

**华夏中证 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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	90
7.1 期末基金资产组合情况.....	90
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	91
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.....	91
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	104
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	105
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.....	106
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.....	106
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.....	106
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.....	106
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	106
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	106
7.12 投资组合报告附注.....	106
§8 基金份额持有人信息.....	108
§9 开放式基金份额变动.....	109
§10 重大事件揭示.....	109
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	112
§12 备查文件目录.....	113

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500（扩位证券简称：500ETF 基金）
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,220,008,794 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 29 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
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 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-308,489,874.93
本期利润	-539,639,094.99
加权平均基金份额本期利润	-0.4166
本期加权平均净值利润率	-12.47%
本期基金份额净值增长率	-11.15%
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	-1,404,077,993.02
期末可供分配基金份额利润	-1.1509
期末基金资产净值	4,169,616,134.58
期末基金份额净值	3.4177
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	-25.19%

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个	8.13%	1.11%	7.10%	1.10%	1.03%	0.01%

月						
过去三个月	3.44%	1.75%	2.04%	1.75%	1.40%	0.00%
过去六个月	-11.15%	1.63%	-12.30%	1.63%	1.15%	0.00%
过去一年	-3.64%	1.32%	-5.20%	1.33%	1.56%	-0.01%
过去三年	38.01%	1.34%	30.37%	1.35%	7.64%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-25.19%	1.67%	-24.16%	1.71%	-1.03%	-0.04%

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

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 5 月 5 日至 2022 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日, 是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管

理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2022 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188；在养老目标日期 FOF(2040)(A 类)中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/14；在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77；在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52；在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏行业景气混合排序第 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 59/286；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排序第 1/25；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 3/13；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 7/98；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642；在偏债型基金(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排序第 4/19；在

规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A类)排序第 15/60；在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A类)排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证 500ETF 联接(A类)排序第 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2016-10-20	-	12 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式

					<p>指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理（2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间）等。</p>
--	--	--	--	--	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年，国内疫情一度遭遇反复，常态化核酸检测似乎是目前平衡疫情防控和经济发展的有效手段，国内就业压力较大，房地产行业下行。货币和信用持续保持宽松，积极的财政政策和各种产业政策托底经济，房地产继续因城施策、保持定力，鼓励平台经济健康发展。

海外通胀压力加大，欧美央行纷纷加息，欧元区负利率债券大面积消失，全球流动性成本上升，发达经济体面临以牺牲经济增长为代价对抗通胀的艰难处境。

市场方面，上半年 A 股经历过过山车，背后的经济周期是内在下行动力，积极的财政和货币政策是反弹上行动力，市场筹码结构的变化加大了波动幅度。市场贝塔的大幅波动，使得宽基 ETF 在抄底时的工具化优势得以显现。结构方面，下跌阶段低估值行业表现出相对收益，反弹阶段新能源赛道表现出弹性。市场主线依旧是围绕能源行业，代表旧能源的煤炭、石油表现优异，代表新能源的新能源车、光伏、风电、储能备受追捧。

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

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

大证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、海通证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 3.4177 元,本报告期份额净值增长率为-11.15%,同期业绩比较基准增长率-12.30%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.15%,与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国内经济处于衰退象限向复苏象限转换的阶段,财政和货币政策依旧对宏观经济有利,通胀不会成为掣肘货币政策的因素;欧美处于加息抑制通胀的阶段,经济周期逐步向衰退转化,因此我国在相对有利的周期位置上,全球视角下的人民币资产具备相对吸引力。如果发生以下风险,将会提供非常好的长期配置机会,譬如美联储缩表对全球流动性显现出负面影响,海外经济衰退预期加剧引发国内出口担忧。内因是事物变化的根据,外因是事物变化的条件。未来一旦国内经济迈入复苏象限,很可能意味着市场新一轮上升周期的开始。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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,本基金利润分配情况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 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,790,067.52	18,915,848.02
结算备付金		66,052,523.34	111,669,799.97
存出保证金		12,273,834.08	18,072,471.40
交易性金融资产	6.4.7.2	4,086,116,635.07	5,881,802,889.38
其中：股票投资		4,085,852,685.33	5,881,398,889.38
基金投资		-	-
债券投资		263,949.74	404,000.00
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	-	-
应收清算款		100,556,271.41	6,147,039.08

应收股利		3,016,089.30	5,858.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	563,471.11	341,480.46
资产总计		4,283,368,891.83	6,036,955,386.31
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		89,362,977.03	5,948,649.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,731,768.32	2,237,486.93
应付托管费		346,353.68	447,497.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,429.83	85,348.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	22,285,228.39	15,521,636.07
负债合计		113,752,757.25	24,240,618.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,573,694,127.60	7,141,626,945.66
未分配利润	6.4.7.8	-1,404,077,993.02	-1,128,912,177.83
净资产合计		4,169,616,134.58	6,012,714,767.83
负债和净资产总计		4,283,368,891.83	6,036,955,386.31

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.4177 元，基金份额总额 1,220,008,794.00 份。

②以下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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 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
一、营业总收入		-525,936,875.82	382,635,513.63
1.利息收入		4,995,757.63	4,829,388.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	641,613.47	851,232.27
债券利息收入		-	577.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	10,602.74
证券出借利息收入		4,354,144.16	3,966,975.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-304,711,493.44	367,895,460.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-341,531,508.06	326,897,097.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	574,331.59	405,664.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-9,186,093.74	8,511,650.48
股利收益	6.4.7.14	45,431,776.77	32,081,047.70
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-231,149,220.06	-3,598,527.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,928,080.05	13,509,192.73
减：二、营业总支出		13,702,219.17	20,238,472.42
1.管理人报酬		10,775,301.91	9,259,767.71
2.托管费		2,155,060.39	1,851,953.43
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		15,680.97	37,439.82
8.其他费用	6.4.7.18	756,175.90	9,089,311.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-539,639,094.99	362,397,041.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-539,639,094.99	362,397,041.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-539,639,094.99	362,397,041.21

注：以下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》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	7,141,626,945.66	-	-1,128,912,177.83	6,012,714,767.83
二、本期期初净资产（基金净值）	7,141,626,945.66	-	-1,128,912,177.83	6,012,714,767.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,567,932,818.06	-	-275,165,815.19	-1,843,098,633.25
（一）、综合收益总额	-	-	-539,639,094.99	-539,639,094.99
（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）	-1,567,932,818.06	-	264,473,279.80	-1,303,459,538.26
其中：1.基金申购款	4,360,242,074.35	-	-1,307,364,903.19	3,052,877,171.16
2.基金赎回款	-5,928,174,892.41	-	1,571,838,182.99	-4,356,336,709.42
（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、本期期末净资产（基金净值）	5,573,694,127.60	-	-1,404,077,993.02	4,169,616,134.58
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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,521,731,909.79	-	-2,118,505,369.89	5,403,226,539.90

产（基金净值）				
二、本期期初净资产（基金净值）	7,521,731,909.79	-	-2,118,505,369.89	5,403,226,539.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,401,239,779.56	-	973,425,952.54	-1,427,813,827.02
（一）、综合收益总额	-	-	362,397,041.21	362,397,041.21
（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）	-2,401,239,779.56	-	611,028,911.33	-1,790,210,868.23
其中：1.基金申购款	6,191,324,488.95	-	-1,709,295,848.28	4,482,028,640.67
2.基金赎回款	-8,592,564,268.51	-	2,320,324,759.61	-6,272,239,508.90
（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、本期期末净资产（基金净值）	5,120,492,130.23	-	-1,145,079,417.35	3,975,412,712.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和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

除下述变更后的会计政策外，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。

6.4.5 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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的

要求,本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,将金融工具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。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。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。

新金融工具准则要求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 2021 年 12 月 31 日,银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、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,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,同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准,计提损失准备 0.00 元,对本基金期初未分配利润无影响。

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、应收利息、应收证券清算款和应收股利,金额分别为 18,915,848.02 元、111,669,799.97 元、18,072,471.40 元、341,480.46 元、6,147,039.08 元和 5,858.00 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、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利,金额分别为 18,918,590.39 元、111,731,084.30 元、18,073,118.64 元、276,757.63 元、6,147,039.08 元和 5,858.00 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 5,881,802,889.38 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 5,881,802,938.27 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 5,948,649.58 元、2,237,486.93 元、447,497.36

元、7,714,043.30 元和 7,807,592.77 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 5,948,649.58 元、2,237,486.93 元、447,497.36 元、7,714,043.30 元和 7,807,592.77 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价

暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	14,790,067.52
等于：本金	14,788,321.35
加：应计利息	1,746.17
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	14,790,067.52

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	4,079,318,854.67	-	4,085,852,685.33	6,533,830.66	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	263,900.00	49.74	263,949.74	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	263,900.00	49.74	263,949.74	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,079,582,754.67	49.74	4,086,116,635.07	6,533,830.66	

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	72,908,760.00	-	-	-
其中：股指期货	72,908,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	72,908,760.00	-	-	-

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
IC2209	中证 500 期货 IC2209 合约	35.00	44,548,000.00	1,615,880.00
IC2207	中证 500 期	14.00	18,016,880.00	538,240.00

	货 IC2207 合约			
IC2208	中证 500 期 货 IC2208 合约	10.00	12,792,400.00	294,400.00
合计	-	-	-	2,448,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	2,448,520.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，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指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 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	563,471.11
待摊费用	-
合计	563,471.11

6.4.7.6 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	8,538,769.29
其中：交易所市场	8,538,769.29
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	109,095.94
应付指数使用费	646,518.14
应退替代款	12,979,678.12
可退替代款	11,166.90
合计	22,285,228.39

6.4.7.7 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	1,563,208,794.00	7,141,626,945.66
本期申购	954,400,000.00	4,360,242,074.35
本期赎回（以“-”号填列）	-1,297,600,000.00	-5,928,174,892.41
本期末	1,220,008,794.00	5,573,694,127.60

6.4.7.8 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	588,537,039.66	-1,717,449,217.49	-1,128,912,177.83
本期利润	-308,489,874.93	-231,149,220.06	-539,639,094.99
本期基金份额交易产生的变动数	-113,381,833.99	377,855,113.79	264,473,279.80
其中：基金申购款	245,893,965.49	-1,553,258,868.68	-1,307,364,903.19
基金赎回款	-359,275,799.48	1,931,113,982.47	1,571,838,182.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,665,330.74	-1,570,743,323.76	-1,404,077,993.02

6.4.7.9 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
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	583,587.83
其他	12,215.85
合计	641,613.47

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	-244,035,390.92
股票投资收益——赎回差价收入	-97,496,117.14
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	-341,531,508.06

6.4.7.10.2 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	3,060,786,510.39
减：卖出股票成本总额	3,298,870,255.81
减：交易费用	5,951,645.50
买卖股票差价收入	-244,035,390.92

6.4.7.10.3 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	4,356,336,709.42
减：现金支付赎回款总额	2,134,248,182.42
减：赎回股票成本总额	2,319,584,644.14
减：交易费用	-
赎回差价收入	-97,496,117.14

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	664.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	573,667.54

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	574,331.59

6.4.7.11.2 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	3,916,075.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,341,600.00
减：应计利息总额	683.14
减：交易费用	124.60
买卖债券差价收入	573,667.54

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-9,186,093.74

6.4.7.14 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	45,431,776.77
其中：证券出借权益补偿收入	5,724,429.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	45,431,776.77

6.4.7.15 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	-232,392,540.06
——股票投资	-232,392,540.06
——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	1,243,320.00
——权证投资	-
——期货投资	1,243,320.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-231,149,220.06

6.4.7.16 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	-
基金申购费收入	-
替代损益	4,928,080.05
合计	4,928,080.05

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	424.33
指数使用费	646,518.14
存托服务费	137.49
合计	756,175.90

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	2,360,575,086.36	42.49%	4,091,973,658.92	52.62%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	3,133,716.18	80.02%	4,694,556.01	66.93%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	15,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	1,018,239.95	42.49%	804,777.43	9.42%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	1,764,898.34	52.62%	247,612.96	3.54%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	10,775,301.91	9,259,767.71
其中：支付销售机构的客户维护费	137,233.12	130,441.41

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

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	2,155,060.39	1,851,953.43

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	1,065,184,562.96	710,709.59	315,609.00	303.04
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	363,721,914.13	500,489.18	737,492.00	203.24

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位： 股)	出借期限 (单位： 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2022011200015469	蓝色光标	2022-01-12	1,942,330.00	174,200.00	14	4.90	3,701.22	-	-
中信	2022011200015487	华宇	2022-01-12	387,810.00	31,000.00	14	3.30	497.69	-	-

证券		软件								
中信证券	2022011200015489	红日药业	2022-01-12	698,220.00	81,000.00	14	3.60	977.51	-	-
中信证券	2022011200015491	海新能科	2022-01-12	231,710.00	29,000.00	14	3.50	315.38	-	-
中信证券	2022011400019918	新宙邦	2022-01-14	1,241,408.00	11,900.00	14	2.80	1,351.76	-	-
中信证券	2022011400019920	长盈精密	2022-01-14	503,712.00	29,700.00	14	3.30	646.43	-	-
中信证券	2022011400019922	长信科技	2022-01-14	1,200,405.00	101,300.00	14	3.10	1,447.15	-	-
中信证券	2022011400019924	安科生物	2022-01-14	666,444.00	47,400.00	14	2.60	673.85	-	-
中信证券	2022011400019926	红日药业	2022-01-14	620,496.00	74,400.00	14	3.60	868.69	-	-
中信证券	2022011400019928	特锐德	2022-01-14	599,324.00	25,700.00	14	3.00	699.21	-	-
中信证券	2022011400020170	网宿科技	2022-01-14	544,181.00	81,100.00	14	3.50	740.69	-	-
中信证券	2022011400020172	机器人	2022-01-14	572,680.00	51,500.00	14	3.60	801.75	-	-
中信	2022011400020174	碧水	2022-01-14	655,338.00	91,400.00	14	3.60	917.47	-	-

证券		源								
中信证券	2022011400020176	华宇软件	2022-01-14	421,344.00	34,200.00	14	3.50	573.50	-	-
中信证券	2022011400020178	利亚德	2022-01-14	916,440.00	84,000.00	14	3.40	1,211.74	-	-
中信证券	2022011400020180	万达信息	2022-01-14	567,596.00	49,100.00	14	3.50	772.56	-	-
中信证券	2022011400020182	迪安诊断	2022-01-14	693,804.00	17,900.00	14	3.50	944.34	-	-
中信证券	2022011400020202	易华录	2022-01-14	520,080.00	16,500.00	14	3.40	687.66	-	-
中信证券	2022011400020776	海新能科	2022-01-14	456,460.00	58,000.00	14	3.50	621.29	-	-
中信证券	2022011400020780	华策影视	2022-01-14	320,070.00	47,000.00	14	3.40	423.20	-	-
中信证券	2022011400020788	国瓷材料	2022-01-14	1,375,305.00	33,100.00	14	3.10	1,658.01	-	-
中信证券	2022011400020792	掌趣科技	2022-01-14	535,056.00	113,600.00	14	3.50	728.27	-	-
中信证券	2022011400020796	我武生物	2022-01-14	568,188.00	10,800.00	14	2.60	574.50	-	-
中信	2022011400020800	卫宁	2022-01-14	1,052,565.00	70,500.00	14	2.10	859.59	-	-

证券		健康								
中信证券	2022011400020802	光线传媒	2022-01-14	552,900.00	48,500.00	14	3.10	666.55	-	-
中信证券	2022011400020804	开山股份	2022-01-14	274,700.00	16,400.00	14	3.50	373.90	-	-
中信证券	2022011400020806	北京君正	2022-01-14	1,095,120.00	10,400.00	14	3.50	1,490.58	-	-
中信证券	2022011400020808	东方国信	2022-01-14	363,303.00	33,300.00	14	2.20	310.83	-	-
中信证券	2022011400020810	中际旭创	2022-01-14	918,145.00	23,500.00	14	3.20	1,142.58	-	-
中信证券	2022011400020812	汤臣倍健	2022-01-14	913,302.00	35,100.00	14	3.10	1,101.04	-	-
中信证券	2022011400020822	捷成股份	2022-01-14	596,551.00	85,100.00	14	3.40	788.77	-	-
中信证券	2022011400020824	光环新网	2022-01-14	657,850.00	44,600.00	14	7.10	1,816.40	-	-
中信证券	2022011400020826	景嘉微	2022-01-14	1,260,480.00	10,400.00	14	3.30	1,617.62	-	-
中信证券	2022011400020828	寒锐钴业	2022-01-14	812,552.00	10,400.00	14	2.80	884.78	-	-
中信	2022011400020830	光威	2022-01-14	933,248.00	12,800.00	14	3.30	1,197.67	-	-

