

# 中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 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 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
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 .....	16
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 .....	17
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 .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
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 .....	18
§ 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 .....	21
6.4 报表附注 .....	22
§ 7 投资组合报告 .....	102
7.1 期末基金资产组合情况 .....	102
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	102
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 .....	103
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	140
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	141
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 .....	141
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 .....	142
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 .....	142
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 .....	142

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	142
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	142
7.12 投资组合报告附注.....	142
§ 8 基金份额持有人信息.....	143
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	143
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	144
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	144
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.....	144
§ 9 开放式基金份额变动.....	145
§ 10 重大事件揭示.....	145
10.1 基金份额持有人大会决议.....	145
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.....	145
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	145
10.4 基金投资策略的改变.....	145
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	145
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.....	145
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	146
10.8 其他重大事件.....	148
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	148
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.....	148
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	149
§ 12 备查文件目录.....	149
12.1 备查文件目录.....	149
12.2 存放地点.....	149
12.3 查阅方式.....	149

## § 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）	1,797,437,198.00
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	姓名	李鹏	李帅帅
负责人	联系电话	021-28932888	0755-25878287

电子邮箱	service@99fund.com	LISHUAI130@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	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
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(2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	-4,538,951.68
本期利润	26,048,497.42
加权平均基金份额本期利润	0.0145
本期加权平均净值利润率	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	159,764,260.19
期末可供分配基金份额利润	0.0889
期末基金资产净值	1,957,201,458.19
期末基金份额净值	1.0889
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	8.89%

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。

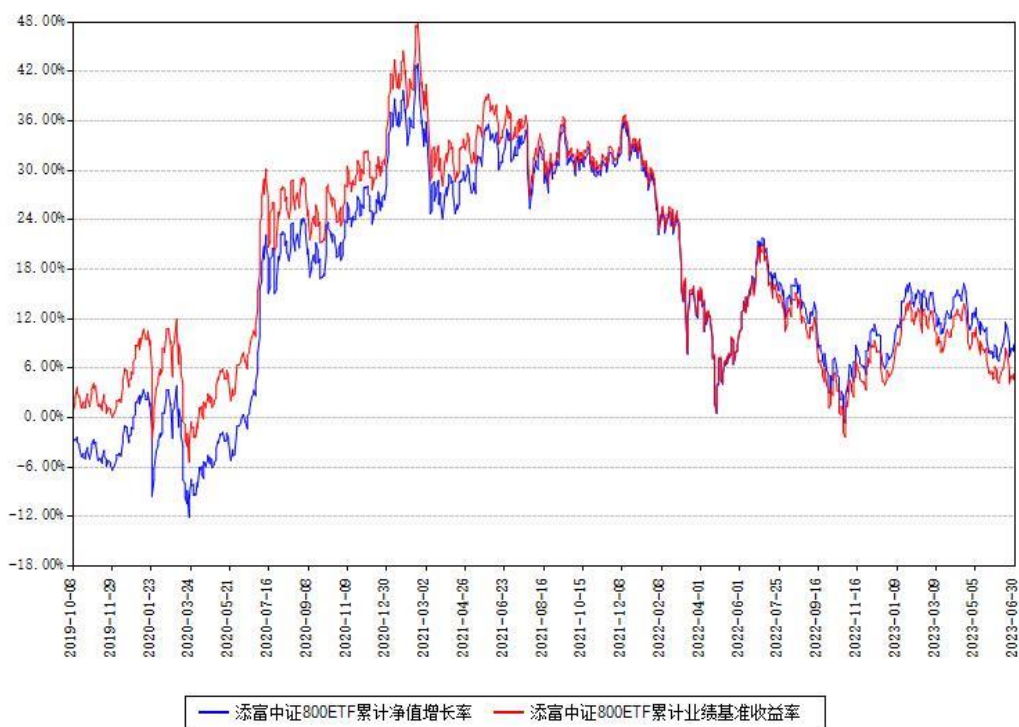
## 3.2 基金净值表现

### 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	1.57%	0.86%	0.63%	0.86%	0.94%	0.00%
过去三个月	-4.00%	0.80%	-5.21%	0.80%	1.21%	0.00%
过去六个月	1.40%	0.80%	0.02%	0.80%	1.38%	0.00%
过去一年	-10.24%	0.94%	-12.59%	0.95%	2.35%	-0.01%
过去三年	4.48%	1.15%	-5.48%	1.16%	9.96%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	8.89%	1.19%	5.33%	1.19%	3.56%	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

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。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。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。



成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 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		9	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 2022 年 11 月 21 日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 日至今任汇添富中证沪港深

				<p>互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日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 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能</p>
--	--	--	--	---

				<p>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> <p>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。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 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,	2019 年 10 月 08 日		12	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金

	<p>指数与量化投资部 副总监</p>			<p>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副总监。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月3日至2023年4月13日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2023年4月6日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2023年5月22日任深证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</p>
--	-------------------------	--	--	---

				<p>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 2022 年 12 月 1 日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 2023 年 5 月 22 日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 2023 年 5 月 18 日任汇添富中证 800 交易型开放式指</p>
--	--	--	--	---

					<p>数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日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。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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 25 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

2023 年上半年，资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情，二季度市场整体显著回调。

上半年美联储累计加息三次，将联邦基金目标利率提升至 5.00%-5.25% 区间。3 月议息会议声明文件对未来继续加息的表述有所弱化，5 月暗示后续加息暂缓但年内仍较难降息。市场普遍预期本轮加息周期接近尾声，但转向降息周期仍然需要一定时间。

全球来看，海外通胀回落速度较为缓慢，美元指数二季度阶段性走强，人民币兑美元贬值压力加大。北向资金二季度小幅净流入，较一季度显著放缓。

国内来看，3 月两会召开，仍然坚持以稳经济增长为中心，加强协同，共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49，较前值小幅企稳，但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%，利润累计同比下滑 18.8%，相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段，内需修复动力不足、外需增长压力较大。经济发展模式转型阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下，政策层面有望持续发力。6 月 MLF 下调 10 个基点，随后一年期、五年期 LPR 均下调 10 个基点，有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

资本市场方面，新一轮科技创新话题引发热议，信息技术领域表现强势，智能化相关子板块体现出较强的爆发力，并有向产业各领域扩散的态势。市场认知科技创新市场前景广阔。二季度市场有所回调，行业主题结构性分化显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调，6 月开始重新受到市场关注。银行、证券等金融类资产则是 4 月表现强势之后进入回调。当前科技创新和中特估仍是市场重点关注的资本市场投资主线，对不同偏好的资金有差异化的吸引力。

中证 800 指数是 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 及其联接基金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。

### 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 1.40%。同期业绩比较基准收益率为 0.02%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济呈现弱复苏状态，复苏强度低于年初预期。分项来看，工业制造和投资相对



具有韧性，消费和出口较为疲弱。但居民消费倾向有抬升迹象，结合收入提升预期，下半年内需动能有望出现改善。国内政策基调仍以稳增长为主，尽管难有强刺激，但或许可以期待整体托底和结构性的支持政策。

全球来看，美国通胀超预期回落，加息周期步入尾声成为市场共识，不排除下半年仍有加息的可能性。通胀数据及通胀预期仍然是加息节奏的关键指标。

资本市场上半年整体表现为震荡修复。业绩角度来看，A 股整体盈利增速尚未明显改善，结构分化仍然较为显著，且与股价表现存在一定的错位。信息技术领域在全球智能化浪潮的背景下获得资金关注，长期市场空间充分，但短期能体现出实际业绩增长的比例有限。与此同时低估值高分红类的资产也获得了较多资金流入。创新成长和具备安全边界的低估值资产，形成了两种较为极端的投资偏好，预计仍然会是下半年市场的关注焦点。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，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。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 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的真实、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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	48,271,140.80	48,997,016.89
结算备付金		12,051,935.91	12,872,963.06
存出保证金		6,740,011.53	6,905,655.01
交易性金融资产	6.4.7.2	1,892,659,970.63	1,806,097,361.02
其中：股票投资		1,892,659,970.63	1,806,097,361.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		78,395.31	15,120,161.65
应收股利		41,798.55	10,409.12
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	23,210.05	33,615.61
资产总计		1,959,866,462.78	1,890,037,182.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022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		1,871,315.76	14,783,502.54
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		241,306.33	240,190.34
应付托管费		80,435.46	80,063.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,675.45	4,092.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	468,271.59	435,095.42
负债合计		2,665,004.59	15,542,944.53
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	1,797,437,198.00	1,745,437,198.00
未分配利润	6.4.7.9	159,764,260.19	129,057,039.83
净资产合计		1,957,201,458.19	1,874,494,237.83
负债和净资产总计		1,959,866,462.78	1,890,037,182.36

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0889 元，基金份额总额 1,797,437,198.00 份。

## 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>28,449,232.48</b>	<b>-181,483,943.72</b>
1. 利息收入		1,155,386.42	1,243,533.90
其中：存款利息收入	6.4.7.10	192,986.93	306,582.20
债券利息收入		-	-
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		962,399.49	936,951.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,238,309.27	-13,601,782.67
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-23,868,491.49	-18,887,933.94
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	108,565.09	618,879.24
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	-2,076,780.30	-13,765,358.61
股利收益	6.4.7.17	22,598,397.43	18,432,630.64
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	30,587,449.10	-168,996,194.19
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	-55,293.77	-129,500.76
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,400,735.06</b>	<b>2,248,145.06</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,495,933.84	1,396,064.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	498,644.63	465,354.80
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		12,590.63	3,374.73
8. 其他费用	6.4.7.21	393,565.96	383,351.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>26,048,497.42</b>	<b>-183,732,088.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>26,048,497.42</b>	<b>-183,732,088.78</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>26,048,497.42</b>	<b>-183,732,088.78</b>

### 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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)	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	52,000,000.00	30,707,220.36	82,707,220.36
（一）、综合收益总额	-	26,048,497.42	26,048,497.42
（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）	52,000,000.00	4,658,722.94	56,658,722.94
其中：1. 基金申购款	216,000,000.00	24,050,600.93	240,050,600.93
2. 基金赎回款	-164,000,000.00	-19,391,877.99	-183,391,877.99
（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)	1,797,437,198.00	159,764,260.19	1,957,201,458.19
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>张暉</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
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 号文《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。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2019）验字第

60466941\_A04 号验资报告予以验证。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）。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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。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。本基金的业绩比较基准为：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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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法》、《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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	48,271,140.80
等于：本金	48,266,373.92
加：应计利息	4,766.88
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	48,271,140.80

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,068,191,753.68	-	1,892,659,970.63	-175,531,783.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	2,068,191,753.68	-	1,892,659,970.63	-175,531,783.05

### 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 2023 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	54,895,380.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	54,895,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	54,895,380.00	-	-	-

#### 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
IF2307	IF2307	48	55,157,760.00	262,380.00
合计				262,380.00

减：可抵销期货暂收款	262,380.00
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 2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	23,210.05
待摊费用	-
合计	23,210.05

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	136,536.73
其中：交易所市场	136,536.73
银行间市场	-
应付利息	-

应付审计费	124,712.18
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	147,515.31
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	468,271.59

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,745,437,198.00	1,745,437,198.00
本期申购	216,000,000.00	216,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-164,000,000.00	-164,000,000.00
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	1,797,437,198.00	1,797,437,198.00

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	594,577,074.49	-465,520,034.66	129,057,039.83
本期利润	-4,538,951.68	30,587,449.10	26,048,497.42
本期基金份额交易产生的变动数	17,508,769.08	-12,850,046.14	4,658,722.94
其中：基金申购款	73,246,500.16	-49,195,899.23	24,050,600.93
基金赎回款	-55,737,731.08	36,345,853.09	-19,391,877.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	607,546,891.89	-447,782,631.70	159,764,260.19

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	84,596.55
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	107,196.21
其他	1,194.17
合计	192,986.93

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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,700,115.94
股票投资收益——赎回差价收入	-4,168,375.55
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	-23,868,491.49

## 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	187,233,388.18
减：卖出股票成本总额	206,521,159.91
减：交易费用	412,344.21
买卖股票差价收入	-19,700,115.94

## 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	183,391,877.99
减：现金支付赎回款总额	79,693,281.99
减：赎回股票成本总额	107,866,971.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,168,375.55

## 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	136.61
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	108,428.48
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	108,565.09

##### 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	673,196.14
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成本总额	564,600.00
减：应计利息总额	140.72
减：交易费用	26.94
买卖债券差价收入	108,428.48

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	-2,076,780.30
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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	22,598,397.43
其中：证券出借权益补偿收入	509,116.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,598,397.43

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	29,292,169.10
——股票投资	29,292,169.10
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,295,280.00
——权证投资	-
——期货投资	1,295,280.00
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	30,587,449.10

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-55,293.77
其他	-
合计	-55,293.77



#### 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	34,712.18
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	299,186.78
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	159.63
合计	393,565.96

#### 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
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	29,852,376.34	7.12	29,862,796.17	6.65

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	524,980.78	77.98	557,307.80	12.02

##### 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 基金交易

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基金交易。

##### 6.4.10.1.5 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。

##### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	21,533.97	11.44	9,131.81	6.69

关联方名称	上年度可比期间 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

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,495,933.84	1,396,064.30
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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	498,644.63	465,354.80

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
	-	-	-	-
上年度可比期间 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	-	-

##### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
东方证券	2023041700002281	辽港股份	2023年04月17日	6,762.00	4,200.00	14	2.40	7.66	-	-

东方 证券	202304240000 1496	珀 莱 雅	202 3 年 04 月 24 日	300,181 .00	1,900.0 0	14	2.2 0	256. 82	-	-
东方 证券	202305080000 2220	蓝 色 光 标	202 3 年 05 月 08 日	43,392. 00	3,200.0 0	14	3.4 0	57.3 7	-	-
东方 证券	202305080000 2296	小 商 品 城	202 3 年 05 月 08 日	41,916. 00	4,200.0 0	14	2.1 0	34.2 3	-	-
东方 证券	202305080002 1917	珀 莱 雅	202 3 年 05 月 08 日	306,926 .00	1,900.0 0	14	2.2 0	262. 59	-	-
东方 证券	202305220006 2020	蓝 色 光 标	202 3 年 05 月 22 日	33,760. 00	3,200.0 0	14	3.4 0	44.6 4	-	-
东方 证券	202306120003 3277	中 国 稀 土	202 3 年 06 月 12 日	59,980. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	53.6 5	-	-
东 方	202306120003 3278	中 航	202 3	22,700. 00	1,000.0 0	14	2.3 0	20.3 0	-	-

证 券		高 科	年 06 月 12 日							
东 方 证 券	202306120003 3281	天 华 新 能	202 3 年 06 月 12 日	74,260. 00	2,000.0 0	14	3.2 0	92.4 1	-	-
东 方 证 券	202306120003 3287	东 软 集 团	202 3 年 06 月 12 日	22,160. 00	2,000.0 0	14	2.0 0	17.2 4	-	-
东 方 证 券	202306120003 3288	华 数 传 媒	202 3 年 06 月 12 日	19,520. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	17.4 6	-	-
东 方 证 券	202306120003 3294	恒 逸 石 化	202 3 年 06 月 12 日	13,380. 00	2,000.0 0	14	2.0 0	10.4 1	-	-
东 方 证 券	202306120003 3300	光 环 新 网	202 3 年 06 月 12 日	24,520. 00	2,000.0 0	14	2.6 0	24.7 9	-	-
东 方 证 券	202306120003 3302	固 德 威	202 3 年 06 月	154,440 .00	1,000.0 0	14	3.5 0	210. 21	-	-

