

# 中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 31 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
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 .....	17
§ 5 托管人报告 .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	18
6.1 资产负债表 .....	18
6.2 利润表 .....	19
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	20
6.4 报表附注 .....	22
§ 7 投资组合报告 .....	111
7.1 期末基金资产组合情况 .....	111
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	111
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	113
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	147
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	148
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 .....	149
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 .....	149
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 .....	149
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 .....	149

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	149
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	149
7.12 投资组合报告附注.....	149
§ 8 基金份额持有人信息 .....	151
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	151
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	151
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	152
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	152
§ 9 开放式基金份额变动 .....	152
§ 10 重大事件揭示 .....	152
10.1 基金份额持有人大会决议.....	153
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.....	153
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	153
10.4 基金投资策略的改变.....	153
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	153
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.....	153
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	153
10.8 其他重大事件.....	155
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	156
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	156
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	157
§ 12 备查文件目录 .....	157
12.1 备查文件目录.....	157
12.2 存放地点 .....	157
12.3 查阅方式 .....	157

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,653,437,198.00
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	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

### 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的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，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化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	李帅帅
	联系电话	021-28932888	0755-25878287

电子邮箱	service@99fund.com	LISHUAI SHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95511-3
传真	021-28932998	0755-82080387
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码	200010	518001
法定代表人	李文	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年06月30日)
本期已实现收益	-14,735,894.59
本期利润	-183,732,088.78
加权平均基金份额本期利润	-0.1143
本期加权平均净值利润率	-9.80%
本期基金份额净值增长率	-8.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	352,416,682.95
期末可供分配基金份额利润	0.2131
期末基金资产净值	2,005,853,880.95
期末基金份额净值	1.2131
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	21.31%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收

益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.76%	1.04%	9.00%	1.05%	0.76%	-0.01%
过去三个月	6.23%	1.47%	5.20%	1.48%	1.03%	-0.01%
过去六个月	-8.87%	1.46%	-9.97%	1.46%	1.10%	0.00%
过去一年	-9.82%	1.21%	-12.16%	1.22%	2.34%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	21.31%	1.27%	20.50%	1.27%	0.81%	0.00%

### 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

添富中证800ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019年10月08日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本为132,724,224元人民币。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。



2022 上半年, 汇添富基金新成立 26 只公开募集证券投资基金, 包括 11 只股票型基金、11 只混合型基金、4 只债券型基金。截至 2022 年 6 月 30 日, 公司共管理 252 只公开募集证券投资基金, 形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征, 较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日		8	国籍: 中国。学历: 复旦大学经济学硕士。从业资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分分析师。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至今任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8

					<p>日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 26 日至今任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至今任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部总监助理	2019 年 10 月 08 日		11	<p>国籍: 中国。学历: 中国科学技术大学金融工程博士。从业资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任指数与量化投资部总监助理。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8</p>

					<p>月 3 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至今</p>
--	--	--	--	--	---

					任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的情况有 18 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年,全球主要关注欧洲地缘冲突、全球疫情进展及美联储加息进度。

欧洲地缘冲突二月开始发酵,对全球市场都造成了短期剧烈冲击,并带来对能源供应的担忧。数据显示发达经济体在上半年普遍呈现高通胀的状态。美联储在 5 月和 6 月连续加息 50 和 75 个基点来应对通胀压力的意图明确,加息周期预期将持续到明年,对全球流动性产生一定冲击。市场对未来更为激进的加息进程也有了一定的预期,对美国陷入衰退的担忧也在逐渐显现。与此同时,全球多地出现疫情反复,然而各地应对方式仍有分化,病毒变异情况和疫苗研发进度也是市场持续关注的因素。

国内经济方面,二季度 GDP 同比增速 0.4%,上半年同比增速 2.5%。政策层面看,去年底以来的稳增长基调不变。上半年多重冲击的背景下,稳增长压力进一步加大,上海等核心城市的供应链体系在此期间受到的短暂影响也不可忽视。5 月中下旬开始,复工复产有序开展,经济活力得以恢复,经济数据改善显著。6 月工业增加值增速 3.9%,前值 0.7%。1-6 月固定资产投资增速 6.1%,前值 6.2%。6 月社零增速 3.1%,前值-6.7%。

资本市场方面,春节后到 4 月阶段性受外部冲击叠加疫情影响,整体出现较为大幅的下跌,尤其是汽车、芯片等供应链受到一定影响的产业,跌幅较深。市场在这一阶段反映了较为极端的悲观情绪,随着 5 月中下旬复工复产开始稳步推进,整体交易情绪的修复也较为迅速。

中证 800 是 A 股市场代表性宽基指数,覆盖 A 股数千只个股中市值较大、流动性较好的前 800 只股票,风格均衡,是 A 股市场核心资产的代表。而 800ETF 则是这一代表性指数的产品化形式,为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

6 月 24 日,中国证监会正式发布《关于交易型开放式基金纳入互联互通相关安排的公

告》，ETF 正式被纳入互联互通范围。这是我国资本市场持续开放的又一重要举措，能有效推动两地资本市场深度融合，广泛引入各类资金进入市场。首批满足纳入条件的数十只 ETF 可在 7 月 4 日正式通过互联互通进行交易。800ETF 是首批纳入的标的之一，成份股 95% 以上的权重是在互联互通范围内可交易的股票。作为覆盖面较广的宽基指数产品，海外投资者能够较为便捷地通过 800ETF 跟踪 A 股市场的整体表现。入通预计也能够进一步开拓 800ETF 的海外客户群体，提升产品活跃度。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓位报告期内基本保持在 95%~100% 之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-8.87%。同期业绩比较基准收益率为-9.97%。

#### 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 2022 年下半年，市场的主线预计仍然围绕经济修复展开。海外流动性收缩预期已经形成，发达经济体通胀抬头进而迎来更为激进的加息逐步成为市场共识。而国内方面仍然存在政策发力空间。上半年的稳增长政策在外部冲击影响下，效果有限。5 月开始的修复分细项看，在消费领域改善最为强劲，下半年在基建等投资领域预计进一步发力。当前国内流动性环境维持适度宽松，资本市场交易情绪尚处在修复阶段，多个板块估值仍低于 2022 年初水平，具备改善空间。

800ETF 是跟踪中证 800 指数的交易型基金产品，覆盖面广、结构均衡，是权益资产的基础性配置工具，在投资运作上将严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专



业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金的收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	55,784,982.51	54,246,161.68
结算备付金		30,721,403.56	37,658,495.56
存出保证金		11,301,654.25	12,601,710.09
交易性金融资产	6.4.7.2	1,908,658,325.80	2,009,986,481.80
其中：股票投资		1,908,413,703.97	2,007,588,481.80
基金投资		-	-
债券投资		244,621.83	2,398,000.00
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	4,863,087.86
应收股利		185,342.18	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	27,061.72	31,931.25
资产总计		2,006,678,770.02	2,119,387,868.24
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,184.00	2,443,643.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		230,839.74	269,214.55

应付托管费		76,946.59	89,738.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,986.04	77,629.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	506,932.70	580,979.26
负债合计		824,889.07	3,461,205.10
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	1,653,437,198.00	1,589,437,198.00
未分配利润	6.4.7.9	352,416,682.95	526,489,465.14
净资产合计		2,005,853,880.95	2,115,926,663.14
负债和净资产总计		2,006,678,770.02	2,119,387,868.24

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2131 元，基金份额总额 1,653,437,198.00 份。

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：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-181,483,943.72</b>	<b>81,215,711.04</b>
1. 利息收入		1,243,533.90	636,700.51
其中：存款利息收入	6.4.7.10	306,582.20	406,011.40
债券利息收入		-	684.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		936,951.70	230,004.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-13,601,782.67	159,016,048.87
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-18,887,933.94	136,582,959.97
基金投资收益	6.4.7.12	-	-

债券投资收益	6.4.7.13	618,879.24	479,256.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-13,765,358.61	6,215,548.93
股利收益	6.4.7.17	18,432,630.64	15,738,283.03
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-168,996,194.19	-78,632,607.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-129,500.76	195,569.48
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,248,145.06</b>	<b>3,604,393.71</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,396,064.30	1,613,283.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	465,354.80	537,761.27
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		3,374.73	32,618.61
8. 其他费用	6.4.7.21	383,351.23	1,420,729.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-183,732,088.78</b>	<b>77,611,317.33</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-183,732,088.78</b>	<b>77,611,317.33</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-183,732,088.78</b>	<b>77,611,317.33</b>

注：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：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“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：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	64,000,000.00	-174,072,782.19	-110,072,782.19
（一）、综合收益总额	-	-183,732,088.78	-183,732,088.78
（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）	64,000,000.00	9,659,306.59	73,659,306.59
其中：1. 基金申购款	200,000,000.00	28,884,865.56	228,884,865.56
2. 基金赎回款	-136,000,000.00	-19,225,558.97	-155,225,558.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,653,437,198.00	352,416,682.95	2,005,853,880.95
项目	上年度可比期间		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,793,437,198.00	546,267,788.91	2,339,704,986.91
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,793,437,198.00	546,267,788.91	2,339,704,986.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-160,000,000.00	17,526,573.67	-142,473,426.33
（一）、综合收益总额	-	77,611,317.33	77,611,317.33

(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)	-160,000,000.00	-60,084,743.66	-220,084,743.66
其中: 1. 基金申购款	244,000,000.00	78,661,222.54	322,661,222.54
2. 基金赎回款	-404,000,000.00	-138,745,966.20	-542,745,966.20
(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)	1,633,437,198.00	563,794,362.58	2,197,231,560.58

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:

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]162 号《关于准予中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效,首次设立募集规模为 6,601,437,198.00 份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、

资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 800 指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 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。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成



为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 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 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，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与现行准则的差异追溯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，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。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。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”

项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 54,246,161.68 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5,722.74 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 54,251,884.42 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 37,658,495.56 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 17,079.59 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 37,675,575.15 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,601,710.09 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 61.05 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,601,771.14 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9,015.31 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,015.31 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 31,931.25 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 5,722.74 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 17,079.59 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 61.05 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 52.56 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 9,015.31 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,009,986,481.80 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 52.56 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币

2,009,986,534.36 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策

的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款

利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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 06 月 30 日
活期存款	55,784,982.51
等于：本金	55,779,686.78
加：应计利息	5,295.73
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	55,784,982.51

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,883,360,876.	-	1,908,413,703.97	25,052,827.15

		82			
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	244,600.00	21.83	244,621.83	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	244,600.00	21.83	244,621.83	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,883,605,476.82	21.83	1,908,658,325.80	25,052,827.15

#### 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 06 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	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	83,956,880.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	83,956,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	83,956,880.00	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	IC2209	22	28,001,600.00	880,800.00
IF2207	IF2207	45	60,388,200.00	3,552,120.00
合计				4,432,920.00
减：可抵销期货暂收款				4,432,920.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应收利息	-
其他应收款	27,061.72
待摊费用	-
合计	27,061.72

#### 6.4.7.7 其他负债



单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 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	188,000.11
其中：交易所市场	188,000.11
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	124,630.98
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	134,794.24
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	506,932.70

## 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,589,437,198.00	1,589,437,198.00
本期申购	200,000,000.00	200,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-136,000,000.00	-136,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,653,437,198.00	1,653,437,198.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.9 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	558,799,616.91	-32,310,151.77	526,489,465.14
本期利润	-14,735,894.59	-168,996,194.19	-183,732,088.78
本期基金份额交易产生的变动数	22,380,252.48	-12,720,945.89	9,659,306.59
其中：基金申购款	69,610,442.85	-40,725,577.29	28,884,865.56
基金赎回款	-47,230,190.37	28,004,631.40	-19,225,558.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	566,443,974.80	-214,027,291.85	352,416,682.95

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	99,355.43
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	206,157.91
其他	1,068.86
合计	306,582.20

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,962,795.95
股票投资收益——赎回差价收入	-1,925,137.99
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	-18,887,933.94

##### 6.4.7.11.2 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01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	206,055,123.38
减：卖出股票成本总额	222,498,663.49
减：交易费用	519,255.84
买卖股票差价收入	-16,962,795.95

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	155,225,558.97
减：现金支付赎回款总额	67,878,448.97
减：赎回股票成本总额	89,272,247.99
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,925,137.99

#### 6.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	451.44
债券投资收益——买卖债券差价收入	618,427.80
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	618,879.24

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,636,933.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,018,000.00
减：应计利息总额	487.50
减：交易费用	18.47
买卖债券差价收入	618,427.80

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
股指期货投资收益	-13,765,358.61
外汇期货投资收益	-

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	18,432,630.64
其中：证券出借权益补偿收入	1,012,364.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,432,630.64

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-174,296,534.19
——股票投资	-174,296,534.19
——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	5,300,340.00
——权证投资	-
——期货投资	5,300,340.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-168,996,194.19

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-129,500.76
其他	-
合计	-129,500.76

## 6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	279,212.88
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	383,351.23

## 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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

本报告期内未发生与本基金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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
平安银行股份有限公司 (“平安银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司

注：以下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 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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 (%)
东方证券	29,862,796.17	6.65	315,234,809.56	41.37

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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 (%)
东方证券	557,307.80	12.02	2,184,178.49	40.78

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 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 01 月 01 日至 2022 年 06 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 (%)
东方证券	21,385.29	9.16	6,626.22	3.52
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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 (%)
东方证券	290,942.95	63.73	274,685.73	82.23

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 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,396,064.30	1,613,283.94
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	465,354.80	537,761.27

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 06 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	期末应收利息余额
东方证券	38,945,545.00	27,412.31	-	-
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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	期末应收利息余额
东方证券	1,623,154.00	3,250.80	-	-

##### 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 01 月 01 日至 2022 年 06 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
东方	2022011100000683	晶盛	2022	338,700.00	6,000.00	14	3.60	474.18	-	-