证券		复材								
中信证券	2022011400020832	迈克生物	2022-01-14	550,298.00	16,100.00	14	2.30	492.21	-	-
中信证券	2022011400020834	万孚生物	2022-01-14	658,900.00	11,000.00	14	2.80	717.47	-	-
中信证券	2022012600010294	海新能科	2022-01-26	233,450.00	29,000.00	14	3.30	299.59	-	-
中信证券	2022012600010296	蓝色光标	2022-01-26	1,611,350.00	174,200.00	14	2.50	1,566.59	-	-
中信证券	2022012600010298	红日药业	2022-01-26	518,400.00	81,000.00	14	2.80	564.48	-	-
中信证券	2022012600011666	华宇软件	2022-01-26	378,200.00	31,000.00	14	3.10	455.94	-	-
中信证券	2022012800020830	万达信息	2022-01-28	577,907.00	49,100.00	14	7.10	1,595.67	-	-
中信证券	2022012800020832	东方国信	2022-01-28	380,952.00	33,300.00	14	2.50	370.37	-	-
中信证券	2022012800020834	易华录	2022-01-28	453,750.00	16,500.00	14	3.00	529.38	-	-
中信证券	2022012800020836	光线传媒	2022-01-28	510,705.00	48,500.00	14	2.90	575.96	-	-
中信	2022012800020838	卫宁	2022-01-28	811,455.00	70,500.00	14	2.80	883.58	-	-

证券		健康								
中信证券	2022012800020840	汤臣倍健	2022-01-28	881,010.00	35,100.00	14	3.30	1,130.63	-	-
中信证券	2022012800020842	迪安诊断	2022-01-28	523,575.00	17,900.00	14	3.20	651.56	-	-
中信证券	2022012800020844	新宙邦	2022-01-28	1,124,907.00	11,900.00	14	2.90	1,268.65	-	-
中信证券	2022012800020846	北京君正	2022-01-28	1,132,560.00	10,400.00	14	2.90	1,277.28	-	-
中信证券	2022012800020848	碧水源	2022-01-28	602,326.00	91,400.00	14	2.90	679.29	-	-
中信证券	2022012800020850	长盈精密	2022-01-28	415,503.00	29,700.00	14	3.20	517.07	-	-
中信证券	2022012800020852	机器人	2022-01-28	520,665.00	51,500.00	14	3.40	688.43	-	-
中信证券	2022012800020854	华策影视	2022-01-28	281,060.00	47,000.00	14	3.10	338.83	-	-
中信证券	2022012800020856	海新能科	2022-01-28	449,500.00	58,000.00	14	3.30	576.86	-	-
中信证券	2022012800021108	捷成股份	2022-01-28	539,534.00	85,100.00	14	3.00	629.46	-	-
中信	2022012800022024	红日	2022-01-28	459,048.00	74,400.00	14	2.80	499.85	-	-

证券		药业								
中信证券	2022012800022026	光威复材	2022-01-28	920,576.00	12,800.00	14	2.90	1,038.21	-	-
中信证券	2022012800022028	长信科技	2022-01-28	1,034,273.00	101,300.00	14	3.20	1,287.10	-	-
中信证券	2022012800022030	万孚生物	2022-01-28	402,600.00	11,000.00	14	3.20	501.01	-	-
中信证券	2022012800022032	开山股份	2022-01-28	250,592.00	16,400.00	14	2.60	253.38	-	-
中信证券	2022012800022034	寒锐钴业	2022-01-28	733,512.00	10,400.00	14	3.20	912.81	-	-
中信证券	2022012800022036	景嘉微	2022-01-28	1,176,864.00	10,400.00	14	3.10	1,418.77	-	-
中信证券	2022012800022038	国瓷材料	2022-01-28	1,327,310.00	33,100.00	14	2.40	1,238.82	-	-
中信证券	2022012800022040	利亚德	2022-01-28	761,880.00	84,000.00	14	3.00	888.86	-	-
中信证券	2022012800022042	光环新网	2022-01-28	593,626.00	44,600.00	14	7.10	1,639.07	-	-
中信证券	2022012800022044	迈克生物	2022-01-28	401,373.00	16,100.00	14	2.90	452.66	-	-
中信	2022012800022046	中际	2022-01-28	841,300.00	23,500.00	14	2.70	883.37	-	-

证券		旭创								
中信证券	2022012800022048	掌趣科技	2022-01-28	421,456.00	113,600.00	14	3.40	557.26	-	-
中信证券	2022012800022050	华宇软件	2022-01-28	392,616.00	34,200.00	14	3.10	473.32	-	-
中信证券	2022012800022052	我武生物	2022-01-28	497,448.00	10,800.00	14	3.20	619.05	-	-
中信证券	2022012800022054	网宿科技	2022-01-28	470,380.00	81,100.00	14	3.40	621.95	-	-
中信证券	2022012800022056	特锐德	2022-01-28	523,766.00	25,700.00	14	3.00	611.06	-	-
中信证券	2022012800022058	安科生物	2022-01-28	497,700.00	47,400.00	14	3.20	619.36	-	-
中信证券	2022020900016618	红日药业	2022-02-09	538,650.00	81,000.00	14	3.40	712.22	-	-
中信证券	2022020900016620	蓝色光标	2022-02-09	1,546,896.00	174,200.00	14	2.90	1,744.55	-	-
中信证券	2022020900016628	海新能科	2022-02-09	236,930.00	29,000.00	14	3.60	331.70	-	-
中信证券	2022020900016636	华宇软件	2022-02-09	372,310.00	31,000.00	14	3.50	506.76	-	-
中信	2022021100018252	万达	2022-02-11	613,750.00	49,100.00	14	3.60	859.25	-	-

证券		信息								
中信证券	2022021100018254	迈克生物	2022-02-11	424,074.00	16,100.00	14	3.30	544.23	-	-
中信证券	2022021100018256	光环新网	2022-02-11	620,832.00	44,600.00	14	3.80	917.45	-	-
中信证券	2022021100018258	利亚德	2022-02-11	750,120.00	84,000.00	14	3.20	933.48	-	-
中信证券	2022021100018260	网宿科技	2022-02-11	502,009.00	81,100.00	14	3.00	585.68	-	-
中信证券	2022021100018262	特锐德	2022-02-11	526,850.00	25,700.00	14	3.00	614.66	-	-
中信证券	2022021100018264	我武生物	2022-02-11	461,808.00	10,800.00	14	3.40	610.61	-	-
中信证券	2022021100018266	光线传媒	2022-02-11	484,030.00	48,500.00	14	2.70	508.23	-	-
中信证券	2022021100018268	易华录	2022-02-11	433,125.00	16,500.00	14	2.30	387.41	-	-
中信证券	2022021100018270	中际旭创	2022-02-11	816,390.00	23,500.00	14	2.70	857.21	-	-
中信证券	2022021100018272	掌趣科技	2022-02-11	446,448.00	113,600.00	14	3.60	625.03	-	-
中信	2022021100018274	华宇	2022-02-11	401,166.00	34,200.00	14	3.50	546.03	-	-

证券		软件								
中信证券	2022021100018276	东方国信	2022-02-11	429,570.00	33,300.00	14	2.70	451.05	-	-
中信证券	2022021100018994	捷成股份	2022-02-11	599,955.00	85,100.00	14	3.70	863.27	-	-
中信证券	2022021100020152	开山股份	2022-02-11	270,928.00	16,400.00	14	3.70	389.84	-	-
中信证券	2022021100020154	光威复材	2022-02-11	851,072.00	12,800.00	14	2.10	695.04	-	-
中信证券	2022021100020156	长信科技	2022-02-11	952,220.00	101,300.00	14	3.30	1,222.02	-	-
中信证券	2022021100020158	万孚生物	2022-02-11	382,360.00	11,000.00	14	3.30	490.70	-	-
中信证券	2022021100020160	红日药业	2022-02-11	448,632.00	74,400.00	14	3.70	645.53	-	-
中信证券	2022021100020162	寒锐钴业	2022-02-11	781,456.00	10,400.00	14	3.30	1,002.87	-	-
中信证券	2022021100020164	景嘉微	2022-02-11	1,110,616.00	10,400.00	14	2.10	907.00	-	-
中信证券	2022021100020168	长盈精密	2022-02-11	356,400.00	29,700.00	14	3.40	471.24	-	-
中信	2022021100020170	海新	2022-02-11	465,160.00	58,000.00	14	3.30	596.96	-	-

证 券		能 科									
中 信 证 券	2022021100020172	碧 水 源	2022-02-11	644,370.00	91,400.00	14	2.00	501.18	-	-	
中 信 证 券	2022021100020174	机 器 人	2022-02-11	531,480.00	51,500.00	14	2.30	475.38	-	-	
中 信 证 券	2022021100020176	北 京 君 正	2022-02-11	1,084,928.00	10,400.00	14	3.40	1,434.52	-	-	
中 信 证 券	2022021100020178	安 科 生 物	2022-02-11	492,960.00	47,400.00	14	3.20	613.46	-	-	
中 信 证 券	2022021100020180	迪 安 诊 断	2022-02-11	506,391.00	17,900.00	14	3.70	728.64	-	-	
中 信 证 券	2022021100020182	华 策 影 视	2022-02-11	277,770.00	47,000.00	14	3.60	388.88	-	-	
中 信 证 券	2022021100020184	新 宙 邦	2022-02-11	1,051,960.00	11,900.00	14	2.20	900.01	-	-	
中 信 证 券	2022021100020186	汤 臣 倍 健	2022-02-11	929,799.00	35,100.00	14	3.30	1,193.24	-	-	
中 信 证 券	2022021100020188	卫 宁 健 康	2022-02-11	813,570.00	70,500.00	14	2.60	822.61	-	-	
中 信 证 券	2022021100020190	国 瓷 材 料	2022-02-11	1,367,030.00	33,100.00	14	3.00	1,594.87	-	-	
中 信	2022022300011464	华 宇	2022-02-23	370,140.00	31,000.00	14	3.50	503.80	-	-	

证券		软件								
中信证券	2022022300011466	红日药业	2022-02-23	546,750.00	81,000.00	14	3.70	786.71	-	-
中信证券	2022022300011468	蓝色光标	2022-02-23	1,386,632.00	174,200.00	14	2.40	1,294.19	-	-
中信证券	2022022300011470	海新能科	2022-02-23	242,440.00	29,000.00	14	3.30	311.13	-	-
中信证券	2022022500017867	易华录	2022-02-25	462,330.00	16,500.00	14	3.10	557.36	-	-
中信证券	2022022500017869	中际旭创	2022-02-25	871,145.00	23,500.00	14	3.40	1,151.85	-	-
中信证券	2022022500017871	卫宁健康	2022-02-25	805,110.00	70,500.00	14	2.50	782.75	-	-
中信证券	2022022500017873	国瓷材料	2022-02-25	1,204,178.00	33,100.00	14	3.00	1,404.87	-	-
中信证券	2022022500017875	光线传媒	2022-02-25	459,295.00	48,500.00	14	2.70	482.26	-	-
中信证券	2022022500017877	碧水源	2022-02-25	609,638.00	91,400.00	14	2.80	663.83	-	-
中信证券	2022022500017879	长盈精密	2022-02-25	360,558.00	29,700.00	14	2.90	406.63	-	-
中信	2022022500017881	机器	2022-02-25	522,725.00	51,500.00	14	2.50	508.20	-	-

证券		人								
中信证券	2022022500017883	万达信息	2022-02-25	617,187.00	49,100.00	14	3.20	768.05	-	-
中信证券	2022022500017885	海新能科	2022-02-25	468,060.00	58,000.00	14	3.50	637.08	-	-
中信证券	2022022500017887	华宇软件	2022-02-25	391,932.00	34,200.00	14	3.40	518.22	-	-
中信证券	2022022500017889	特锐德	2022-02-25	539,443.00	25,700.00	14	3.20	671.31	-	-
中信证券	2022022500017891	开山股份	2022-02-25	261,908.00	16,400.00	14	4.30	437.97	-	-
中信证券	2022022500017893	光威复材	2022-02-25	929,408.00	12,800.00	14	3.30	1,192.74	-	-
中信证券	2022022500019531	捷成股份	2022-02-25	494,431.00	85,100.00	14	3.60	692.20	-	-
中信证券	2022022500019533	红日药业	2022-02-25	503,688.00	74,400.00	14	3.70	724.75	-	-
中信证券	2022022500019535	迈克生物	2022-02-25	435,988.00	16,100.00	14	3.20	542.56	-	-
中信证券	2022022500019537	北京君正	2022-02-25	1,163,760.00	10,400.00	14	3.40	1,538.75	-	-
中信	2022022500019539	万孚	2022-02-25	473,770.00	11,000.00	14	3.40	626.43	-	-

证券		生物									
中信证券	2022022500019541	景嘉微	2022-02-25	1,300,000.00	10,400.00	14	3.10	1,567.22	-	-	
中信证券	2022022500019543	长信科技	2022-02-25	982,610.00	101,300.00	14	3.00	1,146.38	-	-	
中信证券	2022022500019545	华策影视	2022-02-25	263,200.00	47,000.00	14	3.50	358.24	-	-	
中信证券	2022022500019547	网宿科技	2022-02-25	556,346.00	81,100.00	14	3.30	713.98	-	-	
中信证券	2022022500019549	迪安诊断	2022-02-25	544,160.00	17,900.00	14	2.90	613.69	-	-	
中信证券	2022022500019551	新宙邦	2022-02-25	1,128,715.00	11,900.00	14	3.10	1,360.73	-	-	
中信证券	2022022500019553	安科生物	2022-02-25	508,602.00	47,400.00	14	3.10	613.15	-	-	
中信证券	2022022500019555	光环新网	2022-02-25	669,000.00	44,600.00	14	3.90	1,014.65	-	-	
中信证券	2022022500019557	利亚德	2022-02-25	708,960.00	84,000.00	14	3.00	827.12	-	-	
中信证券	2022022500019559	寒锐钴业	2022-02-25	810,368.00	10,400.00	14	3.30	1,039.97	-	-	
中信	2022022500019561	东方	2022-02-25	451,548.00	33,300.00	14	3.30	579.49	-	-	

证 券		国 信									
中 信 证 券	2022022500019563	我 武 生 物	2022-02-25	484,704.00	10,800.00	14	3.10	584.34	-	-	
中 信 证 券	2022022500019565	掌 趣 科 技	2022-02-25	422,592.00	113,600.00	14	3.60	591.63	-	-	
中 信 证 券	2022022500019567	汤 臣 倍 健	2022-02-25	866,268.00	35,100.00	14	3.30	1,111.71	-	-	
中 信 证 券	2022030900015791	海 新 能 科	2022-03-09	200,680.00	29,000.00	14	3.50	273.15	-	-	
中 信 证 券	2022030900015795	华 宇 软 件	2022-03-09	311,240.00	31,000.00	14	3.50	423.63	-	-	
中 信 证 券	2022030900015797	红 日 药 业	2022-03-09	475,470.00	81,000.00	14	3.60	665.66	-	-	
中 信 证 券	2022030900015799	蓝 色 光 标	2022-03-09	1,329,146.00	174,200.00	14	3.30	1,705.74	-	-	
中 信 证 券	2022031700001109	掌 趣 科 技	2022-03-17	321,290.00	89,000.00	28	2.80	699.70	-	-	
中 信 证 券	2022032300012697	华 宇 软 件	2022-03-23	314,030.00	31,000.00	14	3.60	439.64	-	-	
中 信 证 券	2022032300012699	海 新 能 科	2022-03-23	194,880.00	29,000.00	14	3.50	265.25	-	-	
中 信	2022032300012701	红 日	2022-03-23	675,540.00	81,000.00	14	3.80	998.30	-	-	

