380,224,910.78	-380,224,910.78
(二)、本期基金份额交易产生的基	-3,752,362.27	-	-33,043,822.86	-36,796,185.13

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	1,410,042,327.09	-	1,311,463,608.41	2,721,505,935.50
2. 基金赎回款	-1,413,794,689.36	-	-1,344,507,431.27	-2,758,302,120.63
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,598,104,448.93	-	1,675,782,313.45	3,273,886,762.38
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,882,901,924.73	-	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-



更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	1,882,901,924.73	-	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	-656,247,472.74	-	-423,427,861.22	-1,079,675,333.96
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	249,525,076.11	249,525,076.11
(二)、 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)	-656,247,472.74	-	-672,952,937.33	-1,329,200,410.07
其中:1. 基 金 申 购 款	1,607,806,308.20	-	1,569,010,073.70	3,176,816,381.90
2 .基 金 赎 回 款	-2,264,053,780.94	-	-2,241,963,011.03	-4,506,016,791.97
(三)、 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)	-	-	-	-

(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 期末净资产(基金 净值)	1,226,654,451.99	-	1,371,532,573.11	2,598,187,025.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下述变更的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表

中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产

支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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相关交易费用及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。

本基金参与的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“证金公司”)出借证券,证金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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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。

以摊余成本计量的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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 16,855,551.78 元、32,975,602.17 元、12,528,623.06 元、31,000,000.00 元、167,434.88 元、4,722,652.91 元和 1,680.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为 16,857,887.01 元、32,994,084.41 元、12,528,749.12 元、30,989,714.57 元、156,747.01 元、4,722,652.91 元和 1,680.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,600,899,564.62 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,600,899,594.39 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托



管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,316,479.15 元、421,187.25 元、140,395.77 元、897,188.81 元和 455,271.58 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,316,479.15 元、421,187.25 元、140,395.77 元、897,188.81 元和 455,271.58 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	20,677,117.03
等于：本金	20,674,927.28
加：应计利息	2,189.75
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	20,677,117.03

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,176,974,990.53	-	3,194,770,325.34	17,795,334.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	177,900.00	33.53	177,933.53	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	177,900.00	33.53	177,933.53	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,177,152,890.53	33.53	3,194,948,258.87	17,795,334.81	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	74,695,560.00	-	-	-
其中：股指期货投资	74,695,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	74,695,560.00	-	-	-

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	60.00	77,215,200.00	2,519,640.00
合计				2,519,640.00
减：可抵销期货暂收款				2,519,640.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	37,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	37,000,000.00	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	349,651.23
待摊费用	-
合计	349,651.23

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	991,076.70
其中：交易所市场	991,076.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	197,128.42
应付指数使用费	461,505.82
合计	1,649,710.94

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	449,131,868.00	1,601,856,811.20
本期申购	45,600,000.00	162,635,243.19
本期赎回（以“-”号填列）	-48,800,000.00	-174,048,242.75
2022年02月17日 基金拆分/ 份额折算前	445,931,868.00	1,590,443,811.64
基金拆分/份额折算调整	52,338,063.00	-

本期申购	390,800,000.00	1,247,407,083.90
本期赎回（以“-”号填列）	-388,400,000.00	-1,239,746,446.61
本期末	500,669,931.00	1,598,104,448.93

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	2,455,894,890.57	-366,843,843.48	2,089,051,047.09
本期利润	-230,955,407.75	-149,269,503.03	-380,224,910.78
本期基金份额交易产生的变动数	-11,915,938.82	-21,127,884.04	-33,043,822.86
其中：基金申购款	2,053,004,186.64	-741,540,578.23	1,311,463,608.41
基金赎回款	-2,064,920,125.46	720,412,694.19	-1,344,507,431.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,213,023,544.00	-537,241,230.55	1,675,782,313.45

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	48,822.45
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	197,356.41
其他	2,396.88
合计	248,575.74

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-120,047,582.11
股票投资收益——赎回差价收入	-142,911,722.53
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	-262,959,304.64

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	2,113,464,307.90
减：卖出股票成本总额	2,229,850,188.29
减：交易费用	3,661,701.72
买卖股票差价收入	-120,047,582.11

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,758,302,120.63
减：现金支付赎回款总额	1,424,624,710.63
减：赎回股票成本总额	1,476,589,132.53
减：交易费用	-
赎回差价收入	-142,911,722.53

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	426.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	396,112.97
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	396,539.82

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,553,231.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,156,600.00
减：应计利息总额	435.39

减：交易费用	83.34
买卖债券差价收入	396,112.97

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 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
	2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-6,638,954.67



## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	33,637,493.59
其中：证券出借权益补偿收入	3,357,038.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	33,637,493.59

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-147,361,543.03
股票投资	-147,361,543.03
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	-1,907,960.00
权证投资	-
期货投资	-1,907,960.00
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	-149,269,503.03

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,969,641.54
合计	2,969,641.54

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	45,621.05

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	310.00
指数使用费	461,505.82
其他	16.00
存托服务费	82.78
合计	567,043.02

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
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

#### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,307,528.74	2,089,966.14
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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	769,176.23	696,655.32

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。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	320,079,364.00	63.93	265,970,831.00	59.22

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限 公司_活期	20,677,117.03	48,822.45	16,327,908.69	41,176.09

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本期(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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
300834	星辉 环材	2022年 1月6 日	6个月	新股锁 定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益 医疗	2022年 3月25	6个月	新股锁 定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-

		日									
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78		-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14		-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70		-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96		-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28		-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68		-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84		-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90		-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56		-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10		-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股锁定	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36		-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股锁定	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40		-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04		-
301153	中科	2022年	6个月	新股锁	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04		-

	江南	5月10日		定							
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股锁定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74		-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41		-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68		-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股锁定	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80		-

301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新发未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股锁定	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新发未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-

		日									
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-	
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-	
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-	
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-	
688175	高凌信息	2022年3月8日	6个月	新股锁定	51.68	32.23	2,851	147,339.68	91,887.73	-	
688193	仁度生物	2022年3月23日	6个月	新股锁定	72.65	51.57	1,635	118,782.75	84,316.95	-	
688207	格灵深瞳	2022年3月9日	6个月	新股锁定	39.49	26.38	13,391	528,810.59	353,254.58	-	
688306	均普智能	2022年3月15日	6个月	新股锁定	5.08	5.19	47,094	239,237.52	244,417.86	-	

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	1,779	177,900.00	177,933.53	-

注：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，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年06月01日	重大事项停牌	9.60	2022年07月14日	9.99	507,788	4,826,837.23	4,874,764.80	-



		日			日				
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	600522	中天科技	2022年7月1日-2022年7月8日	23.10	309,300	7,144,830.00
2	601615	明阳智能	2022年7月1日-2022年7月8日	33.80	190,300	6,432,140.00
3	600256	广汇能源	2022年7月1日-2022年7月8日	10.54	520,900	5,490,286.00
4	600096	云天化	2022年7月1日-2022年7月8日	31.48	145,600	4,583,488.00
5	300012	华测检测	2022年7月1日-2022年7月8日	23.21	190,100	4,412,221.00
6	002497	雅化集团	2022年7月1日-2022年7月8日	32.65	130,300	4,254,295.00
7	002407	多氟多	2022年7月1日-2022年7月8日	48.91	86,600	4,235,606.00
8	002240	盛新锂能	2022年7月1日-2022年7月8日	60.36	68,800	4,152,768.00
9	002180	纳思达	2022年7月1日-2022年7月8日	50.62	80,000	4,049,600.00
10	600157	永泰能源	2022年7月1日-2022年7月8日	1.59	2,518,200	4,003,938.00
11	600885	宏发股份	2022年7月1日-2022年7月8日	41.85	94,500	3,954,825.00
12	000009	中国宝安	2022年7月1日-2022年7月8日	13.49	292,200	3,941,778.00
13	600141	兴发集团	2022年7月1日-2022年7月8日	43.99	88,200	3,879,918.00
14	300073	当升科技	2022年7月1日-2022年7月8日	90.34	40,100	3,622,634.00
15	600392	盛和资源	2022年7月1日-2022年7月8日	22.60	158,600	3,584,360.00

16	002384	东山精密	2022年7月1日-2022年7月8日	22.93	155,100	3,556,443.00
17	603613	国联股份	2022年7月1日-2022年7月8日	88.60	39,700	3,517,420.00
18	002756	永兴材料	2022年7月1日-2022年7月8日	152.21	22,800	3,470,388.00
19	600418	江淮汽车	2022年7月1日-2022年7月8日	17.16	197,700	3,392,532.00
20	300285	国瓷材料	2022年7月1日-2022年7月8日	35.92	91,100	3,272,312.00
21	600765	中航重机	2022年7月1日-2022年7月8日	32.18	100,300	3,227,654.00
22	600233	圆通速递	2022年7月1日-2022年7月8日	20.39	155,900	3,178,801.00
23	601555	东吴证券	2022年7月1日-2022年7月8日	6.93	453,700	3,144,141.00
24	601058	赛轮轮胎	2022年7月1日-2022年7月8日	11.27	277,600	3,128,552.00
25	600487	亨通光电	2022年7月1日-2022年7月8日	14.54	214,300	3,115,922.00
26	000983	山西焦煤	2022年7月1日-2022年7月8日	13.39	232,200	3,109,158.00
27	600499	科达制造	2022年7月1日-2022年7月8日	20.64	149,800	3,091,872.00
28	300037	新宙邦	2022年7月1日-2022年7月8日	52.56	58,700	3,085,272.00
29	603077	和邦生物	2022年7月1日-2022年7月8日	4.26	700,700	2,984,982.00
30	002385	大北农	2022年7月1日-2022年7月8日	7.81	375,500	2,932,655.00
31	002268	卫士通	2022年7月1日-2022年7月8日	42.91	68,300	2,930,753.00
32	603456	九洲药业	2022年7月1日-2022年7月8日	51.70	56,600	2,926,220.00
33	688180	君实生物	2022年7月1日-2022年7月8日	75.34	38,800	2,923,192.00
34	601108	财通证券	2022年7月1日-2022年7月8日	7.87	368,300	2,898,521.00
35	300363	博腾股份	2022年7月1日-2022年7月8日	77.99	37,100	2,893,429.00
36	688122	西部超导	2022年7月1日-2022年7月8日	92.20	31,000	2,858,200.00
37	688099	晶晨股份	2022年7月1日-2022年7月8日	101.00	28,200	2,848,200.00

38	600486	扬农化工	2022 年 7 月 1 日	133.28	20,900	2,785,552.00
39	600298	安琪酵母	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	48.75	56,600	2,759,250.00
40	000519	中兵红箭	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	29.15	94,600	2,757,590.00
41	300144	宋城演艺	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	15.35	177,800	2,729,230.00
42	000630	铜陵有色	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.26	835,000	2,722,100.00
43	600563	法拉电子	2022 年 7 月 1 日	205.16	13,000	2,667,080.00
44	600862	中航高科	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	28.10	94,900	2,666,690.00
45	000988	华工科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	23.17	113,800	2,636,746.00
46	002353	杰瑞股份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	40.30	65,100	2,623,530.00
47	000783	长江证券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.93	438,700	2,601,491.00
48	601077	渝农商行	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.70	701,900	2,597,030.00
49	601168	西部矿业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	11.83	215,700	2,551,731.00
50	002625	光启技术	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	17.27	146,500	2,530,055.00
51	601696	中银证券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.30	188,600	2,508,380.00
52	601162	天风证券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.18	786,000	2,499,480.00
53	300146	汤臣倍健	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	21.65	115,400	2,498,410.00
54	002028	思源电气	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	35.66	69,200	2,467,672.00
55	002056	横店东磁	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	26.62	92,200	2,454,364.00
56	002797	第一创业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.41	381,100	2,442,851.00
57	002507	涪陵榨菜	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	34.52	70,600	2,437,112.00
58	603517	绝味食品	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	57.82	42,000	2,428,440.00
59	688777	中控技术	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	72.76	33,300	2,422,908.00