证 券		机 电	年 01 月 11 日							
东 方 证 券	2022011100000 689	天 合 光 能	202 2 年 01 月 11 日	502,320. 00	8,000. 00	14	3.6 0	703. 25	-	-
东 方 证 券	2022012500011 876	晶 盛 机 电	202 2 年 01 月 25 日	364,620. 00	6,000. 00	14	3.6 0	510. 47	-	-
东 方 证 券	2022012500011 884	天 合 光 能	202 2 年 01 月 25 日	553,360. 00	8,000. 00	14	3.6 0	774. 70	-	-
东 方 证 券	2022020800015 268	天 合 光 能	202 2 年 02 月 08 日	480,240. 00	8,000. 00	14	3.6 0	672. 34	-	-
东 方 证 券	2022020800015 280	晶 盛 机 电	202 2 年 02 月 08 日	334,860. 00	6,000. 00	14	3.6 0	468. 80	-	-
东 方 证 券	202202200013 701	晶 盛 机 电	202 2 年 02	360,600. 00	6,000. 00	14	3.6 0	504. 84	-	-

			月 22 日							
东方 证券	2022022200013 709	天 合 光 能	202 2 年 02 月 22 日	507,200. 00	8,000. 00	14	3.6 0	710. 08	-	-
东方 证券	2022030800013 186	晶 盛 机 电	202 2 年 03 月 08 日	362,640. 00	6,000. 00	14	3.6 0	507. 70	-	-
东方 证券	2022030800013 430	天 合 光 能	202 2 年 03 月 08 日	585,520. 00	8,000. 00	14	3.6 0	819. 73	-	-
东方 证券	2022032100000 841	三 环 集 团	202 2 年 03 月 21 日	29,550.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	44.6 5	-	-
东方 证券	2022032100000 843	卓 胜 微	202 2 年 03 月 21 日	237,000. 00	1,000. 00	14	3.4 0	358. 13	-	-
东方 证券	2022032100000 845	宋 城 演 艺	202 2 年 03 月 21 日	14,040.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	21.2 2	-	-

			日							
东方证券	2022032100000846	亿联网络	2022年03月21日	78,390.00	1,000.00	14	3.40	118.46	-	-
东方证券	2022032200014209	晶盛机电	2022年03月22日	372,000.00	6,000.00	14	3.60	558.00	-	-
东方证券	2022040600052265	宋城演艺	2022年04月06日	13,900.00	1,000.00	14	3.40	18.38	-	-
东方证券	2022040600052271	亿联网络	2022年04月06日	75,940.00	1,000.00	14	3.40	100.41	-	-
东方证券	2022040600052279	晶盛机电	2022年04月06日	341,940.00	6,000.00	14	3.60	478.72	-	-
东方证券	2022040600060303	三环集团	2022年04月06日	27,670.00	1,000.00	14	3.40	36.59	-	-
东	2022040600060	卓	202	204,960.	1,000.	14	3.4	271.	-	-

方证券	313	胜微	2 年 04 月 06 日	00	00		0	00		
东方证券	2022042000043 100	三环集团	202 2 年 04 月 20 日	28,150.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	39.8 8	-	-
东方证券	2022042000043 104	亿联网络	202 2 年 04 月 20 日	77,640.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	109. 99	-	-
东方证券	2022042000044 998	宋城演艺	202 2 年 04 月 20 日	14,360.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	20.3 4	-	-
东方证券	2022042000045 038	卓胜微	202 2 年 04 月 20 日	201,900. 00	1,000. 00	14	3.4 0	286. 03	-	-
东方证券	2022042000045 042	晶盛机电	202 2 年 04 月 20 日	317,400. 00	6,000. 00	14	3.6 0	476. 10	-	-
东方证	2022050500063 213	三环集	202 2 年	28,610.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	37.8 3	-	-

券		团	05 月 05 日							
东方 证 券	2022050500063 233	亿 联 网 络	202 2 年 05 月 05 日	75,720.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	100. 12	-	-
东方 证 券	2022050500064 473	卓 胜 微	202 2 年 05 月 05 日	182,820. 00	1,000. 00	14	3.4 0	241. 73	-	-
东方 证 券	2022050500064 477	宋 城 演 艺	202 2 年 05 月 05 日	12,280.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	16.2 4	-	-
东方 证 券	2022050500064 489	晶 盛 机 电	202 2 年 05 月 05 日	308,100. 00	6,000. 00	14	3.6 0	431. 34	-	-
东方 证 券	2022050900000 702	宋 城 演 艺	202 2 年 05 月 09 日	22,580.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	29.8 6	-	-
东方 证 券	2022050900000 704	阳 光 电 源	202 2 年 05 月	127,620. 00	2,000. 00	14	3.4 0	168. 74	-	-

			09 日							
东方证 券	2022050900000 706	同花 顺	202 2年 05月 09日	133,450. 00	1,700. 00	14	3.4 0	176. 45	-	-
东方证 券	2022050900000 708	三环集 团	202 2年 05月 09日	54,560.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	72.1 4	-	-
东方证 券	2022050900000 714	芒果超 媒	202 2年 05月 09日	68,360.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	90.3 9	-	-
东方证 券	2022050900000 716	亿联网 络	202 2年 05月 09日	147,920. 00	2,000. 00	14	3.4 0	195. 58	-	-
东方证 券	2022051900041 547	晶盛机 电	202 2年 05月 19日	337,200. 00	6,000. 00	14	3.6 0	472. 08	-	-
东方证 券	2022051900041 559	宋城演 艺	202 2年 05月 19日	11,590.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	15.3 2	-	-

东方 证券	2022051900043 673	卓 胜 微	202 2 年 05 月 19 日	199,500. 00	1,000. 00	14	3.4 0	263. 78	-	-
东方 证券	2022051900043 685	三 环 集 团	202 2 年 05 月 19 日	30,370.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	40.1 6	-	-
东方 证券	2022051900043 693	亿 联 网 络	202 2 年 05 月 19 日	72,900.0 0	1,000. 00	14	3.4 0	96.3 9	-	-
东方 证券	2022052300006 787	阳 光 电 源	202 2 年 05 月 23 日	164,700. 00	2,000. 00	14	3.4 0	217. 77	-	-
东方 证券	2022052300006 807	芒 果 超 媒	202 2 年 05 月 23 日	71,000.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	93.8 8	-	-
东方 证券	2022052300006 935	同 花 顺	202 2 年 05 月 23 日	143,174. 00	1,700. 00	14	3.4 0	189. 31	-	-
东 方	2022052300006 957	宋 城	202 2	23,840.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	31.5 2	-	-

证券		演艺	年 05 月 23 日							
东方 证券	2022052300006 963	亿 联 网 络	202 2 年 05 月 23 日	146,400. 00	2,000. 00	14	3.4 0	193. 57	-	-
东方 证券	2022052300006 967	三 环 集 团	202 2 年 05 月 23 日	59,620.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	78.8 3	-	-
东方 证券	2022062000001 420	卓 胜 微	202 2 年 06 月 20 日	419,440. 00	2,000. 00	14	3.4 0	554. 59	270,000. 00	396. 14
东方 证券	2022062000001 438	蓝 思 科 技	202 2 年 06 月 20 日	21,820.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	28.8 5	22,140.0 0	20.6 1
东方 证券	2022062000001 440	中 科 创 达	202 2 年 06 月 20 日	253,240. 00	2,000. 00	14	3.4 0	334. 84	260,960. 00	239. 17
东方 证券	2022062700001 182	中 科 创 达	202 2 年 06 月	276,900. 00	2,000. 00	14	3.4 0	366. 12	260,960. 00	78.4 5



			月 27 日							
东方 证券	2022062700001 188	蓝 思 科 技	202 2 年 06 月 27 日	21,420.0 0	2,000. 00	14	3.4 0	28.3 2	22,140.0 0	6.07
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日										
关 联 方 名 称	合 约 编 号	证 券 名 称	成 交 时 间	交 易 金 额	交 易 数 量 (单 位: 股)	出 借 期 限 ( 单 位: 天)	费 率	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额
				-	-		-	-	-	-

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 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 06 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 (%)
东方证券股份有限公司	5,515,403.00	0.33	5,560,700.00	0.35

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

##### 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 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	55,784,982.51	99,355.43	86,380,353.86	133,053.74

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 06 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）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	79,744.00	674,634.24
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 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）	总金额
				-	-

#### 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

本基金根据基金合同和招募书约定的投资策略，按照标的指数的成分股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券及基金托管人平安银行发行的股票平安银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 363,944.00 股，持有平安银行 676,367.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有东方证券 302,000.00 股，持有平安银行 718,567.00 股。）

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 6.4.12 期末（2022 年 06 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	证	成功	受	流	认购价	期末估	数量	期末成本总	期末估值总	备

码	券名称	认购日	限期	通受限类型	格	值单价	(单位:股)	额	额	注
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股流通受限	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	
301117	佳缘科技	2022年01月07日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	
301123	奕东电	2022年01月01日	6个月	新股流	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	

	子	月 14 日		通 受 限						
301135	瑞 德 智 能	2022 年 04 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	
301139	元 道 通 信	2022 年 06 月 30 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	
301139	元 道 通 信	2022 年 06 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	
301148	嘉 戎 技 术	2022 年 04 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	
301162	国 能 日 新	2022 年 04 月 19 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	
301175	中 科 环 保	2022 年 06 月 30 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	
301175	中 科 环 保	2022 年 06 月 30	6 个 月	新 股 流 通 受	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	

		日		限						
301181	标榜股份	2022年02月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	
301187	欧圣电气	2022年04月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	
301201	诚达药业	2022年01月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	
301235	华	2022	6	新	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	

	康医疗	年01月21日	个月	股流通受限						
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	
688238	和元生物	2022年03月15日	6个月	新股流通受限	13.23	25.32	12,836	169,820.28	325,007.52	
688270	臻镭科技	2022年01月20日	6个月	新股流通受限	61.88	59.87	3,705	229,265.40	221,818.35	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙22转债	2022年06月15日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	2,130	213,000.00	213,015.87	
127064	杭氧	2022年	32个	新债	100.00	100.02	316	31,600.00	31,605.96	

	转债	05月19日	交易日	流通受限						
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“何氏眼科”（证券代码：301103）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 117 股（根据何氏眼科 2021 年年度权益分派实施公告，何氏眼科以公司现有总股本 121,558,824 股为基数，向全体股东每 10 股派 6 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，除权除息日为 2022 年 6 月 1 日。）。本基金持有的流通受限股票“军信股份”（证券代码：301109）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 613 股（根据军信股份 2021 年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本 273,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 3.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2022 年 6 月 17 日。）。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年06月01日	重大事件停牌	9.60	2022年07月14日	9.99	80,300	815,035.58	770,880.00	

#### 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

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形

成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
1	300750	宁德时代	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	534.00	10,200	5,446,800.00
2	002594	比亚迪	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	333.49	10,000	3,334,900.00
3	601012	隆基绿能	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	66.63	49,900	3,324,837.00
4	601888	中国中免	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	232.93	10,000	2,329,300.00
5	600887	伊利股份	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	38.95	48,000	1,869,600.00
6	600900	长江电力	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	23.12	78,300	1,810,296.00
7	000651	格力电器	2022 年 07 月 04 日	2022 年 07 月 04 日	33.72	50,000	1,686,000.00
8	603259	药明康德	2022 年 07 月 11 日	2022 年 07 月 11 日	103.99	15,600	1,622,244.00



9	000792	盐湖股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	29.96	53,200	1,593,872.00
10	002460	赣锋锂业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	148.70	10,000	1,487,000.00
11	600089	特变电工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	27.39	46,400	1,270,896.00
12	600031	三一重工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	19.06	66,300	1,263,678.00
13	600438	通威股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	59.86	21,100	1,263,046.00
14	002466	天齐锂业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	124.80	10,000	1,248,000.00
15	600309	万华化学	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	96.99	12,700	1,231,773.00
16	300274	阳光电源	2022 年 07 月 01 日	-	2022 年 07 月 01 日	98.25	12,500	1,228,125.00
17	002475	立讯精密	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	33.79	36,300	1,226,577.00
18	002415	海康威视	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	36.20	31,400	1,136,680.00
19	601899	紫金矿业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.33	120,400	1,123,332.00

20	002129	TCL 中环	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	58.89	18,900	1,113,021.00
21	002352	顺丰 控股	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	55.81	19,600	1,093,876.00
22	002714	牧原 股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	55.27	19,400	1,072,238.00
23	600048	保利 发展	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.46	59,500	1,038,870.00
24	002142	宁波 银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	35.81	28,500	1,020,585.00
25	601816	京沪 高铁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.02	202,800	1,018,056.00
26	300014	亿纬 锂能	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	97.50	10,000	975,000.00
27	603799	华友 钴业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	95.62	10,100	965,762.00
28	000625	长安 汽车	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.32	51,500	891,980.00
29	600690	海尔 智家	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	27.46	32,200	884,212.00
30	002709	天赐 材料	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	62.06	14,100	875,046.00

31	300498	温氏股份	2022年07月11日	-	2022年07月11日	21.29	37,700	802,633.00
32	002271	东方雨虹	2022年07月11日	-	2022年07月11日	51.47	15,300	787,491.00
33	601668	中国建筑	2022年07月11日	-	2022年07月11日	5.32	143,800	765,016.00
34	600522	中天科技	2022年07月11日	-	2022年07月11日	23.10	32,900	759,990.00
35	601088	中国神华	2022年07月11日	-	2022年07月11日	33.30	22,400	745,920.00
36	601615	明阳智能	2022年07月13日	-	2022年07月13日	33.80	20,200	682,760.00
37	688599	天合光能	2022年07月11日	-	2022年07月11日	65.25	10,000	652,500.00
38	688005	容百科技	2022年07月11日	-	2022年07月11日	129.44	5,000	647,200.00
39	002241	歌尔股份	2022年07月11日	-	2022年07月11日	33.60	19,200	645,120.00
40	601919	中远海控	2022年07月11日	-	2022年07月11日	13.90	44,600	619,940.00
41	600111	北方稀土	2022年07月11日	-	2022年07月11日	35.16	17,500	615,300.00