			月 12 日							
东方 证券	202306120003 3305	云 铝 股 份	202 3 年 06 月 12 日	26,100. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	16.2 4	-	-
东方 证券	202306120003 3338	南 网 能 源	202 3 年 06 月 12 日	12,540. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	11.2 2	-	-
东方 证券	202306120003 3344	光 线 传 媒	202 3 年 06 月 12 日	18,320. 00	2,000.0 0	14	2.6 0	18.5 2	-	-
东方 证券	202306120003 3346	完 美 世 界	202 3 年 06 月 12 日	36,700. 00	2,000.0 0	14	2.1 0	29.9 7	-	-
东方 证券	202306120003 3347	锡 业 股 份	202 3 年 06 月 12 日	30,060. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	26.8 9	-	-
东方 证券	202306120003 3348	天 顺 风 能	202 3 年 06 月 12 日	30,440. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	27.2 3	-	-

			日							
东方 证券	202306120003 3356	长安 汽车	202 3 年 06 月 12 日	24,300. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	21.7 4	-	-
东方 证券	202306120003 3357	华工 科技	202 3 年 06 月 12 日	72,000. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	64.4 0	-	-
东方 证券	202306120003 3360	鹏都 农牧	202 3 年 06 月 12 日	3,740.0 0	2,000.0 0	14	2.2 0	3.20	-	-
东方 证券	202306120003 3361	盈趣 科技	202 3 年 06 月 12 日	38,000. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	33.9 9	-	-
东方 证券	202306120003 3363	申通 快递	202 3 年 06 月 12 日	11,620. 00	1,000.0 0	14	1.1 0	4.97	-	-
东方 证券	202306120003 3379	中航 产融	202 3 年 06 月 12 日	7,700.0 0	2,000.0 0	14	2.0 0	5.99	-	-
东	202306120003	卫	202	10,080.	1,000.0	14	2.6	10.1	-	-



方 证 券	3382	宁 健 康	3 年 06 月 12 日	00	0		0	9		
东 方 证 券	202306120003 3383	长 盈 精 密	202 3 年 06 月 12 日	22,440. 00	2,000.0 0	14	2.7 0	23.5 6	-	-
东 方 证 券	202306120003 3389	新 兴 铸 管	202 3 年 06 月 12 日	4,160.0 0	1,000.0 0	14	1.5 0	2.43	-	-
东 方 证 券	202306120003 3397	东 山 精 密	202 3 年 06 月 12 日	51,200. 00	2,000.0 0	14	2.0 0	39.8 2	-	-
东 方 证 券	202306120003 3402	云 天 化	202 3 年 06 月 12 日	34,220. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	30.6 1	-	-
东 方 证 券	202306120003 3403	中 国 卫 星	202 3 年 06 月 12 日	54,120. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	48.4 1	-	-
东 方 证 券	202306120003 3405	湖 南 黄	202 3 年	27,640. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	15.0 5	-	-

券		金	06 月 12 日							
东方 证 券	202306120003 3412	易 华 录	202 3 年 06 月 12 日	37,000. 00	1,000.0 0	14	3.5 0	50.3 6	-	-
东方 证 券	202306120003 3422	雅 克 科 技	202 3 年 06 月 12 日	138,300 .00	2,000.0 0	14	2.3 0	123. 70	-	-
东方 证 券	202306120003 3462	许 继 电 气	202 3 年 06 月 12 日	44,660. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	39.9 5	-	-
东方 证 券	202306120003 3463	景 嘉 微	202 3 年 06 月 12 日	92,770. 00	1,000.0 0	14	3.5 0	126. 27	-	-
东方 证 券	202306120003 3467	捷 成 股 份	202 3 年 06 月 12 日	12,920. 00	2,000.0 0	14	2.6 0	13.0 6	-	-
东方 证 券	202306120003 3482	凤 凰 传 媒	202 3 年 06 月	26,680. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	23.8 6	-	-

			12 日							
东方 证券	202306120003 3512	中国 外运	202 3 年 06 月 12 日	9,700.0 0	2,000.0 0	14	1.5 0	5.66	-	-
东方 证券	202306120003 3571	中兵 红箭	202 3 年 06 月 12 日	35,120. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	31.4 1	-	-
东方 证券	202306120003 3586	上海 贝岭	202 3 年 06 月 12 日	34,700. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	25.6 4	-	-
东方 证券	202306120003 3600	碧水 源	202 3 年 06 月 12 日	11,140. 00	2,000.0 0	14	2.6 0	11.2 6	-	-
东方 证券	202306120003 3616	复旦 微电	202 3 年 06 月 12 日	53,340. 00	1,000.0 0	14	3.2 0	66.3 8	-	-
东方 证券	202306120003 3657	西安 银行	202 3 年 06 月 12 日	7,600.0 0	2,000.0 0	14	2.3 0	6.80	-	-

东方 证券	202306120003 3721	江苏 银行	202 3 年 06 月 12 日	15,040. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	9.36	-	-
东方 证券	202306120003 3742	江苏 金租	202 3 年 06 月 12 日	12,700. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	11.3 6	-	-
东方 证券	202306120003 3743	辽港 股份	202 3 年 06 月 12 日	159,580 .00	101,000 .00	14	2.4 0	148. 94	-	-
东方 证券	202306120003 3744	宇通 客车	202 3 年 06 月 12 日	26,620. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	16.5 6	-	-
东方 证券	202306120003 3760	小商 品城	202 3 年 06 月 12 日	19,180. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	17.1 6	-	-
东方 证券	202306120003 3785	兴发 集团	202 3 年 06 月 12 日	22,340. 00	1,000.0 0	14	2.3 0	19.9 8	-	-
东 方	202306120003 3794	太 极	202 3	13,860. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	12.4 0	-	-

证 券		实 业	年 06 月 12 日							
东 方 证 券	202306120003 3813	中 油 工 程	202 3 年 06 月 12 日	7,920.0 0	2,000.0 0	14	2.3 0	7.08	-	-
东 方 证 券	202306120003 3820	中 南 传 媒	202 3 年 06 月 12 日	27,580. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	24.6 7	-	-
东 方 证 券	202306120003 3832	中 信 重 工	202 3 年 06 月 12 日	3,970.0 0	1,000.0 0	14	1.0 0	1.54	-	-
东 方 证 券	202306120003 3844	天 下 秀	202 3 年 06 月 12 日	16,160. 00	2,000.0 0	14	2.3 0	14.4 5	-	-
东 方 证 券	202306120003 3854	江 苏 有 线	202 3 年 06 月 12 日	3,690.0 0	1,000.0 0	14	2.0 0	2.87	-	-
东 方 证 券	202306260003 1287	小 商 品 城	202 3 年 06 月	16,920. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	12.5 0	17,060. 00	3.57

			月 26 日							
东方 证券	202306260003 1307	中信 重工	202 3 年 06 月 26 日	3,990.0 0	1,000.0 0	14	1.0 0	1.55	4,210.0 0	0.44
东方 证券	202306260003 1540	捷成 股份	202 3 年 06 月 26 日	12,420. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	10.6 3	12,620. 00	3.04
东方 证券	202306260003 1553	中国 外运	202 3 年 06 月 26 日	8,800.0 0	2,000.0 0	14	1.4 0	4.79	9,320.0 0	1.37
东方 证券	202306260003 1688	西安 银行	202 3 年 06 月 26 日	6,840.0 0	2,000.0 0	14	1.5 0	3.99	7,040.0 0	1.14
东方 证券	202306260003 1744	中油 工程	202 3 年 06 月 26 日	7,420.0 0	2,000.0 0	14	1.2 0	3.46	8,140.0 0	0.99
东方 证券	202306260003 1752	雅克 科技	202 3 年 06 月 26 日	138,220 .00	2,000.0 0	14	1.7 0	91.3 8	145,760 .00	26.1 1

			日							
东方 证券	202306260003 1863	景 嘉 微	202 3 年 06 月 26 日	89,000. 00	1,000.0 0	14	3.5 0	121. 14	89,990. 00	34.6 1
东方 证券	202306260003 2241	宇 通 客 车	202 3 年 06 月 26 日	26,520. 00	2,000.0 0	14	1.3 0	13.4 1	29,480. 00	3.83
东方 证券	202306260003 2286	天 下 秀	202 3 年 06 月 26 日	15,260. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	8.31	14,180. 00	2.37
东方 证券	202306260003 2377	太 极 实 业	202 3 年 06 月 26 日	14,400. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	7.84	14,520. 00	2.24
东方 证券	202306260003 2822	许 继 电 气	202 3 年 06 月 26 日	42,760. 00	2,000.0 0	14	1.3 0	21.6 2	46,100. 00	6.18
东方 证券	202306260003 3226	江 苏 银 行	202 3 年 06 月 26 日	14,420. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	10.6 5	14,700. 00	3.04
东	202306260003	辽	202	156,550	101,000	14	2.4	146.	157,560	41.7

方 证 券	3330	港 股 份	3 年 06 月 26 日	.00	.00		0	11	.00	5
东 方 证 券	202306260003 4054	江 苏 金 租	202 3 年 06 月 26 日	11,980. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	8.85	8,260.0 0	2.53
东 方 证 券	202306260003 4109	凤 凰 传 媒	202 3 年 06 月 26 日	22,460. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	16.6 0	22,800. 00	4.74
东 方 证 券	202306260003 4133	上 海 贝 岭	202 3 年 06 月 26 日	35,840. 00	2,000.0 0	14	1.2 0	16.7 3	36,500. 00	4.78
东 方 证 券	202306260003 4353	复 旦 微 电	202 3 年 06 月 26 日	53,060. 00	1,000.0 0	14	2.8 0	57.7 8	50,100. 00	16.5 1
东 方 证 券	202306260003 4564	碧 水 源	202 3 年 06 月 26 日	10,460. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	8.95	10,720. 00	2.56
东 方 证 券	202306260003 4820	兴 发 集	202 3 年	21,690. 00	1,000.0 0	14	1.6 0	13.5 0	22,220. 00	3.86



券		团	06 月 26 日							
东方 证 券	202306260003 4987	中兵 红 箭	202 3 年 06 月 26 日	34,620. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	25.5 8	36,180. 00	7.31
东方 证 券	202306260003 5213	盈 趣 科 技	202 3 年 06 月 26 日	37,620. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	27.8 0	38,800. 00	7.94
东方 证 券	202306260003 5215	中 航 产 融	202 3 年 06 月 26 日	7,520.0 0	2,000.0 0	14	1.4 0	4.09	7,660.0 0	1.17
东方 证 券	202306260003 5761	长 盈 精 密	202 3 年 06 月 26 日	23,080. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	19.7 5	23,820. 00	5.64
东方 证 券	202306260003 5765	卫 宁 健 康	202 3 年 06 月 26 日	10,740. 00	1,000.0 0	14	2.2 0	9.19	10,820. 00	2.63
东方 证 券	202306260003 5960	新 兴 铸 管	202 3 年 06 月	3,970.0 0	1,000.0 0	14	1.2 0	1.85	4,080.0 0	0.53

			26 日							
东方证 券	202306260003 6168	固德威	2023 年 06 月 26 日	168,080 .00	1,000.0 0	14	3.5 0	228. 78	166,860 .00	65.3 7
东方证 券	202306260003 6376	东软集团	2023 年 06 月 26 日	21,300. 00	2,000.0 0	14	1.5 0	12.4 3	21,320. 00	3.55
东方证 券	202306260003 6474	长安汽车	2023 年 06 月 26 日	25,700. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	18.9 9	25,860. 00	5.43
东方证 券	202306260003 6614	恒逸石化	2023 年 06 月 26 日	13,220. 00	2,000.0 0	14	1.2 0	6.17	13,560. 00	1.76
东方证 券	202306260003 6616	天顺风能	2023 年 06 月 26 日	31,140. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	19.3 8	30,460. 00	5.54
东方证 券	202306260003 6621	鹏都农牧	2023 年 06 月 26 日	3,720.0 0	2,000.0 0	14	1.1 0	1.59	3,780.0 0	0.45

东方 证券	202306260003 7077	中南 传媒	202 3 年 06 月 26 日	23,660. 00	2,000.0 0	14	1.9 0	17.4 8	23,200. 00	4.99
东方 证券	202306260003 7145	天华 新能	202 3 年 06 月 26 日	68,080. 00	2,000.0 0	14	2.5 0	66.1 9	71,600. 00	18.9 1
东方 证券	202306260003 7341	中航 高科	202 3 年 06 月 26 日	23,520. 00	1,000.0 0	14	1.3 0	11.8 9	25,310. 00	3.40
东方 证券	202306260003 7535	江苏 有线	202 3 年 06 月 26 日	3,340.0 0	1,000.0 0	14	1.3 0	1.69	3,380.0 0	0.48
东方 证券	202306260003 7577	中国 卫星	202 3 年 06 月 26 日	56,300. 00	2,000.0 0	14	1.4 0	30.6 5	56,420. 00	8.76
东方 证券	202306260003 7682	云天 化	202 3 年 06 月 26 日	32,940. 00	2,000.0 0	14	1.5 0	19.2 2	34,140. 00	5.49
东 方	202306260003 7759	中 国	202 3	58,200. 00	2,000.0 0	14	1.6 0	36.2 1	59,200. 00	10.3 5

证券		稀土	2023年06月26日							
东方证券	2023062600037893	东山精密	2023年06月26日	51,820.00	2,000.00	14	1.50	30.23	51,800.00	8.64
东方证券	2023062600037999	光线传媒	2023年06月26日	16,580.00	2,000.00	14	2.20	14.19	16,180.00	4.05
东方证券	2023062600038003	申通快递	2023年06月26日	11,020.00	1,000.00	14	1.10	4.71	10,820.00	1.35
东方证券	2023062600038204	华数传媒	2023年06月26日	17,060.00	2,000.00	14	1.50	9.95	17,400.00	2.84
东方证券	2023062600038211	南网能源	2023年06月26日	13,720.00	2,000.00	14	1.50	8.00	14,240.00	2.29
东方证券	2023062600038428	华工科技	2023年06月06日	70,340.00	2,000.00	14	1.90	51.97	76,020.00	14.85

			月 26 日							
东方 证券	202306260003 8440	湖南 黄金	202 3 年 06 月 26 日	23,900. 00	2,000.0 0	14	1.3 0	12.0 8	24,400. 00	3.45
东方 证券	202306260003 8730	完美 世界	202 3 年 06 月 26 日	33,740. 00	2,000.0 0	14	1.7 0	22.3 1	33,780. 00	6.37
东方 证券	202306260003 8733	云铝 股份	202 3 年 06 月 26 日	24,700. 00	2,000.0 0	14	1.2 0	11.5 3	25,460. 00	3.29
东方 证券	202306260003 9069	锡业 股份	202 3 年 06 月 26 日	29,120. 00	2,000.0 0	14	1.5 0	16.9 9	31,100. 00	4.85
东方 证券	202306260004 0013	光环 新网	202 3 年 06 月 26 日	22,480. 00	2,000.0 0	14	2.2 0	19.2 3	21,500. 00	5.49
上年度可比期间 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 (	费 率	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额