证券		药业								
中信证券	2022032300012703	蓝色光标	2022-03-23	1,424,956.00	174,200.00	14	2.50	1,385.37	-	-
中信证券	2022040600049527	华宇软件	2022-04-06	303,180.00	31,000.00	14	3.50	412.66	-	-
中信证券	2022040600049529	红日药业	2022-04-06	674,730.00	81,000.00	14	3.20	839.66	-	-
中信证券	2022040600049531	海新能科	2022-04-06	189,660.00	29,000.00	14	3.70	272.90	-	-
中信证券	2022040600049535	蓝色光标	2022-04-06	1,534,702.00	174,200.00	14	3.60	2,148.58	-	-
中信证券	2022041400006901	掌趣科技	2022-04-14	308,830.00	89,000.00	28	3.40	816.68	-	-
中信证券	2022042000043134	红日药业	2022-04-20	503,820.00	81,000.00	14	4.00	839.70	-	-
中信证券	2022042000043136	蓝色光标	2022-04-20	1,153,204.00	174,200.00	14	4.30	2,066.15	-	-
中信证券	2022042000043138	华宇软件	2022-04-20	279,310.00	31,000.00	14	3.40	395.69	-	-
中信证券	2022042000043140	海新能科	2022-04-20	171,100.00	29,000.00	14	3.60	256.65	-	-
中信	2022050500072723	蓝色	2022-05-05	992,940.00	174,200.00	14	3.80	1,467.34	-	-

证券		光标								
中信证券	2022050500072725	红日药业	2022-05-05	479,520.00	81,000.00	14	3.70	689.98	-	-
中信证券	2022050500072731	华宇软件	2022-05-05	210,800.00	31,000.00	14	3.60	295.12	-	-
中信证券	2022051200008934	掌趣科技	2022-05-12	269,670.00	89,000.00	28	3.30	692.15	-	-
中信证券	2022051800003891	红日药业	2022-05-05	3,240.00	-	14	3.70	-	-	-
中信证券	2022051900038813	红日药业	2022-05-19	471,420.00	81,000.00	14	3.70	678.32	-	-
中信证券	2022051900038815	蓝色光标	2022-05-19	1,012,102.00	174,200.00	14	3.30	1,298.86	-	-
中信证券	2022051900038827	华宇软件	2022-05-19	211,730.00	31,000.00	14	3.30	271.72	-	-
中信证券	2022060200013630	蓝色光标	2022-06-02	1,062,620.00	174,200.00	14	6.50	2,686.07	-	-
中信证券	2022060200013632	红日药业	2022-06-02	439,020.00	81,000.00	14	3.40	580.48	-	-
中信证券	2022060600014986	蓝色光标	2022-06-02	7,421.37	-	14	6.50	-	-	-

上年度可比期间
2021年1月1日至2021年6月30日

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借 期限 (单 位: 天)	费率 (%)	利息收 入	期末证券 出借业务 余额	期末 应收 利息 余额
中信证券	2021021800001091	捷成股份	2021-02-18	30,400.00	10,000.00	14	3.50	41.38	-	-
中信证券	2021021800040142	神州泰岳	2021-02-18	190,965.00	43,900.00	28	3.40	505.00	-	-
中信证券	2021021800040144	捷成股份	2021-02-18	142,576.00	46,900.00	28	3.30	365.95	-	-
中信证券	2021021800040146	欣旺达	2021-02-18	678,405.00	24,500.00	28	3.40	1,794.00	-	-
中信证券	2021021800040148	利亚德	2021-02-18	262,890.00	38,100.00	28	3.40	695.20	-	-
中信证券	2021021800040150	长信科技	2021-02-18	430,674.00	53,700.00	28	3.40	1,138.89	-	-
中信证券	2021021800040152	三聚环保	2021-02-18	215,490.00	33,000.00	28	3.40	569.85	-	-
中信证券	2021021800040154	机器人	2021-02-18	327,600.00	28,000.00	28	3.40	866.32	-	-
中信证券	2021021800040156	阳光电源	2021-02-18	2,713,780.00	23,500.00	28	3.40	7,176.44	-	-
中信证	2021021800040158	万达信	2021-02-18	370,512.00	18,600.00	28	3.50	1,008.62	-	-

券		息								
中信证 券	2021021800040160	旋 极 信 息	2021-02-18	88,404.00	27,800.00	28	3.10	213.15	-	-
中信证 券	2021021800040170	华 宇 软 件	2021-02-18	267,618.00	14,600.00	28	3.40	707.70	-	-
中信证 券	2021021800040870	华 峰 超 纤	2021-02-18	155,960.00	28,000.00	28	3.40	412.43	-	-
中信证 券	2021021800044038	蓝 色 光 标	2021-02-18	273,564.00	44,700.00	28	3.40	723.42	-	-
中信证 券	2021021800044040	特 锐 德	2021-02-18	447,576.00	13,600.00	28	3.40	1,183.59	-	-
中信证 券	2021021800044042	网 宿 科 技	2021-02-18	287,760.00	43,600.00	28	3.40	760.97	-	-
中信证 券	2021021800044044	红 日 药 业	2021-02-18	164,024.00	40,600.00	28	3.40	433.75	-	-
中信证 券	2021021800044046	长 盈 精 密	2021-02-18	315,112.00	13,600.00	28	3.20	784.28	-	-
中信证 券	2021021800044048	碧 水 源	2021-02-18	367,500.00	49,000.00	28	3.40	971.83	-	-
中信证 券	2021021800044050	昆 仑 万 维	2021-02-18	421,544.00	18,400.00	28	3.40	1,114.75	-	-
中信证 券	2021021800044052	华 策 影	2021-02-18	187,094.00	27,800.00	28	3.40	494.76	-	-

券		视									
中信证 券	2021021800044054	晶 盛 机 电	2021-02-18	598,230.00	13,800.00	28	3.40	1,581.99	-	-	
中信证 券	2021021800044056	东 方 国 信	2021-02-18	173,850.00	19,000.00	28	3.40	459.74	-	-	
中信证 券	2021021800044058	汤 臣 倍 健	2021-02-18	390,720.00	17,600.00	28	3.40	1,033.24	-	-	
中信证 券	2021021800044060	安 科 生 物	2021-02-18	343,785.00	21,500.00	28	3.40	909.12	-	-	
中信证 券	2021021800044062	豆 神 教 育	2021-02-18	116,405.00	15,500.00	28	3.40	307.83	-	-	
中信证 券	2021021800044064	掌 趣 科 技	2021-02-18	336,072.00	62,700.00	28	3.40	888.72	-	-	
中信证 券	2021021800044066	国 瓷 材 料	2021-02-18	960,500.00	17,000.00	28	3.40	2,539.99	-	-	
中信证 券	2021021800044068	华 测 检 测	2021-02-18	1,112,535.00	36,900.00	28	3.40	2,942.04	-	-	
中信证 券	2021030400034849	捷 成 股 份	2021-03-04	32,000.00	10,000.00	14	3.50	43.56	-	-	
中信证 券	2021031000007096	中 科 创 达	2021-03-10	1,679,600.00	15,200.00	28	3.30	4,310.97	-	-	
中信证 券	2021031000007098	我 武 生	2021-03-10	981,240.00	17,000.00	28	3.40	2,594.83	-	-	

券		物								
中信证 券	2021031000007100	迪 安 诊 断	2021-03-10	723,060.00	23,400.00	28	3.30	1,855.85	-	-
中信证 券	2021031000007102	易 华 录	2021-03-10	436,975.00	17,500.00	28	3.30	1,121.57	-	-
中信证 券	2021031000007104	顺 网 科 技	2021-03-10	322,875.00	22,500.00	28	3.30	828.71	-	-
中信证 券	2021031000007106	大 富 科 技	2021-03-10	202,446.00	20,700.00	28	3.50	551.10	-	-
中信证 券	2021031000007108	万 孚 生 物	2021-03-10	849,594.00	11,100.00	28	3.30	2,180.62	-	-
中信证 券	2021031000007110	欧 普 康 视	2021-03-10	1,270,672.00	16,400.00	28	3.60	3,557.88	-	-
中信证 券	2021031000007112	开 山 股 份	2021-03-10	277,315.00	18,500.00	28	3.30	711.78	-	-
中信证 券	2021031800037544	旋 极 信 息	2021-03-18	98,690.00	27,800.00	28	3.40	260.98	-	-
中信证 券	2021031800037546	华 宇 软 件	2021-03-18	280,904.00	14,600.00	28	3.30	720.99	-	-
中信证 券	2021031800037548	三 聚 环 保	2021-03-18	240,240.00	33,000.00	28	3.20	597.93	-	-
中信证 券	2021031800037550	长 信 科	2021-03-18	405,435.00	53,700.00	28	3.40	1,072.15	-	-

券		技								
中信证 券	2021031800037552	阳光 电源	2021-03-18	1,694,115.00	23,500.00	28	3.50	4,611.76	-	-
中信证 券	2021031800037554	机 器 人	2021-03-18	317,520.00	28,000.00	28	3.30	814.97	-	-
中信证 券	2021031800037556	万 达 信 息	2021-03-18	269,514.00	18,600.00	28	3.50	733.68	-	-
中信证 券	2021031800037558	捷 成 股 份	2021-03-18	158,522.00	46,900.00	28	3.40	419.20	-	-
中信证 券	2021031800037560	利 亚 德	2021-03-18	273,939.00	38,100.00	28	3.20	681.80	-	-
中信证 券	2021031800037562	欣 旺 达	2021-03-18	508,865.00	24,500.00	28	3.30	1,306.09	-	-
中信证 券	2021031800037564	神 州 泰 岳	2021-03-18	208,525.00	43,900.00	28	4.10	664.96	-	-
中信证 券	2021031800037570	捷 成 股 份	2021-03-18	33,800.00	10,000.00	14	3.50	46.01	-	-
中信证 券	2021031800037572	华 峰 超 纤	2021-03-18	180,320.00	28,000.00	28	3.20	448.80	-	-
中信证 券	2021031800037574	蓝 色 光 标	2021-03-18	262,389.00	44,700.00	28	3.30	673.47	-	-
中信证 券	2021031800037576	红 日 药	2021-03-18	166,054.00	40,600.00	28	3.30	426.21	-	-

券		业								
中信证 券	2021031800037578	特 锐 德	2021-03-18	357,544.00	13,600.00	28	3.40	945.51	-	-
中信证 券	2021031800037580	网 宿 科 技	2021-03-18	276,860.00	43,600.00	28	3.40	732.14	-	-
中信证 券	2021031800037582	汤 臣 倍 健	2021-03-18	485,760.00	17,600.00	28	3.40	1,284.57	-	-
中信证 券	2021031800037584	安 科 生 物	2021-03-18	307,020.00	21,500.00	28	3.30	788.02	-	-
中信证 券	2021031800037586	掌 趣 科 技	2021-03-18	326,667.00	62,700.00	28	3.50	889.26	-	-
中信证 券	2021031800037588	长 盈 精 密	2021-03-18	288,456.00	13,600.00	28	3.30	740.37	-	-
中信证 券	2021031800037590	豆 神 教 育	2021-03-18	137,330.00	15,500.00	28	4.40	469.97	-	-
中信证 券	2021031800037592	国 瓷 材 料	2021-03-18	683,230.00	17,000.00	28	3.20	1,700.48	-	-
中信证 券	2021031800037594	东 方 国 信	2021-03-18	170,430.00	19,000.00	28	3.40	450.69	-	-
中信证 券	2021031800037596	晶 盛 机 电	2021-03-18	460,230.00	13,800.00	28	3.50	1,252.85	-	-
中信证 券	2021031800037598	华 测 检	2021-03-18	959,769.00	36,900.00	28	3.30	2,463.41	-	-

券		测								
中信证 券	2021031800037600	碧水 源	2021-03-18	382,200.00	49,000.00	28	3.30	980.98	-	-
中信证 券	2021031800037602	昆 仑 万 维	2021-03-18	433,136.00	18,400.00	28	3.40	1,145.40	-	-
中信证 券	2021031800037604	华 策 影 视	2021-03-18	169,858.00	27,800.00	28	3.30	435.97	-	-
中信证 券	2021040100030471	捷 成 股 份	2021-04-01	32,800.00	10,000.00	14	3.50	44.64	-	-
中信证 券	2021040700009549	汤 臣 倍 健	2021-03-18	12,320.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021041500032466	昆 仑 万 维	2021-04-15	367,264.00	18,400.00	28	3.40	971.21	-	-
中信证 券	2021041500032472	蓝 色 光 标	2021-04-15	275,799.00	44,700.00	28	3.40	729.34	-	-
中信证 券	2021041500032474	碧 水 源	2021-04-15	374,360.00	49,000.00	28	3.40	989.97	-	-
中信证 券	2021041500032476	长 信 科 技	2021-04-15	388,251.00	53,700.00	28	3.40	1,026.71	-	-
中信证 券	2021041500032478	长 盈 精 密	2021-04-15	264,792.00	13,600.00	28	3.40	700.23	-	-
中信证 券	2021041500032480	三 聚 环	2021-04-15	189,750.00	33,000.00	28	3.50	516.54	-	-

券		保									
中信证 券	2021041500032482	红 日 药 业	2021-04-15	159,558.00	40,600.00	28	3.40	421.94	-	-	
中信证 券	2021041500032484	安 科 生 物	2021-04-15	387,645.00	21,500.00	28	3.40	1,025.11	-	-	
中信证 券	2021041500032486	神 州 泰 岳	2021-04-15	190,526.00	43,900.00	28	3.40	503.84	-	-	
中信证 券	2021041500032488	特 锐 德	2021-04-15	328,304.00	13,600.00	28	3.10	791.58	-	-	
中信证 券	2021041500032490	豆 神 教 育	2021-04-15	115,785.00	15,500.00	28	3.40	306.19	-	-	
中信证 券	2021041500032492	机 器 人	2021-04-15	283,080.00	28,000.00	28	3.40	748.59	-	-	
中信证 券	2021041500032494	网 宿 科 技	2021-04-15	270,320.00	43,600.00	28	3.40	714.85	-	-	
中信证 券	2021041500032496	华 测 检 测	2021-04-15	1,133,199.00	36,900.00	28	3.40	2,996.68	-	-	
中信证 券	2021041500032498	华 策 影 视	2021-04-15	182,924.00	27,800.00	28	3.40	483.73	-	-	
中信证 券	2021041500032500	利 亚 德	2021-04-15	294,132.00	38,100.00	28	3.40	777.82	-	-	
中信证 券	2021041500032502	国 瓷 材	2021-04-15	751,740.00	17,000.00	28	3.40	1,987.93	-	-	

券		料								
中信证 券	2021041500032504	阳光 电源	2021-04-15	1,621,500.00	23,500.00	28	3.50	4,414.08	-	-
中信证 券	2021041500032508	掌 趣科 技	2021-04-15	314,127.00	62,700.00	28	3.40	830.69	-	-
中信证 券	2021041500032510	旋 极信 息	2021-04-15	96,744.00	27,800.00	28	3.50	263.36	-	-
中信证 券	2021041500032512	晶 盛机 电	2021-04-15	444,084.00	13,800.00	28	3.40	1,174.36	-	-
中信证 券	2021041500032514	华 宇软 件	2021-04-15	269,078.00	14,600.00	28	3.40	711.56	-	-
中信证 券	2021041500032986	万 达信 息	2021-04-15	246,450.00	18,600.00	28	3.50	670.89	-	-
中信证 券	2021041500032988	东 方国 信	2021-04-15	179,170.00	19,000.00	28	3.50	487.74	-	-
中信证 券	2021041500032990	汤 臣倍 健	2021-04-15	506,176.00	17,600.00	28	3.40	1,338.55	-	-
中信证 券	2021041500032992	华 峰超 纤	2021-04-15	155,960.00	28,000.00	28	3.40	412.43	-	-
中信证 券	2021041500032994	欣 旺达	2021-04-15	539,000.00	24,500.00	28	3.40	1,425.36	-	-
中信证 券	2021041500032996	捷 成股	2021-04-15	32,400.00	10,000.00	14	3.50	44.10	-	-