60	603345	安井食品	2022 年 7 月 1 日	167.87	14,400	2,417,328.00
61	603589	口子窖	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	58.61	41,200	2,414,732.00
62	600988	赤峰黄金	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	15.95	150,800	2,405,260.00
63	000932	华菱钢铁	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.09	469,800	2,391,282.00
64	002185	华天科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.38	254,100	2,383,458.00
65	601128	常熟银行	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.64	310,300	2,370,692.00
66	601636	旗滨集团	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	12.75	182,900	2,331,975.00
67	600521	华海药业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	22.70	101,400	2,301,780.00
68	002603	以岭药业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	24.30	94,600	2,298,780.00
69	603605	珀莱雅	2022 年 7 月 1 日	165.18	13,900	2,296,002.00
70	002326	永太科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	32.93	69,600	2,291,928.00
71	600039	四川路桥	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	10.53	217,400	2,289,222.00
72	600109	国金证券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.00	253,200	2,278,800.00
73	601607	上海医药	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	18.08	126,000	2,278,080.00
74	002078	太阳纸业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	12.31	182,900	2,251,499.00
75	000830	鲁西化工	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	17.29	130,200	2,251,158.00
76	002624	完美世界	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	14.37	153,900	2,211,543.00
77	600153	建发股份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.07	168,700	2,204,909.00
78	600546	山煤国际	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	19.46	112,200	2,183,412.00
79	603939	益丰药房	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	52.83	40,800	2,155,464.00
80	688390	固德威	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	313.01	6,840	2,140,988.40
81	601872	招商轮船	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.76	367,300	2,115,648.00

82	002422	科伦药业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	18.70	112,900	2,111,230.00
83	000738	航发控制	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	28.10	75,100	2,110,310.00
84	600348	华阳股份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	15.46	136,000	2,102,560.00
85	600705	中航产融	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.46	606,500	2,098,490.00
86	600497	驰宏锌锗	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.19	403,800	2,095,722.00
87	601990	南京证券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.34	250,500	2,089,170.00
88	600549	厦门钨业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	21.62	96,600	2,088,492.00
89	600177	雅戈尔	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.63	314,800	2,087,124.00
90	000831	五矿稀土	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	31.25	66,600	2,081,250.00
91	600875	东方电气	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	16.45	126,100	2,074,345.00
92	300699	光威复材	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	58.87	35,200	2,072,224.00
93	000970	中科三环	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	18.78	110,000	2,065,800.00
94	603026	石大胜华	2022 年 7 月 1 日	145.35	14,200	2,063,970.00
95	300088	长信科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.42	277,800	2,061,276.00
96	300676	华大基因	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	71.70	28,100	2,014,770.00
97	600160	巨化股份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.15	153,000	2,011,950.00
98	000999	华润三九	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	45.00	44,500	2,002,500.00
99	600859	王府井	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	25.98	76,600	1,990,068.00
100	000998	隆平高科	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	16.66	119,200	1,985,872.00
101	002673	西部证券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.54	303,500	1,984,890.00
102	002138	顺络电子	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	27.25	72,800	1,983,800.00
103	601699	潞安环能	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	14.62	135,400	1,979,548.00

104	002572	索菲亚	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	27.50	71,900	1,977,250 .00
105	600516	方大炭 素	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.60	258,800	1,966,880 .00
106	002557	洽洽食 品	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	56.93	34,500	1,964,085 .00
107	000807	云铝股 份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.88	198,200	1,958,216 .00
108	600143	金发科 技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.52	204,200	1,943,984 .00
109	002508	老板电 器	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	36.03	53,500	1,927,605 .00
110	000039	中集集 团	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.85	139,000	1,925,150 .00
111	601997	贵阳银 行	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.81	331,200	1,924,272 .00
112	600482	中国动 力	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	15.71	122,400	1,922,904 .00
113	002030	达安基 因	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	17.19	111,200	1,911,528 .00
114	002273	水晶光 电	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	12.11	157,500	1,907,325 .00
115	000960	锡业股 份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	16.77	113,400	1,901,718 .00
116	002465	海格通 信	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.09	209,000	1,899,810 .00
117	603267	鸿远电 子	2022 年 7 月 1 日	134.33	14,100	1,894,053 .00
118	000629	攀钢钒 钛	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.80	487,500	1,852,500 .00
119	300357	我武生 物	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	52.03	35,500	1,847,065 .00
120	000728	国元证 券	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.22	296,800	1,846,096 .00
121	300058	蓝色光 标	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.53	282,100	1,842,113 .00
122	300136	信维通 信	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	16.85	109,300	1,841,705 .00
123	000975	银泰黄 金	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.74	188,600	1,836,964 .00
124	600170	上海建 工	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.03	605,600	1,834,968 .00
125	603127	昭衍新 药	2022 年 7 月 1 日	113.80	16,100	1,832,180 .00

126	689009	九号公司	2022 年 7 月 8 日	44.50	41,000	1,824,500.00
127	600704	物产中大	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.13	353,500	1,813,455.00
128	002092	中泰化学	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.76	233,500	1,811,960.00
129	600536	中国软件	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	40.59	44,500	1,806,255.00
130	601577	长沙银行	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.93	227,700	1,805,661.00
131	002409	雅克科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	55.51	32,400	1,798,524.00
132	002294	信立泰	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	28.10	63,200	1,775,920.00
133	600079	人福医药	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	16.00	110,900	1,774,400.00
134	600739	辽宁成大	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	14.58	121,400	1,770,012.00
135	603198	迎驾贡酒	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	65.14	27,100	1,765,294.00
136	002223	鱼跃医疗	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	25.66	68,300	1,752,578.00
137	300244	迪安诊断	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	31.10	56,100	1,744,710.00
138	300474	景嘉微	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	68.39	25,500	1,743,945.00
139	300418	昆仑万维	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	16.00	108,400	1,734,400.00
140	000547	航天发展	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	11.94	145,200	1,733,688.00
141	600415	小商品城	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.57	310,900	1,731,713.00
142	002739	万达电影	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.65	126,600	1,728,090.00
143	000636	风华高科	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	18.79	91,800	1,724,922.00
144	002372	伟星新材	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	24.04	71,700	1,723,668.00
145	002506	协鑫集成	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.72	462,800	1,721,616.00
146	300253	卫宁健康	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.78	194,600	1,708,588.00
147	300558	贝达药业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	60.80	28,100	1,708,480.00

148	600699	均胜电子	2022年7月1日-2022年7月8日	15.71	108,300	1,701,393.00
149	600372	中航电子	2022年7月1日-2022年7月8日	19.39	87,300	1,692,747.00
150	300296	利亚德	2022年7月1日-2022年7月8日	7.30	230,600	1,683,380.00
151	300308	中际旭创	2022年7月1日-2022年7月8日	31.05	54,100	1,679,805.00
152	600637	东方明珠	2022年7月1日-2022年7月8日	7.15	232,100	1,659,515.00
153	002683	广东宏大	2022年7月1日-2022年7月8日	27.83	59,300	1,650,319.00
154	600315	上海家化	2022年7月1日-2022年7月8日	42.75	38,600	1,650,150.00
155	600867	通化东宝	2022年7月1日-2022年7月8日	10.34	159,200	1,646,128.00
156	600985	淮北矿业	2022年7月1日-2022年7月8日	14.56	112,300	1,635,088.00
157	601016	节能风电	2022年7月1日-2022年7月8日	4.80	340,600	1,634,880.00
158	000887	中鼎股份	2022年7月1日-2022年7月8日	18.24	89,500	1,632,480.00
159	600236	桂冠电力	2022年7月1日-2022年7月8日	6.09	268,000	1,632,120.00
160	601198	东兴证券	2022年7月1日-2022年7月8日	8.90	183,300	1,631,370.00
161	600026	中远海能	2022年7月1日-2022年7月8日	10.33	157,200	1,623,876.00
162	002299	圣农发展	2022年7月1日-2022年7月8日	19.18	84,400	1,618,792.00
163	002156	通富微电	2022年7月1日-2022年7月8日	15.40	105,100	1,618,540.00
164	600171	上海贝岭	2022年7月1日-2022年7月8日	25.03	64,600	1,616,938.00
165	002065	东华软件	2022年7月1日-2022年7月8日	6.32	254,100	1,605,912.00
166	600380	健康元	2022年7月1日-2022年7月8日	12.35	129,500	1,599,325.00
167	600879	航天电子	2022年7月1日-2022年7月8日	6.49	246,200	1,597,838.00
168	600642	申能股份	2022年7月1日-2022年7月8日	5.68	278,100	1,579,608.00
169	600258	首旅酒店	2022年7月1日-2022年7月8日	24.80	63,500	1,574,800.00



170	300026	红日药业	2022年7月1日-2022年7月8日	7.70	204,300	1,573,110.00
171	000750	国海证券	2022年7月1日-2022年7月8日	3.63	431,900	1,567,797.00
172	002408	齐翔腾达	2022年7月1日-2022年7月8日	8.11	192,900	1,564,419.00
173	000623	吉林敖东	2022年7月1日-2022年7月8日	14.76	105,000	1,549,800.00
174	000513	丽珠集团	2022年7月1日-2022年7月8日	36.21	42,600	1,542,546.00
175	002203	海亮股份	2022年7月1日-2022年7月8日	11.55	133,300	1,539,615.00
176	000729	燕京啤酒	2022年7月1日-2022年7月8日	9.66	159,200	1,537,872.00
177	600673	东阳光	2022年7月1日-2022年7月8日	8.99	170,700	1,534,593.00
178	000878	云南铜业	2022年7月1日-2022年7月8日	11.39	134,600	1,533,094.00
179	688185	康希诺	2022年7月1日-2022年7月8日	199.08	7,700	1,532,916.00
180	000400	许继电气	2022年7月1日-2022年7月8日	19.20	79,700	1,530,240.00
181	600820	隧道股份	2022年7月1日-2022年7月8日	6.12	249,100	1,524,492.00
182	600038	中直股份	2022年7月1日-2022年7月8日	45.20	33,400	1,509,680.00
183	600529	山东药玻	2022年7月1日-2022年7月8日	27.95	53,800	1,503,710.00
184	600801	华新水泥	2022年7月1日-2022年7月8日	19.51	77,000	1,502,270.00
185	600580	卧龙电驱	2022年7月1日-2022年7月8日	14.42	104,000	1,499,680.00
186	601717	郑煤机	2022年7月1日-2022年7月8日	14.41	104,000	1,498,640.00
187	002439	启明星辰	2022年7月8日	19.93	75,000	1,494,750.00
188	600369	西南证券	2022年7月1日-2022年7月8日	3.97	376,500	1,494,705.00
189	300383	光环新网	2022年7月1日-2022年7月8日	10.42	142,600	1,485,892.00
190	002183	怡亚通	2022年7月1日-2022年7月8日	7.21	206,000	1,485,260.00
191	300017	网宿科技	2022年7月1日-2022年7月8日	5.36	277,100	1,485,256.00