						单 位： 天)				
东方 证券	202201110000 0683	晶 盛 机 电	202 2 年 01 月 11 日	338,700 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	474. 18	-	-
东方 证券	202201110000 0689	天 合 光 能	202 2 年 01 月 11 日	502,320 .00	8,000.0 0	14	3.6 0	703. 25	-	-
东方 证券	202201250001 1876	晶 盛 机 电	202 2 年 01 月 25 日	364,620 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	510. 47	-	-
东方 证券	202201250001 1884	天 合 光 能	202 2 年 01 月 25 日	553,360 .00	8,000.0 0	14	3.6 0	774. 70	-	-
东方 证券	202202080001 5268	天 合 光 能	202 2 年 02 月 08 日	480,240 .00	8,000.0 0	14	3.6 0	672. 34	-	-
东方 证券	202202080001 5280	晶 盛 机 电	202 2 年 02 月 08 日	334,860 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	468. 80	-	-

			日							
东方 证券	202202220001 3701	晶 盛 机 电	202 2 年 02 月 22 日	360,600 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	504. 84	-	-
东方 证券	202202220001 3709	天 合 光 能	202 2 年 02 月 22 日	507,200 .00	8,000.0 0	14	3.6 0	710. 08	-	-
东方 证券	202203080001 3186	晶 盛 机 电	202 2 年 03 月 08 日	362,640 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	507. 70	-	-
东方 证券	202203080001 3430	天 合 光 能	202 2 年 03 月 08 日	585,520 .00	8,000.0 0	14	3.6 0	819. 73	-	-
东方 证券	202203210000 0841	三 环 集 团	202 2 年 03 月 21 日	29,550. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	44.6 5	-	-
东方 证券	202203210000 0843	卓 胜 微	202 2 年 03 月 21 日	237,000 .00	1,000.0 0	14	3.4 0	358. 13	-	-
东	202203210000	宋	202	14,040.	1,000.0	14	3.4	21.2	-	-

方证券	0845	城演艺	2022年03月21日	00	0		0	2		
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	2022040600060303	三环集	2022年	27,670.00	1,000.00	14	3.40	36.59	-	-



券		团	04 月 06 日							
东方 证 券	202204060006 0313	卓 胜 微	202 2 年 04 月 06 日	204,960 .00	1,000.0 0	14	3.4 0	271. 00	-	-
东方 证 券	202204200004 3100	三 环 集 团	202 2 年 04 月 20 日	28,150. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	39.8 8	-	-
东方 证 券	202204200004 3104	亿 联 网 络	202 2 年 04 月 20 日	77,640. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	109. 99	-	-
东方 证 券	202204200004 4998	宋 城 演 艺	202 2 年 04 月 20 日	14,360. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	20.3 4	-	-
东方 证 券	202204200004 5038	卓 胜 微	202 2 年 04 月 20 日	201,900 .00	1,000.0 0	14	3.4 0	286. 03	-	-
东方 证 券	202204200004 5042	晶 盛 机 电	202 2 年 04 月	317,400 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	476. 10	-	-

			20 日							
东方 证券	202205050006 3213	三环 集团	202 2年 05月 05日	28,610. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	37.8 3	-	-
东方 证券	202205050006 3233	亿联 网络	202 2年 05月 05日	75,720. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	100. 12	-	-
东方 证券	202205050006 4473	卓胜 微	202 2年 05月 05日	182,820 .00	1,000.0 0	14	3.4 0	241. 73	-	-
东方 证券	202205050006 4477	宋城 演艺	202 2年 05月 05日	12,280. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	16.2 4	-	-
东方 证券	202205050006 4489	晶盛 机电	202 2年 05月 05日	308,100 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	431. 34	-	-
东方 证券	202205090000 0702	宋城 演艺	202 2年 05月 09日	22,580. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	29.8 6	-	-

东方 证券	202205090000 0704	阳光 电源	202 2 年 05 月 09 日	127,620 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	168. 74	-	-
东方 证券	202205090000 0706	同花 顺	202 2 年 05 月 09 日	133,450 .00	1,700.0 0	14	3.4 0	176. 45	-	-
东方 证券	202205090000 0708	三环 集团	202 2 年 05 月 09 日	54,560. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	72.1 4	-	-
东方 证券	202205090000 0714	芒果 超媒	202 2 年 05 月 09 日	68,360. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	90.3 9	-	-
东方 证券	202205090000 0716	亿联 网络	202 2 年 05 月 09 日	147,920 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	195. 58	-	-
东方 证券	202205190004 1547	晶盛 机电	202 2 年 05 月 19 日	337,200 .00	6,000.0 0	14	3.6 0	472. 08	-	-
东 方	202205190004 1559	宋 城	202 2	11,590. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	15.3 2	-	-

证券		演艺	年 05 月 19 日							
东方 证券	202205190004 3673	卓 胜 微	202 2 年 05 月 19 日	199,500 .00	1,000.0 0	14	3.4 0	263. 78	-	-
东方 证券	202205190004 3685	三 环 集 团	202 2 年 05 月 19 日	30,370. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	40.1 6	-	-
东方 证券	202205190004 3693	亿 联 网 络	202 2 年 05 月 19 日	72,900. 00	1,000.0 0	14	3.4 0	96.3 9	-	-
东方 证券	202205230000 6787	阳 光 电 源	202 2 年 05 月 23 日	164,700 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	217. 77	-	-
东方 证券	202205230000 6807	芒 果 超 媒	202 2 年 05 月 23 日	71,000. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	93.8 8	-	-
东方 证券	202205230000 6935	同 花 顺	202 2 年 05 月	143,174 .00	1,700.0 0	14	3.4 0	189. 31	-	-

			月 23 日							
东方 证券	202205230000 6957	宋 城 演 艺	202 2 年 05 月 23 日	23,840. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	31.5 2	-	-
东方 证券	202205230000 6963	亿 联 网 络	202 2 年 05 月 23 日	146,400 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	193. 57	-	-
东方 证券	202205230000 6967	三 环 集 团	202 2 年 05 月 23 日	59,620. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	78.8 3	-	-
东方 证券	202206200000 1420	卓 胜 微	202 2 年 06 月 20 日	419,440 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	554. 59	270,000 .00	396. 14
东方 证券	202206200000 1438	蓝 思 科 技	202 2 年 06 月 20 日	21,820. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	28.8 5	22,140. 00	20.6 1
东方 证券	202206200000 1440	中 科 创 达	202 2 年 06 月 20 日	253,240 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	334. 84	260,960 .00	239. 17

			日							
东方证券	202206270000 1182	中科 创达	202 2 年 06 月 27 日	276,900 .00	2,000.0 0	14	3.4 0	366. 12	260,960 .00	78.4 5
东方证券	202206270000 1188	蓝思 科技	202 2 年 06 月 27 日	21,420. 00	2,000.0 0	14	3.4 0	28.3 2	22,140. 00	6.07

#### 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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	7,014,145.00	0.39	4,421,869.00	0.25
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	26,150,000.00	1.45	48,610,000.00	2.78

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	48,271,140.80	84,596.55	55,784,982.51	99,355.43

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
				-	-
上年度可比期间 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

#### 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说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，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，和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 379,944.00 股，持有平安银行 706,967.00 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 363,944.00 股，持有平安银行 676,367.00 股。）

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。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（2023 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	期末估单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,328	40,968.80	31,380.64	



301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	
601061	中信	2023年03	6个	新股	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	

	金属	月 30 日	月	流通受限						
601065	江西省盐业集团	2023 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	88	911.68	1,041.92	
601133	柏诚系统股份公司	2023 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	
603125	江苏常青树科技	2023 年 03 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	
603135	中重科技	2023 年 03 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	
688433	华曙高科	2023 年 04 月 07 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	
688484	南芯科技	2023 年 03 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	916	36,630.84	33,626.36	

688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
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
					-	-	-	-	-	
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“科源制药”（证券代码：301281）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96股（根据山东科源制药股份有限公司2022年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本77,350,000股为基数，向全体股东每10股派4元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增4股，除权除息日为2023年5月26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
601298	青岛港	2023年06月28日	重大事项停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	53,600	314,108.28	373,592.00	

			牌						
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--

注：截止 2023 年 6 月 30 日，本基金合计持有\*ST 中天（000540.SZ）371,600 股。于 2023 年 6 月 29 日，\*ST 中天（000540.SZ）发布公告，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将中证 800 交易型开放式指数证券投资基金所持有\*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

#### 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 2023 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 2023 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	002230	科大讯飞	2023年07月03日	2023年07月03日	67.96	24,500	1,665,020.00
2	601138	工业富联	2023年07月13日	2023年07月13日	25.20	52,100	1,312,920.00
3	300308	中际旭创	2023年07月03日	2023年07月10日	147.45	8,600	1,268,070.00
4	688111	金山办公	2023年07月03日	2023年07月03日	472.22	2,500	1,180,550.00

			日	日			
5	600438	通威股份	2023年07月10日	2023年07月10日	34.31	32,000	1,097,920.00
6	600150	中国船舶	2023年07月10日	2023年07月10日	32.91	29,700	977,427.00
7	002459	晶澳科技	2023年07月03日	2023年07月13日	41.70	21,900	913,230.00
8	000625	长安汽车	2023年07月10日	2023年07月10日	12.93	63,000	814,590.00
9	603019	中科曙光	2023年07月03日	2023年07月13日	50.90	15,300	778,770.00
10	603799	华友钴业	2023年07月03日	2023年07月03日	45.91	16,800	771,288.00
11	600893	航发动力	2023年07月10日	2023年07月10日	42.26	17,000	718,420.00
12	000100	TCL科技	2023年07月03日	2023年07月13日	3.94	181,600	715,504.00
13	002812	恩捷股份	2023年07月10日	2023年07月10日	96.35	7,100	684,085.00
14	000977	浪潮信息	2023年07月10日	2023年07月10日	48.50	13,700	664,450.00
15	002555	三七互娱	2023年07月03日	2023年07月10日	34.88	17,700	617,376.00

			日	日			
16	688036	传音控股	2023年07月03日	2023年07月10日	147.00	4,100	602,700.00
17	688008	澜起科技	2023年07月03日	2023年07月13日	57.42	10,400	597,168.00
18	601186	中国铁建	2023年07月10日	2023年07月10日	9.85	60,200	592,970.00
19	601360	三六零	2023年07月03日	2023年07月13日	12.54	46,500	583,110.00
20	001979	招商蛇口	2023年07月03日	2023年07月10日	13.03	41,000	534,230.00
21	300033	同花顺	2023年07月03日	2023年07月10日	175.28	2,700	473,256.00
22	600372	中航电子	2023年07月10日	2023年07月13日	15.18	31,000	470,580.00
23	601689	拓普集团	2023年07月13日	2023年07月13日	80.70	5,700	459,990.00
24	601100	恒立液压	2023年07月10日	2023年07月10日	64.33	7,100	456,743.00
25	000988	华工科技	2023年07月10日	2023年07月10日	38.01	11,900	452,319.00
26	600157	永泰能源	2023年07月03日	2023年07月03日	1.42	307,000	435,940.00

			日	日			
27	600115	中国东航	2023年07月03日	2023年07月10日	4.76	91,000	433,160.00
28	300316	晶盛机电	2023年07月03日	2023年07月03日	70.90	6,000	425,400.00
29	600745	闻泰科技	2023年07月03日	2023年07月03日	48.90	8,500	415,650.00
30	002236	大华股份	2023年07月10日	2023年07月10日	19.75	21,000	414,750.00
31	000301	东方盛虹	2023年07月10日	2023年07月10日	11.82	35,000	413,700.00
32	600536	中国软件	2023年07月03日	2023年07月03日	46.88	8,300	389,104.00
33	002463	沪电股份	2023年07月10日	2023年07月10日	20.94	18,300	383,202.00
34	601111	中国国航	2023年07月03日	2023年07月10日	8.24	46,400	382,336.00
35	300418	昆仑万维	2023年07月03日	2023年07月10日	40.28	9,400	378,632.00
36	688256	寒武纪科技	2023年07月10日	2023年07月10日	188.00	2,000	376,000.00
37	600188	兖矿能源	2023年07月03日	2023年07月03日	29.92	11,900	356,048.00

			日	日			
38	000066	中国长城	2023年07月10日	2023年07月10日	13.83	25,000	345,750.00
39	600482	中国动力	2023年07月03日	2023年07月10日	23.44	14,500	339,880.00
40	603260	合盛硅业	2023年07月10日	2023年07月10日	70.02	4,800	336,096.00
41	002050	三花智控	2023年07月03日	2023年07月10日	30.26	10,900	329,834.00
42	605117	德业股份	2023年07月04日	2023年07月10日	149.55	2,200	329,010.00
43	600415	小商品城	2023年07月03日	2023年07月13日	8.53	37,500	319,875.00
44	600489	中金黄金	2023年07月03日	2023年07月03日	10.33	30,400	314,032.00
45	300058	蓝色光标	2023年07月10日	2023年07月10日	9.67	32,300	312,341.00
46	600732	爱旭股份	2023年07月10日	2023年07月10日	30.75	10,000	307,500.00
47	600383	金地集团	2023年07月03日	2023年07月03日	7.21	42,000	302,820.00
48	002008	大族激光	2023年07月10日	2023年07月10日	26.20	11,500	301,300.00



			日	日			
49	002738	中矿资源	2023年07月03日	2023年07月10日	50.94	5,900	300,546.00
50	002407	多氟多	2023年07月03日	2023年07月10日	19.86	14,800	293,928.00
51	603806	福斯特	2023年07月03日	2023年07月10日	37.19	7,900	293,801.00
52	300390	天华新能	2023年07月03日	2023年07月10日	35.80	8,000	286,400.00
53	603688	石英股份	2023年07月10日	2023年07月10日	113.84	2,500	284,600.00
54	300024	机器人	2023年07月03日	2023年07月04日	16.67	16,900	281,723.00
55	601995	中金公司	2023年07月03日	2023年07月10日	35.52	7,700	273,504.00
56	601233	桐昆股份	2023年07月03日	2023年07月03日	13.25	20,500	271,625.00
57	300763	锦浪科技	2023年07月13日	2023年07月13日	104.10	2,600	270,660.00
58	300474	景嘉微	2023年07月10日	2023年07月10日	89.99	3,000	269,970.00
59	300136	信维通信	2023年07月03日	2023年07月03日	20.08	13,000	261,040.00

			日	日			
60	688777	中控技术	2023年07月10日	2023年07月13日	62.78	4,100	257,398.00
61	000021	深科技	2023年07月13日	2023年07月13日	19.99	12,800	255,872.00
62	601865	福莱特	2023年07月03日	2023年07月03日	38.51	6,600	254,166.00
63	000157	中联重科	2023年07月03日	2023年07月03日	6.75	37,400	252,450.00
64	601633	长城汽车	2023年07月10日	2023年07月10日	25.17	10,000	251,700.00
65	002465	海格通信	2023年07月10日	2023年07月10日	10.34	24,000	248,160.00
66	300395	菲利华	2023年07月10日	2023年07月10日	49.20	5,000	246,000.00
67	600177	雅戈尔	2023年07月10日	2023年07月10日	6.31	38,400	242,304.00
68	000617	中油资本	2023年07月03日	2023年07月10日	7.23	33,000	238,590.00
69	601788	光大证券	2023年07月03日	2023年07月03日	15.89	15,000	238,350.00
70	002850	科达利	2023年07月10日	2023年07月10日	132.25	1,800	238,050.00