券		份								
中信证 券	2021041500032998	捷成股份	2021-04-15	151,956.00	46,900.00	28	3.40	401.84	-	-
中信证 券	2021041500033356	国瓷材料	2021-04-15	1,700.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021042900023945	捷成股份	2021-04-29	35,100.00	10,000.00	14	3.50	47.78	-	-
中信证 券	2021051300025346	神州泰岳	2021-05-13	202,379.00	43,900.00	28	3.40	535.18	-	-
中信证 券	2021051300027668	华策影视	2021-05-13	173,194.00	27,800.00	28	3.60	484.94	-	-
中信证 券	2021051300027670	华峰超纤	2021-05-13	152,600.00	28,000.00	28	3.60	427.28	-	-
中信证 券	2021051300027672	掌趣科技	2021-05-13	275,880.00	62,700.00	28	3.40	729.55	-	-
中信证 券	2021051300027674	豆神教育	2021-05-13	125,240.00	15,500.00	28	4.20	409.12	-	-
中信证 券	2021051300027676	华宇软件	2021-05-13	263,822.00	14,600.00	28	3.40	697.66	-	-
中信证 券	2021051300027678	安科生物	2021-05-13	442,470.00	21,500.00	28	3.40	1,170.09	-	-
中信证 券	2021051300027680	利亚德	2021-05-13	266,319.00	38,100.00	28	3.40	704.27	-	-

券										
中信证券	2021051300027682	国瓷材料	2021-05-13	801,720.00	17,000.00	28	3.40	2,120.10	-	-
中信证券	2021051300027684	特锐德	2021-05-13	318,920.00	13,600.00	28	3.40	843.37	-	-
中信证券	2021051300027686	华测检测	2021-05-13	1,200,357.00	36,900.00	28	3.50	3,267.64	-	-
中信证券	2021051300027688	昆仑万维	2021-05-13	335,248.00	18,400.00	28	3.40	886.54	-	-
中信证券	2021051300027690	长信科技	2021-05-13	419,934.00	53,700.00	28	3.40	1,110.49	-	-
中信证券	2021051300027692	汤臣倍健	2021-05-13	587,840.00	17,600.00	28	3.40	1,554.51	-	-
中信证券	2021051300027694	阳光电源	2021-05-13	1,878,355.00	23,500.00	28	3.50	5,113.30	-	-
中信证券	2021051300027696	晶盛机电	2021-05-13	496,800.00	13,800.00	28	3.40	1,313.76	-	-
中信证券	2021051300027698	欣旺达	2021-05-13	511,070.00	24,500.00	28	4.20	1,669.50	-	-
中信证券	2021051300027700	蓝色光标	2021-05-13	286,080.00	44,700.00	28	3.40	756.52	-	-
中信证	2021051300027702	捷成股	2021-05-13	38,400.00	10,000.00	14	3.50	52.27	-	-

券		份								
中信证 券	2021051300027704	长盈精 密	2021-05-13	246,976.00	13,600.00	28	3.40	653.11	-	-
中信证 券	2021051300027706	碧水 源	2021-05-13	342,510.00	49,000.00	28	3.40	905.75	-	-
中信证 券	2021051300027708	捷成 股份	2021-05-13	180,096.00	46,900.00	28	3.40	476.25	-	-
中信证 券	2021051300027710	东方 国信	2021-05-13	175,180.00	19,000.00	28	4.00	545.00	-	-
中信证 券	2021051300027712	网宿 科技	2021-05-13	246,340.00	43,600.00	28	3.40	651.43	-	-
中信证 券	2021051300027714	三聚 环保	2021-05-13	178,200.00	33,000.00	28	4.20	582.12	-	-
中信证 券	2021051300027716	红日 药业	2021-05-13	185,948.00	40,600.00	28	3.40	491.73	-	-
中信证 券	2021051300027718	机器 人	2021-05-13	263,200.00	28,000.00	28	3.40	696.02	-	-
中信证 券	2021051300027720	万达 信息	2021-05-13	280,116.00	18,600.00	28	4.20	915.05	-	-
中信证 券	2021051300027722	旋极 信息	2021-05-13	91,740.00	27,800.00	28	3.40	242.60	-	-
中信证 券	2021051300028378	安科 生	2021-05-13	-	4,300.00	28	3.40	-	-	-

券		物								
中信证 券	2021051300029715	安科生物	2021-05-13	4,300.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021052000019529	华测检测	2021-05-13	1,291.50	-	28	3.50	-	-	-
中信证 券	2021052100007060	利亚德	2021-05-13	762.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021052700018813	捷成股份	2021-05-27	41,000.00	10,000.00	14	3.40	54.21	-	-
中信证 券	2021052700020901	华策影视	2021-05-13	583.80	-	28	3.60	-	-	-
中信证 券	2021052700021221	阳光电源	2021-05-13	3,290.00	-	28	3.50	-	-	-
中信证 券	2021060100002977	华宇软件	2021-05-13	517.47	-	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021060300011656	长盈精密	2021-05-13	1,360.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021060300011824	长盈精密	2021-05-13	-	2,720.00	28	3.40	-	-	-
中信证 券	2021060300012168	欣旺达	2021-05-13	1,716.27	-	28	4.20	-	-	-
中信证 券	2021060700005669	碧水源	2021-05-13	2,695.00	-	28	3.40	-	-	-

券										
中信证券	2021060900005903	网宿科技	2021-05-13	436.30	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	2021060900006013	红日药业	2021-05-13	1,624.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	2021061000008622	捷成股份	2021-06-10	43,600.00	10,000.00	14	3.50	59.34	-	-
中信证券	2021062400009375	捷成股份	2021-06-24	46,700.00	10,000.00	14	3.50	27.24	49,900.00	27.24

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
华夏中证 500ETF 联接	684,040,823.00	56.07%	675,440,823.00	43.21%
中信证券	5,874,825.00	0.48%	22,575,445.00	1.44%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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

中国建设银行活期存款	14,790,067.52	45,809.79	12,773,529.56	42,428.49
------------	---------------	-----------	---------------	-----------

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	002500	山西证券	配股	486,360	2,431,800.00
中信证券	688819	天能股份	网下申购	28,382	1,186,083.78
中信证券	688660	电气风电	网下申购	51,238	278,734.72
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96

中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 131,086,440.00 元（上年度可比期间：171,091,160.00 元），支付给中信期货的佣金为 3,211.68 元（上年度可比期间为：4,191.67 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
301139	元道通	2022-06-30	1 个月内(含)	新发流	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-

	信			通受限						
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新发流通受限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	含证券送配
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新发流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	含证券送配
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新发流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新发流通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	含证券送配
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	新发流通受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	含证券送配
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	含证券送配
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新发流通受	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-

				限						
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	新发流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新发流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	新发流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301162	国能日新	2022-04-19	6 个月	新发流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新发流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	含 证 券 送 配
301286	侨	2022-06-06	6 个月	新	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-

	源股份			发 流 通 受 限						
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新发 流 通 受 限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新发 流 通 受 限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6 个月	新发 流 通 受 限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	新发 流 通 受 限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新发 流 通 受 限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新发 流 通 受 限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301220	亚香股	2022-06-15	6 个月	新发 流 通 受 限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-

	份			通受限						
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新发流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	新发流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新发流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新发流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-

301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	限新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	限新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
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(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022-05-19	6 个月内(含)	限新发流通受限	100.00	100.02	2,639	263,900.00	263,949.74	期末估值单价为含息价格

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

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

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

6.4.12.2 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	2022-06-01	重大事项	9.60	2022-07-14	9.99	776,486	7,351,565.37	7,454,265.60	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(股)	期末估值总额
1	600522	中天科技	2022年7月1日 -2022年7月11日	23.10	400,600.00	9,253,860.00
2	600256	广汇能源	2022年7月1日 -2022年7月11日	10.54	680,400.00	7,171,416.00
3	603613	国联股份	2022年7月1日 -2022年7月11日	88.60	62,000.00	5,493,200.00
4	002180	纳思达	2022年7月1日 -2022年7月11日	50.62	104,800.00	5,304,976.00
5	600157	永泰能源	2022年7月1日 -2022年7月11日	1.59	3,288,400.00	5,228,556.00
6	000009	中国宝安	2022年7月1日 -2022年7月11日	13.49	381,900.00	5,151,831.00
7	600141	兴发集团	2022年7月1日 -2022年7月11日	43.99	115,200.00	5,067,648.00

8	600392	盛和资源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	22.60	207,900.00	4,698,540.00
9	600885	宏发股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	41.85	106,400.00	4,452,840.00
10	300285	国瓷材料	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	35.92	118,700.00	4,263,704.00
11	600418	江淮汽车	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.16	247,600.00	4,248,816.00
12	600233	圆通速递	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	20.39	203,500.00	4,149,365.00
13	601555	东吴证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.93	594,300.00	4,118,499.00
14	600563	法拉电子	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	205.16	20,000.00	4,103,200.00
15	600487	亨通光电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.54	279,700.00	4,066,838.00
16	000983	山西焦煤	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.39	303,000.00	4,057,170.00
17	002497	雅化集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	32.65	123,000.00	4,015,950.00
18	002384	东山精密	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	22.93	174,100.00	3,992,113.00
19	600096	云天化	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.48	125,900.00	3,963,332.00
20	603077	和邦生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.26	915,300.00	3,899,178.00
21	603456	九洲药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	51.70	74,900.00	3,872,330.00
22	002385	大北农	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.81	490,600.00	3,831,586.00
23	300012	华测检测	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	23.21	165,000.00	3,829,650.00
24	600765	中航重机	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	32.18	118,300.00	3,806,894.00
25	300363	博腾股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	77.99	48,300.00	3,766,917.00
26	002407	多氟多	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	48.91	75,300.00	3,682,923.00
27	000519	中兵红箭	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	29.15	123,600.00	3,602,940.00
28	000630	铜陵有色	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.26	1,090,600.00	3,555,356.00
29	600862	中航高科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	28.10	123,700.00	3,475,970.00

30	601615	明阳智能	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 5 日	33.80	102,400.00	3,461,120.00
31	002268	卫士通	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	42.91	79,500.00	3,411,345.00
32	603589	口子窖	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	58.61	57,900.00	3,393,519.00
33	601077	渝农商行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.70	916,500.00	3,391,050.00
34	601168	西部矿业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.83	282,200.00	3,338,426.00
35	603605	珀莱雅	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	165.18	20,000.00	3,303,600.00
36	002056	横店东磁	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	26.62	120,200.00	3,199,724.00
37	002797	第一创业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.41	497,600.00	3,189,616.00
38	002353	杰瑞股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	40.30	78,700.00	3,171,610.00
39	600298	安琪酵母	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	48.75	64,900.00	3,163,875.00
40	600988	赤峰黄金	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.95	197,100.00	3,143,745.00
41	000999	华润三九	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	45.00	69,500.00	3,127,500.00
42	000932	华菱钢铁	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.09	613,300.00	3,121,697.00
43	601128	常熟银行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.64	405,800.00	3,100,312.00
44	002756	永兴材料	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	152.21	20,000.00	3,044,200.00
45	601636	旗滨集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.75	238,600.00	3,042,150.00
46	600153	建发股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.07	231,600.00	3,027,012.00
47	002240	盛新锂能	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	60.36	50,000.00	3,018,000.00
48	600521	华海药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	22.70	132,900.00	3,016,830.00
49	000988	华工科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	23.17	128,200.00	2,970,394.00
50	002078	太阳纸业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.31	238,800.00	2,939,628.00
51	000830	鲁西化工	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.29	169,100.00	2,923,739.00

52	603517	绝味食品	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	57.82	50,000.00	2,891,000.00
53	300037	新宙邦	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	52.56	54,700.00	2,875,032.00
54	002028	思源电气	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	35.66	80,500.00	2,870,630.00
55	600546	山煤国际	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.46	146,700.00	2,854,782.00
56	601872	招商轮船	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.76	479,600.00	2,762,496.00
57	600348	华阳股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.46	177,700.00	2,747,242.00
58	600705	中航产融	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.46	791,700.00	2,739,282.00
59	600497	驰宏锌锗	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.19	527,400.00	2,737,206.00
60	600039	四川路桥	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.53	259,900.00	2,736,747.00
61	000738	航发控制	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	28.10	97,200.00	2,731,320.00
62	600177	雅戈尔	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.63	410,900.00	2,724,267.00
63	600549	厦门钨业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	21.62	126,000.00	2,724,120.00
64	000970	中科三环	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	18.78	144,300.00	2,709,954.00
65	601058	赛轮轮胎	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.27	240,400.00	2,709,308.00
66	300699	光威复材	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	58.87	46,000.00	2,708,020.00
67	000039	中集集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	13.85	195,500.00	2,707,675.00
68	600875	东方电气	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.45	164,600.00	2,707,670.00
69	300088	长信科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.42	363,100.00	2,694,202.00
70	603267	鸿远电子	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	134.33	20,000.00	2,686,600.00
71	002185	华天科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.38	286,000.00	2,682,680.00
72	600499	科达制造	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	20.64	129,700.00	2,677,008.00
73	002030	达安基因	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	17.19	155,300.00	2,669,607.00

74	688099	晶晨股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	101.00	26,400.00	2,666,400.00
75	600486	扬农化工	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	133.28	20,000.00	2,665,600.00
76	002508	老板电器	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	36.03	73,700.00	2,655,411.00
77	603939	益丰药房	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	52.83	50,000.00	2,641,500.00
78	300146	汤臣倍健	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	21.65	121,600.00	2,632,640.00
79	600160	巨化股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.15	199,900.00	2,628,685.00
80	002422	科伦药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	18.70	140,500.00	2,627,350.00
81	000998	隆平高科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.66	156,100.00	2,600,626.00
82	002673	西部证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.54	396,800.00	2,595,072.00
83	002572	索菲亚	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	27.50	94,300.00	2,593,250.00
84	601699	潞安环能	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.62	177,000.00	2,587,740.00
85	600516	方大炭素	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.60	338,000.00	2,568,800.00
86	000807	云铝股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.88	256,700.00	2,536,196.00
87	601108	财通证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.87	319,000.00	2,510,530.00
88	600482	中国动力	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.71	159,800.00	2,510,458.00
89	000975	银泰黄金	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.74	256,800.00	2,501,232.00
90	000629	攀钢钒钛	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.80	656,700.00	2,495,460.00
91	000960	锡业股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.77	148,200.00	2,485,314.00
92	300073	当升科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	90.34	27,500.00	2,484,350.00
93	000513	丽珠集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	36.21	68,600.00	2,484,006.00
94	002465	海格通信	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.09	272,700.00	2,478,843.00
95	600859	王府井	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.98	95,000.00	2,468,100.00

96	300676	华大基因	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	71.70	34,300.00	2,459,310.00
97	300357	我武生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	52.03	46,600.00	2,424,598.00
98	601997	贵阳银行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.81	414,800.00	2,409,988.00
99	600143	金发科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	9.52	252,900.00	2,407,608.00
100	600704	物产中大	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.13	461,100.00	2,365,443.00
101	300144	宋城演艺	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.35	154,000.00	2,363,900.00
102	300253	卫宁健康	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.78	264,400.00	2,321,432.00
103	600739	辽宁成大	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.58	158,300.00	2,308,014.00
104	603568	伟明环保	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	33.37	68,900.00	2,299,193.00
105	002507	涪陵榨菜	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	34.52	66,500.00	2,295,580.00
106	603127	昭衍新药	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	113.80	20,000.00	2,276,000.00
107	000547	航天发展	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.94	190,000.00	2,268,600.00
108	300418	昆仑万维	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.00	141,700.00	2,267,200.00
109	002372	伟星新材	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	24.04	94,300.00	2,266,972.00
110	002092	中泰化学	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.76	292,100.00	2,266,696.00
111	600415	小商品城	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.57	406,400.00	2,263,648.00
112	600170	上海建工	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.03	745,900.00	2,260,077.00
113	002506	协鑫集成	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.72	606,700.00	2,256,924.00
114	000636	风华高科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	18.79	120,000.00	2,254,800.00
115	002739	万达电影	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.65	164,900.00	2,250,885.00
116	002138	顺络电子	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	27.25	82,300.00	2,242,675.00
117	600699	均胜电子	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.71	141,900.00	2,229,249.00