42	000063	中兴通讯	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	25.53	24,100	615,273.00
43	600585	海螺水泥	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	35.28	17,300	610,344.00
44	002311	海大集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	60.01	10,000	600,100.00
45	601225	陕西煤业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	21.18	28,300	599,394.00
46	600256	广汇能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.54	55,400	583,916.00
47	002230	科大讯飞	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	41.22	14,000	577,080.00
48	600010	包钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.35	243,000	571,050.00
49	600009	上海机场	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	56.70	10,000	567,000.00
50	600104	上汽集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.81	31,400	559,234.00
51	002074	国轩高科	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	45.60	12,200	556,320.00
52	002027	分众传媒	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.73	81,300	547,149.00

53	002410	广联达	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	54.44	10,000	544,400.00
54	600460	士兰微	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	52.00	10,400	540,800.00
55	600406	国电南瑞	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	27.00	19,600	529,200.00
56	300496	中科创达	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	130.48	4,000	521,920.00
57	000338	潍柴动力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.47	41,400	516,258.00
58	603993	洛阳钼业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.73	88,200	505,386.00
59	600660	福耀玻璃	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	41.81	11,900	497,539.00
60	600893	航发动力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	45.51	10,900	496,059.00
61	000100	TCL科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.79	101,300	485,227.00
62	600096	云天化	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	31.48	15,400	484,792.00
63	601229	上海银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.55	73,500	481,425.00

64	601066	中信建投	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	28.91	16,200	468,342.00
65	601658	邮储银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.39	86,600	466,774.00
66	300012	华测检测	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	23.21	20,100	466,521.00
67	600346	恒力石化	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.24	20,900	464,816.00
68	300207	欣旺达	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	31.60	14,700	464,520.00
69	600050	中国联通	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.46	134,100	463,986.00
70	688396	华润微	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	59.07	7,800	460,746.00
71	601390	中国中铁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.14	74,600	458,044.00
72	000963	华东医药	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	45.16	10,000	451,600.00
73	002497	雅化集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	32.65	13,800	450,570.00
74	600905	三峡能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.29	71,600	450,364.00

75	600383	金地集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.44	33,300	447,552.00
76	600958	东方证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.21	43,500	444,135.00
77	600196	复星医药	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	44.09	10,000	440,900.00
78	600188	兖矿能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	39.48	11,100	438,228.00
79	600028	中国石化	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.08	107,400	438,192.00
80	600570	恒生电子	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	43.54	10,000	435,400.00
81	601985	中国核电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.86	63,400	434,924.00
82	300782	卓胜微	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	135.00	3,200	432,000.00
83	000776	广发证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.70	22,800	426,360.00
84	600157	永泰能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.59	267,900	425,961.00
85	601766	中国中车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.20	81,600	424,320.00

86	601117	中国化学	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.41	45,000	423,450.00
87	600019	宝钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.02	70,300	423,206.00
88	000009	中国宝安	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.49	31,100	419,539.00
89	601669	中国电建	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.87	53,300	419,471.00
90	688111	金山办公	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	197.12	2,100	413,952.00
91	002050	三花智控	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	27.48	14,500	398,460.00
92	601628	中国人寿	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	31.08	12,500	388,500.00
93	600392	盛和资源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.60	16,900	381,940.00
94	002493	荣盛石化	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.39	24,800	381,672.00
95	300759	康龙化成	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	95.22	4,000	380,880.00
96	002648	卫星化学	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	25.85	14,700	379,995.00



97	300073	当升科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	90.34	4,200	379,428.00
98	002384	东山精密	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.93	16,500	378,345.00
99	000301	东方盛虹	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.91	22,200	375,402.00
100	601633	长城汽车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	37.04	10,000	370,400.00
101	300661	圣邦股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	182.02	2,000	364,040.00
102	600999	招商证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.41	25,200	363,132.00
103	600418	江淮汽车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.16	21,000	360,360.00
104	601877	正泰电器	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	35.78	10,000	357,800.00
105	600926	杭州银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.98	23,600	353,528.00
106	600426	华鲁恒升	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	29.20	11,900	347,480.00
107	000786	北新建材	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	34.62	10,000	346,200.00

108	300285	国瓷材料	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	35.92	9,600	344,832.00
109	600765	中航重机	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	32.18	10,600	341,108.00
110	600233	圆通速递	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	20.39	16,500	336,435.00
111	600176	中国巨石	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.41	19,200	334,272.00
112	601555	东吴证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.93	48,200	334,026.00
113	601989	中国重工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.71	89,700	332,787.00
114	002008	大族激光	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	33.13	10,000	331,300.00
115	000983	山西焦煤	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.39	24,700	330,733.00
116	601058	赛轮轮胎	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.27	29,300	330,211.00
117	600487	亨通光电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.54	22,700	330,058.00
118	001979	招商蛇口	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.43	24,300	326,349.00

119	600499	科达制造	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	20.64	15,800	326,112.00
120	300037	新宙邦	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	52.56	6,200	325,872.00
121	300316	晶盛机电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	67.59	4,800	324,432.00
122	688180	君实生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	75.34	4,300	323,962.00
123	600219	南山铝业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.69	87,700	323,613.00
124	601336	新华保险	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	32.19	10,000	321,900.00
125	603077	和邦生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.26	74,500	317,370.00
126	002202	金风科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.80	21,300	315,240.00
127	000768	中航西飞	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	30.29	10,400	315,016.00
128	002385	大北农	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.81	40,100	313,181.00
129	688126	沪硅产业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.98	13,600	312,528.00

130	300454	深信服	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	103.78	3,000	311,340.00
131	601600	中国铝业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.75	65,100	309,225.00
132	600588	用友网络	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	21.71	14,200	308,282.00
133	300363	博腾股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	77.99	3,900	304,161.00
134	601006	大秦铁路	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.59	45,700	301,163.00
135	601186	中国铁建	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.90	38,100	300,990.00
136	600584	长电科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	27.00	11,000	297,000.00
137	002001	新和成	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.81	12,900	294,249.00
138	000895	双汇发展	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	29.30	10,000	293,000.00
139	603019	中科曙光	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	29.02	10,000	290,200.00
140	000630	铜陵有色	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.26	88,800	289,488.00

141	601377	兴业 证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.05	40,500	285,525.00
142	688099	晶晨 股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	101.00	2,800	282,800.00
143	601138	工业 富联	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.84	28,600	281,424.00
144	000988	华工 科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	23.17	12,100	280,357.00
145	601800	中国 交建	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.28	29,800	276,544.00
146	601077	渝农 商行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.70	74,600	276,020.00
147	600150	中国 船舶	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.98	14,500	275,210.00
148	300408	三环 集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	30.10	9,100	273,910.00
149	300919	中伟 股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	123.90	2,200	272,580.00
150	601168	西部 矿业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.83	22,900	270,907.00
151	300146	汤臣 倍健	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	21.65	12,300	266,295.00

152	002625	光启技术	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.27	15,400	265,958.00
153	000977	浪潮信息	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	26.48	10,000	264,800.00
154	000157	中联重科	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.16	42,900	264,264.00
155	601838	成都银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.58	15,800	261,964.00
156	000876	新希望	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.30	17,100	261,630.00
157	601111	中国国航	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.61	22,400	260,064.00
158	002797	第一创业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.41	40,500	259,605.00
159	600795	国电电力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.91	66,000	258,060.00
160	600011	华能国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.04	36,600	257,664.00
161	600988	赤峰黄金	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.95	16,000	255,200.00
162	688777	中控技术	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	72.76	3,500	254,660.00

163	000932	华菱 钢铁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.09	50,000	254,500.00
164	601155	新城 控股	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	25.43	10,000	254,300.00
165	002185	华天 科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.38	27,000	253,260.00
166	600741	华域 汽车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	23.00	11,000	253,000.00
167	601128	常熟 银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.64	33,000	252,120.00
168	600029	南方 航空	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.31	34,000	248,540.00
169	601636	旗滨 集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.75	19,400	247,350.00
170	600521	华海 药业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.70	10,800	245,160.00
171	600547	山东 黄金	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.56	13,200	244,992.00
172	600989	宝丰 能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.65	16,700	244,655.00
173	300223	北京 君正	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	106.25	2,300	244,375.00

174	600039	四川路桥	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.53	23,100	243,243.00
175	300999	金龙鱼	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	54.02	4,500	243,090.00
176	002078	太阳纸业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.31	19,400	238,814.00
177	000938	紫光股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	19.40	12,300	238,620.00
178	000830	鲁西化工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.29	13,800	238,602.00
179	601788	光大证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.76	15,000	236,400.00
180	600153	建发股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.07	17,900	233,953.00
181	002601	龙佰集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	20.05	11,600	232,580.00
182	688036	传音控股	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	89.23	2,600	231,998.00
183	600546	山煤国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	19.46	11,900	231,574.00
184	000069	华侨城 A	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.49	35,300	229,097.00



185	601901	方正证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.71	34,000	228,140.00
186	002007	华兰生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	22.80	10,000	228,000.00
187	002236	大华股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.42	13,800	226,596.00
188	601872	招商轮船	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.76	39,100	225,216.00
189	002422	科伦药业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.70	12,000	224,400.00
190	601238	广汽集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.24	14,700	224,028.00
191	600705	中航产融	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.46	64,500	223,170.00
192	600497	驰宏锌锗	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.19	43,000	223,170.00
193	002555	三七互娱	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	21.23	10,500	222,915.00
194	600348	华阳股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.46	14,400	222,624.00
195	600015	华夏银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.21	42,600	221,946.00

196	600177	雅戈尔	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.63	33,400	221,442.00
197	600549	厦门钨业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	21.62	10,200	220,524.00
198	600875	东方电气	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.45	13,400	220,430.00
199	000970	中科三环	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.78	11,700	219,726.00
200	300088	长信科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.42	29,600	219,632.00
201	300699	光威复材	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	58.87	3,700	217,819.00
202	000425	徐工机械	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.39	40,400	217,756.00
203	300433	蓝思科技	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.07	19,600	216,972.00
204	600352	浙江龙盛	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.18	21,000	213,780.00
205	600160	巨化股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.15	16,200	213,030.00
206	000998	隆平高科	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.66	12,700	211,582.00

207	002673	西部 证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.54	32,300	211,242.00
208	600516	方大 炭素	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.60	27,500	209,000.00
209	300601	康泰 生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	45.18	4,600	207,828.00
210	601699	潞安 环能	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	14.62	14,100	206,142.00
211	600886	国投 电力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.50	19,600	205,800.00
212	000807	云铝 股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.88	20,800	205,504.00
213	601997	贵阳 银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.81	35,200	204,512.00
214	600482	中国 动力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.71	13,000	204,230.00
215	000039	中集 集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.85	14,700	203,595.00
216	002030	达安 基因	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.19	11,800	202,842.00
217	601216	君正 集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.88	41,500	202,520.00

218	002273	水晶光电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.11	16,700	202,237.00
219	002465	海格通信	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.09	22,200	201,798.00
220	000708	中信特钢	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	20.15	10,000	201,500.00
221	000960	锡业股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.77	12,000	201,240.00
222	000629	攀钢钒钛	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.80	51,800	196,840.00
223	000728	国元证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.22	31,600	196,552.00
224	600115	中国东航	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.49	35,800	196,542.00
225	300058	蓝色光标	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.53	30,000	195,900.00
226	300136	信维通信	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.85	11,600	195,460.00
227	600170	上海建工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.03	64,300	194,829.00
228	000975	银泰黄金	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.74	20,000	194,800.00

229	601916	浙商银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.32	58,600	194,552.00
230	600704	物产中大	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.13	37,600	192,888.00
231	300357	我武生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	52.03	3,700	192,511.00
232	002092	中泰化学	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.76	24,800	192,448.00
233	601577	长沙银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.93	24,100	191,113.00
234	000783	长江证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.93	32,100	190,353.00
235	601360	三六零	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.52	22,300	189,996.00
236	002252	上海莱士	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.93	32,000	189,760.00
237	601618	中国中冶	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.50	53,800	188,300.00
238	300474	景嘉微	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	68.39	2,700	184,653.00
239	600415	小商品城	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.57	33,100	184,367.00

240	300418	昆仑万维	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.00	11,500	184,000.00
241	000547	航天发展	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.94	15,400	183,876.00
242	002506	协鑫集成	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.72	49,400	183,768.00
243	300244	迪安诊断	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	31.10	5,900	183,490.00
244	002739	万达电影	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.65	13,400	182,910.00
245	300253	卫宁健康	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.78	20,700	181,746.00
246	300144	宋城演艺	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.35	11,800	181,130.00
247	601607	上海医药	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.08	10,000	180,800.00
248	600699	均胜电子	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.71	11,500	180,665.00
249	601162	天风证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.18	56,700	180,306.00
250	300296	利亚德	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.30	24,500	178,850.00

251	600362	江西铜业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.83	10,000	178,300.00
252	601108	财通证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.87	22,500	177,075.00
253	300308	中际旭创	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	31.05	5,700	176,985.00
254	600637	东方明珠	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.15	24,700	176,605.00
255	300628	亿联网络	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	76.15	2,300	175,145.00
256	600867	通化东宝	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.34	16,900	174,746.00
257	002120	韵达股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.06	10,200	174,012.00
258	601016	节能风电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.80	36,200	173,760.00
259	600985	淮北矿业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.56	11,900	173,264.00
260	300529	健帆生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	50.89	3,400	173,026.00
261	688561	奇安信	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	55.80	3,100	172,980.00

262	601198	东兴证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.90	19,400	172,660.00
263	002602	世纪华通	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.82	35,800	172,556.00
264	600026	中远海能	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.33	16,700	172,511.00
265	002156	通富微电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	15.40	11,200	172,480.00
266	300003	乐普医疗	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	18.57	9,200	170,844.00
267	002065	东华软件	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.32	27,000	170,640.00
268	600380	健康元	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.35	13,800	170,430.00
269	600879	航天电子	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.49	26,200	170,038.00
270	600183	生益科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.99	10,000	169,900.00
271	688065	凯赛生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	111.80	1,500	167,700.00
272	600109	国金证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.00	18,600	167,400.00