			日	日				
71	603596	伯特利	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	79.26	3,000	237,780.00
72	300017	网宿科技	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	7.11	33,300	236,763.00
73	600346	恒力石化	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	14.33	16,500	236,445.00
74	688099	晶晨半导体	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	84.32	2,800	236,096.00
75	300832	新产业	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	59.00	4,000	236,000.00
76	300118	东方日升	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	25.63	9,000	230,670.00
77	600118	中国卫星	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	28.21	8,100	228,501.00
78	000408	藏格矿业	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	22.57	10,000	225,700.00
79	002268	电科网安	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	27.87	8,000	222,960.00
80	605358	立昂微	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	36.73	6,000	220,380.00
81	000933	神火股份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	13.00	16,800	218,400.00

			日	日			
82	600153	建发股份	2023年07月03日	2023年07月03日	10.91	20,000	218,200.00
83	300699	光威复材	2023年07月10日	2023年07月10日	30.85	7,000	215,950.00
84	000629	钒钛股份	2023年07月10日	2023年07月13日	3.91	54,300	212,313.00
85	601997	贵阳银行	2023年07月10日	2023年07月10日	5.16	40,400	208,464.00
86	603077	和邦生物	2023年07月10日	2023年07月10日	2.43	85,300	207,279.00
87	002624	完美世界	2023年07月03日	2023年07月10日	16.89	12,200	206,058.00
88	000983	山西焦煤	2023年07月03日	2023年07月03日	9.10	22,500	204,750.00
89	600499	科达制造	2023年07月10日	2023年07月10日	11.36	18,000	204,480.00
90	603000	人民网	2023年07月10日	2023年07月10日	29.20	7,000	204,400.00
91	300088	长信科技	2023年07月10日	2023年07月10日	6.03	33,400	201,402.00
92	002281	光迅科技	2023年07月10日	2023年07月10日	37.09	5,400	200,286.00

			日	日			
93	002353	杰瑞股份	2023年07月03日	2023年07月10日	25.13	7,900	198,527.00
94	600498	烽火通信	2023年07月03日	2023年07月10日	20.37	9,700	197,589.00
95	002203	海亮股份	2023年07月10日	2023年07月10日	12.01	16,000	192,160.00
96	300438	鹏辉能源	2023年07月10日	2023年07月10日	48.04	4,000	192,160.00
97	688005	容百科技	2023年07月03日	2023年07月03日	54.02	3,500	189,070.00
98	688516	奥特维科技	2023年07月10日	2023年07月10日	188.40	1,000	188,400.00
99	600516	方大炭素	2023年07月03日	2023年07月10日	6.20	29,900	185,380.00
100	603927	中科软	2023年07月13日	2023年07月13日	38.56	4,800	185,088.00
101	601216	君正集团	2023年07月10日	2023年07月10日	4.10	44,900	184,090.00
102	300182	捷成股份	2023年07月03日	2023年07月10日	6.31	29,100	183,621.00
103	002506	协鑫集成	2023年07月03日	2023年07月10日	2.93	62,400	182,832.00

			日	日				
104	002531	天顺风能	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	15.23	12,000	182,760.00
105	603517	绝味食品	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	37.15	4,900	182,035.00
106	600655	豫园股份	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	6.86	26,500	181,790.00
107	002156	通富微电	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	22.60	8,000	180,800.00
108	002092	中泰化学	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	6.45	28,000	180,600.00
109	688599	天合光能	2023 年 07 月 13 日	-	2023 年 07 月 13 日	42.61	4,200	178,962.00
110	603185	弘元绿能	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 13 日	74.55	2,400	178,920.00
111	000831	中国稀土	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	29.60	6,000	177,600.00
112	600705	中航产融	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	3.83	46,000	176,180.00
113	688385	复旦微电	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	50.10	3,500	175,350.00
114	600416	湘电股份	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	19.09	9,100	173,719.00

			日	日			
115	600008	首创环保	2023年07月03日	2023年07月03日	2.88	60,000	172,800.00
116	601669	中国电建	2023年07月03日	2023年07月03日	5.74	30,000	172,200.00
117	000877	天山股份	2023年07月03日	2023年07月03日	8.14	21,100	171,754.00
118	000060	中金岭南	2023年07月03日	2023年07月10日	4.75	36,000	171,000.00
119	600258	首旅酒店	2023年07月03日	2023年07月03日	18.95	9,000	170,550.00
120	688390	固德威电源	2023年07月10日	2023年07月10日	166.86	1,000	166,860.00
121	002368	太极股份	2023年07月10日	2023年07月10日	41.17	4,000	164,680.00
122	600029	南方航空	2023年07月03日	2023年07月03日	6.03	27,200	164,016.00
123	002936	郑州银行	2023年07月10日	2023年07月10日	2.30	71,100	163,530.00
124	300919	中伟股份	2023年07月13日	2023年07月13日	60.25	2,700	162,675.00
125	601880	辽港股份	2023年07月03日	2023年07月10日	1.56	104,000	162,240.00

			日	日				
126	603127	昭衍 新药	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	40.90	3,800	155,420.00
127	300026	红日 药业	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.42	28,200	152,844.00
128	000039	中集 集团	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	6.89	22,000	151,580.00
129	688220	翱捷 科技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	75.39	2,000	150,780.00
130	601717	郑煤 机	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	12.45	12,000	149,400.00
131	002601	龙佰 集团	2023 年 07 月 13 日	-	2023 年 07 月 13 日	16.50	9,000	148,500.00
132	600839	四川 长虹	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.05	28,900	145,945.00
133	002409	雅克 科技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	72.88	2,000	145,760.00
134	600673	东阳 光	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	7.21	20,000	144,200.00
135	002958	青农 商行	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	2.72	53,000	144,160.00
136	002244	滨江 集团	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 10 日	8.82	16,300	143,766.00



			日	日			
137	601021	春秋航空	2023年07月03日	2023年07月03日	57.47	2,500	143,675.00
138	603267	鸿远电子	2023年07月10日	2023年07月10日	65.30	2,200	143,660.00
139	600584	长电科技	2023年07月10日	2023年07月10日	31.17	4,600	143,382.00
140	000998	隆平高科	2023年07月03日	2023年07月13日	15.35	9,300	142,755.00
141	000970	中科三环	2023年07月03日	2023年07月10日	12.82	11,100	142,302.00
142	300957	贝泰妮	2023年07月03日	2023年07月03日	88.88	1,600	142,208.00
143	300373	扬杰科技	2023年07月13日	2023年07月13日	40.57	3,500	141,995.00
144	002670	国盛金控	2023年07月10日	2023年07月10日	8.78	16,000	140,480.00
145	300661	圣邦股份	2023年07月03日	2023年07月03日	82.13	1,700	139,621.00
146	000723	美锦能源	2023年07月13日	2023年07月13日	7.54	18,500	139,490.00
147	002444	巨星科技	2023年07月03日	2023年07月03日	21.88	6,300	137,844.00

			日	日			
148	689009	九号公司	2023年07月10日	2023年07月10日	36.85	3,700	136,345.00
149	600959	江苏有线	2023年07月10日	2023年07月10日	3.38	40,000	135,200.00
150	601231	环旭电子	2023年07月03日	2023年07月03日	14.96	9,000	134,640.00
151	600056	中国医药	2023年07月03日	2023年07月03日	12.98	10,200	132,396.00
152	600348	华阳股份	2023年07月03日	2023年07月03日	7.91	16,700	132,097.00
153	300251	光线传媒	2023年07月03日	2023年07月10日	8.09	16,000	129,440.00
154	000027	深圳能源	2023年07月10日	2023年07月10日	6.59	19,600	129,164.00
155	300604	长川科技	2023年07月10日	2023年07月10日	47.49	2,700	128,223.00
156	600171	上海贝岭	2023年07月03日	2023年07月10日	18.25	7,000	127,750.00
157	002326	永太科技	2023年07月03日	2023年07月03日	15.29	8,300	126,907.00
158	601665	齐鲁银行	2023年07月10日	2023年07月10日	3.92	31,600	123,872.00

			日	日			
159	002487	大金重工	2023年07月10日	2023年07月10日	30.84	4,000	123,360.00
160	603568	伟明环保	2023年07月10日	2023年07月10日	17.51	7,000	122,570.00
161	600373	中文传媒	2023年07月03日	2023年07月03日	13.32	9,000	119,880.00
162	300212	易华录	2023年07月10日	2023年07月10日	33.23	3,600	119,628.00
163	000591	太阳能	2023年07月10日	2023年07月13日	6.78	17,600	119,328.00
164	600316	洪都航空	2023年07月10日	2023年07月10日	23.45	5,000	117,250.00
165	300776	帝尔激光	2023年07月10日	2023年07月10日	64.90	1,800	116,820.00
166	688208	道通科技	2023年07月03日	2023年07月03日	30.31	3,800	115,178.00
167	603218	日月股份	2023年07月03日	2023年07月10日	18.99	6,000	113,940.00
168	601698	中国卫通	2023年07月03日	2023年07月10日	19.88	5,600	111,328.00
169	688082	盛美上海半导	2023年07月10日	2023年07月10日	110.40	1,000	110,400.00

		体	日	日			
170	601611	中国核建	2023年07月03日	2023年07月10日	8.45	12,600	106,470.00
171	600556	天下秀	2023年07月03日	2023年07月10日	7.09	15,000	106,350.00
172	600022	山东钢铁	2023年07月10日	2023年07月10日	1.42	73,800	104,796.00
173	601778	晶科科技	2023年07月03日	2023年07月10日	4.94	20,600	101,764.00
174	601615	明阳智能	2023年07月10日	2023年07月10日	16.88	6,000	101,280.00
175	600025	华能水电	2023年07月03日	2023年07月03日	7.13	14,000	99,820.00
176	688029	南微医学科技	2023年07月10日	2023年07月10日	81.56	1,200	97,872.00
177	688006	浙江杭可科技	2023年07月10日	2023年07月10日	30.47	3,200	97,504.00
178	601808	中海油服	2023年07月03日	2023年07月03日	13.88	7,000	97,160.00
179	002030	达安基因	2023年07月03日	2023年07月10日	9.97	9,700	96,709.00
180	002505	鹏都农牧	2023年07月03日	2023年07月10日	1.89	51,000	96,390.00

			日	日			
181	603826	坤彩科技	2023年07月10日	2023年07月10日	50.00	1,900	95,000.00
182	600879	航天电子	2023年07月10日	2023年07月13日	8.49	11,100	94,239.00
183	601881	中国银河	2023年07月03日	2023年07月03日	11.61	8,000	92,880.00
184	600409	三友化工	2023年07月03日	2023年07月10日	5.45	17,000	92,650.00
185	002761	浙江建投	2023年07月03日	2023年07月10日	15.18	6,000	91,080.00
186	601236	红塔证券	2023年07月10日	2023年07月10日	7.45	11,600	86,420.00
187	600707	彩虹股份	2023年07月10日	2023年07月10日	4.76	18,000	85,680.00
188	002468	申通快递	2023年07月03日	2023年07月10日	10.82	7,900	85,478.00
189	601568	北元集团	2023年07月13日	2023年07月13日	5.27	16,200	85,374.00
190	600481	双良节能	2023年07月03日	2023年07月03日	13.98	6,100	85,278.00
191	601156	东航物流	2023年07月03日	2023年07月03日	13.00	6,400	83,200.00

			日	日				
192	600985	淮北矿业	2023年07月10日	-	2023年07月10日	11.52	7,200	82,944.00
193	002240	盛新锂能	2023年07月10日	-	2023年07月10日	31.87	2,600	82,862.00
194	688234	天岳先进	2023年07月10日	-	2023年07月10日	73.94	1,100	81,334.00
195	000537	广宇发展	2023年07月03日	-	2023年07月10日	11.67	6,700	78,189.00
196	000960	锡业股份	2023年07月03日	-	2023年07月10日	15.55	5,000	77,750.00
197	603379	三美股份	2023年07月10日	-	2023年07月10日	23.51	3,300	77,583.00
198	603228	景旺电子	2023年07月10日	-	2023年07月10日	25.65	3,000	76,950.00
199	000887	中鼎股份	2023年07月03日	-	2023年07月10日	13.09	5,800	75,922.00
200	000959	首钢股份	2023年07月10日	-	2023年07月10日	3.50	21,600	75,600.00
201	600871	石化油服	2023年07月03日	-	2023年07月03日	1.98	38,100	75,438.00
202	002756	永兴材料	2023年07月10日	-	2023年07月10日	62.61	1,200	75,132.00

			日	日				
203	000402	金融街	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.52	16,500	74,580.00
204	600487	亨通光电	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	14.66	5,000	73,300.00
205	000559	万向钱潮	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.45	13,400	73,030.00
206	601828	美凯龙	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	4.79	15,000	71,850.00
207	002653	海思科	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	23.60	3,000	70,800.00
208	601298	青岛港	2023 年 06 月 29 日	-	2023 年 06 月 29 日	6.97	9,500	66,215.00
209	688289	圣湘生物	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	16.84	3,900	65,676.00
210	688276	长春百克生物科技	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	62.60	1,000	62,600.00
211	603233	大参林	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	28.01	2,200	61,622.00
212	000012	南玻A	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.96	10,200	60,792.00
213	000519	中兵红箭	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	18.09	3,300	59,697.00

			日	日				
214	002414	高德 红外	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	7.77	7,670	59,595.90
215	600079	人福 医药	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	26.94	2,200	59,268.00
216	600350	山东 高速	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	6.37	9,200	58,604.00
217	002925	盈趣 科技	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	19.40	3,000	58,200.00
218	688303	大全 能源	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	40.45	1,400	56,630.00
219	601098	中南 传媒	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	11.60	4,600	53,360.00
220	601006	大秦 铁路	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	7.43	7,000	52,010.00
221	002384	东山 精密	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	25.90	2,000	51,800.00
222	601718	际华 集团	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	2.97	16,800	49,896.00
223	000553	安道 麦 A	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	8.44	5,900	49,796.00
224	688105	诺唯 赞生 物	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	30.49	1,600	48,784.00



			日	日			
225	001872	招商港口	2023年07月03日	2023年07月03日	17.27	2,800	48,356.00
226	000400	许继电气	2023年07月10日	2023年07月10日	23.05	2,000	46,100.00
227	001289	龙源电力	2023年07月03日	2023年07月03日	22.50	2,000	45,000.00
228	600995	南网储能	2023年07月10日	2023年07月10日	11.01	4,000	44,040.00
229	002945	华林证券	2023年07月03日	2023年07月03日	13.68	3,000	41,040.00
230	600143	金发科技	2023年07月03日	2023年07月03日	8.73	4,700	41,031.00
231	300383	光环新网	2023年07月10日	2023年07月13日	10.75	3,800	40,850.00
232	600704	物产中大	2023年07月03日	2023年07月03日	4.94	8,200	40,508.00
233	601198	东兴证券	2023年07月03日	2023年07月03日	8.02	4,900	39,298.00
234	300759	康龙化成	2023年07月03日	2023年07月03日	38.28	1,000	38,280.00
235	002739	万达电影	2023年07月03日	2023年07月10日	12.54	3,000	37,620.00