118	000728	国元证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.22	355,300.00	2,209,966.00
119	300296	利亚德	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.30	301,500.00	2,200,950.00
120	002625	光启技术	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.27	126,900.00	2,191,563.00
121	300244	迪安诊断	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.10	70,300.00	2,186,330.00
122	601696	中银证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.30	163,600.00	2,175,880.00
123	600637	东方明珠	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.15	303,300.00	2,168,595.00
124	002430	杭氧股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.26	69,200.00	2,163,192.00
125	601162	天风证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.18	680,100.00	2,162,718.00
126	600316	洪都航空	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	30.24	71,500.00	2,162,160.00
127	600867	通化东宝	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.34	208,800.00	2,158,992.00
128	000887	中鼎股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	18.24	117,200.00	2,137,728.00
129	600985	淮北矿业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.56	146,800.00	2,137,408.00
130	601016	节能风电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.80	444,900.00	2,135,520.00
131	600236	桂冠电力	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.09	350,200.00	2,132,718.00
132	601198	东兴证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.90	239,600.00	2,132,440.00
133	600026	中远海能	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.33	205,700.00	2,124,881.00
134	002299	圣农发展	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.18	110,600.00	2,121,308.00
135	002195	二三四五	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.25	932,100.00	2,097,225.00
136	600879	航天电子	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.49	321,900.00	2,089,131.00
137	300136	信维通信	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.85	123,200.00	2,075,920.00
138	600642	申能股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.68	363,600.00	2,065,248.00
139	600529	山东药玻	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	27.95	73,700.00	2,059,915.00

140	002223	鱼跃医疗	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.66	80,000.00	2,052,800.00
141	601577	长沙银行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.93	257,600.00	2,042,768.00
142	002294	信立泰	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	28.10	72,300.00	2,031,630.00
143	000623	吉林敖东	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.76	137,400.00	2,028,024.00
144	300308	中际旭创	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.05	65,200.00	2,024,460.00
145	000878	云南铜业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.39	177,700.00	2,024,003.00
146	600079	人福医药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	16.00	126,500.00	2,024,000.00
147	002203	海亮股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.55	174,800.00	2,018,940.00
148	000729	燕京啤酒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.66	208,600.00	2,015,076.00
149	002683	广东宏大	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	27.83	72,400.00	2,014,892.00
150	600673	东阳光	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.99	223,100.00	2,005,669.00
151	002557	洽洽食品	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	56.93	35,200.00	2,003,936.00
152	002273	水晶光电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.11	163,300.00	1,977,563.00
153	600380	健康元	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.35	160,000.00	1,976,000.00
154	600109	国金证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.00	219,400.00	1,974,600.00
155	601607	上海医药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	18.08	108,800.00	1,967,104.00
156	600801	华新水泥	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.51	100,700.00	1,964,657.00
157	600580	卧龙电驱	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.42	136,100.00	1,962,562.00
158	600171	上海贝岭	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.03	78,400.00	1,962,352.00
159	300474	景嘉微	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	68.39	28,650.00	1,959,373.50
160	600369	西南证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.97	492,200.00	1,954,034.00
161	600062	华润双鹤	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.66	76,000.00	1,950,160.00

162	002131	利欧股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	1.94	999,500.00	1,939,030.00
163	600258	首旅酒店	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	24.80	78,000.00	1,934,400.00
164	600166	福田汽车	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.83	681,700.00	1,929,211.00
165	300026	红日药业	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	7.70	250,200.00	1,926,540.00
166	002408	齐翔腾达	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.11	237,500.00	1,926,125.00
167	603707	健友股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	28.20	68,200.00	1,923,240.00
168	002505	鹏都农牧	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.39	564,900.00	1,915,011.00
169	002444	巨星科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	18.84	101,600.00	1,914,144.00
170	002624	完美世界	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.37	133,100.00	1,912,647.00
171	000400	许继电气	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.20	99,400.00	1,908,480.00
172	600820	隧道股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.12	310,200.00	1,898,424.00
173	600027	华电国际	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.93	483,000.00	1,898,190.00
174	600909	华安证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.55	417,100.00	1,897,805.00
175	601005	重庆钢铁	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	1.91	992,700.00	1,896,057.00
176	600325	华发股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.57	250,300.00	1,894,771.00
177	600008	首创环保	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.90	651,500.00	1,889,350.00
178	002212	天融信	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.15	185,600.00	1,883,840.00
179	603218	日月股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.40	74,100.00	1,882,140.00
180	300383	光环新网	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 14 日	10.42	179,300.00	1,868,306.00
181	300618	寒锐钴业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	57.92	32,200.00	1,865,024.00
182	300024	机器人	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.08	183,900.00	1,853,712.00
183	002183	怡亚通	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.21	256,400.00	1,848,644.00

184	600511	国药股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	26.78	68,800.00	1,842,464.00
185	000825	太钢不锈	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.45	337,200.00	1,837,740.00
186	002926	华西证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.84	233,100.00	1,827,504.00
187	002156	通富微电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.40	118,500.00	1,824,900.00
188	000050	深天马 A	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.97	181,800.00	1,812,546.00
189	601990	南京证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.34	217,000.00	1,809,780.00
190	000027	深圳能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.41	281,900.00	1,806,979.00
191	600271	航天信息	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.94	164,700.00	1,801,818.00
192	002250	联化科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.37	109,300.00	1,789,241.00
193	000783	长江证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.93	300,100.00	1,779,593.00
194	000750	国海证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.63	485,400.00	1,762,002.00
195	600863	内蒙华电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.65	482,500.00	1,761,125.00
196	601866	中远海发	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.00	586,900.00	1,760,700.00
197	000060	中金岭南	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.46	393,900.00	1,756,794.00
198	002958	青农商行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.32	519,900.00	1,726,068.00
199	002249	大洋电机	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.14	279,800.00	1,717,972.00
200	300009	安科生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.11	169,800.00	1,716,678.00
201	600066	宇通客车	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.65	198,100.00	1,713,565.00
202	000778	新兴铸管	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.82	354,700.00	1,709,654.00
203	601992	金隅集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.77	616,900.00	1,708,813.00
204	002065	东华软件	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.32	269,900.00	1,705,768.00
205	300482	万孚生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	40.71	41,700.00	1,697,607.00

206	603345	安井食品	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	167.87	10,000.00	1,678,700.00
207	300182	捷成股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.50	305,100.00	1,678,050.00
208	002373	千方科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.12	150,900.00	1,678,008.00
209	002603	以岭药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 8 日	24.30	68,800.00	1,671,840.00
210	300017	网宿科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.36	311,900.00	1,671,784.00
211	300168	万达信息	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.44	175,600.00	1,657,664.00
212	000401	冀东水泥	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.52	157,500.00	1,656,900.00
213	600998	九州通	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.91	138,700.00	1,651,917.00
214	002326	永太科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	32.93	50,000.00	1,646,500.00
215	600755	厦门国贸	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.50	219,300.00	1,644,750.00
216	300251	光线传媒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.47	173,400.00	1,642,098.00
217	000739	普洛药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	20.64	79,400.00	1,638,816.00
218	002191	劲嘉股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.72	152,400.00	1,633,728.00
219	002128	电投能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.32	113,700.00	1,628,184.00
220	600390	五矿资本	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.89	332,800.00	1,627,392.00
221	000997	新大陆	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.21	122,300.00	1,615,583.00
222	600970	中材国际	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.69	166,400.00	1,612,416.00
223	600667	太极实业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.38	217,900.00	1,608,102.00
224	600118	中国卫星	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	20.08	79,400.00	1,594,352.00
225	002244	滨江集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.65	184,200.00	1,593,330.00
226	600536	中国软件	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	40.59	39,240.00	1,592,751.60
227	002221	东华能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.31	170,600.00	1,588,286.00

228	600528	中铁工业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.05	197,100.00	1,586,655.00
229	600315	上海家化	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	42.75	37,000.00	1,581,750.00
230	002500	山西证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.74	274,500.00	1,575,630.00
231	600839	四川长虹	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.88	546,500.00	1,573,920.00
232	600827	百联股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.21	118,800.00	1,569,348.00
233	600038	中直股份	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	45.20	34,700.00	1,568,440.00
234	600566	济川药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	27.16	57,700.00	1,567,132.00
235	600297	广汇汽车	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.61	600,300.00	1,566,783.00
236	603233	大参林	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.30	50,000.00	1,565,000.00
237	000831	五矿稀土	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.25	50,000.00	1,562,500.00
238	002595	豪迈科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	22.34	69,900.00	1,561,566.00
239	002127	南极电商	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.34	290,600.00	1,551,804.00
240	600598	北大荒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.76	105,100.00	1,551,276.00
241	603858	步长制药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.71	78,500.00	1,547,235.00
242	600155	华创阳安	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.48	180,500.00	1,530,640.00
243	002019	亿帆医药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.98	109,400.00	1,529,412.00
244	600201	生物股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.16	166,800.00	1,527,888.00
245	002266	浙富控股	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.79	317,900.00	1,522,741.00
246	300001	特锐德	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.31	87,600.00	1,516,356.00
247	600208	新湖中宝	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.76	548,300.00	1,513,308.00
248	002155	湖南黄金	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.14	124,500.00	1,511,430.00
249	000012	南玻 A	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.42	203,200.00	1,507,744.00

250	000656	金科股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.86	526,700.00	1,506,362.00
251	600409	三友化工	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.19	183,400.00	1,502,046.00
252	000930	中粮科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.04	165,500.00	1,496,120.00
253	000883	湖北能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.11	290,800.00	1,485,988.00
254	688180	君实生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	75.34	19,700.00	1,484,198.00
255	002153	石基信息	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	15.87	93,500.00	1,483,845.00
256	603156	养元饮品	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	22.72	65,300.00	1,483,616.00
257	600718	东软集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.51	128,800.00	1,482,488.00
258	300558	贝达药业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	60.80	24,300.00	1,477,440.00
259	600372	中航电子	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.39	75,800.00	1,469,762.00
260	002152	广电运通	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.27	158,200.00	1,466,514.00
261	002124	天邦食品	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.72	218,000.00	1,464,960.00
262	000987	越秀金控	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.03	208,305.00	1,464,384.15
263	002511	中顺洁柔	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.52	116,500.00	1,458,580.00
264	688122	西部超导	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	92.20	15,800.00	1,456,760.00
265	603026	石大胜华	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	145.35	10,000.00	1,453,500.00
266	600021	上海电力	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.25	141,700.00	1,452,425.00
267	000686	东北证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.99	207,700.00	1,451,823.00
268	600060	海信视像	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.50	115,900.00	1,448,750.00
269	000581	威孚高科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.25	75,100.00	1,445,675.00
270	600282	南钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.15	456,200.00	1,437,030.00
271	002396	星网锐捷	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	22.64	63,300.00	1,433,112.00

272	603198	迎驾贡酒	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	65.14	22,000.00	1,433,080.00
273	603885	吉祥航空	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.99	79,400.00	1,428,406.00
274	600782	新钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.04	283,200.00	1,427,328.00
275	600895	张江高科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.45	114,600.00	1,426,770.00
276	601880	辽港股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	1.70	836,700.00	1,422,390.00
277	000709	河钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.26	628,500.00	1,420,410.00
278	601179	中国西电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.68	303,400.00	1,419,912.00
279	000690	宝新能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.38	322,200.00	1,411,236.00
280	600022	山东钢铁	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	1.74	810,000.00	1,409,400.00
281	600064	南京高科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.00	128,000.00	1,408,000.00
282	600535	天士力	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.51	133,500.00	1,403,085.00
283	002939	长城证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.16	137,800.00	1,400,048.00
284	000540	中天金融	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	1.93	722,600.00	1,394,618.00
285	000021	深科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.64	119,400.00	1,389,816.00
286	002701	奥瑞金	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.20	266,600.00	1,386,320.00
287	002690	美亚光电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	21.68	63,500.00	1,376,680.00
288	300058	蓝色光标	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	6.53	210,800.00	1,376,524.00
289	002002	鸿达兴业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.71	369,900.00	1,372,329.00
290	600216	浙江医药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.65	100,000.00	1,365,000.00
291	300630	普利制药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	35.15	38,700.00	1,360,305.00
292	600500	中化国际	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.65	204,500.00	1,359,925.00
293	000598	兴蓉环境	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.11	265,200.00	1,355,172.00

294	600037	歌华有线	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.39	143,900.00	1,351,221.00
295	600808	马钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.79	355,800.00	1,348,482.00
296	600663	陆家嘴	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.36	130,100.00	1,347,836.00
297	600728	佳都科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.46	208,000.00	1,343,680.00
298	002409	雅克科技	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	55.51	24,200.00	1,343,342.00
299	600567	山鹰国际	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.77	478,700.00	1,325,999.00
300	600517	国网英大	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.19	254,100.00	1,318,779.00
301	688521	芯原股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	49.40	26,500.00	1,309,100.00
302	002004	华邦健康	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.58	234,500.00	1,308,510.00
303	603225	新凤鸣	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.54	113,000.00	1,304,020.00
304	601456	国联证券	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.27	105,900.00	1,299,393.00
305	300463	迈克生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	20.49	63,400.00	1,299,066.00
306	600498	烽火通信	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.48	89,300.00	1,293,064.00
307	600597	光明乳业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.63	102,100.00	1,289,523.00
308	002439	启明星辰	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 8 日	19.93	64,700.00	1,289,471.00
309	002745	木林森	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.77	131,800.00	1,287,686.00
310	600959	江苏有线	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.26	394,000.00	1,284,440.00
311	600848	上海临港	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.56	94,000.00	1,274,640.00
312	601958	金钼股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.84	143,300.00	1,266,772.00
313	002468	申通快递	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.92	105,300.00	1,255,176.00
314	600507	方大特钢	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.99	179,000.00	1,251,210.00
315	601106	中国一重	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.07	406,300.00	1,247,341.00

316	002390	信邦制药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.91	180,000.00	1,243,800.00
317	688777	中控技术	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	72.76	16,900.00	1,229,644.00
318	600572	康恩贝	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.43	276,500.00	1,224,895.00
319	601118	海南橡胶	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.78	253,200.00	1,210,296.00
320	002399	海普瑞	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.58	68,700.00	1,207,746.00
321	601718	际华集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.10	389,500.00	1,207,450.00
322	002429	兆驰股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.84	312,600.00	1,200,384.00
323	002925	盈趣科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	21.52	55,600.00	1,196,512.00
324	002048	宁波华翔	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.02	74,400.00	1,191,888.00
325	600737	中粮糖业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.52	158,400.00	1,191,168.00
326	688390	固德威	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	313.01	3,800.00	1,189,438.00
327	000089	深圳机场	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.72	151,900.00	1,172,668.00
328	300072	海新能科	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.06	231,700.00	1,172,402.00
329	600582	天地科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.78	245,200.00	1,172,056.00
330	000937	冀中能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.46	156,800.00	1,169,728.00
331	002010	传化智联	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.43	181,900.00	1,169,617.00
332	603638	艾迪精密	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	20.50	56,900.00	1,166,450.00
333	000559	万向钱潮	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.94	195,500.00	1,161,270.00
334	002368	太极股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	19.21	60,200.00	1,156,442.00
335	600967	内蒙一机	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.12	126,000.00	1,149,120.00
336	300677	英科医疗	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.36	45,300.00	1,148,808.00
337	000898	鞍钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.22	354,500.00	1,141,490.00

338	600435	北方导航	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.62	132,400.00	1,141,288.00
339	601000	唐山港	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.58	439,000.00	1,132,620.00
340	688002	睿创微纳	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	39.72	28,500.00	1,132,020.00
341	600811	东方集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.83	399,900.00	1,131,717.00
342	601333	广深铁路	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	2.18	512,500.00	1,117,250.00
343	600764	中国海防	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.24	44,100.00	1,113,084.00
344	600398	海澜之家	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.75	234,100.00	1,111,975.00
345	300115	长盈精密	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.31	107,200.00	1,105,232.00
346	002110	三钢闽光	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.09	181,300.00	1,104,117.00
347	603866	桃李面包	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	16.55	66,700.00	1,103,885.00
348	001914	招商积余	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.97	61,200.00	1,099,764.00
349	002233	塔牌集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.85	123,500.00	1,092,975.00
350	601860	紫金银行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.87	379,100.00	1,088,017.00
351	002281	光迅科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.58	61,000.00	1,072,380.00
352	600871	石化油服	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 13 日	1.89	560,900.00	1,060,101.00
353	002174	游族网络	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.77	108,500.00	1,060,045.00
354	000402	金融街	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.95	176,800.00	1,051,960.00
355	000528	柳工	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.51	160,900.00	1,047,459.00
356	600120	浙江东方	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.01	257,600.00	1,032,976.00
357	300166	东方国信	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.22	112,000.00	1,032,640.00
358	002416	爱施德	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.30	110,100.00	1,023,930.00
359	600126	杭钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.12	199,700.00	1,022,464.00