192	002131	利欧股份	2022年7月1日-2022年7月8日	1.94	765,400	1,484,876.00
193	600316	洪都航空	2022年7月1日-2022年7月8日	30.24	49,100	1,484,784.00
194	688256	寒武纪	2022年7月1日-2022年7月8日	64.70	22,900	1,481,630.00
195	600166	福田汽车	2022年7月1日-2022年7月8日	2.83	521,700	1,476,411.00
196	600848	上海临港	2022年7月1日-2022年7月8日	13.56	108,400	1,469,904.00
197	603568	伟明环保	2022年7月1日-2022年7月8日	33.37	44,000	1,468,280.00
198	002958	青农商行	2022年7月1日-2022年7月8日	3.32	441,000	1,464,120.00
199	002195	二三四五	2022年7月1日-2022年7月8日	2.25	648,400	1,458,900.00
200	002444	巨星科技	2022年7月1日-2022年7月8日	18.84	77,300	1,456,332.00
201	600909	华安证券	2022年7月1日-2022年7月8日	4.55	319,400	1,453,270.00
202	600027	华电国际	2022年7月1日-2022年7月8日	3.93	369,300	1,451,349.00
203	601005	重庆钢铁	2022年7月1日-2022年7月8日	1.91	759,600	1,450,836.00
204	600325	华发股份	2022年7月1日-2022年7月8日	7.57	191,500	1,449,655.00
205	600008	首创环保	2022年7月1日-2022年7月8日	2.90	499,400	1,448,260.00
206	300001	特锐德	2022年7月1日-2022年7月8日	17.31	82,400	1,426,344.00
207	300024	机器人	2022年7月1日-2022年7月8日	10.08	140,300	1,414,224.00
208	000825	太钢不锈	2022年7月1日-2022年7月8日	5.45	258,200	1,407,190.00
209	688521	芯原股份	2022年7月1日-2022年7月8日	49.40	28,400	1,402,960.00
210	300618	寒锐钴业	2022年7月1日-2022年7月8日	57.92	24,200	1,401,664.00
211	002926	华西证券	2022年7月1日-2022年7月8日	7.84	178,500	1,399,440.00
212	002500	山西证券	2022年7月1日-2022年7月8日	5.74	243,600	1,398,264.00
213	002373	千方科技	2022年7月1日-2022年7月8日	11.12	125,400	1,394,448.00

214	000050	深天马 A	2022年7月1日-2022年 7月8日	9.97	138,900	1,384,833 .00
215	603218	日月股 份	2022年7月1日-2022年 7月8日	25.40	54,500	1,384,300 .00
216	002430	杭氧股 份	2022年7月1日-2022年 7月8日	31.26	44,200	1,381,692 .00
217	000739	普洛药 业	2022年7月1日-2022年 7月8日	20.64	66,900	1,380,816 .00
218	000027	深圳能 源	2022年7月1日-2022年 7月8日	6.41	215,200	1,379,432 .00
219	600271	航天信 息	2022年7月1日-2022年 7月8日	10.94	126,000	1,378,440 .00
220	002250	联化科 技	2022年7月1日-2022年 7月8日	16.37	83,600	1,368,532 .00
221	002212	天融信	2022年7月1日-2022年 7月8日	10.15	134,100	1,361,115 .00
222	600863	内蒙华 电	2022年7月1日-2022年 7月8日	3.65	369,800	1,349,770 .00
223	601866	中远海 发	2022年7月1日-2022年 7月8日	3.00	449,100	1,347,300 .00
224	600118	中国卫 星	2022年7月1日-2022年 7月8日	20.08	67,000	1,345,360 .00
225	600208	新湖中 宝	2022年7月1日-2022年 7月8日	2.76	487,300	1,344,948 .00
226	603233	大参林	2022年7月1日-2022年 7月8日	31.30	42,700	1,336,510 .00
227	688009	中国通 号	2022年7月1日-2022年 7月8日	4.53	293,100	1,327,743 .00
228	000060	中金岭 南	2022年7月1日-2022年 7月8日	4.46	296,700	1,323,282 .00
229	300677	英科医 疗	2022年7月1日-2022年 7月8日	25.36	52,100	1,321,256 .00
230	002249	大洋电 机	2022年7月1日-2022年 7月8日	6.14	214,600	1,317,644 .00
231	300009	安科生 物	2022年7月1日-2022年 7月8日	10.11	129,700	1,311,267 .00
232	000778	新兴铸 管	2022年7月1日-2022年 7月8日	4.82	271,600	1,309,112 .00
233	601992	金隅集 团	2022年7月1日-2022年 7月8日	2.77	472,600	1,309,102 .00
234	002152	广电运 通	2022年7月1日-2022年 7月8日	9.27	140,600	1,303,362 .00
235	603156	养元饮 品	2022年7月1日-2022年 7月8日	22.72	57,300	1,301,856 .00

236	600066	宇通客 车	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.65	150,500	1,301,825 .00
237	603658	安图生 物	2022 年 7 月 1 日	48.89	26,300	1,285,807 .00
238	300182	捷成股 份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.50	233,500	1,284,250 .00
239	300070	碧水源	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.21	246,000	1,281,660 .00
240	603858	步长制 药	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	19.71	64,800	1,277,208 .00
241	000401	冀东水 泥	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	10.52	120,500	1,267,660 .00
242	300168	万达信 息	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.44	134,200	1,266,848 .00
243	600998	九州通	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	11.91	105,900	1,261,269 .00
244	002128	电投能 源	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	14.32	87,800	1,257,296 .00
245	300251	光线传 媒	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.47	132,600	1,255,722 .00
246	002191	劲嘉股 份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	10.72	116,700	1,251,024 .00
247	600970	中材国 际	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.69	128,600	1,246,134 .00
248	600390	五矿资 本	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	4.89	254,800	1,245,972 .00
249	000997	新大 陆	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.21	93,600	1,236,456 .00
250	600667	太极实 业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.38	166,900	1,231,722 .00
251	000021	深科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	11.64	105,800	1,231,512 .00
252	300482	万孚生 物	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	40.71	30,100	1,225,371 .00
253	002505	鹏都农 牧	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.39	360,800	1,223,112 .00
254	002244	滨江集 团	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.65	141,000	1,219,650 .00
255	600528	中铁工 业	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.05	151,200	1,217,160 .00
256	600021	上海电 力	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	10.25	118,700	1,216,675 .00
257	002221	东华能 源	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.31	130,400	1,214,024 .00

258	000656	金科股份	2022年7月1日-2022年7月8日	2.86	423,300	1,210,638.00
259	603885	吉祥航空	2022年7月1日-2022年7月8日	17.99	67,000	1,205,330.00
260	600839	四川长虹	2022年7月1日-2022年7月8日	2.88	418,100	1,204,128.00
261	600062	华润双鹤	2022年7月1日-2022年7月8日	25.66	46,900	1,203,454.00
262	600827	百联股份	2022年7月1日-2022年7月8日	13.21	91,000	1,202,110.00
263	600297	广汇汽车	2022年7月1日-2022年7月8日	2.61	459,700	1,199,817.00
264	603707	健友股份	2022年7月1日-2022年7月8日	28.20	42,400	1,195,680.00
265	002396	星网锐捷	2022年7月1日-2022年7月8日	22.64	52,700	1,193,128.00
266	002127	南极电商	2022年7月1日-2022年7月8日	5.34	222,400	1,187,616.00
267	600598	北大荒	2022年7月1日-2022年7月8日	14.76	80,300	1,185,228.00
268	688002	睿创微纳	2022年7月1日-2022年7月8日	39.72	29,800	1,183,656.00
269	002019	亿帆医药	2022年7月1日-2022年7月8日	13.98	83,800	1,171,524.00
270	600155	华创阳安	2022年7月1日-2022年7月8日	8.48	137,900	1,169,392.00
271	600201	生物股份	2022年7月1日-2022年7月8日	9.16	127,600	1,168,816.00
272	600498	烽火通信	2022年7月1日-2022年7月8日	14.48	80,600	1,167,088.00
273	002266	浙富控股	2022年7月1日-2022年7月8日	4.79	243,500	1,166,365.00
274	002155	湖南黄金	2022年7月1日-2022年7月8日	12.14	95,400	1,158,156.00
275	000012	南玻A	2022年7月1日-2022年7月8日	7.42	155,800	1,156,036.00
276	600259	广晟有色	2022年7月1日-2022年7月8日	50.65	22,700	1,149,755.00
277	600511	国药股份	2022年7月1日-2022年7月8日	26.78	42,900	1,148,862.00
278	000930	中粮科技	2022年7月1日-2022年7月8日	9.04	127,000	1,148,080.00
279	600409	三友化工	2022年7月1日-2022年7月8日	8.19	140,100	1,147,419.00

280	000883	湖北能源	2022年7月1日-2022年7月8日	5.11	223,000	1,139,530.00
281	600718	东软集团	2022年7月1日-2022年7月8日	11.51	98,800	1,137,188.00
282	002153	石基信息	2022年7月1日-2022年7月8日	15.87	71,400	1,133,118.00
283	600755	厦门国贸	2022年7月1日-2022年7月8日	7.50	149,800	1,123,500.00
284	002124	天邦食品	2022年7月1日-2022年7月8日	6.72	166,600	1,119,552.00
285	002511	中顺洁柔	2022年7月1日-2022年7月8日	12.52	89,300	1,118,036.00
286	600060	海信视像	2022年7月1日-2022年7月8日	12.50	88,800	1,110,000.00
287	000686	东北证券	2022年7月1日-2022年7月8日	6.99	158,700	1,109,313.00
288	600959	江苏有线	2022年7月1日-2022年7月8日	3.26	340,000	1,108,400.00
289	603712	七一二	2022年7月1日-2022年7月8日	31.50	35,100	1,105,650.00
290	688188	柏楚电子	2022年7月1日-2022年7月8日	220.04	5,000	1,100,200.00
291	600282	南钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	3.15	349,200	1,099,980.00
292	600566	济川药业	2022年7月1日-2022年7月8日	27.16	40,400	1,097,264.00
293	000581	威孚高科	2022年7月1日-2022年7月8日	19.25	56,800	1,093,400.00
294	600782	新钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	5.04	216,500	1,091,160.00
295	600895	张江高科	2022年7月1日-2022年7月8日	12.45	87,500	1,089,375.00
296	601880	辽港股份	2022年7月1日-2022年7月8日	1.70	640,400	1,088,680.00
297	000709	河钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	2.26	481,300	1,087,738.00
298	601179	中国西电	2022年7月1日-2022年7月8日	4.68	232,400	1,087,632.00
299	000690	宝新能源	2022年7月1日-2022年7月8日	4.38	246,400	1,079,232.00
300	600022	山东钢铁	2022年7月1日-2022年7月8日	1.74	620,000	1,078,800.00
301	600064	南京高科	2022年7月1日-2022年7月8日	11.00	98,000	1,078,000.00