			日	日			
236	000156	华数传媒	2023年07月10日	2023年07月10日	8.70	4,200	36,540.00
237	600956	新天绿能	2023年07月04日	2023年07月04日	8.72	4,100	35,752.00
238	600032	浙江新能	2023年07月03日	2023年07月03日	12.56	2,800	35,168.00
239	600096	云天化	2023年07月10日	2023年07月10日	17.07	2,000	34,140.00
240	600535	天士力	2023年07月03日	2023年07月03日	14.51	2,300	33,373.00
241	300001	特锐德	2023年07月03日	2023年07月03日	20.78	1,600	33,248.00
242	600155	华创云信	2023年07月10日	2023年07月10日	6.22	5,000	31,100.00
243	600066	宇通客车	2023年07月10日	2023年07月10日	14.74	2,000	29,480.00
244	000807	云铝股份	2023年07月10日	2023年07月10日	12.73	2,000	25,460.00
245	600862	中航高科	2023年07月10日	2023年07月10日	25.31	1,000	25,310.00
246	002155	湖南黄金	2023年07月10日	2023年07月10日	12.20	2,000	24,400.00

			日	日			
247	300115	长盈精密	2023年07月10日	2023年07月10日	11.91	2,000	23,820.00
248	601225	陕西煤业	2023年07月03日	2023年07月03日	18.19	1,300	23,647.00
249	002195	二三四五	2023年07月10日	2023年07月10日	2.89	8,100	23,409.00
250	601928	凤凰传媒	2023年07月10日	2023年07月10日	11.40	2,000	22,800.00
251	600141	兴发集团	2023年07月10日	2023年07月10日	22.22	1,000	22,220.00
252	600718	东软集团	2023年07月10日	2023年07月10日	10.66	2,000	21,320.00
253	600859	王府井	2023年07月03日	2023年07月03日	19.79	1,000	19,790.00
254	002745	木林森	2023年07月10日	2023年07月10日	9.20	2,000	18,400.00
255	600895	张江高科	2023年07月03日	2023年07月03日	13.92	1,300	18,096.00
256	600827	百联股份	2023年07月03日	2023年07月03日	13.37	1,300	17,381.00
257	002221	东华能源	2023年07月03日	2023年07月03日	8.65	2,000	17,300.00

			日	日				
258	601998	中信 银行	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.98	2,700	16,146.00
259	600919	江苏 银行	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	7.35	2,000	14,700.00
260	600667	太极 实业	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	7.26	2,000	14,520.00
261	003035	南网 能源	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	7.12	2,000	14,240.00
262	000703	恒逸 石化	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	6.78	2,000	13,560.00
263	600901	江苏 金租	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.13	2,800	11,564.00
264	300253	卫宁 健康	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	10.82	1,000	10,820.00
265	300070	碧水 源	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	5.36	2,000	10,720.00
266	002202	金风 科技	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	10.62	1,000	10,620.00
267	000547	航天 发展	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	10.00	1,000	10,000.00
268	601598	中国 外运	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.66	2,000	9,320.00

			日	日				
269	002600	领益 智造	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	6.91	1,200	8,292.00
270	600339	中油 工程	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.07	2,000	8,140.00
271	600928	西安 银行	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	3.52	2,000	7,040.00
272	601608	中信 重工	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.21	1,000	4,210.00
273	000778	新兴 铸管	2023 年 07 月 10 日	-	2023 年 07 月 10 日	4.08	1,000	4,080.00
274	601016	节能 风电	2023 年 07 月 03 日	-	2023 年 07 月 03 日	3.67	1,000	3,670.00
合计	-	-	-	-	-	-	4,142,870	55,661,703.90

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。

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，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	48,271,140.80	-	-	-	-	-	48,271,140.80
结算备付金	12,051,935.91	-	-	-	-	-	12,051,935.91
存出保证金	121,080.33	-	-	-	-	6,618,931.20	6,740,011.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,892,659,970.63	1,892,659,970.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权	-	-	-	-	-	-	-

投资							
应收清算款		-	-	-	-	78,395.31	78,395.31
应收股利		-	-	-	-	41,798.55	41,798.55
应收申购款		-	-	-	-	-	-
递延所得税资产		-	-	-	-	-	-
其他资产		-	-	-	-	23,210.05	23,210.05
资产总计	60,444,157.04	-	-	-	-	1,899,422,305.74	1,959,866,462.78
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		-	-	-	-	1,871,315.76	1,871,315.76
应付赎回款		-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬		-	-	-	-	241,306.33	241,306.33
应付托管		-	-	-	-	80,435.46	80,435.46



费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	3,675.45	3,675.45
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	468,271.59	468,271.59
负债总计	-	-	-	-	-	2,665,004.59	2,665,004.59
利率敏感度缺口	60,444,157.04	-	-	-	-	1,896,757,301.15	1,957,201,458.19
上年度末 2022 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	48,997,016.89	-	-	-	-	-	48,997,016.89
结算备付金	12,872,963.06	-	-	-	-	-	12,872,963.06
存出保证金	190,647.01	-	-	-	-	6,715,008.00	6,905,655.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,806,097,361.02	1,806,097,361.02

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	15,120,161.65	15,120,161.65
应收股利	-	-	-	-	-	10,409.12	10,409.12
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	33,615.61	33,615.61
资产总计	62,060,626.96	-	-	-	-	1,827,976,555.40	1,890,037,182.36
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	-	-	-	-	-	14,783,502.54	14,783,502.54
应付	-	-	-	-	-	-	-

赎回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	240,190.34	240,190.34
应付托管费	-	-	-	-	-	80,063.42	80,063.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	4,092.81	4,092.81
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	435,095.42	435,095.42
负债总计	-	-	-	-	-	15,542,944.53	15,542,944.53
利率敏感度缺口	62,060,626.96	-	-	-	-	1,812,433,610.87	1,874,494,237.83

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

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	1,892,659,970.63	96.70	1,806,097,361.02	96.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,892,659,970.63	96.70	1,806,097,361.02	96.35

##### 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 800 指数 上涨 5%	97,174,712.43	93,235,484.43
	中证 800 指数 下跌 5%	-97,174,712.43	-93,235,484.43

注：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 2023 年 06 月 30 日
第一层次	1,891,880,391.92
第二层次	405,615.04
第三层次	373,963.67
合计	1,892,659,970.63

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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	1,892,659,970.63	96.57
	其中：股票	1,892,659,970.63	96.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	60,323,076.71	3.08
8	其他各项资产	6,883,415.44	0.35
9	合计	1,959,866,462.78	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 55,661,703.90 元，占期末基金资产净值比例 2.84%。

### 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	19,006,809.70	0.97
B	采矿业	72,707,578.00	3.71
C	制造业	1,100,777,881.24	56.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,796,046.20	3.00
E	建筑业	38,363,647.75	1.96
F	批发和零售业	21,254,604.60	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	50,677,907.76	2.59
H	住宿和餐饮业	2,379,718.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,791,875.63	5.66
J	金融业	326,279,631.31	16.67
K	房地产业	27,641,691.16	1.41
L	租赁和商务服务业	19,160,851.26	0.98
M	科学研究和技术服务业	19,213,570.11	0.98

N	水利、环境和公共设施管理业	2,875,031.25	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,454,819.95	0.53
R	文化、体育和娱乐业	9,148,431.00	0.47
S	综合	2,723,889.00	0.14
	合计	1,892,253,983.92	96.68

### 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	299,107.60	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	59,575.00	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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,716.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	405,986.71	0.02

### 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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产
----	------	-----	-------	---------	-------

		称			净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	45,815	77,473,165.00	3.96
2	300750	宁德时代	192,520	44,046,650.80	2.25
3	601318	中国平安	789,656	36,640,038.40	1.87
4	600036	招商银行	902,100	29,552,796.00	1.51
5	000858	五粮液	141,561	23,155,132.77	1.18
6	000333	美的集团	358,361	21,114,630.12	1.08
7	002594	比亚迪	65,700	16,968,339.00	0.87
8	601166	兴业银行	1,059,300	16,578,045.00	0.85
9	600900	长江电力	712,640	15,720,838.40	0.80
10	600276	恒瑞医药	324,742	15,555,141.80	0.79
11	600030	中信证券	710,550	14,054,679.00	0.72
12	601899	紫金矿业	1,200,000	13,644,000.00	0.70
13	300059	东方财富	924,627	13,129,703.40	0.67
14	600887	伊利股份	463,500	13,126,320.00	0.67
15	601012	隆基绿能	441,832	12,667,323.44	0.65
16	601398	工商银行	2,555,100	12,315,582.00	0.63
17	600309	万华化学	137,400	12,069,216.00	0.62
18	000651	格力电器	327,540	11,958,485.40	0.61
19	002475	立讯精密	363,884	11,808,035.80	0.60
20	601328	交通银行	2,001,700	11,609,860.00	0.59
21	002415	海康威视	341,100	11,293,821.00	0.58



22	000568	泸州老窖	53,800	11,274,866.00	0.58
23	000725	京东方 A	2,733,000	11,177,970.00	0.57
24	000063	中兴通讯	232,450	10,585,773.00	0.54
25	300760	迈瑞医疗	35,200	10,552,960.00	0.54
26	601816	京沪高铁	1,788,600	9,408,036.00	0.48
27	603259	药明康德	149,881	9,339,085.11	0.48
28	002230	科大讯飞	135,200	9,188,192.00	0.47
29	600028	中国石化	1,387,700	8,825,772.00	0.45
30	300274	阳光电源	75,600	8,817,228.00	0.45
31	601668	中国建筑	1,527,300	8,766,702.00	0.45
32	300124	汇川技术	135,750	8,716,507.50	0.45
33	002714	牧原股份	198,958	8,386,079.70	0.43
34	601288	农业银行	2,327,000	8,214,310.00	0.42
35	002352	顺丰控股	178,544	8,050,548.96	0.41
36	000001	平安银行	706,967	7,939,239.41	0.41
37	002129	TCL 中环	236,000	7,835,200.00	0.40
38	601888	中国中免	70,842	7,830,166.26	0.40
39	000792	盐湖股份	396,200	7,595,154.00	0.39
40	601088	中国神华	239,940	7,378,155.00	0.38
41	601138	工业富联	289,700	7,300,440.00	0.37
42	002142	宁波银行	288,070	7,288,171.00	0.37
43	688981	中芯国际	142,702	7,209,305.04	0.37

44	300308	中际旭创	48,800	7,195,560.00	0.37
45	600031	三一重工	431,600	7,177,508.00	0.37
46	300498	温氏股份	381,040	6,992,084.00	0.36
47	000002	万科A	495,600	6,948,312.00	0.36
48	600048	保利发展	523,600	6,822,508.00	0.35
49	600016	民生银行	1,810,700	6,790,125.00	0.35
50	600406	国电南瑞	292,294	6,751,991.40	0.34
51	600438	通威股份	196,500	6,741,915.00	0.34
52	600050	中国联通	1,390,900	6,676,320.00	0.34
53	600809	山西汾酒	35,460	6,562,582.20	0.34
54	600837	海通证券	704,200	6,492,724.00	0.33
55	601601	中国太保	249,500	6,482,010.00	0.33
56	600690	海尔智家	275,900	6,478,132.00	0.33
57	688111	金山办公	13,700	6,469,414.00	0.33
58	601728	中国电信	1,132,311	6,374,910.93	0.33
59	600919	江苏银行	858,550	6,310,342.50	0.32
60	600089	特变电工	282,800	6,303,612.00	0.32
61	300015	爱尔眼科	338,949	6,287,503.95	0.32
62	600000	浦发银行	856,500	6,201,060.00	0.32
63	600436	片仔癀	21,600	6,185,376.00	0.32
64	601857	中国石油	826,600	6,174,702.00	0.32
65	600941	中国移动	65,400	6,101,820.00	0.31

66	601988	中国银行	1,537,800	6,012,798.00	0.31
67	002371	北方华创	18,876	5,995,961.40	0.31
68	603501	韦尔股份	60,742	5,955,145.68	0.30
69	601766	中国中车	886,300	5,760,950.00	0.29
70	002304	洋河股份	43,800	5,753,130.00	0.29
71	603288	海天味业	121,355	5,685,481.75	0.29
72	601390	中国中铁	748,600	5,674,388.00	0.29
73	600905	三峡能源	1,041,700	5,593,929.00	0.29
74	300014	亿纬锂能	89,583	5,419,771.50	0.28
75	600150	中国船舶	162,468	5,346,821.88	0.27
76	000938	紫光股份	166,260	5,295,381.00	0.27
77	002466	天齐锂业	75,300	5,264,223.00	0.27
78	603986	兆易创新	48,768	5,181,600.00	0.26
79	601688	华泰证券	375,400	5,169,258.00	0.26
80	601225	陕西煤业	282,000	5,129,580.00	0.26
81	002027	分众传媒	736,700	5,016,927.00	0.26
82	002460	赣锋锂业	82,280	5,015,788.80	0.26
83	002459	晶澳科技	119,936	5,001,331.20	0.26
84	601169	北京银行	1,079,000	4,995,770.00	0.26
85	000338	潍柴动力	395,300	4,925,438.00	0.25
86	600570	恒生电子	110,710	4,903,345.90	0.25
87	688012	中微半导体设	31,300	4,896,885.00	0.25

		备			
88	601985	中国核电	688,500	4,853,925.00	0.25
89	600104	上汽集团	340,600	4,826,302.00	0.25
90	002050	三花智控	156,780	4,744,162.80	0.24
91	000625	长安汽车	361,692	4,676,677.56	0.24
92	002049	紫光国微	49,580	4,623,335.00	0.24
93	601211	国泰君安	327,700	4,584,523.00	0.23
94	600111	北方稀土	184,600	4,426,708.00	0.23
95	601919	中远海控	464,860	4,369,684.00	0.22
96	603019	中科曙光	85,520	4,352,968.00	0.22
97	000100	TCL 科技	1,091,390	4,300,076.60	0.22
98	603799	华友钴业	93,370	4,286,616.70	0.22
99	601628	中国人寿	121,113	4,234,110.48	0.22
100	002179	中航光电	92,716	4,204,670.60	0.21
101	600660	福耀玻璃	116,600	4,180,110.00	0.21
102	601229	上海银行	722,700	4,155,525.00	0.21
103	601818	光大银行	1,349,500	4,142,965.00	0.21
104	600585	海螺水泥	174,300	4,137,882.00	0.21
105	002812	恩捷股份	42,800	4,123,780.00	0.21
106	600009	上海机场	90,600	4,115,052.00	0.21
107	600893	航发动力	97,178	4,106,742.28	0.21
108	002271	东方雨虹	147,300	4,015,398.00	0.21
109	601989	中国重	829,000	3,995,780.00	0.20