273	601878	浙商证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.38	14,700	167,286.00
274	000703	恒逸石化	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.51	15,900	167,109.00
275	300026	红日药业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.70	21,700	167,090.00
276	300413	芒果超媒	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	33.36	5,000	166,800.00
277	000750	国海证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.63	45,900	166,617.00
278	002408	齐翔腾达	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.11	20,500	166,255.00
279	000623	吉林敖东	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.76	11,200	165,312.00
280	300677	英科医疗	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 11 日	25.36	6,500	164,840.00
281	000729	燕京啤酒	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.66	17,000	164,220.00
282	002203	海亮股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.55	14,200	164,010.00
283	000878	云南铜业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.39	14,300	162,877.00

284	600673	东阳光	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.99	18,100	162,719.00
285	600489	中金黄金	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.39	21,900	161,841.00
286	600820	隧道股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.12	26,400	161,568.00
287	601696	中银证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.30	12,100	160,930.00
288	600580	卧龙电驱	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.42	11,100	160,062.00
289	600079	人福医药	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	16.00	10,000	160,000.00
290	601717	郑煤机	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.41	11,100	159,951.00
291	600369	西南证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.97	40,000	158,800.00
292	002131	利欧股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.94	81,400	157,916.00
293	300017	网宿科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.36	29,400	157,584.00
294	600166	福田汽车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.83	55,400	156,782.00

295	688363	华熙生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	142.18	1,100	156,398.00
296	300383	光环新网	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.42	15,000	156,300.00
297	600018	上港集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.83	26,800	156,244.00
298	600642	申能股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.68	27,400	155,632.00
299	002958	青农商行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.32	46,800	155,376.00
300	688256	寒武纪	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	64.70	2,400	155,280.00
301	002195	二三四五	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.25	69,000	155,250.00
302	600027	华电国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.93	39,300	154,449.00
303	600325	华发股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.57	20,400	154,428.00
304	601005	重庆钢铁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.91	80,800	154,328.00
305	600909	华安证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.55	33,900	154,245.00

306	300033	同花顺	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	96.15	1,600	153,840.00
307	000066	中国长城	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.82	14,200	153,644.00
308	002624	完美世界	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.37	10,500	150,885.00
309	300001	特锐德	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.31	8,700	150,597.00
310	300024	机器人	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.08	14,900	150,192.00
311	000825	太钢不锈	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.45	27,400	149,330.00
312	002500	山西证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.74	25,900	148,666.00
313	002926	华西证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.84	18,900	148,176.00
314	002373	千方科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.12	13,300	147,896.00
315	000050	深天马A	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.97	14,800	147,556.00
316	600271	航天信息	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.94	13,400	146,596.00

317	300618	寒锐钴业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	57.92	2,500	144,800.00
318	002212	天融信	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.15	14,200	144,130.00
319	600143	金发科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.52	15,100	143,752.00
320	600863	内蒙华电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.65	39,300	143,445.00
321	601866	中远海发	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.00	47,700	143,100.00
322	600208	新湖中宝	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.76	51,800	142,968.00
323	600918	中泰证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.65	18,600	142,290.00
324	000060	中金岭南	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.46	31,500	140,490.00
325	002249	大洋电机	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.14	22,800	139,992.00
326	300009	安科生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.11	13,800	139,518.00
327	601992	金隅集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.77	50,200	139,054.00

328	000778	新兴铸管	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.82	28,800	138,816.00
329	600066	宇通客车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.65	16,000	138,400.00
330	688521	芯原股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	49.40	2,800	138,320.00
331	002152	广电运通	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.27	14,900	138,123.00
332	000027	深圳能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.41	21,400	137,174.00
333	300070	碧水源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.21	26,200	136,502.00
334	300182	捷成股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.50	24,800	136,400.00
335	300676	华大基因	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	71.70	1,900	136,230.00
336	600848	上海临港	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	13.56	10,000	135,600.00
337	600655	豫园股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.44	14,300	134,992.00
338	300168	万达信息	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.44	14,300	134,992.00

339	000401	冀东水泥	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.52	12,800	134,656.00
340	600998	九州通	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.91	11,300	134,583.00
341	601898	中煤能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.38	12,900	133,902.00
342	300251	光线传媒	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.47	14,100	133,527.00
343	600755	厦门国贸	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.50	17,800	133,500.00
344	002607	中公教育	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.79	23,000	133,170.00
345	002191	劲嘉股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.72	12,400	132,928.00
346	600390	五矿资本	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.89	27,100	132,519.00
347	600970	中材国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.69	13,600	131,784.00
348	000021	深科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.64	11,300	131,532.00
349	600667	太极实业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.38	17,700	130,626.00

350	002670	国盛金控	2022 年 06 月 03 日	-	2022 年 06 月 03 日	9.60	13,600	130,560.00
351	300482	万孚生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	40.71	3,200	130,272.00
352	002505	鹏都农牧	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.39	38,400	130,176.00
353	002221	东华能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.31	13,900	129,409.00
354	600236	桂冠电力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.09	21,200	129,108.00
355	002244	滨江集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.65	14,900	128,885.00
356	600528	中铁工业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.05	16,000	128,800.00
357	002414	高德红外	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.87	10,000	128,700.00
358	000656	金科股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.86	45,000	128,700.00
359	600839	四川长虹	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.88	44,500	128,160.00
360	600021	上海电力	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.25	12,500	128,125.00



361	600297	广汇汽车	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.61	48,800	127,368.00
362	002127	南极电商	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.34	23,700	126,558.00
363	601319	中国人保	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.06	25,000	126,500.00
364	002266	浙富控股	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.79	25,900	124,061.00
365	600061	国投资本	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.36	19,500	124,020.00
366	600155	华创阳安	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.48	14,600	123,808.00
367	600201	生物股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.16	13,500	123,660.00
368	688002	睿创微纳	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	39.72	3,100	123,132.00
369	002155	湖南黄金	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	12.14	10,100	122,614.00
370	000012	南玻 A	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.42	16,500	122,430.00
371	000930	中粮科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.04	13,500	122,040.00

372	600409	三友化工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.19	14,900	122,031.00
373	300558	贝达药业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	60.80	2,000	121,600.00
374	000883	湖北能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.11	23,700	121,107.00
375	600718	东软集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	11.51	10,400	119,704.00
376	002124	天邦食品	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.72	17,700	118,944.00
377	000686	东北证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.99	16,900	118,131.00
378	600959	江苏有线	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.26	36,100	117,686.00
379	600282	南钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.15	37,100	116,865.00
380	600782	新钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.04	23,000	115,920.00
381	601880	辽港股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.70	68,100	115,770.00
382	000709	河钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.26	51,200	115,712.00

383	601179	中国西电	2022年07月11日	-	2022年07月11日	4.68	24,700	115,596.00
384	600022	山东钢铁	2022年07月11日	-	2022年07月11日	1.74	66,000	114,840.00
385	000690	宝新能源	2022年07月11日	-	2022年07月11日	4.38	26,200	114,756.00
386	600064	南京高科	2022年07月11日	-	2022年07月11日	11.00	10,400	114,400.00
387	002600	领益智造	2022年07月11日	-	2022年07月11日	5.02	22,700	113,954.00
388	002939	长城证券	2022年07月11日	-	2022年07月11日	10.16	11,200	113,792.00
389	600535	天士力	2022年07月11日	-	2022年07月11日	10.51	10,800	113,508.00
390	002701	奥瑞金	2022年07月11日	-	2022年07月11日	5.20	21,700	112,840.00
391	002002	鸿达兴业	2022年07月11日	-	2022年07月11日	3.71	30,100	111,671.00
392	600606	绿地控股	2022年07月11日	-	2022年07月11日	3.96	28,100	111,276.00
393	600008	首创环保	2022年07月11日	-	2022年07月11日	2.90	38,200	110,780.00

394	600500	中化国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.65	16,600	110,390.00
395	600808	马钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.79	29,100	110,289.00
396	600037	歌华有线	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.39	11,700	109,863.00
397	600663	陆家嘴	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.36	10,600	109,816.00
398	000598	兴蓉环境	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.11	21,400	109,354.00
399	600728	佳都科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.46	16,900	109,174.00
400	300630	普利制药	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	35.15	3,100	108,965.00
401	600567	山鹰国际	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.77	38,900	107,753.00
402	002004	华邦健康	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.58	19,000	106,020.00
403	688208	道通科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	32.92	3,200	105,344.00
404	600025	华能水电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.99	15,000	104,850.00

405	002745	木林森	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.77	10,700	104,539.00
406	300463	迈克生物	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	20.49	5,100	104,499.00
407	002429	兆驰股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.84	27,200	104,448.00
408	300115	长盈精密	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	10.31	10,100	104,131.00
409	600517	国网英大	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.19	20,000	103,800.00
410	601881	中国银河	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.67	10,700	103,469.00
411	601958	金铂股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.84	11,600	102,544.00
412	300166	东方国信	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.22	11,000	101,420.00
413	601106	中国一重	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.07	33,000	101,310.00
414	601860	紫金银行	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.87	35,200	101,024.00
415	002390	信邦制药	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.91	14,600	100,886.00

416	300072	三聚环保	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.06	19,800	100,188.00
417	600572	康恩贝	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.43	22,500	99,675.00
418	601118	海南橡胶	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.78	20,600	98,468.00
419	600398	海澜之家	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.75	20,700	98,325.00
420	688006	杭可科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	70.06	1,400	98,084.00
421	601718	际华集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.10	31,600	97,960.00
422	600507	方大特钢	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.99	14,000	97,860.00
423	600737	中粮糖业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.52	12,900	97,008.00
424	000540	中天金融	2022 年 07 月 04 日	-	2022 年 07 月 04 日	1.93	50,100	96,693.00
425	002064	华峰化学	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.44	11,300	95,372.00
426	002010	传化智联	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.43	14,800	95,164.00

427	600582	天地科技	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.78	19,900	95,122.00
428	000089	深圳机场	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.72	12,300	94,956.00
429	000937	冀中能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.46	12,700	94,742.00
430	000559	万向钱潮	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.94	15,900	94,446.00
431	000987	越秀金控	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.03	13,400	94,202.00
432	000800	一汽解放	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.34	10,000	93,400.00
433	600967	内蒙一机	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.12	10,200	93,024.00
434	000898	鞍钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.22	28,800	92,736.00
435	600435	北方导航	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.62	10,700	92,234.00
436	601000	唐山港	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.58	35,700	92,106.00
437	601236	红塔证券	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	9.13	10,000	91,300.00

438	600871	石化油服	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.89	47,400	89,586.00
439	002110	三钢闽光	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.09	14,700	89,523.00
440	000959	首钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.76	18,800	89,488.00
441	002233	塔牌集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	8.85	10,100	89,385.00
442	601333	广深铁路	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.18	40,800	88,944.00
443	000156	华数传媒	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.97	11,100	88,467.00
444	600811	东方集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.83	30,900	87,447.00
445	003035	南网能源	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.35	13,600	86,360.00
446	300866	安克创新	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	66.32	1,300	86,216.00
447	000402	金融街	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.95	14,400	85,680.00
448	600120	浙江东方	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.01	20,900	83,809.00



449	300212	易华录	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	17.40	4,800	83,520.00
450	600126	杭钢股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.12	16,200	82,944.00
451	000488	晨鸣纸业	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.64	14,700	82,908.00
452	600167	联美控股	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.49	11,000	82,390.00
453	000685	中山公用	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	7.68	10,600	81,408.00
454	002081	金螳螂	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.08	16,000	81,280.00
455	000158	常山北明	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.00	13,500	81,000.00
456	600707	彩虹股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.68	17,300	80,964.00
457	300979	华利集团	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	73.08	1,100	80,388.00
458	002387	维信诺	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.72	11,600	77,952.00
459	000967	盈峰环境	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.06	15,300	77,418.00

460	688009	中国通号	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.53	16,900	76,557.00
461	000528	柳工	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	6.51	11,700	76,167.00
462	600376	首开股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.91	15,500	76,105.00
463	000563	陕国投A	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.12	23,900	74,568.00
464	600901	江苏租赁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.13	14,400	73,872.00
465	601598	中国外运	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.88	19,000	73,720.00
466	600307	酒钢宏兴	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	1.94	37,700	73,138.00
467	601991	大唐发电	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.43	29,900	72,657.00
468	300257	开山股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	14.96	4,800	71,808.00
469	000961	中南建设	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.05	23,000	70,150.00
470	600717	天津港	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	4.01	17,400	69,774.00

471	000718	苏宁 环球	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	3.68	18,300	67,344.00
472	300888	稳健 医疗	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	66.50	1,000	66,500.00
473	000415	渤海 租赁	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.17	29,800	64,666.00
474	600968	海油 发展	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.58	24,500	63,210.00
475	600787	中储 股份	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	5.69	10,500	59,745.00
476	600339	中油 工程	2022 年 07 月 11 日	-	2022 年 07 月 11 日	2.89	20,100	58,089.00
合计	-	-	-	-	-	-	11,955,900	147,633,983.00

注：出借证券中如有其它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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

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

具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

## 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2年 06 月 30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	55,784,982.51	-	-	-	-	-	55,784,982.51
结算备付金	30,721,403.56	-	-	-	-	-	30,721,403.56
存出保证金	134,846.25	-	-	-	-	11,166,808.00	11,301,654.25
交易性金融资产	-	-	244,621.83	-	-	1,908,413,703.97	1,908,658,325.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	185,342.18	185,342.18
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	27,061.72	27,061.72
资产总计	86,641,232.32	-	244,621.83	-	-	1,919,792,915.87	2,006,678,770.02
负债							

短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	5,184.00	5,184.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	230,839.74	230,839.74
应	-	-	-	-	-	76,946.59	76,946.59

付 托 管 费							
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 投 资 顾 问 费	-	-	-	-	-	-	-
应 交 税 费	-	-	-	-	-	4,986.04	4,986.04
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	506,932.70	506,932.70
负 债 总 计	-	-	-	-	-	824,889.07	824,889.07
利 率 敏	86,641,232.3 2	-	244,621.83	-	-	1,918,968,026.8 0	2,005,853,880.9 5