360	000488	晨鸣纸业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.64	181,100.00	1,021,404.00
361	600259	广晟有色	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	50.65	20,100.00	1,018,065.00
362	600167	联美控股	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.49	135,500.00	1,014,895.00
363	600446	金证股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.38	97,700.00	1,014,126.00
364	000537	广宇发展	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.99	77,900.00	1,011,921.00
365	000959	首钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.76	211,700.00	1,007,692.00
366	601098	中南传媒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.44	106,500.00	1,005,360.00
367	000685	中山公用	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.68	130,800.00	1,004,544.00
368	002081	金螳螂	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.08	197,500.00	1,003,300.00
369	600373	中文传媒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.99	100,200.00	1,000,998.00
370	002382	蓝帆医疗	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.55	104,400.00	997,020.00
371	600131	国网信通	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.45	73,900.00	993,955.00
372	000158	常山北明	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.00	165,600.00	993,600.00
373	600707	彩虹股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.68	212,300.00	993,564.00
374	688188	柏楚电子	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	220.04	4,500.00	990,180.00
375	600195	中牧股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	12.26	80,500.00	986,930.00
376	601611	中国核建	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.39	117,300.00	984,147.00
377	603658	安图生物	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	48.89	20,000.00	977,800.00
378	600006	东风汽车	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.55	129,100.00	974,705.00
379	002146	荣盛发展	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.03	321,400.00	973,842.00
380	601608	中信重工	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.79	256,700.00	972,893.00
381	688208	道通科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	32.92	29,000.00	954,680.00

382	003035	南网能源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.35	149,400.00	948,690.00
383	000156	华数传媒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.97	118,700.00	946,039.00
384	601717	郑煤机	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 5 日	14.41	65,100.00	938,091.00
385	600376	首开股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.91	190,800.00	936,828.00
386	000563	陕国投 A	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.12	293,400.00	915,408.00
387	002387	维信诺	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.72	136,200.00	915,264.00
388	689009	九号公司	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	44.50	20,500.00	912,250.00
389	600901	江苏租赁	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.13	177,000.00	908,010.00
390	002670	国盛金控	2022 年 7 月 14 日 -2022 年 7 月 14 日	9.60	94,500.00	907,200.00
391	300257	开山股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	14.96	60,600.00	906,576.00
392	601598	中国外运	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.88	233,500.00	905,980.00
393	688006	杭可科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	70.06	12,900.00	903,774.00
394	600307	酒钢宏兴	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	1.94	464,000.00	900,160.00
395	601991	大唐发电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.43	367,300.00	892,539.00
396	000990	诚志股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	10.95	81,400.00	891,330.00
397	300212	易华录	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	17.40	50,900.00	885,660.00
398	000967	盈峰环境	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.06	172,400.00	872,344.00
399	688321	微芯生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	25.19	34,600.00	871,574.00
400	603000	人民网	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	11.20	77,600.00	869,120.00
401	000961	中南建设	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.05	283,600.00	864,980.00
402	600717	天津港	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.01	214,600.00	860,546.00
403	600623	华谊集团	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.30	102,300.00	849,090.00

404	002434	万里扬	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.55	97,900.00	837,045.00
405	000718	苏宁环球	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.68	224,800.00	827,264.00
406	300888	稳健医疗	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	66.50	12,400.00	824,600.00
407	601928	凤凰传媒	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	7.15	112,900.00	807,235.00
408	000671	阳光城	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.19	367,300.00	804,387.00
409	002705	新宝股份	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	21.99	36,400.00	800,436.00
410	603712	七一二	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	31.50	25,400.00	800,100.00
411	600648	外高桥	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.60	58,600.00	796,960.00
412	000415	渤海租赁	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.17	365,800.00	793,786.00
413	688185	康希诺	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	199.08	3,900.00	776,412.00
414	600968	海油发展	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.58	300,800.00	776,064.00
415	600056	中国医药	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 8 日	14.82	52,000.00	770,640.00
416	600835	上海机电	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	13.73	56,000.00	768,880.00
417	000031	大悦城	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.00	190,500.00	762,000.00
418	600787	中储股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.69	129,900.00	739,131.00
419	688256	寒武纪	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	64.70	11,400.00	737,580.00
420	600928	西安银行	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.67	197,300.00	724,091.00
421	600339	中油工程	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.89	248,500.00	718,165.00
422	300070	碧水源	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 8 日	5.21	134,100.00	698,661.00
423	688029	南微医学	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	87.20	7,980.00	695,856.00
424	688088	虹软科技	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	31.59	21,800.00	688,662.00
425	688289	圣湘生物	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	29.61	22,900.00	678,069.00

426	601228	广州港	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.67	183,500.00	673,445.00
427	600299	安迪苏	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	9.58	70,000.00	670,600.00
428	688009	中国通号	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.53	147,300.00	667,269.00
429	002242	九阳股份	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	18.36	35,300.00	648,108.00
430	600377	宁沪高速	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.57	74,600.00	639,322.00
431	000717	韶钢松山	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	3.50	178,800.00	625,800.00
432	300869	康泰医学	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	28.26	21,700.00	613,242.00
433	601969	海南矿业	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	8.59	70,300.00	603,877.00
434	600329	达仁堂	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	24.58	24,400.00	599,752.00
435	000028	国药一致	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	29.79	20,000.00	595,800.00
436	000869	张裕 A	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	29.74	20,000.00	594,800.00
437	601298	青岛港	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.47	103,600.00	566,692.00
438	601139	深圳燃气	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.94	78,900.00	547,566.00
439	603228	景旺电子	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	23.33	22,800.00	531,924.00
440	600823	世茂股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	2.98	167,000.00	497,660.00
441	002653	海思科	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	16.11	30,800.00	496,188.00
442	001872	招商港口	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	15.60	31,300.00	488,280.00
443	000062	深圳华强	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	12.70	35,700.00	453,390.00
444	601828	美凯龙	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	6.06	73,600.00	446,016.00
445	603379	三美股份	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	22.25	20,000.00	445,000.00
446	603883	老百姓	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 5 日	33.88	13,000.00	440,440.00
447	600350	山东高速	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	5.25	81,400.00	427,350.00

448	002563	森马服饰	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 8 日	5.92	66,400.00	393,088.00
449	603515	欧普照明	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	17.45	20,000.00	349,000.00
450	601003	柳钢股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	4.05	75,500.00	305,775.00
451	603719	良品铺子	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	28.63	10,000.00	286,300.00
452	603355	莱克电气	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	25.23	10,000.00	252,300.00
453	688819	天能股份	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 11 日	34.58	7,200.00	248,976.00
454	600917	重庆燃气	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 5 日	7.22	10,000.00	72,200.00
合计	-	-	-	-	91,671,475.00	823,291,708.25

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证

券市场整体波动) 发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 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	4,085,852,685.33	97.99	5,881,398,889.38	97.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	263,949.74	0.01	404,000.00	0.01
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	4,086,116,635.07	98.00	5,881,802,889.38	97.82

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

②由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-204,878,388.96	-270,936,787.40
	+5%	204,878,388.96	270,936,787.40

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
第一层次	4,076,257,853.25
第二层次	7,935,916.77
第三层次	1,922,865.05
合计	4,086,116,635.07

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	4,085,852,685.33	95.39
	其中：股票	4,085,852,685.33	95.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	263,949.74	0.01
	其中：债券	263,949.74	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	-	-
	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	80,842,590.86	1.89
8	其他各项资产	116,409,665.90	2.72
9	合计	4,283,368,891.83	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 823,291,708.25 元, 占本基金期末资产净值的 19.75%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	37,448,461.04	0.90
B	采矿业	182,481,720.17	4.38
C	制造业	2,427,844,055.84	58.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	125,815,954.90	3.02
E	建筑业	52,712,742.33	1.26
F	批发和零售业	157,232,111.27	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	108,768,063.34	2.61
H	住宿和餐饮业	8,652,273.60	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	303,425,782.21	7.28
J	金融业	361,499,101.90	8.67
K	房地产业	96,357,797.93	2.31
L	租赁和商务服务业	49,350,632.81	1.18
M	科学研究和技术服务业	50,710,679.82	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	29,659,363.30	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	9,578,955.44	0.23
R	文化、体育和娱乐业	54,410,392.18	1.30
S	综合	29,904,585.25	0.72
	合计	4,085,852,673.33	97.99

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	1,691,511	39,073,904.10	0.94
2	601615	明阳智能	1,041,398	35,199,252.40	0.84
3	600256	广汇能源	2,845,880	29,995,575.20	0.72

4	300769	德方纳米	66,998	27,380,742.64	0.66
5	600096	云天化	797,200	25,095,856.00	0.60
6	300012	华测检测	1,039,800	24,133,758.00	0.58
7	002497	雅化集团	712,000	23,246,800.00	0.56
8	002407	多氟多	475,100	23,237,141.00	0.56
9	002240	盛新锂能	370,000	22,333,200.00	0.54
10	002180	纳思达	437,800	22,161,436.00	0.53
11	300390	天华超净	253,101	22,121,027.40	0.53
12	600157	永泰能源	13,741,500	21,848,985.00	0.52
13	600885	宏发股份	518,314	21,691,440.90	0.52
14	000009	中国宝安	1,594,332	21,507,538.68	0.52
15	600141	兴发集团	482,910	21,243,210.90	0.51
16	300073	当升科技	222,210	20,074,451.40	0.48
17	600392	盛和资源	866,757	19,588,708.20	0.47
18	002384	东山精密	845,200	19,380,436.00	0.46
19	603613	国联股份	218,582	19,366,365.20	0.46
20	002756	永兴材料	124,707	18,981,652.47	0.46
21	600418	江淮汽车	1,082,714	18,579,372.24	0.45
22	300285	国瓷材料	498,905	17,920,667.60	0.43
23	600765	中航重机	544,677	17,527,705.86	0.42
24	600399	抚顺特钢	972,400	17,405,960.00	0.42
25	600233	圆通速递	848,800	17,307,032.00	0.42
26	601555	东吴证券	2,475,570	17,155,700.10	0.41
27	601058	赛轮轮胎	1,517,580	17,103,126.60	0.41
28	600487	亨通光电	1,168,500	16,989,990.00	0.41
29	300037	新宙邦	322,520	16,951,651.20	0.41
30	600499	科达制造	820,800	16,941,312.00	0.41
31	000983	山西焦煤	1,264,670	16,933,931.30	0.41
32	600732	爱旭股份	505,670	16,697,223.40	0.40
33	600563	法拉电子	81,058	16,629,859.28	0.40
34	603077	和邦生物	3,829,864	16,315,220.64	0.39
35	603456	九洲药业	310,205	16,037,598.50	0.38
36	688099	晶晨股份	158,585	16,017,085.00	0.38
37	002385	大北农	2,048,700	16,000,347.00	0.38
38	300363	博腾股份	204,100	15,917,759.00	0.38
39	688180	君实生物	210,670	15,871,877.80	0.38
40	601108	财通证券	2,014,960	15,857,735.20	0.38
41	002268	卫士通	369,222	15,843,316.02	0.38
42	688122	西部超导	167,401	15,434,372.20	0.37
43	600486	扬农化工	113,776	15,164,065.28	0.36
44	000519	中兵红箭	519,795	15,152,024.25	0.36
45	600298	安琪酵母	309,565	15,091,293.75	0.36
46	603345	安井食品	88,500	14,856,495.00	0.36

47	000630	铜陵有色	4,555,467	14,850,822.42	0.36
48	300144	宋城演艺	965,943	14,827,225.05	0.36
49	600862	中航高科	520,000	14,612,000.00	0.35
50	000988	华工科技	623,276	14,441,304.92	0.35
51	002353	杰瑞股份	357,899	14,423,329.70	0.35
52	000783	长江证券	2,395,800	14,207,094.00	0.34
53	601077	渝农商行	3,829,600	14,169,520.00	0.34
54	603605	珀莱雅	84,680	13,987,442.40	0.34
55	601168	西部矿业	1,179,231	13,950,302.73	0.33
56	002625	光启技术	802,100	13,852,267.00	0.33
57	601696	中银证券	1,031,000	13,712,300.00	0.33
58	300146	汤臣倍健	632,631	13,696,461.15	0.33
59	601162	天风证券	4,288,800	13,638,384.00	0.33
60	300724	捷佳伟创	150,900	13,482,915.00	0.32
61	002056	横店东磁	505,500	13,456,410.00	0.32
62	002028	思源电气	375,176	13,378,776.16	0.32
63	002797	第一创业	2,080,200	13,334,082.00	0.32
64	603589	口子窖	227,400	13,327,914.00	0.32
65	002507	涪陵榨菜	382,032	13,187,744.64	0.32
66	688777	中控技术	180,044	13,100,001.44	0.31
67	600988	赤峰黄金	820,800	13,091,760.00	0.31
68	000932	华菱钢铁	2,566,320	13,062,568.80	0.31
69	603517	绝味食品	225,500	13,038,410.00	0.31
70	002185	华天科技	1,389,900	13,037,262.00	0.31
71	601128	常熟银行	1,698,300	12,975,012.00	0.31
72	605117	德业股份	46,040	12,886,135.60	0.31
73	601636	旗滨集团	995,650	12,694,537.50	0.30
74	002603	以岭药业	519,800	12,631,140.00	0.30
75	600521	华海药业	553,800	12,571,260.00	0.30
76	600039	四川路桥	1,189,256	12,522,865.68	0.30
77	600109	国金证券	1,384,400	12,459,600.00	0.30
78	002326	永太科技	377,100	12,417,903.00	0.30
79	603026	石大胜华	85,400	12,412,890.00	0.30
80	688390	固德威	39,603	12,396,135.03	0.30
81	601607	上海医药	685,000	12,384,800.00	0.30
82	000830	鲁西化工	711,500	12,301,835.00	0.30
83	002078	太阳纸业	995,872	12,259,184.32	0.29
84	600153	建发股份	922,453	12,056,460.71	0.29
85	002624	完美世界	838,200	12,044,934.00	0.29
86	600546	山煤国际	614,100	11,950,386.00	0.29
87	601872	招商轮船	2,009,600	11,575,296.00	0.28
88	002422	科伦药业	618,300	11,562,210.00	0.28
89	603939	益丰药房	218,100	11,522,223.00	0.28