		工			
110	601658	邮储银行	806,778	3,945,144.42	0.20
111	002555	三七互娱	112,900	3,937,952.00	0.20
112	300122	智飞生物	87,100	3,849,820.00	0.20
113	600958	东方证券	379,944	3,685,456.80	0.19
114	600999	招商证券	269,510	3,657,250.70	0.19
115	000977	浪潮信息	75,000	3,637,500.00	0.19
116	600019	宝钢股份	647,000	3,636,140.00	0.19
117	600760	中航沈飞	80,280	3,612,600.00	0.18
118	300896	爱美客	8,000	3,559,600.00	0.18
119	688036	传音控股	23,800	3,498,600.00	0.18
120	002709	天赐材料	84,260	3,470,669.40	0.18
121	300316	晶盛机电	47,700	3,381,930.00	0.17
122	688599	天合光能	79,100	3,370,451.00	0.17
123	600426	华鲁恒升	108,260	3,316,003.80	0.17
124	601186	中国铁建	335,400	3,303,690.00	0.17
125	688008	澜起科技	57,500	3,301,650.00	0.17
126	601360	三六零	259,500	3,254,130.00	0.17
127	600584	长电科技	104,100	3,244,797.00	0.17
128	601006	大秦铁路	434,040	3,224,917.20	0.16
129	601600	中国铝业	579,400	3,180,906.00	0.16
130	000661	长春高新	23,300	3,175,790.00	0.16
131	002410	广联达	97,430	3,165,500.70	0.16
132	000776	广发证	215,000	3,162,650.00	0.16

		券			
133	600745	闻泰科技	63,900	3,124,710.00	0.16
134	002241	歌尔股份	174,900	3,104,475.00	0.16
135	600547	山东黄金	132,000	3,099,360.00	0.16
136	300142	沃森生物	117,000	3,094,650.00	0.16
137	002920	德赛西威	19,800	3,085,038.00	0.16
138	600588	用友网络	150,250	3,080,125.00	0.16
139	601377	兴业证券	502,140	3,073,096.80	0.16
140	601939	建设银行	490,800	3,072,408.00	0.16
141	000166	申万宏源	654,900	3,025,638.00	0.15
142	688256	寒武纪科技	16,000	3,008,000.00	0.15
143	601009	南京银行	375,900	3,007,200.00	0.15
144	000596	古井贡酒	12,100	2,993,298.00	0.15
145	600010	包钢股份	1,656,600	2,965,314.00	0.15
146	600011	华能国际	319,500	2,958,570.00	0.15
147	001979	招商蛇口	225,600	2,939,568.00	0.15
148	000988	华工科技	76,200	2,896,362.00	0.15
149	601669	中国电建	502,700	2,885,498.00	0.15
150	300450	先导智能	79,700	2,882,749.00	0.15
151	300408	三环集团	98,100	2,879,235.00	0.15
152	600085	同仁堂	49,900	2,872,244.00	0.15
153	600196	复星医药	92,300	2,852,070.00	0.15
154	002311	海大集	60,700	2,843,188.00	0.15

		团			
155	601800	中国交建	258,200	2,816,962.00	0.14
156	603659	璞泰来	73,450	2,807,259.00	0.14
157	300033	同花顺	15,900	2,786,952.00	0.14
158	000963	华东医药	64,200	2,784,354.00	0.14
159	000538	云南白药	52,360	2,747,852.80	0.14
160	600886	国投电力	216,600	2,739,990.00	0.14
161	603993	洛阳钼业	513,400	2,736,422.00	0.14
162	000768	中航西飞	101,300	2,709,775.00	0.14
163	002384	东山精密	103,700	2,685,830.00	0.14
164	002340	格林美	388,300	2,683,153.00	0.14
165	600845	宝信软件	52,261	2,655,381.41	0.14
166	002422	科伦药业	89,400	2,653,392.00	0.14
167	600600	青岛啤酒	25,600	2,652,928.00	0.14
168	300782	卓胜微	26,960	2,605,144.80	0.13
169	601689	拓普集团	32,200	2,598,540.00	0.13
170	002493	荣盛石化	221,750	2,581,170.00	0.13
171	002252	上海莱士	342,800	2,574,428.00	0.13
172	600372	中航电子	169,537	2,573,571.66	0.13
173	300418	昆仑万维	63,600	2,561,808.00	0.13
174	600926	杭州银行	216,560	2,544,580.00	0.13
175	000733	振华科技	26,400	2,530,440.00	0.13
176	600015	华夏银行	465,500	2,518,355.00	0.13
177	601100	恒立液压	38,948	2,505,524.84	0.13

178	300012	华测检测	128,000	2,496,000.00	0.13
179	600176	中国巨石	175,623	2,486,821.68	0.13
180	600795	国电电力	647,900	2,481,457.00	0.13
181	002180	纳思达	72,100	2,469,425.00	0.13
182	300347	泰格医药	38,200	2,465,428.00	0.13
183	600732	爱旭股份	80,080	2,462,460.00	0.13
184	000157	中联重科	363,400	2,452,950.00	0.13
185	600674	川投能源	162,100	2,439,605.00	0.12
186	603369	今世缘	45,857	2,421,249.60	0.12
187	002236	大华股份	121,000	2,389,750.00	0.12
188	600157	永泰能源	1,679,100	2,384,322.00	0.12
189	600115	中国东航	499,800	2,379,048.00	0.12
190	600029	南方航空	391,600	2,361,348.00	0.12
191	600079	人福医药	86,400	2,327,616.00	0.12
192	000425	徐工机械	343,600	2,326,172.00	0.12
193	300724	捷佳伟创	20,700	2,325,645.00	0.12
194	601066	中信建投	95,100	2,301,420.00	0.12
195	600489	中金黄金	221,500	2,288,095.00	0.12
196	000301	东方盛虹	193,000	2,281,260.00	0.12
197	601995	中金公司	64,000	2,273,280.00	0.12
198	601788	光大证券	142,500	2,264,325.00	0.12
199	601633	长城汽车	89,662	2,256,792.54	0.12
200	601336	新华保	61,265	2,252,714.05	0.12



		险			
201	300003	乐普医疗	99,388	2,247,162.68	0.11
202	300496	中科创达	23,000	2,216,050.00	0.11
203	601868	中国能建	942,465	2,205,368.10	0.11
204	601117	中国化学	266,200	2,204,136.00	0.11
205	600346	恒力石化	153,700	2,202,521.00	0.11
206	002738	中矿资源	43,140	2,197,551.60	0.11
207	600487	亨通光电	149,900	2,197,534.00	0.11
208	688777	中控技术	34,890	2,190,394.20	0.11
209	601877	正泰电器	78,251	2,163,640.15	0.11
210	002028	思源电气	46,300	2,163,136.00	0.11
211	002074	国轩高科	77,700	2,146,074.00	0.11
212	600536	中国软件	45,725	2,143,588.00	0.11
213	002202	金风科技	200,800	2,132,496.00	0.11
214	002463	沪电股份	101,400	2,123,316.00	0.11
215	601058	赛轮轮胎	185,900	2,117,401.00	0.11
216	600741	华域汽车	114,700	2,117,362.00	0.11
217	601555	东吴证券	302,802	2,101,445.88	0.11
218	601111	中国国航	253,700	2,090,488.00	0.11
219	002001	新和成	134,688	2,074,195.20	0.11
220	601618	中国中冶	521,800	2,071,546.00	0.11
221	688126	上海硅产业集团	99,100	2,071,190.00	0.11

222	600765	中航重机	78,060	2,069,370.60	0.11
223	688223	晶科能源	146,000	2,052,760.00	0.10
224	002841	视源股份	30,700	2,051,988.00	0.10
225	300037	新宙邦	39,500	2,049,655.00	0.10
226	603806	福斯特	54,583	2,029,941.77	0.10
227	000066	中国长城	146,700	2,028,861.00	0.10
228	600989	宝丰能源	160,000	2,017,600.00	0.10
229	600885	宏发股份	63,330	2,017,060.50	0.10
230	300454	深信服	17,800	2,015,850.00	0.10
231	002821	凯莱英	17,100	2,015,406.00	0.10
232	000807	云铝股份	157,500	2,004,975.00	0.10
233	601838	成都银行	163,000	1,990,230.00	0.10
234	600188	兖矿能源	66,400	1,986,688.00	0.10
235	688396	华润微电子	37,600	1,970,616.00	0.10
236	601901	方正证券	299,100	1,956,114.00	0.10
237	601615	明阳智能	115,700	1,953,016.00	0.10
238	300661	圣邦股份	23,495	1,929,644.35	0.10
239	000876	新希望	165,000	1,927,200.00	0.10
240	600482	中国动力	82,100	1,924,424.00	0.10
241	605117	德业股份	12,760	1,908,258.00	0.10
242	000009	中国宝安	156,800	1,892,576.00	0.10
243	688099	晶晨半导体	22,400	1,888,768.00	0.10
244	600460	士兰微	62,000	1,876,740.00	0.10
245	600039	四川路桥	191,040	1,874,102.40	0.10

246	300413	芒果超媒	54,700	1,871,287.00	0.10
247	688303	大全能源	46,000	1,860,700.00	0.10
248	000895	双汇发展	75,702	1,853,941.98	0.09
249	300146	汤臣倍健	77,300	1,853,654.00	0.09
250	000423	东阿阿胶	34,600	1,849,370.00	0.09
251	600352	浙江龙盛	197,300	1,844,755.00	0.09
252	002648	卫星化学	123,040	1,840,678.40	0.09
253	002736	国信证券	209,600	1,829,808.00	0.09
254	603392	万泰生物	27,378	1,828,029.06	0.09
255	600233	圆通速递	125,100	1,821,456.00	0.09
256	300058	蓝色光标	188,100	1,818,927.00	0.09
257	300769	德方纳米	16,480	1,816,590.40	0.09
258	002966	苏州银行	276,970	1,814,153.50	0.09
259	002156	通富微电	80,200	1,812,520.00	0.09
260	601607	上海医药	80,800	1,810,728.00	0.09
261	000786	北新建材	73,800	1,808,838.00	0.09
262	002185	华天科技	195,600	1,799,520.00	0.09
263	603260	合盛硅业	25,700	1,799,514.00	0.09
264	002007	华兰生物	79,620	1,784,284.20	0.09
265	003816	中国广核	571,500	1,777,365.00	0.09
266	601108	财通证券	244,780	1,772,207.20	0.09
267	600415	小商品城	207,500	1,769,975.00	0.09

268	300207	欣旺达	108,400	1,769,088.00	0.09
269	300999	金龙鱼	43,600	1,743,564.00	0.09
270	002625	光启技术	114,200	1,742,692.00	0.09
271	300751	迈为股份	10,276	1,740,548.88	0.09
272	002601	龙佰集团	105,100	1,734,150.00	0.09
273	002624	完美世界	102,450	1,730,380.50	0.09
274	300144	宋城演艺	139,020	1,723,848.00	0.09
275	600027	华电国际	257,400	1,722,006.00	0.09
276	600109	国金证券	198,200	1,718,394.00	0.09
277	300433	蓝思科技	145,800	1,714,608.00	0.09
278	000783	长江证券	294,500	1,708,100.00	0.09
279	600988	赤峰黄金	126,600	1,704,036.00	0.09
280	600161	天坛生物	62,632	1,700,458.80	0.09
281	601233	桐昆股份	127,600	1,690,700.00	0.09
282	002008	大族激光	64,400	1,687,280.00	0.09
283	300285	国瓷材料	61,500	1,685,100.00	0.09
284	601077	渝农商行	467,600	1,678,684.00	0.09
285	601238	广汽集团	161,100	1,678,662.00	0.09
286	600298	安琪酵母	46,300	1,676,523.00	0.09
287	300568	星源材质	97,300	1,672,587.00	0.09
288	600383	金地集团	231,000	1,665,510.00	0.09
289	600096	云天化	97,500	1,664,325.00	0.09
290	600418	江淮汽车	132,100	1,663,139.00	0.08

291	300759	康龙化成	43,200	1,653,696.00	0.08
292	002385	大北农	250,400	1,652,640.00	0.08
293	002223	鱼跃医疗	45,400	1,633,946.00	0.08
294	600332	白云山	51,000	1,625,880.00	0.08
295	603444	吉比特	3,300	1,620,663.00	0.08
296	601021	春秋航空	28,200	1,620,654.00	0.08
297	000630	铜陵有色	559,400	1,616,666.00	0.08
298	002407	多氟多	81,080	1,610,248.80	0.08
299	600862	中航高科	63,600	1,609,716.00	0.08
300	600763	通策医疗	16,600	1,607,876.00	0.08
301	300390	天华新能	44,680	1,599,544.00	0.08
302	603882	金域医学	21,000	1,585,500.00	0.08
303	600132	重庆啤酒	17,200	1,585,152.00	0.08
304	603688	石英股份	13,900	1,582,376.00	0.08
305	300474	景嘉微	17,500	1,574,825.00	0.08
306	300024	机器人	93,700	1,561,979.00	0.08
307	601162	天风证券	524,060	1,561,698.80	0.08
308	000933	神火股份	119,700	1,556,100.00	0.08
309	002409	雅克科技	21,300	1,552,344.00	0.08
310	300073	当升科技	30,800	1,550,164.00	0.08
311	002497	雅化集团	87,100	1,548,638.00	0.08
312	600705	中航产融	403,900	1,546,937.00	0.08
313	600219	南山铝业	510,500	1,541,710.00	0.08
314	300395	菲利华	31,300	1,539,960.00	0.08
315	300604	长川科技	32,300	1,533,927.00	0.08

316	002240	盛新锂能	48,100	1,532,947.00	0.08
317	601168	西部矿业	144,900	1,522,899.00	0.08
318	300763	锦浪科技	14,600	1,519,860.00	0.08
319	002439	启明星辰	50,800	1,511,808.00	0.08
320	300223	北京君正	17,100	1,510,101.00	0.08
321	000932	华菱钢铁	316,000	1,507,320.00	0.08
322	605358	立昂微	41,000	1,505,930.00	0.08
323	600875	东方电气	80,600	1,503,190.00	0.08
324	000983	山西焦煤	164,700	1,498,770.00	0.08
325	600066	宇通客车	100,259	1,477,817.66	0.08
326	002138	顺络电子	61,800	1,477,638.00	0.08
327	600060	海信视像	59,700	1,477,575.00	0.08
328	000975	银泰黄金	125,960	1,473,732.00	0.08
329	600998	九州通	141,803	1,471,915.14	0.08
330	300136	信维通信	73,300	1,471,864.00	0.08
331	002600	领益智造	212,900	1,471,139.00	0.08
332	002797	第一创业	256,300	1,466,036.00	0.07
333	002756	永兴材料	23,210	1,453,178.10	0.07
334	002465	海格通信	140,400	1,451,736.00	0.07
335	002568	百润股份	39,900	1,450,365.00	0.07
336	603596	伯特利	18,200	1,442,532.00	0.07
337	600362	江西铜业	75,500	1,432,990.00	0.07
338	601699	潞安环能	87,700	1,431,264.00	0.07

339	601865	福莱特	37,100	1,428,721.00	0.07
340	002850	科达利	10,800	1,428,300.00	0.07
341	600563	法拉电子	10,400	1,427,920.00	0.07
342	603816	顾家家居	37,400	1,426,810.00	0.07
343	600839	四川长虹	282,200	1,425,110.00	0.07
344	600160	巨化股份	103,200	1,422,096.00	0.07
345	000723	美锦能源	188,400	1,420,536.00	0.07
346	000021	深科技	71,036	1,420,009.64	0.07
347	603939	益丰药房	38,300	1,417,100.00	0.07
348	601128	常熟银行	207,300	1,413,786.00	0.07
349	000591	太阳能	208,300	1,412,274.00	0.07
350	600918	中泰证券	204,100	1,410,331.00	0.07
351	600754	锦江酒店	33,200	1,405,688.00	0.07
352	300253	卫宁健康	129,900	1,405,518.00	0.07
353	600873	梅花生物	156,600	1,398,438.00	0.07
354	600879	航天电子	164,600	1,397,454.00	0.07
355	688567	孚能科技	64,700	1,396,873.00	0.07
356	601878	浙商证券	140,700	1,390,116.00	0.07
357	688521	芯原微电子	19,300	1,388,056.00	0.07
358	300832	新产业	23,500	1,386,500.00	0.07
359	688169	石头科技	4,320	1,385,337.60	0.07
360	000683	远兴能源	191,400	1,376,166.00	0.07
361	600392	盛和资源	106,800	1,374,516.00	0.07
362	300866	安克创新	15,700	1,373,750.00	0.07