感度缺口							
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	54,246,161.68	-	-	-	-	-	54,246,161.68
结算备付金	37,658,495.56	-	-	-	-	-	37,658,495.56
存出保证金	123,190.09	-	-	-	-	12,478,520.00	12,601,710.09
交易性金融资产	-	-	2,398,000.00	-	-	2,007,588,481.80	2,009,986,481.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买	-	-	-	-	-	-	-

入返售金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,863,087.86	4,863,087.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	31,931.25	31,931.25
资产总计	92,027,847.33	-	2,398,000.00	-	-	2,024,962,020.91	2,119,387,868.24
负债							
短期	-	-	-	-	-	-	-

借款							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,443,643.71	2,443,643.71
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	269,214.55	269,214.55
应付托	-	-	-	-	-	89,738.20	89,738.20

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	77,629.38	77,629.38
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	580,979.26	580,979.26
负债总计	-	-	-	-	-	3,461,205.10	3,461,205.10
利率敏感度	92,027,847.33	-	2,398,000.00	-	-	2,021,500,815.81	2,115,926,663.14

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 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	1,908,413,703.97	95.14	2,007,588,481.80	94.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	244,621.83	0.01	2,398,000.00	0.11
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	1,908,658,325.80	95.15	2,009,986,481.80	94.99

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 800 指数 上涨 5%	99,820,270.43	105,096,262.51
	中证 800 指数 下跌 5%	-99,820,270.43	-105,096,262.51

本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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 06 月 30 日
第一层次	1,906,267,247.11
第二层次	1,476,150.37
第三层次	914,928.32
合计	1,908,658,325.80

###### 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、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,908,413,703.97	95.10
	其中：股票	1,908,413,703.97	95.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	244,621.83	0.01
	其中：债券	244,621.83	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	86,506,386.07	4.31
8	其他各项资产	11,514,058.15	0.57
9	合计	2,006,678,770.02	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 147,633,983.00 元，占期末基金资产净值比例 7.36%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,919,689.66	1.09
B	采矿业	60,245,829.00	3.00
C	制造业	1,139,723,779.13	56.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,884,462.74	2.49
E	建筑业	34,327,403.05	1.71
F	批发和零售业	20,674,633.80	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	48,944,515.04	2.44
H	住宿和餐饮业	947,360.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,705,527.70	3.82
J	金融业	333,262,152.01	16.61
K	房地产业	37,522,659.35	1.87
L	租赁和商务服务业	25,902,946.06	1.29
M	科学研究和技术服务业	27,950,727.19	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	3,269,352.50	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	742,278.00	0.04
Q	卫生和社会工作	13,989,499.88	0.70
R	文化、体育和娱乐业	7,728,249.00	0.39
S	综合	3,297,063.00	0.16
	合计	1,907,038,127.11	95.07

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	454,047.32	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	257,723.18	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	340,862.26	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	285,308.80	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-



P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,375,576.86	0.07

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	43,615	89,192,675.00	4.45
2	300750	宁德时代	101,700	54,307,800.00	2.71
3	600036	招商银行	862,200	36,384,840.00	1.81
4	601318	中国平安	754,356	35,220,881.64	1.76
5	601012	隆基绿能	422,532	28,153,307.16	1.40
6	000858	五粮液	134,761	27,212,288.73	1.36
7	002594	比亚迪	63,600	21,209,964.00	1.06
8	000333	美的集团	341,661	20,632,907.79	1.03
9	601166	兴业银行	1,013,500	20,168,650.00	1.01
10	300059	东方财富	736,489	18,706,820.60	0.93
11	600900	长江电力	792,077	18,312,820.24	0.91
12	601888	中国中免	68,342	15,918,902.06	0.79
13	603259	药明康德	143,181	14,889,392.19	0.74

14	600030	中信证 券	680,050	14,729,883.00	0.73
15	600887	伊利股 份	356,600	13,889,570.00	0.69
16	000568	泸州老 窖	50,900	12,548,886.00	0.63
17	002415	海康威 视	328,500	11,891,700.00	0.59
18	002475	立讯精 密	345,784	11,684,041.36	0.58
19	601398	工商银 行	2,439,800	11,637,846.00	0.58
20	600276	恒瑞医 药	311,142	11,540,256.78	0.58
21	600438	通威股 份	188,300	11,271,638.00	0.56
22	000651	格力电 器	329,040	11,095,228.80	0.55
23	600809	山西汾 酒	34,160	11,095,168.00	0.55
24	300760	迈瑞医 疗	34,000	10,648,800.00	0.53
25	600309	万华化 学	109,500	10,620,405.00	0.53
26	000725	京东方 A	2,615,100	10,303,494.00	0.51
27	002714	牧原股 份	185,758	10,266,844.66	0.51
28	000001	平安银 行	676,367	10,131,977.66	0.51
29	603288	海天味 业	109,863	9,927,220.68	0.49
30	002142	宁波银 行	276,170	9,889,647.70	0.49
31	000002	万 科 A	474,000	9,717,000.00	0.48
32	601328	交通银 行	1,914,100	9,532,218.00	0.48
33	002460	赣锋锂 业	63,700	9,472,190.00	0.47
34	603799	华友钴 业	98,870	9,453,949.40	0.47
35	601899	紫金矿 业	1,003,300	9,360,789.00	0.47

36	002812	恩捷股份	37,300	9,341,785.00	0.47
37	002129	TCL 中环	157,700	9,286,953.00	0.46
38	000792	盐湖股份	303,400	9,089,864.00	0.45
39	002466	天齐锂业	72,200	9,010,560.00	0.45
40	600048	保利发展	501,200	8,750,952.00	0.44
41	300015	爱尔眼科	188,844	8,454,545.88	0.42
42	300124	汇川技术	128,350	8,454,414.50	0.42
43	600031	三一重工	413,400	7,879,404.00	0.39
44	601668	中国建筑	1,461,000	7,772,520.00	0.39
45	002304	洋河股份	42,000	7,692,300.00	0.38
46	300014	亿纬锂能	78,883	7,691,092.50	0.38
47	600436	片仔癀	21,500	7,669,695.00	0.38
48	601088	中国神华	229,940	7,657,002.00	0.38
49	002352	顺丰控股	135,944	7,587,034.64	0.38
50	300498	温氏股份	353,940	7,535,382.60	0.38
51	600690	海尔智家	264,200	7,254,932.00	0.36
52	002271	东方雨虹	140,900	7,252,123.00	0.36
53	600089	特变电工	264,000	7,230,960.00	0.36
54	300274	阳光电源	72,500	7,123,125.00	0.36
55	300122	智飞生物	63,300	7,026,933.00	0.35
56	603986	兆易创新	48,368	6,878,413.28	0.34
57	601816	京沪高铁	1,369,000	6,872,380.00	0.34
58	601288	农业银	2,221,600	6,709,232.00	0.33

		行			
59	600837	海通证 券	673,200	6,604,092.00	0.33
60	600000	浦发银 行	817,100	6,544,971.00	0.33
61	600016	民生银 行	1,728,800	6,431,136.00	0.32
62	603501	韦尔股 份	36,709	6,351,758.27	0.32
63	002371	北方华 创	22,876	6,339,397.12	0.32
64	600406	国电南 瑞	233,405	6,301,935.00	0.31
65	601919	中远海 控	440,260	6,119,614.00	0.31
66	688981	中芯国 际	134,400	6,070,848.00	0.30
67	000625	长安汽 车	346,892	6,008,169.44	0.30
68	600585	海螺水 泥	167,100	5,895,288.00	0.29
69	600919	江苏银 行	822,650	5,857,268.00	0.29
70	601688	华泰证 券	409,000	5,807,800.00	0.29
71	002709	天赐材 料	93,260	5,787,715.60	0.29
72	600104	上汽集 团	324,500	5,779,345.00	0.29
73	601225	陕西煤 业	270,100	5,720,718.00	0.29
74	002049	紫光国 微	29,900	5,672,628.00	0.28
75	000063	中兴通 讯	222,150	5,671,489.50	0.28
76	601601	中国太 保	238,500	5,611,905.00	0.28
77	002241	歌尔股 份	166,300	5,587,680.00	0.28
78	300142	沃森生 物	111,800	5,410,002.00	0.27
79	000661	长春高 新	23,000	5,368,660.00	0.27

80	002230	科大讯飞	130,000	5,358,600.00	0.27
81	600111	北方稀土	152,100	5,347,836.00	0.27
82	002459	晶澳科技	65,740	5,186,886.00	0.26
83	688599	天合光能	75,700	4,939,425.00	0.25
84	300450	先导智能	76,300	4,820,634.00	0.24
85	601988	中国银行	1,468,500	4,787,310.00	0.24
86	601211	国泰君安	313,900	4,771,280.00	0.24
87	002027	分众传媒	704,800	4,743,304.00	0.24
88	000338	潍柴动力	377,700	4,709,919.00	0.23
89	000100	TCL 科技	979,100	4,689,889.00	0.23
90	601169	北京银行	1,030,200	4,677,108.00	0.23
91	600660	福耀玻璃	111,400	4,657,634.00	0.23
92	601229	上海银行	693,400	4,541,770.00	0.23
93	601985	中国核电	656,700	4,504,962.00	0.22
94	600050	中国联通	1,296,600	4,486,236.00	0.22
95	601766	中国中车	848,100	4,410,120.00	0.22
96	600745	闻泰科技	51,700	4,400,187.00	0.22
97	601390	中国中铁	715,300	4,391,942.00	0.22
98	600522	中天科技	187,100	4,322,010.00	0.22
99	600893	航发动力	92,678	4,217,775.78	0.21
100	300347	泰格医药	36,700	4,200,315.00	0.21
101	601669	中国电建	533,400	4,197,858.00	0.21

102	603659	璞泰来	48,300	4,076,520.00	0.20
103	601658	邮储银行	755,278	4,070,948.42	0.20
104	601615	明阳智能	114,500	3,870,100.00	0.19
105	000776	广发证券	206,100	3,854,070.00	0.19
106	600009	上海机场	67,500	3,827,250.00	0.19
107	600028	中国石化	933,100	3,807,048.00	0.19
108	600905	三峡能源	596,200	3,750,098.00	0.19
109	600019	宝钢股份	621,900	3,743,838.00	0.19
110	601009	南京银行	358,900	3,739,738.00	0.19
111	600999	招商证券	259,210	3,735,216.10	0.19
112	600958	东方证券	363,944	3,715,868.24	0.19
113	600010	包钢股份	1,578,900	3,710,415.00	0.18
114	600196	复星医药	83,700	3,690,333.00	0.18
115	688005	容百科技	28,100	3,637,264.00	0.18
116	002410	广联达	66,793	3,636,210.92	0.18
117	601628	中国人寿	116,113	3,608,792.04	0.18
118	601857	中国石油	676,300	3,584,390.00	0.18
119	300896	爱美客	5,900	3,540,059.00	0.18
120	000895	双汇发展	120,802	3,539,498.60	0.18
121	600570	恒生电子	81,108	3,531,442.32	0.18
122	002179	中航光电	55,120	3,490,198.40	0.17
123	601818	光大银行	1,154,600	3,475,346.00	0.17
124	002311	海大集团	57,500	3,450,575.00	0.17

125	002050	三花智控	124,980	3,434,450.40	0.17
126	600256	广汇能源	312,600	3,294,804.00	0.16
127	300759	康龙化成	34,600	3,294,612.00	0.16
128	600346	恒力石化	147,800	3,287,072.00	0.16
129	600760	中航沈飞	54,100	3,270,345.00	0.16
130	688012	中微公司	28,000	3,269,000.00	0.16
131	002493	荣盛石化	211,650	3,257,293.50	0.16
132	002074	国轩高科	69,900	3,187,440.00	0.16
133	601633	长城汽车	85,362	3,161,808.48	0.16
134	300496	中科创达	24,100	3,144,568.00	0.16
135	600926	杭州银行	206,960	3,100,260.80	0.15
136	300661	圣邦股份	16,950	3,085,239.00	0.15
137	300769	德方纳米	7,500	3,065,100.00	0.15
138	600460	士兰微	58,800	3,057,600.00	0.15
139	600426	华鲁恒升	104,160	3,041,472.00	0.15
140	300316	晶盛机电	44,700	3,021,273.00	0.15
141	002920	德赛西威	20,300	3,004,400.00	0.15
142	000538	云南白药	49,660	2,998,967.40	0.15
143	001979	招商蛇口	221,700	2,977,431.00	0.15
144	601989	中国重工	795,700	2,952,047.00	0.15
145	002001	新和成	129,088	2,944,497.28	0.15
146	300782	卓胜微	21,760	2,937,600.00	0.15
147	600176	中国巨	167,123	2,909,611.43	0.15

		石			
148	000768	中航西飞	96,000	2,907,840.00	0.14
149	600763	通策医疗	16,600	2,895,704.00	0.14
150	002821	凯莱英	10,000	2,890,000.00	0.14
151	002202	金风科技	192,600	2,850,480.00	0.14
152	601939	建设银行	466,300	2,825,778.00	0.14
153	603993	洛阳钼业	490,400	2,809,992.00	0.14
154	000963	华东医药	61,500	2,777,340.00	0.14
155	000596	古井贡酒	11,100	2,771,226.00	0.14
156	600096	云天化	87,600	2,757,648.00	0.14
157	601138	工业富联	276,700	2,722,728.00	0.14
158	601006	大秦铁路	412,640	2,719,297.60	0.14
159	000166	申万宏源	626,900	2,689,401.00	0.13
160	300012	华测检测	115,300	2,676,113.00	0.13
161	601877	正泰电器	74,751	2,674,590.78	0.13
162	600584	长电科技	98,900	2,670,300.00	0.13
163	688396	华润微	45,000	2,658,150.00	0.13
164	300207	欣旺达	83,800	2,648,080.00	0.13
165	601377	兴业证券	371,800	2,621,190.00	0.13
166	600600	青岛啤酒	25,100	2,608,392.00	0.13
167	601600	中国铝业	548,000	2,603,000.00	0.13
168	601066	中信建投	90,000	2,601,900.00	0.13
169	600588	用友网络	119,650	2,597,601.50	0.13
170	600029	南方航空	352,000	2,573,120.00	0.13