90	600348	华阳股份	743,773	11,498,730.58	0.28
91	600705	中航产融	3,313,200	11,463,672.00	0.27
92	000831	五矿稀土	366,800	11,462,500.00	0.27
93	600549	厦门钨业	529,990	11,458,383.80	0.27
94	600497	驰宏锌锗	2,204,200	11,439,798.00	0.27
95	600177	雅戈尔	1,723,731	11,428,336.53	0.27
96	300699	光威复材	194,126	11,428,197.62	0.27
97	601990	南京证券	1,369,800	11,424,132.00	0.27
98	000738	航发控制	405,406	11,391,908.60	0.27
99	000970	中科三环	602,480	11,314,574.40	0.27
100	300088	长信科技	1,520,250	11,280,255.00	0.27
101	600875	东方电气	685,643	11,278,827.35	0.27
102	603267	鸿远电子	83,800	11,256,854.00	0.27
103	603127	昭衍新药	97,385	11,082,413.00	0.27
104	300676	华大基因	153,860	11,031,762.00	0.26
105	600160	巨化股份	833,030	10,954,344.50	0.26
106	000999	华润三九	242,284	10,902,780.00	0.26
107	600859	王府井	419,542	10,899,701.16	0.26
108	000998	隆平高科	654,129	10,897,789.14	0.26
109	002673	西部证券	1,660,255	10,858,067.70	0.26
110	002138	顺络电子	397,290	10,826,152.50	0.26
111	601699	潞安环能	740,300	10,823,186.00	0.26
112	002572	索菲亚	393,500	10,821,250.00	0.26
113	002557	洽洽食品	189,839	10,807,534.27	0.26
114	600516	方大炭素	1,415,874	10,760,642.40	0.26
115	603444	吉比特	27,713	10,752,644.00	0.26
116	600143	金发科技	1,117,600	10,639,552.00	0.26
117	000807	云铝股份	1,074,200	10,613,096.00	0.25
118	002508	老板电器	293,500	10,574,805.00	0.25
119	600482	中国动力	672,900	10,571,259.00	0.25
120	000039	中集集团	760,560	10,533,756.00	0.25
121	601997	贵阳银行	1,810,900	10,521,329.00	0.25
122	002030	达安基因	608,413	10,458,619.47	0.25
123	000960	锡业股份	620,492	10,405,650.84	0.25
124	002273	水晶光电	859,251	10,405,529.61	0.25
125	002465	海格通信	1,138,800	10,351,692.00	0.25
126	300357	我武生物	196,211	10,208,858.33	0.24
127	000629	攀钢钒钛	2,661,007	10,111,826.60	0.24
128	300136	信维通信	598,800	10,089,780.00	0.24
129	300058	蓝色光标	1,543,471	10,078,865.63	0.24
130	000728	国元证券	1,619,465	10,073,072.30	0.24
131	000975	银泰黄金	1,030,485	10,036,923.90	0.24
132	600170	上海建工	3,307,400	10,021,422.00	0.24

133	600704	物产中大	1,928,955	9,895,539.15	0.24
134	601577	长沙银行	1,246,284	9,883,032.12	0.24
135	002092	中泰化学	1,272,600	9,875,376.00	0.24
136	002409	雅克科技	177,800	9,869,678.00	0.24
137	600536	中国软件	243,010	9,863,775.90	0.24
138	002294	信立泰	346,771	9,744,265.10	0.23
139	689009	九号公司	218,284	9,713,638.00	0.23
140	600079	人福医药	606,700	9,707,200.00	0.23
141	600739	辽宁成大	665,264	9,699,549.12	0.23
142	603198	迎驾贡酒	148,500	9,673,290.00	0.23
143	300244	迪安诊断	307,483	9,562,721.30	0.23
144	300474	景嘉微	139,406	9,533,976.34	0.23
145	000547	航天发展	795,851	9,502,460.94	0.23
146	300418	昆仑万维	592,444	9,479,104.00	0.23
147	002223	鱼跃医疗	368,819	9,463,895.54	0.23
148	000636	风华高科	503,281	9,456,649.99	0.23
149	002506	协鑫集成	2,534,200	9,427,224.00	0.23
150	002372	伟星新材	392,063	9,425,194.52	0.23
151	002739	万达电影	688,600	9,399,390.00	0.23
152	600415	小商品城	1,687,100	9,397,147.00	0.23
153	300558	贝达药业	154,400	9,387,520.00	0.23
154	300253	卫宁健康	1,064,000	9,341,920.00	0.22
155	600699	均胜电子	592,475	9,307,782.25	0.22
156	600372	中航电子	478,500	9,278,115.00	0.22
157	300296	利亚德	1,263,000	9,219,900.00	0.22
158	300308	中际旭创	296,900	9,218,745.00	0.22
159	600315	上海家化	212,648	9,090,702.00	0.22
160	600637	东方明珠	1,270,672	9,085,304.80	0.22
161	002683	广东宏大	325,363	9,054,852.29	0.22
162	600867	通化东宝	869,619	8,991,860.46	0.22
163	600985	淮北矿业	614,800	8,951,488.00	0.21
164	601016	节能风电	1,864,211	8,948,212.80	0.21
165	000887	中鼎股份	490,400	8,944,896.00	0.21
166	600236	桂冠电力	1,462,290	8,905,346.10	0.21
167	601198	东兴证券	998,478	8,886,454.20	0.21
168	600171	上海贝岭	354,700	8,878,141.00	0.21
169	600026	中远海能	858,747	8,870,856.51	0.21
170	002299	圣农发展	462,500	8,870,750.00	0.21
171	300832	新产业	196,459	8,862,265.49	0.21
172	002156	通富微电	574,887	8,853,259.80	0.21
173	688185	康希诺	44,275	8,814,267.00	0.21
174	002065	东华软件	1,390,400	8,787,328.00	0.21
175	600380	健康元	708,463	8,749,518.05	0.21

176	600879	航天电子	1,346,334	8,737,707.66	0.21
177	600258	首旅酒店	348,882	8,652,273.60	0.21
178	600642	申能股份	1,520,930	8,638,882.40	0.21
179	300026	红日药业	1,119,700	8,621,690.00	0.21
180	002936	郑州银行	3,184,677	8,566,781.13	0.21
181	002408	齐翔腾达	1,055,878	8,563,170.58	0.21
182	000750	国海证券	2,357,443	8,557,518.09	0.21
183	000623	吉林敖东	574,987	8,486,808.12	0.20
184	002203	海亮股份	729,600	8,426,880.00	0.20
185	000729	燕京啤酒	871,252	8,416,294.32	0.20
186	600673	东阳光	934,043	8,397,046.57	0.20
187	000878	云南铜业	735,900	8,381,901.00	0.20
188	000400	许继电气	436,400	8,378,880.00	0.20
189	600820	隧道股份	1,362,700	8,339,724.00	0.20
190	688256	寒武纪	128,842	8,336,077.40	0.20
191	000513	丽珠集团	229,750	8,319,247.50	0.20
192	600038	中直股份	183,727	8,304,460.40	0.20
193	600529	山东药玻	294,400	8,228,480.00	0.20
194	600801	华新水泥	420,367	8,201,360.17	0.20
195	600580	卧龙电驱	568,700	8,200,654.00	0.20
196	600369	西南证券	2,054,900	8,157,953.00	0.20
197	002439	启明星辰	409,200	8,155,356.00	0.20
198	002183	怡亚通	1,130,100	8,148,021.00	0.20
199	300383	光环新网	780,000	8,127,600.00	0.19
200	300017	网宿科技	1,515,200	8,121,472.00	0.19
201	601717	郑煤机	563,400	8,118,594.00	0.19
202	002131	利欧股份	4,178,914	8,107,093.16	0.19
203	600166	福田汽车	2,848,800	8,062,104.00	0.19
204	600848	上海临港	592,400	8,032,944.00	0.19
205	600316	洪都航空	265,057	8,015,323.68	0.19
206	603568	伟明环保	239,734	7,999,923.58	0.19
207	002958	青农商行	2,407,400	7,992,568.00	0.19
208	002444	巨星科技	423,668	7,981,905.12	0.19
209	002195	二三四五	3,540,568	7,966,278.00	0.19
210	600325	华发股份	1,048,276	7,935,449.32	0.19
211	600909	华安证券	1,741,573	7,924,157.15	0.19
212	601005	重庆钢铁	4,147,100	7,920,961.00	0.19
213	600027	华电国际	2,015,100	7,919,343.00	0.19
214	600008	首创环保	2,720,670	7,889,943.00	0.19
215	300001	特锐德	450,902	7,805,113.62	0.19
216	300024	机器人	768,300	7,744,464.00	0.19
217	300618	寒锐钴业	133,488	7,731,624.96	0.19
218	000825	太钢不锈	1,412,600	7,698,670.00	0.18

219	002500	山西证券	1,332,560	7,648,894.40	0.18
220	002926	华西证券	971,800	7,618,912.00	0.18
221	603218	日月股份	299,400	7,604,760.00	0.18
222	002373	千方科技	682,957	7,594,481.84	0.18
223	000050	深天马 A	761,000	7,587,170.00	0.18
224	000739	普洛药业	367,214	7,579,296.96	0.18
225	000027	深圳能源	1,176,980	7,544,441.80	0.18
226	002430	杭氧股份	241,300	7,543,038.00	0.18
227	600271	航天信息	685,500	7,499,370.00	0.18
228	002250	联化科技	457,455	7,488,538.35	0.18
229	002670	国盛金控	776,486	7,454,265.60	0.18
230	002212	天融信	733,095	7,440,914.25	0.18
231	600118	中国卫星	368,484	7,399,158.72	0.18
232	600863	内蒙华电	2,023,966	7,387,475.90	0.18
233	601866	中远海发	2,455,738	7,367,214.00	0.18
234	600208	新湖中宝	2,659,900	7,341,324.00	0.18
235	688521	芯原股份	147,803	7,301,468.20	0.18
236	603233	大参林	232,490	7,276,937.00	0.17
237	688009	中国通号	1,598,933	7,243,166.49	0.17
238	300677	英科医疗	285,180	7,232,164.80	0.17
239	000060	中金岭南	1,618,200	7,217,172.00	0.17
240	002249	大洋电机	1,170,219	7,185,144.66	0.17
241	300009	安科生物	708,378	7,161,701.58	0.17
242	002985	北摩高科	122,182	7,157,421.56	0.17
243	601992	金隅集团	2,583,312	7,155,774.24	0.17
244	000778	新兴铸管	1,481,100	7,138,902.00	0.17
245	002152	广电运通	769,300	7,131,411.00	0.17
246	603156	养元饮品	313,881	7,131,376.32	0.17
247	603658	安图生物	144,926	7,085,432.14	0.17
248	600066	宇通客车	817,700	7,073,105.00	0.17
249	300070	碧水源	1,345,800	7,011,618.00	0.17
250	603858	步长制药	355,358	7,004,106.18	0.17
251	300182	捷成股份	1,271,500	6,993,250.00	0.17
252	000401	冀东水泥	660,404	6,947,450.08	0.17
253	300168	万达信息	734,507	6,933,746.08	0.17
254	002966	苏州银行	1,132,270	6,906,847.00	0.17
255	600998	九州通	579,119	6,897,307.29	0.17
256	300251	光线传媒	725,400	6,869,538.00	0.16
257	600056	中国医药	463,437	6,868,136.34	0.16
258	002191	劲嘉股份	637,400	6,832,928.00	0.16
259	002128	电投能源	476,749	6,827,045.68	0.16
260	600390	五矿资本	1,393,700	6,815,193.00	0.16
261	000997	新大陆	513,600	6,784,656.00	0.16

262	600970	中材国际	699,245	6,775,684.05	0.16
263	300482	万孚生物	165,827	6,750,817.17	0.16
264	600667	太极实业	913,000	6,737,940.00	0.16
265	000021	深科技	578,800	6,737,232.00	0.16
266	002831	裕同科技	227,658	6,727,293.90	0.16
267	002505	鹏都农牧	1,973,640	6,690,639.60	0.16
268	002244	滨江集团	771,594	6,674,288.10	0.16
269	600528	中铁工业	827,925	6,664,796.25	0.16
270	600021	上海电力	649,790	6,660,347.50	0.16
271	002221	东华能源	713,069	6,638,672.39	0.16
272	603885	吉祥航空	367,630	6,613,663.70	0.16
273	000656	金科股份	2,308,200	6,601,452.00	0.16
274	600839	四川长虹	2,287,189	6,587,104.32	0.16
275	600062	华润双鹤	256,668	6,586,100.88	0.16
276	600827	百联股份	498,337	6,583,031.77	0.16
277	600297	广汇汽车	2,516,300	6,567,543.00	0.16
278	000987	越秀金控	932,855	6,557,970.65	0.16
279	002396	星网锐捷	288,395	6,529,262.80	0.16
280	002127	南极电商	1,216,200	6,494,508.00	0.16
281	600598	北大荒	439,751	6,490,724.76	0.16
282	603707	健友股份	228,315	6,438,483.00	0.15
283	002019	亿帆医药	458,600	6,411,228.00	0.15
284	600155	华创阳安	753,900	6,393,072.00	0.15
285	600498	烽火通信	440,800	6,382,784.00	0.15
286	688002	睿创微纳	160,449	6,373,034.28	0.15
287	600201	生物股份	695,047	6,366,630.52	0.15
288	002266	浙富控股	1,328,713	6,364,535.27	0.15
289	000012	南玻 A	847,890	6,291,343.80	0.15
290	600409	三友化工	767,300	6,284,187.00	0.15
291	002155	湖南黄金	517,300	6,280,022.00	0.15
292	600259	广晟有色	123,847	6,272,850.55	0.15
293	000930	中粮科技	690,500	6,242,120.00	0.15
294	000883	湖北能源	1,220,700	6,237,777.00	0.15
295	600511	国药股份	230,959	6,185,082.02	0.15
296	688188	柏楚电子	28,082	6,179,163.28	0.15
297	600755	厦门国贸	821,853	6,163,897.50	0.15
298	002153	石基信息	387,799	6,154,370.13	0.15
299	600718	东软集团	534,600	6,153,246.00	0.15
300	002124	天邦食品	911,140	6,122,860.80	0.15
301	002511	中顺洁柔	489,002	6,122,305.04	0.15
302	600060	海信视像	487,260	6,090,750.00	0.15
303	603712	七一二	192,705	6,070,207.50	0.15
304	000686	东北证券	867,959	6,067,033.41	0.15

305	600959	江苏有线	1,859,416	6,061,696.16	0.15
306	600566	济川药业	222,600	6,045,816.00	0.14
307	600282	南钢股份	1,905,500	6,002,325.00	0.14
308	000581	威孚高科	310,959	5,985,960.75	0.14
309	600895	张江高科	480,443	5,981,515.35	0.14
310	600782	新钢股份	1,183,600	5,965,344.00	0.14
311	000709	河钢股份	2,628,100	5,939,506.00	0.14
312	601880	辽港股份	3,490,890	5,934,513.00	0.14
313	601179	中国西电	1,263,757	5,914,382.76	0.14
314	000690	宝新能源	1,346,680	5,898,458.40	0.14
315	600022	山东钢铁	3,384,460	5,888,960.40	0.14
316	600064	南京高科	532,320	5,855,520.00	0.14
317	002939	长城证券	575,400	5,846,064.00	0.14
318	600535	天士力	555,300	5,836,203.00	0.14
319	002701	奥瑞金	1,118,920	5,818,384.00	0.14
320	601778	晶科科技	1,075,823	5,809,444.20	0.14
321	300376	易事特	714,600	5,802,552.00	0.14
322	002002	鸿达兴业	1,548,957	5,746,630.47	0.14
323	300630	普利制药	162,706	5,719,115.90	0.14
324	600216	浙江医药	416,900	5,690,685.00	0.14
325	600500	中化国际	854,087	5,679,678.55	0.14
326	000598	兴蓉环境	1,111,256	5,678,518.16	0.14
327	600808	马钢股份	1,496,000	5,669,840.00	0.14
328	600037	歌华有线	603,100	5,663,109.00	0.14
329	002468	申通快递	474,714	5,658,590.88	0.14
330	002532	天山铝业	862,400	5,631,472.00	0.14
331	600663	陆家嘴	542,562	5,620,942.32	0.13
332	600728	佳都科技	869,452	5,616,659.92	0.13
333	600567	山鹰国际	1,996,200	5,529,474.00	0.13
334	600517	国网英大	1,062,322	5,513,451.18	0.13
335	002004	华邦健康	983,464	5,487,729.12	0.13
336	002595	豪迈科技	245,555	5,485,698.70	0.13
337	603866	桃李面包	331,261	5,482,369.55	0.13
338	603225	新凤鸣	474,280	5,473,191.20	0.13
339	688006	杭可科技	78,061	5,468,953.66	0.13
340	601456	国联证券	443,367	5,440,113.09	0.13
341	300463	迈克生物	264,001	5,409,380.49	0.13
342	000785	居然之家	1,212,900	5,397,405.00	0.13
343	300115	长盈精密	523,347	5,395,707.57	0.13
344	002429	兆驰股份	1,403,000	5,387,520.00	0.13
345	600597	光明乳业	425,800	5,377,854.00	0.13
346	002745	木林森	549,255	5,366,221.35	0.13
347	688208	道通科技	162,348	5,344,496.16	0.13