363	300699	光威复材	44,380	1,369,123.00	0.07
364	601990	南京证券	167,300	1,368,514.00	0.07
365	601872	招商轮船	236,060	1,366,787.40	0.07
366	002078	太阳纸业	127,800	1,366,182.00	0.07
367	002368	太极股份	33,099	1,362,685.83	0.07
368	603290	斯达半导	6,300	1,355,760.00	0.07
369	601319	中国人保	231,978	1,354,751.52	0.07
370	600497	驰宏锌锗	269,300	1,351,886.00	0.07
371	601696	中银证券	126,100	1,344,226.00	0.07
372	000729	燕京啤酒	107,700	1,343,019.00	0.07
373	000617	中油资本	185,200	1,338,996.00	0.07
374	600061	国投资本	187,896	1,337,819.52	0.07
375	603589	口子窖	27,000	1,332,450.00	0.07
376	000831	中国稀土	45,000	1,332,000.00	0.07
377	601998	中信银行	222,600	1,331,148.00	0.07
378	600516	方大炭素	214,620	1,330,644.00	0.07
379	688390	固德威电源	7,964	1,328,873.04	0.07
380	600177	雅戈尔	210,000	1,325,100.00	0.07
381	300118	东方日升	51,500	1,319,945.00	0.07
382	002294	信立泰	42,200	1,316,218.00	0.07
383	603486	科沃斯	16,900	1,314,313.00	0.07
384	000069	华侨城 A	298,000	1,311,200.00	0.07
385	601799	星宇股份	10,600	1,310,160.00	0.07
386	300017	网宿科	184,100	1,308,951.00	0.07



		技			
387	600141	兴发集团	58,900	1,308,758.00	0.07
388	603833	欧派家居	13,620	1,304,796.00	0.07
389	000408	藏格矿业	57,800	1,304,546.00	0.07
390	002025	航天电器	20,400	1,301,520.00	0.07
391	600642	申能股份	185,400	1,295,946.00	0.07
392	300628	亿联网络	36,800	1,290,576.00	0.07
393	000728	国元证券	197,730	1,289,199.60	0.07
394	002673	西部证券	202,904	1,288,440.40	0.07
395	600803	新奥股份	67,800	1,286,844.00	0.07
396	002430	杭氧股份	37,300	1,281,628.00	0.07
397	600699	均胜电子	72,600	1,280,664.00	0.07
398	000629	钒钛股份	327,400	1,280,134.00	0.07
399	002532	天山铝业	212,900	1,275,271.00	0.07
400	600118	中国卫星	45,100	1,272,271.00	0.07
401	002273	水晶光电	106,100	1,266,834.00	0.06
402	688363	华熙生物	14,200	1,266,072.00	0.06
403	688005	容百科技	23,400	1,264,068.00	0.06
404	600170	上海建工	469,500	1,262,955.00	0.06
405	600325	华发股份	128,100	1,261,785.00	0.06
406	600486	扬农化工	14,400	1,258,848.00	0.06
407	600521	华海药业	68,300	1,257,403.00	0.06

408	002195	二三四五	432,800	1,250,792.00	0.06
409	300601	康泰生物	49,220	1,249,695.80	0.06
410	002739	万达电影	99,400	1,246,476.00	0.06
411	600884	杉杉股份	82,300	1,246,022.00	0.06
412	688072	拓荆科技	2,925	1,245,962.25	0.06
413	002268	电科网安	44,700	1,245,789.00	0.06
414	000400	许继电气	54,000	1,244,700.00	0.06
415	601966	玲珑轮胎	56,000	1,244,320.00	0.06
416	600143	金发科技	142,300	1,242,279.00	0.06
417	600153	建发股份	113,800	1,241,558.00	0.06
418	002372	伟星新材	60,300	1,238,562.00	0.06
419	600549	厦门钨业	64,900	1,235,047.00	0.06
420	002938	鹏鼎控股	50,800	1,233,932.00	0.06
421	600166	福田汽车	362,800	1,233,520.00	0.06
422	300595	欧普康视	40,660	1,227,525.40	0.06
423	689009	九号公司	33,300	1,227,105.00	0.06
424	600399	抚顺特钢	120,300	1,227,060.00	0.06
425	688002	睿创微纳	27,383	1,226,758.40	0.06
426	600637	东方明珠	156,630	1,224,846.60	0.06
427	000998	隆平高科	79,700	1,223,395.00	0.06
428	603000	人民网	41,800	1,220,560.00	0.06
429	688220	翱捷科技	16,174	1,219,357.86	0.06

430	600183	生益科技	85,820	1,218,644.00	0.06
431	000738	航发控制	49,900	1,217,560.00	0.06
432	603899	晨光股份	27,200	1,214,208.00	0.06
433	002444	巨星科技	55,100	1,205,588.00	0.06
434	002065	东华软件	169,700	1,198,082.00	0.06
435	600859	王府井	60,400	1,195,316.00	0.06
436	601577	长沙银行	153,400	1,190,384.00	0.06
437	000997	新大陆	62,900	1,188,810.00	0.06
438	002131	利欧股份	515,300	1,185,190.00	0.06
439	600481	双良节能	84,700	1,184,106.00	0.06
440	002353	杰瑞股份	46,900	1,178,597.00	0.06
441	300383	光环新网	109,600	1,178,200.00	0.06
442	688536	思瑞浦股份	5,400	1,177,200.00	0.06
443	601198	东兴证券	146,400	1,174,128.00	0.06
444	600704	物产中大	237,600	1,173,744.00	0.06
445	600499	科达制造	102,900	1,168,944.00	0.06
446	300682	朗新科技	50,200	1,168,656.00	0.06
447	000708	中信特钢	73,500	1,164,240.00	0.06
448	300487	蓝晓科技	18,650	1,164,133.00	0.06
449	000960	锡业股份	74,800	1,163,140.00	0.06
450	300001	特锐德	55,800	1,159,524.00	0.06
451	300438	鹏辉能源	24,100	1,157,764.00	0.06
452	600021	上海电	107,130	1,153,790.10	0.06

		力			
453	600271	航天信息	84,100	1,151,329.00	0.06
454	300919	中伟股份	19,100	1,150,775.00	0.06
455	000519	中兵红箭	63,600	1,150,524.00	0.06
456	688009	中国通号	196,896	1,141,996.80	0.06
457	002373	千方科技	83,700	1,141,668.00	0.06
458	601997	贵阳银行	221,038	1,140,556.08	0.06
459	002916	深南电路	15,100	1,138,087.00	0.06
460	603185	弘元绿能	15,260	1,137,633.00	0.06
461	002507	涪陵榨菜	62,120	1,137,417.20	0.06
462	601898	中煤能源	134,500	1,135,180.00	0.06
463	603077	和邦生物	467,000	1,134,810.00	0.06
464	002056	横店东磁	62,200	1,132,662.00	0.06
465	000623	吉林敖东	70,600	1,132,424.00	0.06
466	300088	长信科技	187,700	1,131,831.00	0.06
467	688516	奥特维科技	6,000	1,130,400.00	0.06
468	000703	恒逸石化	166,410	1,128,259.80	0.06
469	600511	国药股份	28,700	1,114,995.00	0.06
470	000513	丽珠集团	28,600	1,112,826.00	0.06
471	600380	健康元	87,500	1,112,125.00	0.06
472	600867	通化东宝	106,404	1,110,857.76	0.06
473	600498	烽火通信	54,500	1,110,165.00	0.06
474	300676	华大基	18,500	1,109,815.00	0.06

		因			
475	002152	广电运通	94,600	1,108,712.00	0.06
476	002281	光迅科技	29,800	1,105,282.00	0.06
477	600529	山东药玻	40,200	1,094,244.00	0.06
478	688301	奕瑞科技股份	3,860	1,090,179.80	0.06
479	002299	圣农发展	56,900	1,089,635.00	0.06
480	600348	华阳股份	137,600	1,088,416.00	0.06
481	600546	山煤国际	75,100	1,086,697.00	0.06
482	601881	中国银河	93,600	1,086,696.00	0.06
483	002203	海亮股份	90,100	1,082,101.00	0.06
484	601016	节能风电	293,850	1,078,429.50	0.06
485	002192	融捷股份	16,100	1,075,963.00	0.05
486	000636	风华高科	70,096	1,075,272.64	0.05
487	603517	绝味食品	28,800	1,069,920.00	0.05
488	002595	豪迈科技	30,400	1,067,952.00	0.05
489	600018	上港集团	203,200	1,066,800.00	0.05
490	600739	辽宁成大	81,000	1,065,150.00	0.05
491	603737	三棵树	16,280	1,065,037.60	0.05
492	603338	浙江鼎力	19,000	1,064,190.00	0.05
493	603712	七一二	35,100	1,060,371.00	0.05
494	601636	旗滨集团	121,800	1,049,916.00	0.05
495	002080	中材科技	51,100	1,048,572.00	0.05
496	603885	吉祥航空	67,900	1,047,697.00	0.05

497	603927	中科软	27,100	1,044,976.00	0.05
498	002531	天顺风能	68,400	1,041,732.00	0.05
499	688561	奇安信集团	20,100	1,041,381.00	0.05
500	002506	协鑫集成	353,600	1,036,048.00	0.05
501	002432	九安医疗	29,400	1,035,174.00	0.05
502	688772	珠海冠宇电池	51,200	1,031,680.00	0.05
503	000877	天山股份	125,800	1,024,012.00	0.05
504	600970	中材国际	80,000	1,020,000.00	0.05
505	600580	卧龙电驱	69,800	1,019,778.00	0.05
506	600863	内蒙华电	245,500	1,018,825.00	0.05
507	688385	复旦微电	20,300	1,017,030.00	0.05
508	000878	云南铜业	91,800	1,014,390.00	0.05
509	300182	捷成股份	160,500	1,012,755.00	0.05
510	002092	中泰化学	156,800	1,011,360.00	0.05
511	300212	易华录	30,420	1,010,856.60	0.05
512	600655	豫园股份	147,200	1,009,792.00	0.05
513	300296	利亚德	154,600	1,009,538.00	0.05
514	600909	华安证券	215,770	1,007,645.90	0.05
515	002120	韵达股份	105,270	1,006,381.20	0.05
516	601216	君正集团	245,400	1,006,140.00	0.05
517	002683	广东宏大	34,100	1,003,904.00	0.05
518	600528	中铁工业	101,500	1,002,820.00	0.05
519	002064	华峰化学	146,100	1,002,246.00	0.05

520	600820	隧道股份	166,500	1,000,665.00	0.05
521	002939	长城证券	122,000	991,860.00	0.05
522	600535	天士力	68,300	991,033.00	0.05
523	002926	华西证券	119,200	990,552.00	0.05
524	300748	金力永磁	32,800	981,376.00	0.05
525	000547	航天发展	97,900	979,000.00	0.05
526	600258	首旅酒店	51,400	974,030.00	0.05
527	300244	迪安诊断	38,000	973,940.00	0.05
528	603233	大参林	34,720	972,507.20	0.05
529	600416	湘电股份	50,600	965,954.00	0.05
530	000893	亚钾国际	42,100	965,774.00	0.05
531	000750	国海证券	287,790	964,096.50	0.05
532	688200	华峰测控	6,300	963,900.00	0.05
533	600329	达仁堂	21,400	960,646.00	0.05
534	002414	高德红外	123,611	960,457.47	0.05
535	000039	中集集团	139,100	958,399.00	0.05
536	600008	首创环保	332,690	958,147.20	0.05
537	000060	中金岭南	200,400	951,900.00	0.05
538	601155	新城控股	66,000	951,060.00	0.05
539	603156	养元饮品	38,332	946,800.40	0.05
540	000970	中科三环	73,710	944,962.20	0.05
541	002429	兆驰股份	171,100	941,050.00	0.05
542	002557	洽洽食品	22,600	939,030.00	0.05

543	603160	汇顶科技	20,300	938,875.00	0.05
544	603456	九洲药业	34,100	933,658.00	0.05
545	600025	华能水电	130,800	932,604.00	0.05
546	603893	瑞芯微	12,800	932,480.00	0.05
547	601991	大唐发电	280,000	926,800.00	0.05
548	000830	鲁西化工	87,200	920,832.00	0.05
549	600369	西南证券	251,300	917,245.00	0.05
550	600390	五矿资本	170,100	915,138.00	0.05
551	600435	北方导航	79,400	912,306.00	0.05
552	002508	老板电器	36,000	910,440.00	0.05
553	002500	山西证券	162,980	909,428.40	0.05
554	002936	郑州银行	393,543	905,148.90	0.05
555	300558	贝达药业	18,800	902,964.00	0.05
556	601880	辽港股份	576,500	899,340.00	0.05
557	002128	电投能源	68,000	898,960.00	0.05
558	600398	海澜之家	130,600	898,528.00	0.05
559	603658	安图生物	17,350	897,515.50	0.05
560	300009	安科生物	88,540	885,400.00	0.05
561	300070	碧水源	164,500	881,720.00	0.05
562	002153	石基信息	62,657	877,198.00	0.04
563	600038	中直股份	22,000	876,040.00	0.04
564	601717	郑煤机	70,000	871,500.00	0.04
565	600848	上海临港	72,600	867,570.00	0.04



566	600985	淮北矿业	75,200	866,304.00	0.04
567	300026	红日药业	159,200	862,864.00	0.04
568	603858	步长制药	41,800	860,662.00	0.04
569	300529	健帆生物	37,000	857,660.00	0.04
570	000050	深天马A	92,800	851,904.00	0.04
571	002572	索菲亚	48,800	850,096.00	0.04
572	601179	中国西电	156,500	846,665.00	0.04
573	300957	贝泰妮	9,500	844,360.00	0.04
574	600606	绿地控股	306,275	842,256.25	0.04
575	002244	滨江集团	95,000	837,900.00	0.04
576	600673	东阳光	115,300	831,313.00	0.04
577	002266	浙富控股	200,300	827,239.00	0.04
578	688779	长远锂科	73,100	823,837.00	0.04
579	688116	天奈科技	18,000	823,500.00	0.04
580	600895	张江高科	59,123	822,992.16	0.04
581	601456	国联证券	90,300	821,730.00	0.04
582	002408	齐翔腾达	128,980	821,602.60	0.04
583	603127	昭衍新药	20,060	820,454.00	0.04
584	688188	上海柏楚电子科技	4,351	820,424.56	0.04
585	603195	公牛集团	8,520	818,431.20	0.04
586	601958	金钼股份	73,400	818,410.00	0.04
587	003035	南网能源	114,700	816,664.00	0.04
588	600566	济川药	28,107	816,227.28	0.04