302	000987	越秀金控	2022年7月1日-2022年7月8日	7.03	152,670	1,073,270.10
303	002939	长城证券	2022年7月1日-2022年7月8日	10.16	105,200	1,068,832.00
304	600535	天士力	2022年7月1日-2022年7月8日	10.51	101,500	1,066,765.00
305	600056	中国医药	2022年7月1日-2022年7月8日	14.82	71,860	1,064,965.20
306	002701	奥瑞金	2022年7月1日-2022年7月8日	5.20	204,000	1,060,800.00
307	002002	鸿达兴业	2022年7月1日-2022年7月8日	3.71	283,000	1,049,930.00
308	300630	普利制药	2022年7月1日-2022年7月8日	35.15	29,700	1,043,955.00
309	600663	陆家嘴	2022年7月1日-2022年7月8日	10.36	100,700	1,043,252.00
310	600500	中化国际	2022年7月1日-2022年7月8日	6.65	156,700	1,042,055.00
311	600216	浙江医药	2022年7月1日-2022年7月8日	13.65	76,200	1,040,130.00
312	000598	兴蓉环境	2022年7月1日-2022年7月8日	5.11	203,100	1,037,841.00
313	600808	马钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	3.79	273,700	1,037,323.00
314	600037	歌华有线	2022年7月1日-2022年7月8日	9.39	110,100	1,033,839.00
315	002468	申通快递	2022年7月1日-2022年7月8日	11.92	86,500	1,031,080.00
316	600728	佳都科技	2022年7月1日-2022年7月8日	6.46	158,900	1,026,494.00
317	600567	山鹰国际	2022年7月1日-2022年7月8日	2.77	366,000	1,013,820.00
318	600517	国网英大	2022年7月1日-2022年7月8日	5.19	194,200	1,007,898.00
319	002595	豪迈科技	2022年7月1日-2022年7月8日	22.34	44,900	1,003,066.00
320	002004	华邦健康	2022年7月1日-2022年7月8日	5.58	179,400	1,001,052.00
321	603866	桃李面包	2022年7月1日-2022年7月8日	16.55	60,400	999,620.00
322	603225	新凤鸣	2022年7月1日-2022年7月8日	11.54	86,400	997,056.00
323	601456	国联证券	2022年7月1日-2022年7月8日	12.27	81,000	993,870.00

324	688208	道通科技	2022年7月1日-2022年7月8日	32.92	30,100	990,892.00
325	300463	迈克生物	2022年7月1日-2022年7月8日	20.49	48,300	989,667.00
326	002429	兆驰股份	2022年7月1日-2022年7月8日	3.84	256,500	984,960.00
327	600597	光明乳业	2022年7月1日-2022年7月8日	12.63	77,900	983,877.00
328	300115	长盈精密	2022年7月1日-2022年7月8日	10.31	95,300	982,543.00
329	002745	木林森	2022年7月1日-2022年7月8日	9.77	100,500	981,885.00
330	688289	圣湘生物	2022年7月1日-2022年7月8日	29.61	32,700	968,247.00
331	601958	金铂股份	2022年7月1日-2022年7月8日	8.84	109,500	967,980.00
332	688006	杭可科技	2022年7月1日-2022年7月8日	70.06	13,800	966,828.00
333	300166	东方国信	2022年7月1日-2022年7月8日	9.22	104,000	958,880.00
334	601106	中国一重	2022年7月1日-2022年7月8日	3.07	310,700	953,849.00
335	601860	紫金银行	2022年7月1日-2022年7月8日	2.87	331,700	951,979.00
336	002390	信邦制药	2022年7月1日-2022年7月8日	6.91	137,700	951,507.00
337	300888	稳健医疗	2022年7月1日-2022年7月8日	66.50	14,200	944,300.00
338	300072	三聚环保	2022年7月1日-2022年7月8日	5.06	186,100	941,666.00
339	600572	康恩贝	2022年7月1日-2022年7月8日	4.43	211,600	937,388.00
340	600398	海澜之家	2022年7月1日-2022年7月8日	4.75	195,500	928,625.00
341	601118	海南橡胶	2022年7月1日-2022年7月8日	4.78	193,900	926,842.00
342	601718	际华集团	2022年7月1日-2022年7月8日	3.10	298,900	926,590.00
343	600507	方大特钢	2022年7月1日-2022年7月8日	6.99	131,800	921,282.00
344	000540	中天金融	2022年7月1日-2022年7月8日	1.93	476,200	919,066.00
345	600737	中粮糖业	2022年7月1日-2022年7月8日	7.52	121,100	910,672.00



346	002010	传化智联	2022年7月1日-2022年7月8日	6.43	139,600	897,628.00
347	000937	冀中能源	2022年7月1日-2022年7月8日	7.46	120,200	896,692.00
348	000089	深圳机场	2022年7月1日-2022年7月8日	7.72	116,100	896,292.00
349	600582	天地科技	2022年7月1日-2022年7月8日	4.78	187,100	894,338.00
350	000559	万向钱潮	2022年7月1日-2022年7月8日	5.94	149,900	890,406.00
351	603883	老百姓	2022年7月1日-2022年7月8日	33.88	26,130	885,284.40
352	002048	宁波华翔	2022年7月1日-2022年7月8日	16.02	55,200	884,304.00
353	000898	鞍钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	3.22	274,000	882,280.00
354	600967	内蒙一机	2022年7月1日-2022年7月8日	9.12	96,500	880,080.00
355	002368	太极股份	2022年7月1日-2022年7月8日	19.21	45,600	875,976.00
356	600871	石化油服	2022年7月1日-2022年7月8日	1.89	461,400	872,046.00
357	600435	北方导航	2022年7月1日-2022年7月8日	8.62	101,000	870,620.00
358	002690	美亚光电	2022年7月1日-2022年7月8日	21.68	40,000	867,200.00
359	601000	唐山港	2022年7月1日-2022年7月8日	2.58	335,500	865,590.00
360	001914	招商积余	2022年7月1日-2022年7月8日	17.97	47,800	858,966.00
361	600195	中牧股份	2022年7月1日-2022年7月8日	12.26	69,000	845,940.00
362	002110	三钢闽光	2022年7月1日-2022年7月8日	6.09	138,700	844,683.00
363	000959	首钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	4.76	177,100	842,996.00
364	601333	广深铁路	2022年7月1日-2022年7月8日	2.18	384,600	838,428.00
365	002233	塔牌集团	2022年7月1日-2022年7月8日	8.85	94,600	837,210.00
366	000156	华数传媒	2022年7月1日-2022年7月8日	7.97	104,600	833,662.00
367	002281	光迅科技	2022年7月1日-2022年7月8日	17.58	47,200	829,776.00

368	002705	新宝股份	2022年7月1日-2022年7月8日	21.99	37,600	826,824.00
369	000537	广宇发展	2022年7月1日-2022年7月8日	12.99	63,400	823,566.00
370	600811	东方集团	2022年7月1日-2022年7月8日	2.83	290,300	821,549.00
371	003035	南网能源	2022年7月1日-2022年7月8日	6.35	128,800	817,880.00
372	600764	中国海防	2022年7月1日-2022年7月8日	25.24	32,200	812,728.00
373	002174	游族网络	2022年7月1日-2022年7月8日	9.77	82,900	809,933.00
374	688321	微芯生物	2022年7月1日-2022年7月8日	25.19	32,000	806,080.00
375	000402	金融街	2022年7月1日-2022年7月8日	5.95	135,300	805,035.00
376	600329	达仁堂	2022年7月1日-2022年7月8日	24.58	32,500	798,850.00
377	600120	浙江东方	2022年7月1日-2022年7月8日	4.01	196,800	789,168.00
378	603638	艾迪精密	2022年7月1日-2022年7月8日	20.50	38,300	785,150.00
379	600126	杭钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	5.12	153,100	783,872.00
380	300212	易华录	2022年7月1日-2022年7月8日	17.40	45,000	783,000.00
381	002416	爱施德	2022年7月1日-2022年7月8日	9.30	84,100	782,130.00
382	000488	晨鸣纸业	2022年7月1日-2022年7月8日	5.64	138,500	781,140.00
383	000990	诚志股份	2022年7月1日-2022年7月8日	10.95	71,200	779,640.00
384	600167	联美控股	2022年7月1日-2022年7月8日	7.49	103,500	775,215.00
385	600446	金证股份	2022年7月1日-2022年7月8日	10.38	74,300	771,234.00
386	002081	金螳螂	2022年7月1日-2022年7月8日	5.08	151,500	769,620.00
387	601098	中南传媒	2022年7月1日-2022年7月8日	9.44	81,300	767,472.00
388	000685	中山公用	2022年7月1日-2022年7月8日	7.68	99,900	767,232.00
389	002925	盈趣科技	2022年7月1日-2022年7月8日	21.52	35,600	766,112.00

390	600373	中文传媒	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.99	76,400	763,236.00
391	000158	常山北明	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.00	126,900	761,400.00
392	002382	蓝帆医疗	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	9.55	79,700	761,135.00
393	600707	彩虹股份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	4.68	162,300	759,564.00
394	601611	中国核建	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.39	90,100	755,939.00
395	688029	南微医学	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	87.20	8,600	749,920.00
396	002399	海普瑞	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	17.58	42,600	748,908.00
397	002146	荣盛发展	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.03	246,000	745,380.00
398	601608	中信重工	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.79	196,600	745,114.00
399	688088	虹软科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	31.59	23,300	736,047.00
400	002387	维信诺	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.72	109,400	735,168.00
401	000967	盈峰环境	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.06	144,000	728,640.00
402	600131	国网信通	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	13.45	54,100	727,645.00
403	000528	柳工	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	6.51	110,700	720,657.00
404	600376	首开股份	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	4.91	146,200	717,842.00
405	600623	华谊集团	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	8.30	85,400	708,820.00
406	603000	人民网	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	11.20	62,600	701,120.00
407	000563	陕国投 A	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.12	224,500	700,440.00
408	600901	江苏租赁	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	5.13	135,100	693,063.00
409	601598	中国外运	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	3.88	178,600	692,968.00
410	600307	酒钢宏兴	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	1.94	354,900	688,506.00
411	600006	东风汽车	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 8 日	7.55	90,500	683,275.00

412	601991	大唐发电	2022年7月1日-2022年7月8日	2.43	280,800	682,344.00
413	603228	景旺电子	2022年7月1日-2022年7月8日	23.33	28,900	674,237.00
414	300257	开山股份	2022年7月1日-2022年7月8日	14.96	44,600	667,216.00
415	600717	天津港	2022年7月1日-2022年7月8日	4.01	165,400	663,254.00
416	000961	中南建设	2022年7月1日-2022年7月8日	3.05	216,600	660,630.00
417	002242	九阳股份	2022年7月1日-2022年7月8日	18.36	34,800	638,928.00
418	002434	万里扬	2022年7月1日-2022年7月8日	8.55	74,000	632,700.00
419	000718	苏宁环球	2022年7月1日-2022年7月8日	3.68	171,900	632,592.00
420	601928	凤凰传媒	2022年7月1日-2022年7月8日	7.15	86,400	617,760.00
421	000671	阳光城	2022年7月1日-2022年7月8日	2.19	281,200	615,828.00
422	000415	渤海租赁	2022年7月1日-2022年7月8日	2.17	280,200	608,034.00
423	601969	海南矿业	2022年7月1日-2022年7月8日	8.59	69,200	594,428.00
424	600968	海油发展	2022年7月1日-2022年7月8日	2.58	230,200	593,916.00
425	000031	大悦城	2022年7月1日-2022年7月8日	4.00	145,700	582,800.00
426	600648	外高桥	2022年7月1日-2022年7月8日	13.60	42,500	578,000.00
427	600787	中储股份	2022年7月1日-2022年7月8日	5.69	99,500	566,155.00
428	600928	西安银行	2022年7月1日-2022年7月8日	3.67	151,200	554,904.00
429	600339	中油工程	2022年7月1日-2022年7月8日	2.89	189,600	547,944.00
430	002563	森马服饰	2022年7月1日-2022年7月8日	5.92	91,700	542,864.00
431	601228	广州港	2022年7月1日-2022年7月8日	3.67	140,200	514,534.00
432	600835	上海机电	2022年7月1日-2022年7月8日	13.73	36,700	503,891.00
433	300869	康泰医学	2022年7月1日-2022年7月8日	28.26	17,800	503,028.00