348	601958	金钼股份	599,100	5,296,044.00	0.13
349	688289	圣湘生物	177,560	5,257,551.60	0.13
350	300166	东方国信	569,539	5,251,149.58	0.13
351	601106	中国一重	1,699,900	5,218,693.00	0.13
352	002390	信邦制药	753,500	5,206,685.00	0.12
353	601860	紫金银行	1,813,264	5,204,067.68	0.12
354	300072	三聚环保	1,016,886	5,145,443.16	0.12
355	600572	康恩贝	1,153,935	5,111,932.05	0.12
356	300888	稳健医疗	76,500	5,087,250.00	0.12
357	600398	海澜之家	1,070,777	5,086,190.75	0.12
358	601718	际华集团	1,636,700	5,073,770.00	0.12
359	603927	中科软	217,380	5,069,301.60	0.12
360	601118	海南橡胶	1,059,903	5,066,336.34	0.12
361	600507	方大特钢	720,511	5,036,371.89	0.12
362	000540	中天金融	2,595,850	5,009,990.50	0.12
363	600737	中粮糖业	664,353	4,995,934.56	0.12
364	000937	冀中能源	658,800	4,914,648.00	0.12
365	000089	深圳机场	636,059	4,910,375.48	0.12
366	603883	老百姓	144,784	4,905,281.92	0.12
367	600582	天地科技	1,023,700	4,893,286.00	0.12
368	000559	万向钱潮	821,120	4,877,452.80	0.12
369	002048	宁波华翔	302,434	4,844,992.68	0.12
370	002690	美亚光电	222,947	4,833,490.96	0.12
371	002368	太极股份	249,290	4,788,860.90	0.11
372	600967	内蒙一机	524,615	4,784,488.80	0.11
373	000898	鞍钢股份	1,483,313	4,776,267.86	0.11
374	600871	石化油服	2,518,500	4,759,965.00	0.11
375	600435	北方导航	551,275	4,751,990.50	0.11
376	601000	唐山港	1,828,212	4,716,786.96	0.11
377	001914	招商积余	261,100	4,691,967.00	0.11
378	601568	北元集团	737,090	4,673,150.60	0.11
379	002110	三钢闽光	759,104	4,622,943.36	0.11
380	002233	塔牌集团	519,200	4,594,920.00	0.11
381	600556	天下秀	557,900	4,591,517.00	0.11
382	000959	首钢股份	964,200	4,589,592.00	0.11
383	600195	中牧股份	374,313	4,589,077.38	0.11
384	601333	广深铁路	2,097,789	4,573,180.02	0.11
385	000156	华数传媒	572,405	4,562,067.85	0.11
386	002705	新宝股份	206,815	4,547,861.85	0.11
387	002281	光迅科技	258,215	4,539,419.70	0.11
388	000537	广宇发展	347,600	4,515,324.00	0.11
389	600811	东方集团	1,589,441	4,498,118.03	0.11
390	600764	中国海防	176,900	4,464,956.00	0.11

391	003035	南网能源	701,600	4,455,160.00	0.11
392	002010	传化智联	692,200	4,450,846.00	0.11
393	002174	游族网络	453,600	4,431,672.00	0.11
394	000402	金融街	739,600	4,400,620.00	0.11
395	600329	达仁堂	178,500	4,387,530.00	0.11
396	688321	微芯生物	173,236	4,363,814.84	0.10
397	603638	艾迪精密	210,664	4,318,612.00	0.10
398	600120	浙江东方	1,076,631	4,317,290.31	0.10
399	002416	爱施德	460,641	4,283,961.30	0.10
400	000488	晨鸣纸业	758,300	4,276,812.00	0.10
401	300212	易华录	245,480	4,271,352.00	0.10
402	600126	杭钢股份	833,707	4,268,579.84	0.10
403	600167	联美控股	565,206	4,233,392.94	0.10
404	000990	诚志股份	385,401	4,220,140.95	0.10
405	601200	上海环境	415,327	4,219,722.32	0.10
406	600446	金证股份	406,100	4,215,318.00	0.10
407	002925	盈趣科技	195,519	4,207,568.88	0.10
408	688029	南微医学	48,152	4,198,854.40	0.10
409	002867	周大生	270,300	4,197,759.00	0.10
410	601098	中南传媒	444,475	4,195,844.00	0.10
411	000685	中山公用	545,790	4,191,667.20	0.10
412	600373	中文传媒	418,187	4,177,688.13	0.10
413	002081	金螳螂	821,945	4,175,480.60	0.10
414	002382	蓝帆医疗	435,763	4,161,536.65	0.10
415	600707	彩虹股份	888,000	4,155,840.00	0.10
416	601611	中国核建	493,400	4,139,626.00	0.10
417	000158	常山北明	688,909	4,133,454.00	0.10
418	688088	虹软科技	130,509	4,122,779.31	0.10
419	002146	荣盛发展	1,345,500	4,076,865.00	0.10
420	601608	中信重工	1,073,894	4,070,058.26	0.10
421	001965	招商公路	532,900	4,066,027.00	0.10
422	600095	湘财股份	526,100	4,045,709.00	0.10
423	002387	维信诺	599,000	4,025,280.00	0.10
424	002399	海普瑞	228,923	4,024,466.34	0.10
425	603317	天味食品	140,986	4,013,871.42	0.10
426	000967	盈峰环境	788,689	3,990,766.34	0.10
427	600131	国网信通	295,844	3,979,101.80	0.10
428	002948	青岛银行	1,095,604	3,966,086.48	0.10
429	000528	柳工	605,630	3,942,651.30	0.09
430	600376	首开股份	801,742	3,936,553.22	0.09
431	600623	华谊集团	468,185	3,885,935.50	0.09
432	601187	厦门银行	649,700	3,872,212.00	0.09
433	603000	人民网	343,854	3,851,164.80	0.09

434	000563	陕国投 A	1,227,800	3,830,736.00	0.09
435	002423	中粮资本	569,300	3,820,003.00	0.09
436	601598	中国外运	978,900	3,798,132.00	0.09
437	600901	江苏租赁	739,027	3,791,208.51	0.09
438	600307	酒钢宏兴	1,947,100	3,777,374.00	0.09
439	600006	东风汽车	495,700	3,742,535.00	0.09
440	601991	大唐发电	1,535,850	3,732,115.50	0.09
441	603228	景旺电子	158,423	3,696,008.59	0.09
442	300257	开山股份	243,904	3,648,803.84	0.09
443	000961	中南建设	1,183,600	3,609,980.00	0.09
444	600906	财达证券	399,800	3,594,202.00	0.09
445	600717	天津港	895,459	3,590,790.59	0.09
446	603650	彤程新材	109,400	3,564,252.00	0.09
447	002242	九阳股份	191,496	3,515,866.56	0.08
448	002434	万里扬	404,545	3,458,859.75	0.08
449	000718	苏宁环球	932,900	3,433,072.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	473,481	3,385,389.15	0.08
451	000671	阳光城	1,540,100	3,372,819.00	0.08
452	000415	渤海租赁	1,533,400	3,327,478.00	0.08
453	600968	海油发展	1,260,600	3,252,348.00	0.08
454	000553	安道麦 A	268,300	3,249,113.00	0.08
455	601969	海南矿业	372,800	3,202,352.00	0.08
456	000031	大悦城	799,395	3,197,580.00	0.08
457	600648	外高桥	228,751	3,111,013.60	0.07
458	600787	中储股份	540,100	3,073,169.00	0.07
459	600928	西安银行	828,200	3,039,494.00	0.07
460	600339	中油工程	1,034,700	2,990,283.00	0.07
461	002563	森马服饰	502,200	2,973,024.00	0.07
462	002815	崇达技术	221,400	2,836,134.00	0.07
463	601228	广州港	767,300	2,815,991.00	0.07
464	688819	天能股份	81,245	2,809,452.10	0.07
465	600835	上海机电	201,400	2,765,222.00	0.07
466	300869	康泰医学	97,525	2,756,056.50	0.07
467	000028	国药一致	90,170	2,686,164.30	0.06
468	600377	宁沪高速	307,300	2,633,561.00	0.06
469	000717	韶钢松山	748,800	2,620,800.00	0.06
470	603056	德邦股份	192,300	2,582,589.00	0.06
471	002945	华林证券	167,800	2,558,950.00	0.06
472	603379	三美股份	111,989	2,491,755.25	0.06
473	000062	深圳华强	195,943	2,488,476.10	0.06
474	601139	深圳燃气	358,300	2,486,602.00	0.06
475	000869	张裕 A	81,635	2,427,824.90	0.06
476	601869	长飞光纤	78,358	2,422,829.36	0.06

477	601298	青岛港	433,300	2,370,151.00	0.06
478	600299	安迪苏	247,000	2,366,260.00	0.06
479	603868	飞科电器	30,780	2,331,585.00	0.06
480	300741	华宝股份	79,174	2,202,620.68	0.05
481	001872	招商港口	139,857	2,181,769.20	0.05
482	002653	海思科	132,500	2,134,575.00	0.05
483	601156	东航物流	106,500	2,108,700.00	0.05
484	600823	世茂股份	694,494	2,069,592.12	0.05
485	601828	美凯龙	336,040	2,036,402.40	0.05
486	600350	山东高速	384,700	2,019,675.00	0.05
487	600927	永安期货	97,100	1,958,507.00	0.05
488	001227	兰州银行	385,400	1,896,168.00	0.05
489	603355	莱克电气	73,850	1,863,235.50	0.04
490	603786	科博达	28,287	1,741,630.59	0.04
491	603515	欧普照明	91,144	1,590,462.80	0.04
492	001203	大中矿业	139,585	1,577,310.50	0.04
493	601665	齐鲁银行	312,395	1,524,487.60	0.04
494	603719	良品铺子	51,600	1,477,308.00	0.04
495	002946	新乳业	105,691	1,372,926.09	0.03
496	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.03
497	601003	柳钢股份	317,900	1,287,495.00	0.03
498	002901	大博医疗	29,517	1,155,295.38	0.03
499	600956	新天绿能	84,800	1,044,736.00	0.03
500	603983	丸美股份	33,600	900,480.00	0.02
501	600917	重庆燃气	105,300	760,266.00	0.02
502	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
503	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
504	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
505	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
506	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
507	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
508	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
509	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
510	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
511	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
512	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
513	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
514	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
515	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
516	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
517	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
518	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
519	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00

520	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
521	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
522	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
523	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
524	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
525	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
526	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
527	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
528	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
529	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
530	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
531	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
532	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
533	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
534	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
535	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
536	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	000733	振华科技	26,138,558.00	0.43
2	300012	华测检测	25,905,096.00	0.43
3	300769	德方纳米	25,085,826.20	0.42
4	600096	云天化	25,039,711.00	0.42
5	002497	雅化集团	24,536,030.00	0.41
6	002240	盛新锂能	23,114,441.00	0.38
7	002407	多氟多	21,267,660.00	0.35
8	300390	天华超净	20,118,958.38	0.33
9	688180	君实生物	19,139,464.43	0.32
10	300073	当升科技	18,939,377.20	0.31
11	002756	永兴材料	18,763,907.61	0.31
12	601058	赛轮轮胎	17,870,722.75	0.30
13	002340	格林美	17,623,286.37	0.29
14	300285	国瓷材料	17,488,447.53	0.29
15	688122	西部超导	17,218,266.07	0.29
16	002180	纳思达	16,354,631.74	0.27
17	601108	财通证券	16,253,755.50	0.27
18	000009	中国宝安	16,023,949.46	0.27
19	000783	长江证券	15,823,914.00	0.26
20	688777	中控技术	15,805,126.94	0.26

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000733	振华科技	63,165,895.03	1.05
2	002340	格林美	50,982,865.46	0.85
3	000723	美锦能源	41,983,940.50	0.70
4	300751	迈为股份	30,943,497.82	0.51
5	002013	中航机电	30,676,079.45	0.51
6	300223	北京君正	26,870,789.42	0.45
7	600188	兖矿能源	25,603,058.42	0.43
8	000009	中国宝安	24,305,699.25	0.40
9	300285	国瓷材料	24,218,993.93	0.40
10	002180	纳思达	23,810,005.90	0.40
11	688005	容百科技	23,461,297.13	0.39
12	300763	锦浪科技	23,271,190.38	0.39
13	002080	中材科技	21,670,717.49	0.36
14	601117	中国化学	21,533,957.15	0.36
15	002384	东山精密	21,436,715.02	0.36
16	002385	大北农	21,342,437.00	0.35
17	002268	卫士通	21,241,183.35	0.35
18	002028	思源电气	20,362,739.66	0.34
19	002353	杰瑞股份	20,138,299.12	0.33
20	000630	铜陵有色	19,979,148.60	0.33

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,510,479,503.33
卖出股票收入（成交）总额	3,060,786,510.39

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	263,949.74	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	263,949.74	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	2,639	263,949.74	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，盛新锂能集团股份有限公司出现在报告编制日前一

年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，盛新锂能系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,273,834.08
2	应收清算款	100,556,271.41
3	应收股利	3,016,089.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	563,471.11
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,409,665.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600522	中天科技	9,253,860.00	0.22	转融通出借证券受限
2	600256	广汇能源	7,171,416.00	0.17	转融通出借证券受限
3	002180	纳思达	5,304,976.00	0.13	转融通出借证券受限
4	002497	雅化集团	4,015,950.00	0.10	转融通出借证券受限
5	600096	云天化	3,963,332.00	0.10	转融通出借证券受限
6	300012	华测检测	3,829,650.00	0.09	转融通出借证券受限
7	002407	多氟多	3,682,923.00	0.09	转融通出借证券受限
8	601615	明阳智能	3,461,120.00	0.08	转融通出借证券受限
9	002240	盛新锂能	3,018,000.00	0.07	转融通出借证券受限

					限
--	--	--	--	--	---

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
24,984	48,831.60	326,303,230.00	26.75%	209,664,741.00	17.19%	684,040,823.00	56.07%

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	中国人寿保险股份有限公司	87,999,988.00	7.21%
2	中国国际金融股份有限公司	14,867,209.00	1.22%
3	野村新加坡有限公司—自有资金	14,060,500.00	1.15%
4	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	12,998,500.00	1.07%
5	华安证券股份有限公司融券专用证券账户	12,667,700.00	1.04%
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	12,211,918.00	1.00%
7	前海人寿保险股份有限公司—分红保险产品华泰组合	9,000,000.00	0.74%
8	华泰证券股份有限公司	7,969,692.00	0.65%
9	安信证券股份有限公司	7,847,300.00	0.64%
10	湘财证券股份有限公司融	7,200,000.00	0.59%

	券专用证券账户		
11	中国建设银行股份有限公司—华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	684,040,823.00	56.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	2,134,473,505
本报告期期初基金份额总额	1,563,208,794
本报告期基金总申购份额	954,400,000
减：本报告期基金总赎回份额	1,297,600,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,220,008,794

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	18	2,360,575,086.36	42.49%	1,018,239.95	42.49%	-
华泰证券	2	1,480,600,570.71	26.65%	638,598.43	26.65%	-
光大证券	5	453,566,296.06	8.16%	195,627.58	8.16%	-
国泰君安证券	2	366,314,280.25	6.59%	158,067.65	6.60%	-
招商证券	2	333,540,051.93	6.00%	143,858.69	6.00%	-
中金公司	5	188,604,962.07	3.39%	81,347.86	3.39%	-
国盛证券	1	170,585,236.86	3.07%	73,632.61	3.07%	-
申万宏源证券	2	119,972,677.67	2.16%	51,747.38	2.16%	-
中信建投证券	5	49,089,028.18	0.88%	21,172.44	0.88%	-
安信证券	1	19,821,159.39	0.36%	8,548.98	0.36%	-
中泰证券	2	12,927,497.38	0.23%	5,575.49	0.23%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方证券、东兴证券、方正证券、海通证券、华西证券、万联证券、银河证券、粤开证券、浙商证券、中国银河证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	3,133,716.18	80.02%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	139,603.90	3.56%	-	-	-	-	-	-
招商证券	349,002.00	8.91%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	293,753.20	7.50%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
9	华夏基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华夏中证 500ETF 联接	1	2022-01-01 至 2022-06-30	675,440,823.00	49,000,000.00	40,400,000.00	684,040,823.00	56.07%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基							

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日