171	002497	雅化集团	78,700	2,569,555.00	0.13
172	002407	多氟多	52,100	2,548,211.00	0.13
173	600383	金地集团	189,000	2,540,160.00	0.13
174	600741	华域汽车	110,200	2,534,600.00	0.13
175	601186	中国铁建	320,800	2,534,320.00	0.13
176	600188	兖矿能源	63,900	2,522,772.00	0.13
177	600085	同仁堂	47,700	2,522,376.00	0.13
178	002240	盛新锂能	41,400	2,498,904.00	0.12
179	601838	成都银行	150,600	2,496,948.00	0.12
180	300390	天华超净	28,400	2,482,160.00	0.12
181	688111	金山办公	12,500	2,464,000.00	0.12
182	000786	北新建材	70,900	2,454,558.00	0.12
183	600795	国电电力	622,500	2,433,975.00	0.12
184	002180	纳思达	48,000	2,429,760.00	0.12
185	603806	福斯特	37,002	2,424,371.04	0.12
186	600132	重庆啤酒	16,500	2,418,900.00	0.12
187	601111	中国国航	207,300	2,406,753.00	0.12
188	600157	永泰能源	1,512,000	2,404,080.00	0.12
189	601117	中国化学	255,300	2,402,373.00	0.12
190	300408	三环集团	79,800	2,401,980.00	0.12
191	000876	新希望	156,400	2,392,920.00	0.12
192	600885	宏发股份	56,730	2,374,150.50	0.12
193	000009	中国宝安	175,900	2,372,891.00	0.12
194	603019	中科曙	81,220	2,357,004.40	0.12

		光			
195	600150	中国船舶	124,068	2,354,810.64	0.12
196	601238	广汽集团	153,500	2,339,340.00	0.12
197	600547	山东黄金	125,300	2,325,568.00	0.12
198	600141	兴发集团	52,700	2,318,273.00	0.12
199	003816	中国广核	819,600	2,294,880.00	0.11
200	300751	迈为股份	4,660	2,287,594.00	0.11
201	601800	中国交建	244,500	2,268,960.00	0.11
202	300999	金龙鱼	41,600	2,247,232.00	0.11
203	601100	恒立液压	36,348	2,243,398.56	0.11
204	600989	宝丰能源	152,800	2,238,520.00	0.11
205	300073	当升科技	24,700	2,231,398.00	0.11
206	600015	华夏银行	427,400	2,226,754.00	0.11
207	603369	今世缘	43,457	2,216,307.00	0.11
208	600886	国投电力	206,800	2,171,400.00	0.11
209	600011	华能国际	306,600	2,158,464.00	0.11
210	002648	卫星化学	83,400	2,155,890.00	0.11
211	600392	盛和资源	95,200	2,151,520.00	0.11
212	300763	锦浪科技	10,100	2,151,300.00	0.11
213	601868	中国能建	907,465	2,150,692.05	0.11
214	601788	光大证券	136,100	2,144,936.00	0.11
215	002384	东山精密	92,900	2,130,197.00	0.11
216	603613	国联股份	24,015	2,127,729.00	0.11

217	000157	中联重科	344,800	2,123,968.00	0.11
218	300601	康泰生物	46,520	2,101,773.60	0.10
219	000301	东方盛虹	123,700	2,091,767.00	0.10
220	600115	中国东航	380,600	2,089,494.00	0.10
221	000425	徐工机械	383,000	2,064,370.00	0.10
222	002756	永兴材料	13,500	2,054,835.00	0.10
223	603185	上机数控	13,160	2,052,828.40	0.10
224	688008	澜起科技	33,800	2,047,604.00	0.10
225	002236	大华股份	124,600	2,045,932.00	0.10
226	600418	江淮汽车	118,800	2,038,608.00	0.10
227	300595	欧普康视	35,560	2,033,676.40	0.10
228	688180	君实生物	26,600	2,004,044.00	0.10
229	002601	龙佰集团	99,400	1,992,970.00	0.10
230	002555	三七互娱	92,700	1,968,021.00	0.10
231	300285	国瓷材料	54,300	1,950,456.00	0.10
232	300628	亿联网络	25,600	1,949,440.00	0.10
233	000938	紫光股份	100,460	1,948,924.00	0.10
234	600765	中航重机	60,460	1,945,602.80	0.10
235	002736	国信证券	201,600	1,929,312.00	0.10
236	002008	大族激光	58,200	1,928,166.00	0.10
237	601916	浙商银行	580,400	1,926,928.00	0.10
238	600399	抚顺特钢	107,500	1,924,250.00	0.10

239	600941	中国移动	31,800	1,923,900.00	0.10
240	601901	方正证券	285,700	1,917,047.00	0.10
241	600233	圆通速递	93,400	1,904,426.00	0.09
242	603486	科沃斯	15,600	1,901,484.00	0.09
243	601058	赛轮轮胎	167,800	1,891,106.00	0.09
244	601555	东吴证券	272,502	1,888,438.86	0.09
245	000977	浪潮信息	71,300	1,888,024.00	0.09
246	603833	欧派家居	12,420	1,871,445.60	0.09
247	000983	山西焦煤	139,640	1,869,779.60	0.09
248	600499	科达制造	90,500	1,867,920.00	0.09
249	600487	亨通光电	128,300	1,865,482.00	0.09
250	300037	新宙邦	35,400	1,860,624.00	0.09
251	601336	新华保险	57,765	1,859,455.35	0.09
252	603392	万泰生物	11,970	1,858,941.00	0.09
253	600219	南山铝业	502,000	1,852,380.00	0.09
254	600563	法拉电子	9,000	1,846,440.00	0.09
255	000069	华侨城 A	284,500	1,846,405.00	0.09
256	600352	浙江龙盛	181,000	1,842,580.00	0.09
257	600732	爱旭股份	55,300	1,826,006.00	0.09
258	603290	斯达半导	4,700	1,813,730.00	0.09
259	601995	中金公司	40,600	1,806,294.00	0.09
260	603077	和邦生物	420,700	1,792,182.00	0.09
261	002385	大北农	226,700	1,770,527.00	0.09

262	002841	视源股份	23,500	1,770,020.00	0.09
263	603456	九洲药业	34,200	1,768,140.00	0.09
264	300454	深信服	17,000	1,764,260.00	0.09
265	300363	博腾股份	22,600	1,762,574.00	0.09
266	601618	中国中冶	499,200	1,747,200.00	0.09
267	002007	华兰生物	76,620	1,746,936.00	0.09
268	601108	财通证券	221,380	1,742,260.60	0.09
269	600845	宝信软件	31,870	1,740,102.00	0.09
270	688126	沪硅产业	75,600	1,737,288.00	0.09
271	002120	韵达股份	101,570	1,732,784.20	0.09
272	300529	健帆生物	34,000	1,730,260.00	0.09
273	002268	卫士通	40,300	1,729,273.00	0.09
274	300413	芒果超媒	51,700	1,724,712.00	0.09
275	603260	合盛硅业	14,600	1,722,216.00	0.09
276	688122	西部超导	18,600	1,714,920.00	0.09
277	601360	三六零	199,900	1,703,148.00	0.08
278	002252	上海莱士	280,700	1,664,551.00	0.08
279	600298	安琪酵母	34,100	1,662,375.00	0.08
280	601799	星宇股份	9,700	1,658,700.00	0.08
281	688099	晶晨股份	16,400	1,656,400.00	0.08
282	000519	中兵红箭	56,700	1,652,805.00	0.08
283	600486	扬农化工	12,400	1,652,672.00	0.08
284	688390	固德威	5,260	1,646,432.60	0.08

285	603345	安井食品	9,800	1,645,126.00	0.08
286	300144	宋城演艺	106,920	1,641,222.00	0.08
287	000630	铜陵有色	501,600	1,635,216.00	0.08
288	300003	乐普医疗	87,988	1,633,937.16	0.08
289	000703	恒逸石化	154,010	1,618,645.10	0.08
290	601155	新城控股	63,200	1,607,176.00	0.08
291	600862	中航高科	56,700	1,593,270.00	0.08
292	000988	华工科技	68,600	1,589,462.00	0.08
293	603882	金域医学	19,200	1,584,960.00	0.08
294	002353	杰瑞股份	39,100	1,575,730.00	0.08
295	000783	长江证券	263,500	1,562,555.00	0.08
296	601077	渝农商行	421,300	1,558,810.00	0.08
297	603605	珀莱雅	9,400	1,552,692.00	0.08
298	601878	浙商证券	135,100	1,537,438.00	0.08
299	300919	中伟股份	12,400	1,536,360.00	0.08
300	600332	白云山	48,600	1,535,274.00	0.08
301	300433	蓝思科技	138,300	1,530,981.00	0.08
302	601168	西部矿业	129,400	1,530,802.00	0.08
303	002625	光启技术	88,300	1,524,941.00	0.08
304	601021	春秋航空	26,100	1,522,935.00	0.08
305	601696	中银证券	113,500	1,509,550.00	0.08
306	300146	汤臣倍健	69,600	1,506,840.00	0.08
307	601162	天风证	470,760	1,497,016.80	0.07

		券			
308	002602	世纪华通	310,520	1,496,706.40	0.07
309	600489	中金黄金	201,800	1,491,302.00	0.07
310	600918	中泰证券	193,600	1,481,040.00	0.07
311	002028	思源电气	41,500	1,479,890.00	0.07
312	603517	绝味食品	25,400	1,468,628.00	0.07
313	002797	第一创业	228,800	1,466,608.00	0.07
314	002056	横店东磁	55,000	1,464,100.00	0.07
315	603899	晨光股份	26,000	1,458,080.00	0.07
316	002507	涪陵榨菜	42,200	1,456,744.00	0.07
317	002938	鹏鼎控股	48,200	1,456,122.00	0.07
318	603589	口子窖	24,800	1,453,528.00	0.07
319	000066	中国长城	134,200	1,452,044.00	0.07
320	688777	中控技术	19,900	1,447,924.00	0.07
321	300724	捷佳伟创	16,200	1,447,470.00	0.07
322	688036	传音控股	16,200	1,445,526.00	0.07
323	600988	赤峰黄金	90,300	1,440,285.00	0.07
324	000932	华菱钢铁	282,000	1,435,380.00	0.07
325	002185	华天科技	152,700	1,432,326.00	0.07
326	601128	常熟银行	186,600	1,425,624.00	0.07
327	688169	石头科技	2,300	1,418,410.00	0.07
328	000708	中信特钢	70,300	1,416,545.00	0.07
329	300033	同花顺	14,600	1,403,790.00	0.07

330	601728	中国电信	375,411	1,400,283.03	0.07
331	601636	旗滨集团	109,800	1,399,950.00	0.07
332	600521	华海药业	61,400	1,393,780.00	0.07
333	300223	北京君正	13,100	1,391,875.00	0.07
334	603026	石大胜华	9,500	1,380,825.00	0.07
335	002603	以岭药业	56,620	1,375,866.00	0.07
336	600039	四川路桥	130,500	1,374,165.00	0.07
337	600109	国金证券	152,100	1,368,900.00	0.07
338	002078	太阳纸业	111,100	1,367,641.00	0.07
339	601607	上海医药	75,600	1,366,848.00	0.07
340	002326	永太科技	41,500	1,366,595.00	0.07
341	600183	生益科技	80,320	1,364,636.80	0.07
342	000830	鲁西化工	78,300	1,353,807.00	0.07
343	601865	福莱特	35,400	1,348,740.00	0.07
344	605117	德业股份	4,800	1,343,472.00	0.07
345	600018	上港集团	228,700	1,333,321.00	0.07
346	601898	中煤能源	128,000	1,328,640.00	0.07
347	600153	建发股份	101,600	1,327,912.00	0.07
348	002624	完美世界	92,050	1,322,758.50	0.07
349	603939	益丰药房	25,000	1,320,750.00	0.07
350	600546	山煤国际	67,600	1,315,496.00	0.07
351	002916	深南电路	13,900	1,302,569.00	0.06



352	600362	江西铜业	72,200	1,287,326.00	0.06
353	300699	光威复材	21,800	1,283,366.00	0.06
354	002422	科伦药业	68,100	1,273,470.00	0.06
355	601872	招商轮船	220,860	1,272,153.60	0.06
356	600348	华阳股份	81,700	1,263,082.00	0.06
357	600549	厦门钨业	58,400	1,262,608.00	0.06
358	300957	贝泰妮	5,800	1,261,674.00	0.06
359	600705	中航产融	364,000	1,259,440.00	0.06
360	600497	驰宏锌锗	242,500	1,258,575.00	0.06
361	601990	南京证券	150,600	1,256,004.00	0.06
362	600177	雅戈尔	189,100	1,253,733.00	0.06
363	000738	航发控制	44,600	1,253,260.00	0.06
364	603267	鸿远电子	9,300	1,249,269.00	0.06
365	000970	中科三环	66,410	1,247,179.80	0.06
366	600875	东方电气	75,700	1,245,265.00	0.06
367	000831	五矿稀土	39,800	1,243,750.00	0.06
368	300088	长信科技	167,000	1,239,140.00	0.06
369	000999	华润三九	27,100	1,219,500.00	0.06
370	603127	昭衍新药	10,700	1,217,660.00	0.06
371	600160	巨化股份	91,500	1,203,225.00	0.06
372	002557	洽洽食品	21,100	1,201,223.00	0.06
373	600859	王府井	46,100	1,197,678.00	0.06
374	000998	隆平高科	71,800	1,196,188.00	0.06