434	688819	天能股份	2022年7月1日-2022年7月8日	34.58	14,500	501,410.00
435	600377	宁沪高速	2022年7月1日-2022年7月8日	8.57	56,200	481,634.00
436	000717	韶钢松山	2022年7月1日-2022年7月8日	3.50	137,000	479,500.00
437	601139	深圳燃气	2022年7月1日-2022年7月8日	6.94	65,900	457,346.00
438	603379	三美股份	2022年7月1日-2022年7月8日	22.25	20,500	456,125.00
439	000062	深圳华强	2022年7月1日-2022年7月8日	12.70	35,600	452,120.00
440	000028	国药一致	2022年7月1日	29.79	15,100	449,829.00
441	600299	安迪苏	2022年7月1日-2022年7月8日	9.58	45,300	433,974.00
442	601298	青岛港	2022年7月1日-2022年7月8日	5.47	79,100	432,677.00
443	000869	张裕A	2022年7月1日	29.74	13,500	401,490.00
444	001872	招商港口	2022年7月1日	15.60	25,400	396,240.00
445	002653	海思科	2022年7月1日-2022年7月8日	16.11	24,200	389,862.00
446	601869	长飞光纤	2022年7月1日	30.92	12,400	383,408.00
447	600823	世茂股份	2022年7月1日-2022年7月8日	2.98	127,700	380,546.00
448	600350	山东高速	2022年7月1日-2022年7月8日	5.25	71,000	372,750.00
449	601828	美凯龙	2022年7月1日-2022年7月8日	6.06	61,200	370,872.00
450	603355	莱克电气	2022年7月1日	25.23	11,700	295,191.00
451	603515	欧普照明	2022年7月1日	17.45	15,200	265,240.00
452	601003	柳钢股份	2022年7月1日-2022年7月8日	4.05	58,000	234,900.00
453	600917	重庆燃气	2022年7月1日-2022年7月8日	7.22	20,000	144,400.00
合计	-	-	-	-	73,587,700	694,580,140.10

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

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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、风险管理部门，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，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 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。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	177,933.53	248,000.00
未评级	-	-
合计	177,933.53	248,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.3 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同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。

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

**6.4.13.3.2 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 6.4.12 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,677,117.03	-	-	-	20,677,117.03
结算备付金	21,668,613.73	-	-	-	21,668,613.73
存出保证金	340,397.34	-	-	10,810,128.00	11,150,525.34



交易性金融资产	-	-	177,933.53	3,194,770,325.34	3,194,948,258.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	37,000,000.00	-	-	-	37,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,666,890.54	1,666,890.54
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	349,651.23	349,651.23
资产总计	79,686,128.10	-	177,933.53	3,207,596,995.11	3,287,461,056.74
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	11,409,378.41	11,409,378.41
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	377,848.84	377,848.84
应付托管费	-	-	-	125,949.58	125,949.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	11,406.59	11,406.59
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,649,710.94	1,649,710.94
负债总计	-	-	-	13,574,294.36	13,574,294.36
利率敏感度缺口	79,686,128.10	-	177,933.53	3,194,022,700.75	3,273,886,762.38
上年度末 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

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-2,508.74	-3,494.75
	市场利率下降25个基点	2,551.15	3,553.82

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	3,194,770,325.34	97.58	3,600,651,564.62	97.55
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	3,194,770,325.34	97.58	3,600,651,564.62	97.55

##### 6.4.13.4.3.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	163,799,031.40	184,238,016.06

	业绩比较基准下降 5%	-163,799,031.40	-184,238,016.06
--	----------------	-----------------	-----------------

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	3,187,462,284.49	3,592,785,780.60
第二层次	5,772,168.94	8,113,784.02
第三层次	1,713,805.44	-
合计	3,194,948,258.87	3,600,899,564.62

###### 6.4.14.2.2 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。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,194,770,325.34	97.18
	其中：股票	3,194,770,325.34	97.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	177,933.53	0.01
	其中：债券	177,933.53	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	37,000,000.00	1.13
	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	42,345,730.76	1.29
8	其他各项资产	13,167,067.11	0.40
9	合计	3,287,461,056.74	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 694,580,140.10 元，占基金资产净值的比例为 21.22%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	29,255,306.24	0.89
B	采矿业	111,325,503.31	3.40
C	制造业	1,905,411,752.42	58.20
D	电力、热力、燃气	98,362,581.24	3.00

	及水生产和供应业		
E	建筑业	41,219,487.59	1.26
F	批发和零售业	123,222,240.24	3.76
G	交通运输、仓储和邮政业	85,043,166.98	2.60
H	住宿和餐饮业	6,727,248.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	235,986,156.57	7.21
J	金融业	281,798,958.47	8.61
K	房地产业	75,336,176.67	2.30
L	租赁和商务服务业	38,562,103.53	1.18
M	科学研究和技术服务业	39,892,190.00	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	23,221,230.04	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,464,342.10	0.23
R	文化、体育和娱乐业	42,633,587.00	1.30
S	综合	46,818,689.39	1.43
	合计	3,192,280,719.79	97.51

### 7.2.2 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	1,201,195.20	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	719,918.40	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服	30,307.77	0.00

	务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	286,443.55	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,488,846.55	0.08

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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	600522	中天科技	1,320,400	30,501,240.00	0.93
2	601615	明阳智能	814,285	27,522,833.00	0.84
3	600256	广汇能源	2,224,300	23,444,122.00	0.72
4	300769	德方纳米	50,200	20,515,736.00	0.63
5	600096	云天化	621,400	19,561,672.00	0.60
6	300012	华测检测	813,100	18,872,051.00	0.58
7	002497	雅化集团	558,000	18,218,700.00	0.56
8	002407	多氟多	370,129	18,103,009.39	0.55
9	002240	盛新锂能	292,700	17,667,372.00	0.54
10	300390	天华超净	199,800	17,462,520.00	0.53
11	002180	纳思达	342,600	17,342,412.00	0.53
12	600157	永泰能源	10,744,400	17,083,596.00	0.52
13	600885	宏发股份	402,910	16,861,783.50	0.52
14	000009	中国宝安	1,247,117	16,823,608.33	0.51
15	600141	兴发集团	376,241	16,550,841.59	0.51
16	300073	当升科技	171,198	15,466,027.32	0.47
17	600392	盛和资源	678,870	15,342,462.00	0.47
18	002384	东山精密	661,217	15,161,705.81	0.46
19	002756	永兴材料	98,600	15,007,906.00	0.46
20	603613	国联股份	168,572	14,935,479.20	0.46
21	600418	江淮汽车	845,686	14,511,971.76	0.44
22	300285	国瓷材料	388,236	13,945,437.12	0.43
23	600765	中航重机	428,410	13,786,233.80	0.42

24	600399	抚顺特钢	762,800	13,654,120.00	0.42
25	600563	法拉电子	66,231	13,587,951.96	0.42
26	600233	圆通速递	664,402	13,547,156.78	0.41
27	601555	东吴证券	1,938,870	13,436,369.10	0.41
28	601058	赛轮轮胎	1,186,400	13,370,728.00	0.41
29	600487	亨通光电	913,800	13,286,652.00	0.41
30	000983	山西焦煤	990,470	13,262,393.30	0.41
31	300037	新宙邦	251,242	13,205,279.52	0.40
32	600499	科达制造	639,100	13,191,024.00	0.40
33	600732	爱旭股份	393,700	12,999,974.00	0.40
34	603077	和邦生物	2,990,748	12,740,586.48	0.39
35	688180	君实生物	168,551	12,698,632.34	0.39
36	688122	西部超导	136,318	12,568,519.60	0.38
37	603456	九洲药业	242,100	12,516,570.00	0.38
38	002385	大北农	1,602,048	12,511,994.88	0.38
39	601108	财通证券	1,572,000	12,371,640.00	0.38
40	300363	博腾股份	157,700	12,299,023.00	0.38
41	002268	卫士通	286,255	12,283,202.05	0.38
42	600486	扬农化工	90,430	12,052,510.40	0.37
43	688099	晶晨股份	118,802	11,999,002.00	0.37
44	603345	安井食品	71,200	11,952,344.00	0.37
45	600298	安琪酵母	241,600	11,778,000.00	0.36
46	000519	中兵红箭	403,829	11,771,615.35	0.36
47	300144	宋城演艺	758,500	11,642,975.00	0.36
48	000630	铜陵有色	3,563,300	11,616,358.00	0.35
49	603605	珀莱雅	68,931	11,386,022.58	0.35
50	600862	中航高科	404,100	11,355,210.00	0.35
51	000988	华工科技	486,222	11,265,763.74	0.34
52	002353	杰瑞股份	277,751	11,193,365.30	0.34
53	000783	长江证券	1,871,800	11,099,774.00	0.34
54	601077	渝农商行	2,993,900	11,077,430.00	0.34
55	601168	西部矿业	923,342	10,923,135.86	0.33
56	002625	光启技术	625,100	10,795,477.00	0.33
57	601696	中银证券	806,600	10,727,780.00	0.33
58	300146	汤臣倍健	493,254	10,678,949.10	0.33
59	601162	天风证券	3,355,000	10,668,900.00	0.33
60	688777	中控技术	145,879	10,614,156.04	0.32
61	300724	捷佳伟创	117,900	10,534,365.00	0.32
62	002028	思源电气	294,985	10,519,165.10	0.32
63	002797	第一创业	1,632,600	10,464,966.00	0.32
64	002056	横店东磁	392,916	10,459,423.92	0.32
65	002507	涪陵榨菜	300,231	10,363,974.12	0.32



66	603517	绝味食品	178,040	10,294,272.80	0.31
67	600988	赤峰黄金	644,000	10,271,800.00	0.31
68	000932	华菱钢铁	2,004,341	10,202,095.69	0.31
69	603589	口子窖	173,874	10,190,755.14	0.31
70	002185	华天科技	1,084,762	10,175,067.56	0.31
71	601128	常熟银行	1,326,593	10,135,170.52	0.31
72	603026	石大胜华	69,700	10,130,895.00	0.31
73	601636	旗滨集团	779,200	9,934,800.00	0.30
74	600521	华海药业	434,800	9,869,960.00	0.30
75	002603	以岭药业	403,728	9,810,590.40	0.30
76	600039	四川路桥	929,884	9,791,678.52	0.30
77	002326	永太科技	296,500	9,763,745.00	0.30
78	600109	国金证券	1,080,700	9,726,300.00	0.30
79	601607	上海医药	537,200	9,712,576.00	0.30
80	605117	德业股份	34,500	9,656,205.00	0.29
81	000830	鲁西化工	557,683	9,642,339.07	0.29
82	002078	太阳纸业	779,407	9,594,500.17	0.29
83	002624	完美世界	656,500	9,433,905.00	0.29
84	600153	建发股份	720,600	9,418,242.00	0.29
85	600546	山煤国际	479,300	9,327,178.00	0.28
86	688390	固德威	29,668	9,286,380.68	0.28
87	603939	益丰药房	173,730	9,178,155.90	0.28
88	603267	鸿远电子	68,280	9,172,052.40	0.28
89	601872	招商轮船	1,568,400	9,033,984.00	0.28
90	002422	科伦药业	482,500	9,022,750.00	0.28
91	600348	华阳股份	581,100	8,983,806.00	0.27
92	000738	航发控制	318,700	8,955,470.00	0.27
93	600705	中航产融	2,588,100	8,954,826.00	0.27
94	600497	驰宏锌锗	1,724,800	8,951,712.00	0.27
95	601990	南京证券	1,069,800	8,922,132.00	0.27
96	603127	昭衍新药	78,380	8,919,644.00	0.27
97	600177	雅戈尔	1,343,100	8,904,753.00	0.27
98	600549	厦门钨业	411,380	8,894,035.60	0.27
99	000831	五矿稀土	284,400	8,887,500.00	0.27
100	300699	光威复材	150,200	8,842,274.00	0.27
101	600875	东方电气	537,300	8,838,585.00	0.27
102	000970	中科三环	469,932	8,825,322.96	0.27
103	300088	长信科技	1,187,359	8,810,203.78	0.27
104	000999	华润三九	191,741	8,628,345.00	0.26
105	300676	华大基因	120,100	8,611,170.00	0.26
106	600160	巨化股份	653,027	8,587,305.05	0.26
107	600859	王府井	329,600	8,563,008.00	0.26

108	002673	西部证券	1,306,000	8,541,240.00	0.26
109	002138	顺络电子	312,814	8,524,181.50	0.26
110	002572	索菲亚	309,764	8,518,510.00	0.26
111	000998	隆平高科	509,397	8,486,554.02	0.26
112	601699	潞安环能	579,000	8,464,980.00	0.26
113	600516	方大炭素	1,104,300	8,392,680.00	0.26
114	002557	洽洽食品	146,994	8,368,368.42	0.26
115	600143	金发科技	871,800	8,299,536.00	0.25
116	000807	云铝股份	838,667	8,286,029.96	0.25
117	002508	老板电器	229,600	8,272,488.00	0.25
118	000039	中集集团	593,935	8,225,999.75	0.25
119	601997	贵阳银行	1,414,900	8,220,569.00	0.25
120	600482	中国动力	522,300	8,205,333.00	0.25
121	002030	达安基因	475,090	8,166,797.10	0.25
122	002273	水晶光电	673,290	8,153,541.90	0.25
123	000960	锡业股份	484,193	8,119,916.61	0.25
124	002465	海格通信	891,300	8,101,917.00	0.25
125	603444	吉比特	20,679	8,023,452.00	0.25
126	300136	信维通信	471,299	7,941,388.15	0.24
127	000629	攀钢钒钛	2,080,150	7,904,570.00	0.24
128	300357	我武生物	151,752	7,895,656.56	0.24
129	000728	国元证券	1,266,000	7,874,520.00	0.24
130	300058	蓝色光标	1,204,682	7,866,573.46	0.24
131	000975	银泰黄金	806,222	7,852,602.28	0.24
132	600170	上海建工	2,583,570	7,828,217.10	0.24
133	600536	中国软件	192,570	7,816,416.30	0.24
134	689009	九号公司	174,182	7,751,099.00	0.24
135	600704	物产中大	1,507,500	7,733,475.00	0.24
136	002092	中泰化学	996,342	7,731,613.92	0.24
137	601577	长沙银行	972,400	7,711,132.00	0.24
138	002409	雅克科技	138,000	7,660,380.00	0.23
139	600079	人福医药	473,900	7,582,400.00	0.23
140	002294	信立泰	269,400	7,570,140.00	0.23
141	603198	迎驾贡酒	116,070	7,560,799.80	0.23
142	600739	辽宁成大	517,700	7,548,066.00	0.23
143	300474	景嘉微	109,458	7,485,832.62	0.23
144	300244	迪安诊断	240,011	7,464,342.10	0.23
145	002223	鱼跃医疗	290,660	7,458,335.60	0.23
146	002372	伟星新材	308,823	7,424,104.92	0.23
147	300418	昆仑万维	463,342	7,413,472.00	0.23
148	600415	小商品城	1,328,900	7,401,973.00	0.23
149	000547	航天发展	619,300	7,394,442.00	0.23

150	002506	协鑫集成	1,980,300	7,366,716.00	0.23
151	002739	万达电影	539,100	7,358,715.00	0.22
152	000636	风华高科	391,477	7,355,852.83	0.22
153	300558	贝达药业	120,500	7,326,400.00	0.22
154	300253	卫宁健康	830,998	7,296,162.44	0.22
155	600699	均胜电子	463,340	7,279,071.40	0.22
156	600372	中航电子	373,180	7,235,960.20	0.22
157	300308	中际旭创	232,141	7,207,978.05	0.22
158	300296	利亚德	983,700	7,181,010.00	0.22
159	600637	东方明珠	991,400	7,088,510.00	0.22
160	002683	广东宏大	253,350	7,050,730.50	0.22
161	600867	通化东宝	681,000	7,041,540.00	0.22
162	600315	上海家化	164,077	7,014,291.75	0.21
163	600985	淮北矿业	479,900	6,987,344.00	0.21
164	601016	节能风电	1,454,573	6,981,950.40	0.21
165	000887	中鼎股份	381,900	6,965,856.00	0.21
166	600236	桂冠电力	1,143,306	6,962,733.54	0.21
167	600026	中远海能	673,619	6,958,484.27	0.21
168	601198	东兴证券	781,400	6,954,460.00	0.21
169	002156	通富微电	450,390	6,936,006.00	0.21
170	002299	圣农发展	360,957	6,923,155.26	0.21
171	600171	上海贝岭	275,375	6,892,636.25	0.21
172	600380	健康元	557,023	6,879,234.05	0.21
173	002065	东华软件	1,085,100	6,857,832.00	0.21
174	300832	新产业	152,000	6,856,720.00	0.21
175	600879	航天电子	1,052,484	6,830,621.16	0.21
176	600642	申能股份	1,187,900	6,747,272.00	0.21
177	600258	首旅酒店	271,260	6,727,248.00	0.21
178	300026	红日药业	871,600	6,711,320.00	0.20
179	002408	齐翔腾达	824,983	6,690,612.13	0.20
180	000750	国海证券	1,842,991	6,690,057.33	0.20
181	002936	郑州银行	2,486,878	6,689,701.82	0.20
182	000623	吉林敖东	450,388	6,647,726.88	0.20
183	002203	海亮股份	572,094	6,607,685.70	0.20
184	688185	康希诺	33,168	6,603,085.44	0.20
185	000729	燕京啤酒	682,130	6,589,375.80	0.20
186	000878	云南铜业	575,700	6,557,223.00	0.20
187	000513	丽珠集团	181,035	6,555,277.35	0.20
188	000400	许继电气	341,395	6,554,784.00	0.20
189	600673	东阳光	728,694	6,550,959.06	0.20
190	600820	隧道股份	1,064,520	6,514,862.40	0.20
191	600038	中直股份	142,461	6,439,237.20	0.20

192	600529	山东药玻	230,285	6,436,465.75	0.20
193	600801	华新水泥	329,825	6,434,885.75	0.20
194	601717	郑煤机	446,371	6,432,206.11	0.20
195	600580	卧龙电驱	445,819	6,428,709.98	0.20
196	002439	启明星辰	321,000	6,397,530.00	0.20
197	600369	西南证券	1,606,700	6,378,599.00	0.19
198	300017	网宿科技	1,183,600	6,344,096.00	0.19
199	300383	光环新网	608,514	6,340,715.88	0.19
200	603568	伟明环保	189,959	6,338,931.83	0.19
201	002183	怡亚通	879,000	6,337,590.00	0.19
202	002131	利欧股份	3,266,679	6,337,357.26	0.19
203	600316	洪都航空	208,872	6,316,289.28	0.19
204	600166	福田汽车	2,225,700	6,298,731.00	0.19
205	600848	上海临港	463,100	6,279,636.00	0.19
206	002444	巨星科技	332,284	6,260,230.56	0.19
207	688256	寒武纪	96,520	6,244,844.00	0.19
208	002958	青农商行	1,880,400	6,242,928.00	0.19
209	002195	二三四五	2,768,678	6,229,525.50	0.19
210	600325	华发股份	819,377	6,202,683.89	0.19
211	600909	华安证券	1,362,970	6,201,513.50	0.19
212	601005	重庆钢铁	3,245,100	6,198,141.00	0.19
213	600027	华电国际	1,577,000	6,197,610.00	0.19
214	600008	首创环保	2,129,630	6,175,927.00	0.19
215	300001	特锐德	352,426	6,100,494.06	0.19
216	300618	寒锐钴业	105,140	6,089,708.80	0.19
217	300024	机器人	599,733	6,045,308.64	0.18
218	000825	太钢不锈	1,101,772	6,004,657.40	0.18
219	002500	山西证券	1,041,814	5,980,012.36	0.18
220	002430	杭氧股份	191,100	5,973,786.00	0.18
221	002926	华西证券	761,500	5,970,160.00	0.18
222	603218	日月股份	234,220	5,949,188.00	0.18
223	002373	千方科技	534,472	5,943,328.64	0.18
224	000050	深天马 A	594,384	5,926,008.48	0.18
225	000027	深圳能源	920,884	5,902,866.44	0.18
226	688521	芯原股份	119,414	5,899,051.60	0.18
227	600271	航天信息	537,800	5,883,532.00	0.18
228	000739	普洛药业	284,705	5,876,311.20	0.18
229	002250	联化科技	357,150	5,846,545.50	0.18
230	002212	天融信	573,668	5,822,730.20	0.18
231	603233	大参林	184,740	5,782,362.00	0.18
232	600863	内蒙华电	1,578,200	5,760,430.00	0.18
233	601866	中远海发	1,918,800	5,756,400.00	0.18

234	600208	新湖中宝	2,080,900	5,743,284.00	0.18
235	600118	中国卫星	285,688	5,736,615.04	0.18
236	688009	中国通号	1,251,610	5,669,793.30	0.17
237	002985	北摩高科	96,753	5,667,790.74	0.17
238	300677	英科医疗	223,460	5,666,945.60	0.17
239	000060	中金岭南	1,264,971	5,641,770.66	0.17
240	002249	大洋电机	915,084	5,618,615.76	0.17
241	300009	安科生物	555,478	5,615,882.58	0.17
242	601992	金隅集团	2,016,600	5,585,982.00	0.17
243	000778	新兴铸管	1,157,475	5,579,029.50	0.17
244	002152	广电运通	600,435	5,566,032.45	0.17
245	603156	养元饮品	244,940	5,565,036.80	0.17
246	600066	宇通客车	642,200	5,555,030.00	0.17
247	603658	安图生物	113,600	5,553,904.00	0.17
248	300070	碧水源	1,052,038	5,481,117.98	0.17
249	300182	捷成股份	996,100	5,478,550.00	0.17
250	603858	步长制药	275,648	5,433,022.08	0.17
251	300168	万达信息	574,727	5,425,422.88	0.17
252	000401	冀东水泥	514,000	5,407,280.00	0.17
253	002966	苏州银行	886,412	5,407,113.20	0.17
254	600998	九州通	453,600	5,402,376.00	0.17
255	300251	光线传媒	568,000	5,378,960.00	0.16
256	600056	中国医药	361,627	5,359,312.14	0.16
257	002191	劲嘉股份	497,819	5,336,619.68	0.16
258	002128	电投能源	371,637	5,321,841.84	0.16
259	600390	五矿资本	1,087,600	5,318,364.00	0.16
260	002831	裕同科技	179,757	5,311,819.35	0.16
261	600970	中材国际	547,777	5,307,959.13	0.16
262	000021	深科技	453,241	5,275,725.24	0.16
263	000997	新大陆	399,074	5,271,767.54	0.16
264	600667	太极实业	714,300	5,271,534.00	0.16
265	300482	万孚生物	129,038	5,253,136.98	0.16
266	002505	鹏都农牧	1,541,530	5,225,786.70	0.16
267	688002	睿创微纳	131,172	5,210,151.84	0.16
268	002221	东华能源	558,855	5,202,940.05	0.16
269	600062	华润双鹤	202,446	5,194,764.36	0.16
270	002244	滨江集团	600,270	5,192,335.50	0.16
271	600021	上海电力	506,100	5,187,525.00	0.16
272	600528	中铁工业	644,410	5,187,500.50	0.16
273	000656	金科股份	1,807,600	5,169,736.00	0.16
274	600839	四川长虹	1,786,100	5,143,968.00	0.16
275	603885	吉祥航空	285,000	5,127,150.00	0.16