375	002673	西部证 券	182,700	1,194,858.00	0.06
376	002138	顺络电 子	43,800	1,193,550.00	0.06
377	002572	索菲亚	43,400	1,193,500.00	0.06
378	601699	潞安环 能	81,300	1,188,606.00	0.06
379	002508	老板电 器	32,900	1,185,387.00	0.06
380	300676	华大基 因	16,500	1,183,050.00	0.06
381	002414	高德红 外	91,732	1,180,590.84	0.06
382	600516	方大炭 素	155,320	1,180,432.00	0.06
383	000039	中集集 团	84,400	1,168,940.00	0.06
384	600143	金发科 技	122,400	1,165,248.00	0.06
385	000807	云铝股 份	117,900	1,164,852.00	0.06
386	600161	天坛生 物	47,960	1,164,468.80	0.06
387	600482	中国动 力	73,600	1,156,256.00	0.06
388	601997	贵阳银 行	198,938	1,155,829.78	0.06
389	002030	达安基 因	67,032	1,152,280.08	0.06
390	000960	锡业股 份	68,300	1,145,391.00	0.06
391	601216	君正集 团	234,400	1,143,872.00	0.06
392	002273	水晶光 电	94,300	1,141,973.00	0.06
393	600061	国投资 本	179,296	1,140,322.56	0.06
394	002465	海格通 信	125,200	1,138,068.00	0.06
395	300357	我武生 物	21,700	1,129,051.00	0.06
396	002791	坚朗五 金	8,700	1,128,564.00	0.06

397	603444	吉比特	2,900	1,125,200.00	0.06
398	601319	中国人保	221,878	1,122,702.68	0.06
399	300136	信维通信	66,100	1,113,785.00	0.06
400	000629	攀钢钒钛	293,000	1,113,400.00	0.06
401	000728	国元证券	178,630	1,111,078.60	0.06
402	300058	蓝色光标	169,400	1,106,182.00	0.06
403	600536	中国软件	27,250	1,106,077.50	0.06
404	000975	银泰黄金	113,360	1,104,126.40	0.06
405	600170	上海建工	363,000	1,099,890.00	0.05
406	002409	雅克科技	19,800	1,099,098.00	0.05
407	002568	百润股份	36,300	1,090,452.00	0.05
408	002092	中泰化学	140,300	1,088,728.00	0.05
409	600704	物产中大	212,200	1,088,586.00	0.05
410	601577	长沙银行	136,800	1,084,824.00	0.05
411	600079	人福医药	67,800	1,084,800.00	0.05
412	000408	藏格矿业	32,800	1,080,432.00	0.05
413	002294	信立泰	37,900	1,064,990.00	0.05
414	600739	辽宁成大	72,900	1,062,882.00	0.05
415	300418	昆仑万维	66,300	1,060,800.00	0.05
416	002506	协鑫集成	284,200	1,057,224.00	0.05
417	600606	绿地控股	266,250	1,054,350.00	0.05
418	300244	迪安诊断	33,900	1,054,290.00	0.05
419	600372	中航电	54,300	1,052,877.00	0.05

		子			
420	002223	鱼跃医疗	40,900	1,049,494.00	0.05
421	601966	玲珑轮胎	41,200	1,045,244.00	0.05
422	603198	迎驾贡酒	16,000	1,042,240.00	0.05
423	600415	小商品城	186,900	1,041,033.00	0.05
424	000547	航天发展	87,100	1,039,974.00	0.05
425	002372	伟星新材	43,200	1,038,528.00	0.05
426	688561	奇安信	18,600	1,037,880.00	0.05
427	002739	万达电影	75,900	1,036,035.00	0.05
428	300474	景嘉微	15,100	1,032,689.00	0.05
429	000636	风华高科	54,796	1,029,616.84	0.05
430	600699	均胜电子	65,400	1,027,434.00	0.05
431	300253	卫宁健康	116,900	1,026,382.00	0.05
432	600655	豫园股份	108,200	1,021,408.00	0.05
433	601998	中信银行	214,700	1,019,825.00	0.05
434	300308	中际旭创	32,800	1,018,440.00	0.05
435	300296	利亚德	138,700	1,012,510.00	0.05
436	300558	贝达药业	16,600	1,009,280.00	0.05
437	600315	上海家化	23,400	1,000,350.00	0.05
438	600637	东方明珠	139,730	999,069.50	0.05
439	002600	领益智造	198,200	994,964.00	0.05
440	002683	广东宏大	35,700	993,531.00	0.05
441	600867	通化东宝	95,504	987,511.36	0.05
442	600985	淮北矿	67,700	985,712.00	0.05

		业			
443	300832	新产业	21,800	983,398.00	0.05
444	601016	节能风电	204,600	982,080.00	0.05
445	601198	东兴证券	110,100	979,890.00	0.05
446	002156	通富微电	63,600	979,440.00	0.05
447	600236	桂冠电力	160,800	979,272.00	0.05
448	600026	中远海能	94,400	975,152.00	0.05
449	000887	中鼎股份	53,400	974,016.00	0.05
450	603233	大参林	31,100	973,430.00	0.05
451	600171	上海贝岭	38,800	971,164.00	0.05
452	002299	圣农发展	50,500	968,590.00	0.05
453	603160	汇顶科技	15,600	966,108.00	0.05
454	002065	东华软件	152,700	965,064.00	0.05
455	600380	健康元	78,000	963,300.00	0.05
456	600879	航天电子	148,100	961,169.00	0.05
457	300677	英科医疗	37,740	957,086.40	0.05
458	688363	华熙生物	6,700	952,606.00	0.05
459	688065	凯赛生物	8,500	950,300.00	0.05
460	600642	申能股份	166,800	947,424.00	0.05
461	600258	首旅酒店	38,200	947,360.00	0.05
462	300026	红日药业	122,500	943,250.00	0.05
463	000750	国海证券	259,590	942,311.70	0.05
464	002408	齐翔腾达	116,080	941,408.80	0.05
465	002936	郑州银	349,843	941,077.67	0.05

		行			
466	000623	吉林敖东	63,600	938,736.00	0.05
467	000513	丽珠集团	25,800	934,218.00	0.05
468	002203	海亮股份	80,200	926,310.00	0.05
469	000729	燕京啤酒	95,700	924,462.00	0.05
470	600673	东阳光	102,800	924,172.00	0.05
471	600038	中直股份	20,400	922,080.00	0.05
472	000878	云南铜业	80,900	921,451.00	0.05
473	000400	许继电气	47,800	917,760.00	0.05
474	688185	康希诺	4,600	915,768.00	0.05
475	600820	隧道股份	149,600	915,552.00	0.05
476	600529	山东药玻	32,500	908,375.00	0.05
477	601717	郑煤机	63,000	907,830.00	0.05
478	600580	卧龙电驱	62,900	907,018.00	0.05
479	300383	光环新网	86,600	902,372.00	0.04
480	600801	华新水泥	46,200	901,362.00	0.04
481	600166	福田汽车	317,800	899,374.00	0.04
482	600369	西南证券	226,200	898,014.00	0.04
483	002439	启明星辰	45,000	896,850.00	0.04
484	603568	伟明环保	26,850	895,984.50	0.04
485	600316	洪都航空	29,500	892,080.00	0.04
486	002131	利欧股份	459,700	891,818.00	0.04
487	300017	网宿科技	166,200	890,832.00	0.04
488	002183	怡亚	123,500	890,435.00	0.04

		通			
489	002195	二三四五	395,100	888,975.00	0.04
490	600848	上海临港	65,400	886,824.00	0.04
491	600909	华安证券	194,770	886,203.50	0.04
492	002958	青农商行	264,300	877,476.00	0.04
493	002444	巨星科技	46,500	876,060.00	0.04
494	002064	华峰化学	103,700	875,228.00	0.04
495	600027	华电国际	222,100	872,853.00	0.04
496	600325	华发股份	115,300	872,821.00	0.04
497	600025	华能水电	124,800	872,352.00	0.04
498	601005	重庆钢铁	456,300	871,533.00	0.04
499	600008	首创环保	299,890	869,681.00	0.04
500	688256	寒武纪	13,400	866,980.00	0.04
501	601881	中国银河	89,300	863,531.00	0.04
502	300001	特锐德	49,300	853,383.00	0.04
503	300024	机器人	84,200	848,736.00	0.04
504	000825	太钢不锈	155,000	844,750.00	0.04
505	002430	杭氧股份	27,000	844,020.00	0.04
506	002500	山西证券	146,680	841,943.20	0.04
507	600271	航天信息	76,900	841,286.00	0.04
508	002926	华西证券	107,300	841,232.00	0.04
509	603218	日月股份	33,000	838,200.00	0.04
510	002373	千方科技	75,300	837,336.00	0.04
511	300618	寒锐钴	14,400	834,048.00	0.04

		业			
512	000050	深天马 A	83,500	832,495.00	0.04
513	000027	深圳能 源	129,400	829,454.00	0.04
514	000739	普洛药 业	40,100	827,664.00	0.04
515	600863	内蒙华 电	225,200	821,980.00	0.04
516	688521	芯原股 份	16,600	820,040.00	0.04
517	002250	联化科 技	50,000	818,500.00	0.04
518	002212	天融信	80,600	818,090.00	0.04
519	603195	公牛集 团	5,300	810,423.00	0.04
520	600208	新湖中 宝	293,600	810,336.00	0.04
521	601866	中远海 发	269,700	809,100.00	0.04
522	600118	中国卫 星	40,200	807,216.00	0.04
523	688009	中国通 号	176,300	798,639.00	0.04
524	603156	养元饮 品	35,032	795,927.04	0.04
525	000060	中金岭 南	178,300	795,218.00	0.04
526	002152	广电运 通	85,600	793,512.00	0.04
527	002249	大洋电 机	128,500	788,990.00	0.04
528	300009	安科生 物	78,040	788,984.40	0.04
529	601992	金隅集 团	283,620	785,627.40	0.04
530	000778	新兴铸 管	162,700	784,214.00	0.04
531	600066	宇通客 车	90,159	779,875.35	0.04
532	002985	北摩高 科	13,310	779,699.80	0.04
533	300182	捷成股	140,500	772,750.00	0.04



		份			
534	300070	碧水源	148,100	771,601.00	0.04
535	002670	国盛金控	80,300	770,880.00	0.04
536	603658	安图生物	15,650	765,128.50	0.04
537	603858	步长制药	38,800	764,748.00	0.04
538	600998	九州通	64,018	762,454.38	0.04
539	002191	劲嘉股份	71,100	762,192.00	0.04
540	300168	万达信息	80,700	761,808.00	0.04
541	000401	冀东水泥	72,400	761,648.00	0.04
542	002966	苏州银行	124,570	759,877.00	0.04
543	600970	中材国际	78,200	757,758.00	0.04
544	002831	裕同科技	25,600	756,480.00	0.04
545	300251	光线传媒	79,800	755,706.00	0.04
546	600056	中国医药	50,967	755,330.94	0.04
547	600755	厦门国贸	100,500	753,750.00	0.04
548	600390	五矿资本	153,100	748,659.00	0.04
549	000021	深科技	64,036	745,379.04	0.04
550	002128	电投能源	52,000	744,640.00	0.04
551	002244	滨江集团	86,000	743,900.00	0.04
552	600667	太极实业	100,600	742,428.00	0.04
553	002607	中公教育	128,200	742,278.00	0.04
554	000997	新大陆	56,000	739,760.00	0.04
555	603707	健友股份	26,140	737,148.00	0.04
556	002505	鹏都农	217,200	736,308.00	0.04

		牧			
557	300866	安克创新	11,100	736,152.00	0.04
558	600021	上海电力	71,730	735,232.50	0.04
559	603885	吉祥航空	40,800	733,992.00	0.04
560	603087	甘李药业	15,300	733,941.00	0.04
561	600062	华润双鹤	28,600	733,876.00	0.04
562	300482	万孚生物	17,970	731,558.70	0.04
563	002221	东华能源	78,500	730,835.00	0.04
564	000987	越秀金控	103,905	730,452.15	0.04
565	600827	百联股份	55,100	727,871.00	0.04
566	000656	金科股份	254,500	727,870.00	0.04
567	600528	中铁工业	90,400	727,720.00	0.04
568	600839	四川长虹	252,100	726,048.00	0.04
569	002396	星网锐捷	31,900	722,216.00	0.04
570	600297	广汇汽车	275,800	719,838.00	0.04
571	002127	南极电商	133,500	712,890.00	0.04
572	600598	北大荒	48,200	711,432.00	0.04
573	600155	华创阳安	83,800	710,624.00	0.04
574	002019	亿帆医药	50,800	710,184.00	0.04
575	688002	睿创微纳	17,783	706,340.76	0.04
576	600201	生物股份	76,600	701,656.00	0.03
577	002266	浙富控股	146,300	700,777.00	0.03
578	600511	国药股	25,900	693,602.00	0.03

		份			
579	002155	湖南黄金	57,100	693,194.00	0.03
580	000012	南玻 A	93,100	690,802.00	0.03
581	600498	烽火通信	47,700	690,696.00	0.03
582	002153	石基信息	43,452	689,583.24	0.03
583	000930	中粮科技	76,200	688,848.00	0.03
584	600409	三友化工	84,100	688,779.00	0.03
585	600718	东软集团	59,500	684,845.00	0.03
586	000883	湖北能源	133,900	684,229.00	0.03
587	600566	济川药业	24,907	676,474.12	0.03
588	002124	天邦食品	100,420	674,822.40	0.03
589	603712	七一二	21,400	674,100.00	0.03
590	600282	南钢股份	212,900	670,635.00	0.03
591	000581	威孚高科	34,700	667,975.00	0.03
592	002511	中顺洁柔	53,300	667,316.00	0.03
593	000686	东北证券	95,400	666,846.00	0.03
594	600959	江苏有线	203,700	664,062.00	0.03
595	600060	海信视像	53,100	663,750.00	0.03
596	600895	张江高科	53,123	661,381.35	0.03
597	600782	新钢股份	130,100	655,704.00	0.03
598	601179	中国西电	139,800	654,264.00	0.03
599	000709	河钢股份	289,400	654,044.00	0.03
600	601880	辽港股	384,400	653,480.00	0.03