276	600827	百联股份	387,863	5,123,670.23	0.16
277	600297	广汇汽车	1,961,200	5,118,732.00	0.16
278	000987	越秀金控	727,815	5,116,539.45	0.16
279	002396	星网锐捷	225,829	5,112,768.56	0.16
280	603707	健友股份	180,330	5,085,306.00	0.16
281	600598	北大荒	344,100	5,078,916.00	0.16
282	002127	南极电商	949,900	5,072,466.00	0.15
283	002019	亿帆医药	358,100	5,006,238.00	0.15
284	600155	华创阳安	589,000	4,994,720.00	0.15
285	600498	烽火通信	344,900	4,994,152.00	0.15
286	600201	生物股份	544,361	4,986,346.76	0.15
287	002266	浙富控股	1,038,915	4,976,402.85	0.15
288	600259	广晟有色	98,111	4,969,322.15	0.15
289	002155	湖南黄金	406,717	4,937,544.38	0.15
290	000012	南 玻 A	663,692	4,924,594.64	0.15
291	600409	三友化工	598,956	4,905,449.64	0.15
292	000930	中粮科技	540,927	4,889,980.08	0.15
293	600511	国药股份	182,109	4,876,879.02	0.15
294	002670	国盛金控	507,788	4,874,764.80	0.15
295	000883	湖北能源	953,200	4,870,852.00	0.15
296	600718	东软集团	420,600	4,841,106.00	0.15
297	002153	石基信息	304,580	4,833,684.60	0.15
298	600755	厦门国贸	638,511	4,788,832.50	0.15
299	002124	天邦食品	711,618	4,782,072.96	0.15
300	002511	中顺洁柔	380,783	4,767,403.16	0.15
301	000686	东北证券	679,716	4,751,214.84	0.15
302	600060	海信视像	379,467	4,743,337.50	0.14
303	600959	江苏有线	1,450,970	4,730,162.20	0.14
304	603712	七一二	149,200	4,699,800.00	0.14
305	600282	南钢股份	1,489,900	4,693,185.00	0.14
306	000581	威孚高科	242,590	4,669,857.50	0.14
307	600782	新钢股份	925,800	4,666,032.00	0.14
308	600895	张江高科	374,362	4,660,806.90	0.14
309	600566	济川药业	171,600	4,660,656.00	0.14
310	601880	辽港股份	2,731,349	4,643,293.30	0.14
311	000709	河钢股份	2,054,100	4,642,266.00	0.14
312	601179	中国西电	991,400	4,639,752.00	0.14
313	688188	柏楚电子	21,037	4,628,981.48	0.14
314	000690	宝新能源	1,052,654	4,610,624.52	0.14
315	600022	山东钢铁	2,647,020	4,605,814.80	0.14
316	600064	南京高科	418,084	4,598,924.00	0.14
317	600535	天士力	435,900	4,581,309.00	0.14

318	002939	长城证券	450,700	4,579,112.00	0.14
319	300376	易事特	560,000	4,547,200.00	0.14
320	601778	晶科科技	839,800	4,534,920.00	0.14
321	002701	奥瑞金	870,945	4,528,914.00	0.14
322	002002	鸿达兴业	1,207,772	4,480,834.12	0.14
323	600216	浙江医药	327,300	4,467,645.00	0.14
324	300630	普利制药	126,722	4,454,278.30	0.14
325	600500	中化国际	668,310	4,444,261.50	0.14
326	600808	马钢股份	1,169,400	4,432,026.00	0.14
327	000598	兴蓉环境	866,400	4,427,304.00	0.14
328	600037	歌华有线	471,226	4,424,812.14	0.14
329	002532	天山铝业	675,600	4,411,668.00	0.13
330	002468	申通快递	370,100	4,411,592.00	0.13
331	600663	陆家嘴	425,293	4,406,035.48	0.13
332	600728	佳都科技	680,900	4,398,614.00	0.13
333	688208	道通科技	132,778	4,371,051.76	0.13
334	002595	豪迈科技	194,585	4,347,028.90	0.13
335	600567	山鹰国际	1,564,000	4,332,280.00	0.13
336	600517	国网英大	829,800	4,306,662.00	0.13
337	002004	华邦健康	765,793	4,273,124.94	0.13
338	603866	桃李面包	257,805	4,266,672.75	0.13
339	603225	新凤鸣	369,716	4,266,522.64	0.13
340	300463	迈克生物	207,914	4,260,157.86	0.13
341	688289	圣湘生物	143,840	4,259,102.40	0.13
342	601456	国联证券	347,100	4,258,917.00	0.13
343	600597	光明乳业	333,823	4,216,184.49	0.13
344	000785	居然之家	947,400	4,215,930.00	0.13
345	002745	木林森	431,436	4,215,129.72	0.13
346	002429	兆驰股份	1,094,543	4,203,045.12	0.13
347	300115	长盈精密	406,344	4,189,406.64	0.13
348	300888	稳健医疗	62,800	4,176,200.00	0.13
349	601958	金铂股份	468,300	4,139,772.00	0.13
350	300166	东方国信	446,396	4,115,771.12	0.13
351	688006	杭可科技	58,478	4,096,968.68	0.13
352	601106	中国一重	1,326,600	4,072,662.00	0.12
353	601860	紫金银行	1,416,700	4,065,929.00	0.12
354	002390	信邦制药	588,368	4,065,622.88	0.12
355	300072	三聚环保	796,181	4,028,675.86	0.12
356	603927	中科软	172,076	4,012,812.32	0.12
357	600572	康恩贝	902,715	3,999,027.45	0.12
358	601118	海南橡胶	833,600	3,984,608.00	0.12
359	600398	海澜之家	835,600	3,969,100.00	0.12

360	601718	际华集团	1,274,000	3,949,400.00	0.12
361	600507	方大特钢	564,473	3,945,666.27	0.12
362	000540	中天金融	2,032,725	3,923,159.25	0.12
363	600737	中粮糖业	517,386	3,890,742.72	0.12
364	603883	老百姓	113,838	3,856,831.44	0.12
365	600582	天地科技	806,800	3,856,504.00	0.12
366	000089	深圳机场	495,791	3,827,506.52	0.12
367	000937	冀中能源	512,500	3,823,250.00	0.12
368	000559	万向钱潮	638,961	3,795,428.34	0.12
369	002368	太极股份	196,995	3,784,273.95	0.12
370	002048	宁波华翔	236,205	3,784,004.10	0.12
371	600967	内蒙一机	411,832	3,755,907.84	0.11
372	000898	鞍钢股份	1,159,100	3,732,302.00	0.11
373	600435	北方导航	432,910	3,731,684.20	0.11
374	600871	石化油服	1,968,500	3,720,465.00	0.11
375	601000	唐山港	1,432,966	3,697,052.28	0.11
376	001914	招商积余	205,734	3,697,039.98	0.11
377	002690	美亚光电	170,278	3,691,627.04	0.11
378	601568	北元集团	576,600	3,655,644.00	0.11
379	600195	中牧股份	294,682	3,612,801.32	0.11
380	002110	三钢闽光	592,859	3,610,511.31	0.11
381	600556	天下秀	437,900	3,603,917.00	0.11
382	000959	首钢股份	756,147	3,599,259.72	0.11
383	002281	光迅科技	203,623	3,579,692.34	0.11
384	601333	广深铁路	1,639,800	3,574,764.00	0.11
385	000156	华数传媒	448,500	3,574,545.00	0.11
386	002233	塔牌集团	403,381	3,569,921.85	0.11
387	688321	微芯生物	140,639	3,542,696.41	0.11
388	002705	新宝股份	159,765	3,513,232.35	0.11
389	000537	广宇发展	270,100	3,508,599.00	0.11
390	600811	东方集团	1,238,532	3,505,045.56	0.11
391	003035	南网能源	549,500	3,489,325.00	0.11
392	002010	传化智联	541,900	3,484,417.00	0.11
393	600764	中国海防	137,401	3,468,001.24	0.11
394	002174	游族网络	354,363	3,462,126.51	0.11
395	000402	金融街	578,500	3,442,075.00	0.11
396	600329	达仁堂	138,509	3,404,551.22	0.10
397	300212	易华录	193,959	3,374,886.60	0.10
398	600120	浙江东方	841,127	3,372,919.27	0.10
399	002416	爱施德	359,541	3,343,731.30	0.10
400	600126	杭钢股份	653,040	3,343,564.80	0.10
401	000488	晨鸣纸业	592,312	3,340,639.68	0.10



402	603638	艾迪精密	162,640	3,334,120.00	0.10
403	600167	联美控股	443,250	3,319,942.50	0.10
404	000990	诚志股份	302,700	3,314,565.00	0.10
405	600446	金证股份	319,300	3,314,334.00	0.10
406	601200	上海环境	326,098	3,313,155.68	0.10
407	002867	周大生	212,498	3,300,093.94	0.10
408	000685	中山公用	428,763	3,292,899.84	0.10
409	601098	中南传媒	347,600	3,281,344.00	0.10
410	002081	金螳螂	645,693	3,280,120.44	0.10
411	600373	中文传媒	328,200	3,278,718.00	0.10
412	002382	蓝帆医疗	341,204	3,258,498.20	0.10
413	002925	盈趣科技	151,309	3,256,169.68	0.10
414	600707	彩虹股份	694,500	3,250,260.00	0.10
415	000158	常山北明	540,945	3,245,670.00	0.10
416	601611	中国核建	384,400	3,225,116.00	0.10
417	001965	招商公路	418,000	3,189,340.00	0.10
418	002146	荣盛发展	1,051,800	3,186,954.00	0.10
419	600095	湘财股份	413,900	3,182,891.00	0.10
420	601608	中信重工	838,743	3,178,835.97	0.10
421	002399	海普瑞	180,652	3,175,862.16	0.10
422	603317	天味食品	110,928	3,158,120.16	0.10
423	002387	维信诺	468,209	3,146,364.48	0.10
424	688029	南微医学	36,072	3,145,478.40	0.10
425	600131	国网信通	231,500	3,113,675.00	0.10
426	000967	盈峰环境	614,945	3,111,621.70	0.10
427	688088	虹软科技	97,768	3,088,491.12	0.09
428	002948	青岛银行	853,140	3,088,366.80	0.09
429	000528	柳工	472,752	3,077,615.52	0.09
430	600376	首开股份	623,669	3,062,214.79	0.09
431	601187	厦门银行	510,800	3,044,368.00	0.09
432	600623	华谊集团	365,200	3,031,160.00	0.09
433	603000	人民网	267,400	2,994,880.00	0.09
434	002423	中粮资本	446,200	2,994,002.00	0.09
435	000563	陕国投 A	958,479	2,990,454.48	0.09
436	600901	江苏租赁	578,100	2,965,653.00	0.09
437	601598	中国外运	762,400	2,958,112.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	1,514,200	2,937,548.00	0.09
439	600006	东风汽车	386,432	2,917,561.60	0.09
440	601991	大唐发电	1,200,000	2,916,000.00	0.09
441	300257	开山股份	193,048	2,887,998.08	0.09
442	603228	景旺电子	123,480	2,880,788.40	0.09
443	603650	彤程新材	87,200	2,840,976.00	0.09

444	600906	财达证券	314,600	2,828,254.00	0.09
445	000961	中南建设	925,800	2,823,690.00	0.09
446	600717	天津港	700,712	2,809,855.12	0.09
447	002242	九阳股份	148,218	2,721,282.48	0.08
448	002434	万里扬	318,142	2,720,114.10	0.08
449	000718	苏宁环球	733,691	2,699,982.88	0.08
450	601928	凤凰传媒	369,200	2,639,780.00	0.08
451	000671	阳光城	1,201,400	2,631,066.00	0.08
452	000415	渤海租赁	1,196,343	2,596,064.31	0.08
453	000553	安道麦 A	211,100	2,556,421.00	0.08
454	600968	海油发展	983,100	2,536,398.00	0.08
455	601969	海南矿业	294,900	2,533,191.00	0.08
456	000031	大悦城	621,783	2,487,132.00	0.08
457	600648	外高桥	180,600	2,456,160.00	0.08
458	600787	中储股份	423,670	2,410,682.30	0.07
459	600928	西安银行	644,600	2,365,682.00	0.07
460	600339	中油工程	811,100	2,344,079.00	0.07
461	002563	森马服饰	390,700	2,312,944.00	0.07
462	300869	康泰医学	78,400	2,215,584.00	0.07
463	601228	广州港	599,000	2,198,330.00	0.07
464	000028	国药一致	72,994	2,174,491.26	0.07
465	002815	崇达技术	169,142	2,166,709.02	0.07
466	600835	上海机电	155,675	2,137,417.75	0.07
467	688819	天能股份	60,863	2,104,642.54	0.06
468	600377	宁沪高速	240,100	2,057,657.00	0.06
469	000717	韶钢松山	585,100	2,047,850.00	0.06
470	603056	德邦股份	148,967	2,000,626.81	0.06
471	002945	华林证券	130,500	1,990,125.00	0.06
472	000869	张裕 A	66,662	1,982,527.88	0.06
473	603379	三美股份	89,076	1,981,941.00	0.06
474	601139	深圳燃气	278,300	1,931,402.00	0.06
475	000062	深圳华强	151,521	1,924,316.70	0.06
476	600299	安迪苏	195,300	1,870,974.00	0.06
477	601298	青岛港	339,700	1,858,159.00	0.06
478	601869	长飞光纤	59,983	1,854,674.36	0.06
479	603868	飞科电器	23,005	1,742,628.75	0.05
480	001872	招商港口	109,711	1,711,491.60	0.05
481	300741	华宝股份	60,600	1,685,892.00	0.05
482	601156	东航物流	85,100	1,684,980.00	0.05
483	002653	海思科	104,290	1,680,111.90	0.05
484	600823	世茂股份	543,900	1,620,822.00	0.05
485	601828	美凯龙	261,896	1,587,089.76	0.05

486	600350	山东高速	302,200	1,586,550.00	0.05
487	600927	永安期货	78,200	1,577,294.00	0.05
488	001227	兰州银行	304,200	1,496,664.00	0.05
489	603355	莱克电气	55,298	1,395,168.54	0.04
490	603786	科博达	21,100	1,299,127.00	0.04
491	603515	欧普照明	73,865	1,288,944.25	0.04
492	001203	大中矿业	109,600	1,238,480.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	243,600	1,188,768.00	0.04
494	603719	良品铺子	38,600	1,105,118.00	0.03
495	002946	新乳业	84,500	1,097,655.00	0.03
496	601003	柳钢股份	248,047	1,004,590.35	0.03
497	002901	大博医疗	22,000	861,080.00	0.03
498	600956	新天绿能	69,000	850,080.00	0.03
499	603983	丸美股份	25,100	672,680.00	0.02
500	600917	重庆燃气	84,300	608,646.00	0.02

### 7.3.2 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	688207	格灵深瞳	13,391	353,254.58	0.01
2	688306	均普智能	47,094	244,417.86	0.01
3	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
4	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
5	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
6	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
7	688175	高凌信息	2,851	91,887.73	0.00
8	688193	仁度生物	1,635	84,316.95	0.00
9	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
10	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
11	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
12	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
13	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
14	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
15	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
16	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
17	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
18	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
19	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
20	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
21	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
22	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
23	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00

24	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
25	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
26	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
27	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
28	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
29	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
30	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
31	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
32	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
33	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
34	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
35	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
36	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
37	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
38	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
39	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
40	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
41	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
42	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
43	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
44	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
45	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
46	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
47	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
48	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
49	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
50	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
51	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
52	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600096	云天化	20,322,326.26	0.55
2	300769	德方纳米	18,641,146.46	0.51
3	688099	晶晨股份	17,943,723.66	0.49
4	689009	九号公司	17,936,270.05	0.49
5	300012	华测检测	17,758,798.22	0.48
6	002497	雅化集团	17,311,144.00	0.47
7	002240	盛新锂能	16,964,920.00	0.46
8	688005	容百科技	16,448,979.10	0.45

9	688180	君实生物	15,878,097.93	0.43
10	600563	法拉电子	15,478,186.90	0.42
11	300390	天华超净	14,407,535.00	0.39
12	002407	多氟多	14,325,936.28	0.39
13	688122	西部超导	14,219,171.72	0.39
14	601058	赛轮轮胎	14,185,500.00	0.38
15	688777	中控技术	13,198,546.01	0.36
16	300073	当升科技	13,056,763.06	0.35
17	600522	中天科技	13,018,285.90	0.35
18	002756	永兴材料	12,954,786.00	0.35
19	601108	财通证券	12,839,200.75	0.35
20	601615	明阳智能	11,789,337.00	0.32

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688005	容百科技	40,668,364.87	1.10
2	600188	兖矿能源	32,621,924.61	0.88
3	688099	晶晨股份	28,420,692.17	0.77
4	601117	中国化学	28,166,176.00	0.76
5	600884	杉杉股份	25,577,583.68	0.69
6	000733	振华科技	24,238,719.00	0.66
7	600563	法拉电子	23,913,591.92	0.65
8	605358	立昂微	23,584,053.45	0.64
9	601689	拓普集团	23,007,545.96	0.62
10	600754	锦江酒店	22,270,300.70	0.60
11	600522	中天科技	22,242,378.17	0.60
12	300751	迈为股份	22,061,474.50	0.60
13	600256	广汇能源	19,603,136.39	0.53
14	002340	格林美	19,128,414.11	0.52
15	600157	永泰能源	18,421,668.00	0.50
16	601615	明阳智能	18,060,229.40	0.49
17	603267	鸿远电子	17,749,076.78	0.48
18	300763	锦浪科技	17,201,000.50	0.47
19	603893	瑞芯微	16,840,368.70	0.46
20	600486	扬农化工	16,129,525.70	0.44

#### 7.4.3 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	1,594,567,702.26
卖出股票收入（成交）总额	2,113,464,307.90

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 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。

### 7.5 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）	177,933.53	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	177,933.53	0.01

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	127064	杭氧转债	1,779	177,933.53	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,150,525.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,666,890.54
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	349,651.23
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,167,067.11

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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	600522	中天科技	7,144,830.00	0.22	转融通出借证券
2	601615	明阳智能	6,432,140.00	0.20	转融通出借证券

3	600256	广汇能源	5,490,286.00	0.17	转融通出借证券
4	600096	云天化	4,583,488.00	0.14	转融通出借证券
5	300012	华测检测	4,412,221.00	0.13	转融通出借证券
6	002497	雅化集团	4,254,295.00	0.13	转融通出借证券
7	002407	多氟多	4,235,606.00	0.13	转融通出借证券
8	002240	盛新锂能	4,152,768.00	0.13	转融通出借证券

### 7.12.5.2 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	688207	格灵深瞳	353,254.58	0.01	新股锁定
2	688306	均普智能	244,417.86	0.01	新股锁定
3	301175	中科环保	243,311.08	0.01	新发未上市
4	301139	元道通信	217,337.46	0.01	新发未上市
5	301239	普瑞眼科	174,037.80	0.01	新发未上市
5	301239	普瑞眼科	19,348.75	0.00	新股锁定

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 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 (%)
14,602	34,287.76	431,229,550.00	86.13	69,440,381.00	13.87

#### 8.1.2 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	320,079,364.00	63.93



## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	16,876,324.00	3.37
2	申万宏源证券有限公司	16,285,898.00	3.25
3	华泰证券股份有限公司	9,384,566.00	1.87
4	韩国产业银行—自有资金账户（R）	8,335,986.00	1.66
5	中国国际金融股份有限公司	6,804,255.00	1.36
6	中信证券—浦发银行—中信证券星辰 54 号集合资产管理计划	6,412,494.00	1.28
7	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	5,958,080.00	1.19
8	广发证券股份有限公司	3,364,204.00	0.67
9	龙飞	3,356,692.00	0.67
10	东方证券股份有限公司	3,284,944.00	0.66
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	320,079,364.00	63.93

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	970.00	0.00

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	449,131,868.00
本报告期基金总申购份额	436,400,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	437,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	52,338,063.00
本报告期期末基金份额总额	500,669,931.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022年5月12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》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

中信建投 证券股份 有限公司	6	2,243,450,05 1.21	60.89	236,255.85	19.99	-
长江证券 股份有限 公司	1	646,111,878. 58	17.54	408,386.03	34.55	-
招商证券 股份有限 公司	1	517,600,879. 54	14.05	362,323.61	30.65	-
广发证券 股份有限 公司	3	157,752,709. 44	4.28	99,592.55	8.43	-
华西证券 股份有限 公司	2	98,940,410.2 0	2.69	62,462.87	5.28	-
开源证券 股份有限 公司	2	20,666,482.3 9	0.56	13,046.83	1.10	-
安信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
财信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
光大证券 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	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限	2	-	-	-	-	-

公司						
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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. 报告期内，本基金新增以下交易单元：中信建投证券股份有限公司新增交易单元 2 个，安信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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的比例 (%)
中信建投证券股份有限公司	948,239.73	37.14	109,000,000.00	3.33	-	-
长江证券股份有限公司	323,700.40	12.68	1,913,000,000.00	58.38	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	873,708.77	34.22	780,000,000.00	23.80	-	-
华西证券股份有限公司	407,582.80	15.96	213,000,000.00	6.50	-	-

开源证券股份有限公司			-262,000,000.00	8.00		
安信证券股份有限公司						
北京高华证券有限责任公司						
财信证券股份有限公司						
光大证券股份有限公司						
国泰君安证券股份有限公司						
国元证券股份有限公司						
海通证券股份有限公司						
华泰证券股份有限公司						
申万宏源证券有限公司						
西部证券股份有限公司						
兴业证券股份有限公司						

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务的公告	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	2022 年 2 月 14 日
2	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额拆分结果及恢复申购、赎回的公告	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	2022 年 2 月 18 日

3	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增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	2022 年 3 月 25 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	2022 年 5 月 12 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	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	2022 年 6 月 23 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	2022-01-01 至 2022-06-30	265,970,831.00	357,656,220.00	303,547,687.00	320,079,364.00	63.93
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>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 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

## 12.3 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 8 月 29 日