		份			
601	600064	南京高科	59,200	651,200.00	0.03
602	600022	山东钢铁	373,500	649,890.00	0.03
603	000690	宝新能源	148,200	649,116.00	0.03
604	600535	天士力	61,600	647,416.00	0.03
605	002939	长城证券	63,600	646,176.00	0.03
606	002002	鸿达兴业	172,700	640,717.00	0.03
607	300376	易事特	78,700	639,044.00	0.03
608	601778	晶科科技	118,100	637,740.00	0.03
609	002701	奥瑞金	122,400	636,480.00	0.03
610	600037	歌华有线	67,700	635,703.00	0.03
611	600808	马钢股份	166,800	632,172.00	0.03
612	002595	豪迈科技	28,000	625,520.00	0.03
613	600216	浙江医药	45,800	625,170.00	0.03
614	600500	中化国际	93,944	624,727.60	0.03
615	600663	陆家嘴	60,200	623,672.00	0.03
616	000598	兴蓉环境	121,800	622,398.00	0.03
617	600567	山鹰国际	223,800	619,926.00	0.03
618	002032	苏泊尔	11,000	619,740.00	0.03
619	002532	天山铝业	94,800	619,044.00	0.03
620	600728	佳都科技	95,700	618,222.00	0.03
621	002468	申通快递	51,800	617,456.00	0.03
622	600517	国网英大	118,800	616,572.00	0.03
623	002004	华邦健康	110,100	614,358.00	0.03

624	300630	普利制药	17,452	613,437.80	0.03
625	603225	新凤鸣	52,600	607,004.00	0.03
626	000800	一汽解放	64,900	606,166.00	0.03
627	688208	道通科技	18,300	602,436.00	0.03
628	300463	迈克生物	29,400	602,406.00	0.03
629	603866	桃李面包	36,340	601,427.00	0.03
630	601236	红塔证券	65,760	600,388.80	0.03
631	601456	国联证券	48,600	596,322.00	0.03
632	002745	木林森	60,900	594,993.00	0.03
633	002429	兆驰股份	153,800	590,592.00	0.03
634	600597	光明乳业	46,700	589,821.00	0.03
635	000785	居然之家	132,300	588,735.00	0.03
636	300115	长盈精密	57,040	588,082.40	0.03
637	601958	金钼股份	66,100	584,324.00	0.03
638	603927	中科软	25,000	583,000.00	0.03
639	300166	东方国信	62,800	579,016.00	0.03
640	688006	杭可科技	8,200	574,492.00	0.03
641	601106	中国一重	186,794	573,457.58	0.03
642	601808	中海油服	41,100	573,345.00	0.03
643	300888	稳健医疗	8,600	571,900.00	0.03
644	002390	信邦制药	82,600	570,766.00	0.03
645	601860	紫金银行	198,700	570,269.00	0.03
646	600572	康恩贝	128,500	569,255.00	0.03
647	300072	三聚环	112,000	566,720.00	0.03

		保			
648	601118	海南橡胶	118,500	566,430.00	0.03
649	600398	海澜之家	117,300	557,175.00	0.03
650	000540	中天金融	287,500	554,875.00	0.03
651	600507	方大特钢	79,262	554,041.38	0.03
652	601718	际华集团	178,600	553,660.00	0.03
653	000089	深圳机场	71,600	552,752.00	0.03
654	600737	中粮糖业	72,900	548,208.00	0.03
655	002048	宁波华翔	34,100	546,282.00	0.03
656	600967	内蒙一机	59,100	538,992.00	0.03
657	600582	天地科技	112,700	538,706.00	0.03
658	000937	冀中能源	72,200	538,612.00	0.03
659	002010	传化智联	83,500	536,905.00	0.03
660	002690	美亚光电	24,662	534,672.16	0.03
661	002368	太极股份	27,799	534,018.79	0.03
662	000559	万向钱潮	89,700	532,818.00	0.03
663	600435	北方导航	61,100	526,682.00	0.03
664	603883	老百姓	15,496	525,004.48	0.03
665	000898	鞍钢股份	162,900	524,538.00	0.03
666	001914	招商积余	29,100	522,927.00	0.03
667	600871	石化油服	276,200	522,018.00	0.03
668	601000	唐山港	201,400	519,612.00	0.03
669	600764	中国海防	20,500	517,420.00	0.03

670	600556	天下秀	62,800	516,844.00	0.03
671	000959	首钢股份	108,200	515,032.00	0.03
672	605499	东鹏饮料	3,000	512,580.00	0.03
673	601568	北元集团	80,840	512,525.60	0.03
674	600195	中牧股份	41,452	508,201.52	0.03
675	000877	天山股份	41,300	507,990.00	0.03
676	002110	三钢闽光	83,300	507,297.00	0.03
677	002281	光迅科技	28,800	506,304.00	0.03
678	601333	广深铁路	230,800	503,144.00	0.03
679	000156	华数传媒	63,100	502,907.00	0.03
680	002705	新宝股份	22,800	501,372.00	0.02
681	002233	塔牌集团	56,600	500,910.00	0.02
682	600811	东方集团	174,500	493,835.00	0.02
683	000537	广宇发展	38,000	493,620.00	0.02
684	003035	南网能源	77,100	489,585.00	0.02
685	600329	达仁堂	19,900	489,142.00	0.02
686	002174	游族网络	49,600	484,592.00	0.02
687	000402	金融街	81,300	483,735.00	0.02
688	600120	浙江东方	119,956	481,023.56	0.02
689	000488	晨鸣纸业	85,000	479,400.00	0.02
690	300212	易华录	27,420	477,108.00	0.02
691	603638	艾迪精密	23,240	476,420.00	0.02
692	002925	盈趣科技	22,090	475,376.80	0.02

693	600167	联美控 股	63,400	474,866.00	0.02
694	600446	金证股 份	45,700	474,366.00	0.02
695	600126	杭钢股 份	91,600	468,992.00	0.02
696	002416	爱施德	50,300	467,790.00	0.02
697	002081	金螳 螂	91,900	466,852.00	0.02
698	000158	常山北 明	77,800	466,800.00	0.02
699	002867	周大生	30,000	465,900.00	0.02
700	600373	中文传 媒	46,600	465,534.00	0.02
701	000685	中山公 用	60,600	465,408.00	0.02
702	000990	诚志股 份	42,500	465,375.00	0.02
703	601200	上海环 境	45,700	464,312.00	0.02
704	300979	华利集 团	6,300	460,404.00	0.02
705	001965	招商公 路	60,300	460,089.00	0.02
706	601098	中南传 媒	48,700	459,728.00	0.02
707	601608	中信重 工	120,800	457,832.00	0.02
708	600095	湘财股 份	59,500	457,555.00	0.02
709	002382	蓝帆医 疗	47,800	456,490.00	0.02
710	600707	彩虹股 份	97,000	453,960.00	0.02
711	688029	南微医 学	5,200	453,440.00	0.02
712	002146	荣盛发 展	149,500	452,985.00	0.02
713	002399	海普瑞	25,700	451,806.00	0.02
714	601611	中国核 建	53,700	450,543.00	0.02
715	002387	维信诺	66,100	444,192.00	0.02
716	000528	柳	67,700	440,727.00	0.02



		工			
717	600376	首开股份	89,600	439,936.00	0.02
718	600131	国网信通	32,700	439,815.00	0.02
719	000967	盈峰环境	86,300	436,678.00	0.02
720	002948	青岛银行	119,800	433,676.00	0.02
721	601825	沪农商行	68,800	431,376.00	0.02
722	002423	中粮资本	63,900	428,769.00	0.02
723	601187	厦门银行	71,700	427,332.00	0.02
724	600623	华谊集团	51,101	424,138.30	0.02
725	000563	陕国投 A	135,200	421,824.00	0.02
726	603000	人民网	37,600	421,120.00	0.02
727	600307	酒钢宏兴	217,000	420,980.00	0.02
728	300257	开山股份	28,100	420,376.00	0.02
729	601598	中国外运	107,500	417,100.00	0.02
730	600901	江苏租赁	81,200	416,556.00	0.02
731	601991	大唐发电	168,600	409,698.00	0.02
732	600006	东风汽车	54,100	408,455.00	0.02
733	603228	景旺电子	17,380	405,475.40	0.02
734	000961	中南建设	129,900	396,195.00	0.02
735	600906	财达证券	44,000	395,560.00	0.02
736	600717	天津港	98,500	394,985.00	0.02
737	603650	彤程新材	11,900	387,702.00	0.02
738	002434	万里扬	45,300	387,315.00	0.02
739	000718	苏宁环	105,100	386,768.00	0.02

		球			
740	000671	阳光城	171,000	374,490.00	0.02
741	601928	凤凰传媒	51,700	369,655.00	0.02
742	000415	渤海租赁	168,000	364,560.00	0.02
743	000553	安道麦 A	29,800	360,878.00	0.02
744	600968	海油发展	138,700	357,846.00	0.02
745	601969	海南矿业	41,500	356,485.00	0.02
746	600648	外高桥	25,700	349,520.00	0.02
747	600787	中储股份	61,000	347,090.00	0.02
748	600339	中油工程	116,900	337,841.00	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.02
2	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
3	688270	臻镭科技	3,705	221,818.35	0.01
4	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
5	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
6	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
7	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
8	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
9	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
10	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
11	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
12	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
13	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
14	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
15	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
16	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
17	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
18	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00

19	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
20	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
21	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
22	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
23	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
24	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	000792	盐湖股份	9,833,013.37	0.46
2	300750	宁德时代	7,592,617.00	0.36
3	600089	特变电工	6,607,871.00	0.31
4	000858	五粮液	3,428,582.00	0.16
5	300059	东方财富	3,237,157.20	0.15
6	002074	国轩高科	3,214,006.31	0.15
7	300661	圣邦股份	3,085,784.00	0.15
8	002594	比亚迪	3,081,833.00	0.15
9	002920	德赛西威	3,066,562.00	0.14
10	300496	中科创达	2,971,520.00	0.14
11	000333	美的集团	2,942,546.00	0.14
12	000725	京东方 A	2,877,634.00	0.14
13	600460	士兰微	2,695,671.00	0.13
14	300769	德方纳米	2,646,936.00	0.13
15	300012	华测检测	2,641,281.00	0.12
16	300207	欣旺达	2,598,501.00	0.12
17	600096	云天化	2,586,014.00	0.12
18	002497	雅化集团	2,567,296.00	0.12
19	002240	盛新锂能	2,487,739.00	0.12
20	002648	卫星化学	2,347,486.83	0.11

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	300750	宁德时代	5,200,503.00	0.25

2	600519	贵州茅台	3,522,550.00	0.17
3	000733	振华科技	3,451,355.00	0.16
4	000858	五粮液	3,386,853.89	0.16
5	002594	比亚迪	2,996,174.00	0.14
6	002340	格林美	2,866,237.00	0.14
7	000333	美的集团	2,672,391.00	0.13
8	300059	东方财富	2,355,469.60	0.11
9	000723	美锦能源	2,288,296.00	0.11
10	688223	晶科能源	2,224,678.50	0.11
11	600884	杉杉股份	1,924,027.11	0.09
12	605358	立昂微	1,787,979.80	0.08
13	600036	招商银行	1,764,647.00	0.08
14	688303	大全能源	1,755,595.68	0.08
15	601689	拓普集团	1,754,198.00	0.08
16	002013	中航机电	1,713,942.00	0.08
17	600754	锦江酒店	1,695,598.00	0.08
18	601318	中国平安	1,683,729.00	0.08
19	300760	迈瑞医疗	1,620,511.00	0.08
20	002179	中航光电	1,616,640.00	0.08

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	258,558,269.64
卖出股票收入（成交）总额	206,055,123.38

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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）	244,621.83	0.01
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-

10	其他	-	-
11	合计	244,621.83	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	113060	浙 22 转债	2,130	213,015.87	0.01
2	127064	杭氧转债	316	31,605.96	0.00

## 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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，浙商证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、兴业银行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。本基金对上述主体发行的相关证券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

本基金投资的前十名股票没有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	11,301,654.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	185,342.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	27,061.72
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,514,058.15

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	5,446,800.00	0.27	转融通出借流通受限
2	002594	比亚迪	3,334,900.00	0.17	转融通出借流通受限
3	601012	隆基绿能	3,324,837.00	0.17	转融通出借流通受限

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688238	和元生物	325,007.52	0.02	新股流通受限
2	301175	中科环保	243,311.08	0.01	新股流通受限
3	688270	臻镭科技	221,818.35	0.01	新股流通受限
4	301139	元道通信	217,337.46	0.01	新股流通受限

5	301200	大族数控	44,495.44	0.00	新股流通受限
---	--------	------	-----------	------	--------

## § 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		平安银行股份有限公司—汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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 (%)
3,508	471,333.29	1,493,401,336.00	90.32	160,035,862.00	9.68	43,362,000.00	2.62

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 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	中央汇金资产管理有限责任公司	1,307,627,911.00	79.09
2	张虹	75,136,019.00	4.54
3	光大理财有限责任公司—阳光橙增盈绝对收益策略	65,234,500.00	3.95
4	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	11,766,900.00	0.71
5	广发证券股份有限公司	11,356,360.00	0.69
6	华泰证券股份有限公司	7,003,310.00	0.42

7	中信建投证券股份有限公司	6,654,332.00	0.40
8	中国国际金融股份有限公司	5,934,600.00	0.36
9	东方证券股份有限公司	5,515,403.00	0.33
10	中信证券股份有限公司	4,730,652.00	0.29
11	平安银行股份有限公司—汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	43,362,000.00	2.62

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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（2019年10月08日）基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	1,589,437,198.00
本报告期基金总申购份额	200,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	136,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,653,437,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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

### 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 (%)	
中泰证券	1	160,189,530.70	35.70	50,907.98	21.80	
兴业证券	2	132,269,153.22	29.47	95,413.95	40.87	
海通证券	2	126,450,766.32	28.18	65,772.96	28.17	
东方证	2	29,862,796.17	6.65	21,385.29	9.16	

券						
广发证 券	2	-	-	-	-	
华泰证 券	2	-	-	-	-	
中信证 券	1	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

### 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 (%)
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	3,843,994.80	82.90	-	-	-	-	-	-
海通 证券	235,631.17	5.08	-	-	-	-	-	-
东方 证券	557,307.80	12.02	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配

量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 01 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证	2022 年 04 月 22 日

		监会基金电子披露网站	
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下的上海证券交易所 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 20 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 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 (%)
机构	1	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	79.09
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致基金规模较小,基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元,进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 08 月 31 日