		业			
589	600667	太极实业	112,200	814,572.00	0.04
590	300373	扬杰科技	20,000	811,400.00	0.04
591	002019	亿帆医药	55,400	808,840.00	0.04
592	600827	百联股份	60,400	807,548.00	0.04
593	688187	时代电气	19,200	803,712.00	0.04
594	603267	鸿远电子	12,300	803,190.00	0.04
595	000155	川能动力	55,600	800,640.00	0.04
596	002958	青农商行	294,100	799,952.00	0.04
597	688538	和辉光电	314,800	799,592.00	0.04
598	601666	平煤股份	106,000	799,240.00	0.04
599	600208	新潮中宝	321,400	797,072.00	0.04
600	600282	南钢股份	236,500	797,005.00	0.04
601	600171	上海贝岭	43,600	795,700.00	0.04
602	601000	唐山港	223,900	790,367.00	0.04
603	000739	普洛药业	44,500	789,430.00	0.04
604	002155	湖南黄金	64,700	789,340.00	0.04
605	600755	厦门国贸	101,900	788,706.00	0.04
606	688065	凯赛生物	12,660	788,211.60	0.04
607	300357	我武生物	23,400	786,942.00	0.04
608	000887	中鼎股份	60,100	786,709.00	0.04
609	002670	国盛金控	87,800	770,884.00	0.04
610	300677	英科医	34,940	768,680.00	0.04

		疗			
611	600316	洪都航空	32,700	766,815.00	0.04
612	600959	江苏有线	226,700	766,246.00	0.04
613	600378	昊华科技	20,300	764,092.00	0.04
614	300888	稳健医疗	18,180	757,560.60	0.04
615	300115	长盈精密	63,240	753,188.40	0.04
616	600315	上海家化	25,900	751,359.00	0.04
617	002487	大金重工	24,300	749,412.00	0.04
618	600056	中国医药	57,667	748,517.66	0.04
619	601231	环旭电子	50,000	748,000.00	0.04
620	603026	胜华新材	12,600	746,550.00	0.04
621	002030	达安基因	74,432	742,087.04	0.04
622	603218	日月股份	39,000	740,610.00	0.04
623	600582	天地科技	126,900	739,827.00	0.04
624	300363	博腾股份	25,000	739,750.00	0.04
625	688082	盛美上海半导体	6,700	739,680.00	0.04
626	600517	国网英大	129,700	739,290.00	0.04
627	601866	中远海发	299,300	739,271.00	0.04
628	000778	新兴铸管	180,900	738,072.00	0.04
629	600131	国网信通	36,500	736,935.00	0.04
630	000598	兴蓉环境	135,300	734,679.00	0.04
631	002249	大洋电机	127,600	727,320.00	0.04

632	600598	北大荒	54,400	725,152.00	0.04
633	000987	越秀资本	114,005	723,931.75	0.04
634	002221	东华能源	83,500	722,275.00	0.04
635	002326	永太科技	47,200	721,688.00	0.04
636	000027	深圳能源	109,200	719,628.00	0.04
637	300251	光线传媒	88,700	717,583.00	0.04
638	601005	重庆钢铁	506,500	709,100.00	0.04
639	000709	河钢股份	312,500	706,250.00	0.04
640	600906	财达证券	98,000	705,600.00	0.04
641	601106	中国一重	209,794	704,907.84	0.04
642	002183	怡亚通	137,300	700,230.00	0.04
643	600718	东软集团	65,600	699,296.00	0.04
644	002518	科士达	17,400	696,174.00	0.04
645	002831	裕同科技	28,300	690,237.00	0.04
646	000883	湖北能源	151,300	689,928.00	0.04
647	002985	北摩高科	15,610	688,713.20	0.04
648	601992	金隅集团	315,020	686,743.60	0.04
649	600373	中文传媒	51,100	680,652.00	0.03
650	601665	齐鲁银行	173,200	678,944.00	0.03
651	000825	太钢不锈	175,200	678,024.00	0.03
652	002690	美亚光电	26,262	676,246.50	0.03
653	601778	晶科科技	136,800	675,792.00	0.03
654	600901	江苏金	163,580	675,585.40	0.03

		租			
655	603568	伟明环保	38,475	673,697.25	0.03
656	002511	中顺洁柔	60,300	672,345.00	0.03
657	600663	陆家嘴	67,700	668,199.00	0.03
658	300776	帝尔激光	10,240	664,576.00	0.03
659	603228	景旺电子	25,880	663,822.00	0.03
660	600967	内蒙一机	65,700	663,570.00	0.03
661	600737	中粮糖业	81,900	659,295.00	0.03
662	601928	凤凰传媒	57,500	655,500.00	0.03
663	603225	新凤鸣	58,500	646,425.00	0.03
664	600155	华创云信	103,800	645,636.00	0.03
665	603883	老百姓	21,596	644,640.60	0.03
666	600297	广汇汽车	309,600	643,968.00	0.03
667	688208	道通科技	21,200	642,572.00	0.03
668	002468	申通快递	58,700	635,134.00	0.03
669	600801	华新水泥	51,400	634,790.00	0.03
670	300482	万孚生物	23,770	632,995.10	0.03
671	000012	南玻A	106,000	631,760.00	0.03
672	601098	中南传媒	54,200	628,720.00	0.03
673	688281	华秦科技实业	3,100	627,750.00	0.03
674	300861	美畅股份	14,400	624,528.00	0.03
675	001227	兰州银行	218,000	623,480.00	0.03
676	002745	木林森	67,600	621,920.00	0.03
677	600500	中化国际	111,044	617,404.64	0.03

678	002791	坚朗五金	9,500	614,745.00	0.03
679	601698	中国卫通	30,900	614,292.00	0.03
680	688778	厦钨新能源	12,400	613,800.00	0.03
681	000156	华数传媒	70,300	611,610.00	0.03
682	600871	石化油服	307,700	609,246.00	0.03
683	603866	桃李面包	60,188	609,102.56	0.03
684	603529	爱玛科技	18,900	608,958.00	0.03
685	601808	中海油服	43,600	605,168.00	0.03
686	000401	冀东水泥	81,500	600,655.00	0.03
687	000581	威孚高科	38,000	598,500.00	0.03
688	002867	周大生	33,300	592,074.00	0.03
689	601118	海南橡胶	131,800	590,464.00	0.03
690	002032	苏泊尔	11,800	590,000.00	0.03
691	002250	联化科技	55,700	582,622.00	0.03
692	600556	天下秀	82,100	582,089.00	0.03
693	301029	怡合达	13,000	580,840.00	0.03
694	601611	中国核建	68,700	580,515.00	0.03
695	688690	纳微科技	14,900	578,865.00	0.03
696	600022	山东钢铁	404,200	573,964.00	0.03
697	000930	中粮科技	70,700	572,670.00	0.03
698	000785	居然之家	150,100	571,881.00	0.03
699	002010	传化智联	107,200	570,304.00	0.03
700	688276	长春百克生物	9,100	569,660.00	0.03

		科技			
701	000800	一汽解放	67,800	567,486.00	0.03
702	688520	神州细胞集团公司	9,900	561,726.00	0.03
703	002423	中粮资本	69,900	559,200.00	0.03
704	601598	中国外运	119,300	555,938.00	0.03
705	002505	鹏都农牧	293,700	555,093.00	0.03
706	300850	新强联	14,800	553,224.00	0.03
707	600259	广晟有色	15,300	552,942.00	0.03
708	601608	中信重工	131,200	552,352.00	0.03
709	600062	华润双鹤	31,700	552,214.00	0.03
710	000559	万向钱潮	101,100	550,995.00	0.03
711	688006	浙江杭可科技	18,000	548,460.00	0.03
712	688029	南微医学科技	6,705	546,859.80	0.03
713	600782	新钢股份	146,800	544,628.00	0.03
714	002081	金螳螂	120,600	543,906.00	0.03
715	600597	光明乳业	52,000	540,800.00	0.03
716	000089	深圳机场	77,600	539,320.00	0.03
717	300979	华利集团	11,000	536,140.00	0.03
718	605499	东鹏饮料	3,100	535,990.00	0.03
719	300618	寒锐钴业	16,400	531,524.00	0.03
720	603826	坤彩科技	10,600	530,000.00	0.03
721	000958	电投产融	121,900	527,827.00	0.03

722	603638	艾迪精密	25,640	526,132.80	0.03
723	600339	中油工程	129,100	525,437.00	0.03
724	600707	彩虹股份	109,700	522,172.00	0.03
725	600095	湘财股份	66,600	519,480.00	0.03
726	601236	红塔证券	68,760	512,262.00	0.03
727	000937	冀中能源	80,200	511,676.00	0.03
728	600409	三友化工	93,500	509,575.00	0.03
729	601187	厦门银行	101,000	507,020.00	0.03
730	688052	纳芯微电子	3,200	506,784.00	0.03
731	000898	鞍钢股份	181,100	503,458.00	0.03
732	002761	浙江建投	32,700	496,386.00	0.03
733	603707	健友股份	36,752	496,152.00	0.03
734	000537	广宇发展	42,300	493,641.00	0.03
735	601718	际华集团	166,200	493,614.00	0.03
736	688107	安路科技	8,900	492,971.00	0.03
737	000967	盈峰环境	97,500	492,375.00	0.03
738	000415	渤海租赁	233,400	490,140.00	0.03
739	600507	方大特钢	105,462	488,289.06	0.02
740	001914	招商积余	32,200	484,610.00	0.02
741	600167	联美控股	69,400	483,718.00	0.02
742	600968	海油发展	155,700	477,999.00	0.02
743	000563	陕国投A	156,700	477,935.00	0.02



744	601568	北元集团	90,040	474,510.80	0.02
745	601156	东航物流	36,100	469,300.00	0.02
746	600808	马钢股份	182,400	468,768.00	0.02
747	688234	天岳先进	6,300	465,822.00	0.02
748	002925	盈趣科技	23,890	463,466.00	0.02
749	300257	开山股份	30,200	458,134.00	0.02
750	002705	新宝股份	25,300	456,159.00	0.02
751	300442	润泽科技	14,700	452,172.00	0.02
752	600195	中牧股份	38,652	451,455.36	0.02
753	600126	杭钢股份	103,900	450,926.00	0.02
754	603379	三美股份	18,800	441,988.00	0.02
755	600764	中国海防	15,800	430,076.00	0.02
756	002608	江苏国信	56,800	429,976.00	0.02
757	603650	彤程新材	13,000	426,400.00	0.02
758	000959	首钢股份	118,400	414,400.00	0.02
759	000402	金融街	90,300	408,156.00	0.02
760	688185	康希诺生物	4,930	401,795.00	0.02
761	002653	海思科	16,900	398,840.00	0.02
762	603786	科博达	6,000	394,200.00	0.02
763	601828	美凯龙	81,900	392,301.00	0.02
764	002110	三钢闽光	92,600	390,772.00	0.02
765	001203	大中矿业	35,000	388,850.00	0.02
766	002563	森马服饰	61,800	384,396.00	0.02

767	688289	圣湘生物	22,200	373,848.00	0.02
768	601298	青岛港	53,600	373,592.00	0.02
769	600377	宁沪高速	37,600	369,608.00	0.02
770	601228	广州港	114,200	368,866.00	0.02
771	603056	德邦股份	23,900	368,538.00	0.02
772	688819	天能电池集团股份	9,900	364,716.00	0.02
773	000031	大悦城	98,800	361,608.00	0.02
774	600927	永安期货	22,200	360,972.00	0.02
775	600623	华谊集团	57,701	359,477.23	0.02
776	603317	天味食品	24,400	356,484.00	0.02
777	600928	西安银行	100,600	354,112.00	0.02
778	601869	长飞光纤	9,300	344,193.00	0.02
779	600350	山东高速	51,900	330,603.00	0.02
780	002399	海普瑞	28,500	326,895.00	0.02
781	601136	首创证券	22,900	324,493.00	0.02
782	601139	深圳燃气	44,300	322,947.00	0.02
783	601969	海南矿业	47,900	315,182.00	0.02
784	000869	张裕 A	10,100	309,666.00	0.02
785	001872	招商港口	17,900	309,133.00	0.02
786	600995	南网储能	26,700	293,967.00	0.02
787	000553	安道麦 A	33,900	286,116.00	0.01
788	002945	华林证券	20,700	283,176.00	0.01
789	688105	诺唯赞生物	9,000	274,410.00	0.01
790	001289	龙源电	11,200	252,000.00	0.01

		力			
791	600299	安迪苏	31,400	250,258.00	0.01
792	601158	重庆水务	44,400	246,864.00	0.01
793	688248	南方电网电力科技	6,200	238,018.00	0.01
794	603355	莱克电气	9,000	228,690.00	0.01
795	603868	飞科电器	3,500	220,815.00	0.01
796	688295	中复神鹰碳纤维	5,900	216,412.00	0.01
797	600956	新天绿能	24,000	209,280.00	0.01
798	600032	浙江新能	16,000	200,960.00	0.01
799	300741	华宝股份	9,100	194,922.00	0.01
800	002901	大博医疗	4,200	130,536.00	0.01

### 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	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
2	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
3	688484	南芯科技	916	33,626.36	0.00
4	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
5	301260	格力博	1,328	31,380.64	0.00
6	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
7	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
8	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
9	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
10	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
11	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
12	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00

13	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
14	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
15	688535	华海诚科 新材料	161	8,248.03	0.00
16	601133	柏诚系统 股份公司	664	8,140.64	0.00
17	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
18	603125	江苏常青 树科技	160	3,924.80	0.00
19	000540	*ST 中天	371,600	3,716.00	0.00
20	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
21	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
22	601065	江西省盐 业集团	88	1,041.92	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	300750	宁德时代	6,979,061.80	0.37
2	000858	五粮液	3,352,953.00	0.18
3	002594	比亚迪	3,085,060.00	0.16
4	600028	中国石化	2,628,740.00	0.14
5	000333	美的集团	2,552,602.00	0.14
6	600941	中国移动	2,468,364.00	0.13
7	600732	爱旭股份	2,133,084.00	0.11
8	600905	三峡能源	2,110,728.00	0.11
9	002463	沪电股份	2,060,520.00	0.11
10	000066	中国长城	2,047,307.00	0.11
11	300059	东方财富	1,982,364.60	0.11
12	000423	东阿阿胶	1,811,852.00	0.10
13	300760	迈瑞医疗	1,785,888.46	0.10
14	002371	北方华创	1,738,147.00	0.09
15	600372	中航电子	1,705,974.47	0.09
16	688223	晶科能源	1,704,154.60	0.09
17	000983	山西焦煤	1,699,436.00	0.09
18	000933	神火股份	1,694,293.00	0.09
19	002240	盛新锂能	1,678,447.00	0.09
20	601818	光大银行	1,608,444.00	0.09

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	6,412,646.60	0.34
2	600900	长江电力	3,018,765.00	0.16
3	002594	比亚迪	3,011,111.00	0.16
4	000858	五粮液	2,906,680.00	0.16
5	002602	世纪华通	2,804,370.00	0.15
6	000333	美的集团	2,184,638.00	0.12
7	603345	安井食品	2,107,420.00	0.11
8	000999	华润三九	2,097,208.00	0.11
9	688122	西部超导	2,019,672.46	0.11
10	002371	北方华创	1,945,735.00	0.10
11	600519	贵州茅台	1,835,386.00	0.10
12	002603	以岭药业	1,814,865.20	0.10
13	300059	东方财富	1,776,014.24	0.09
14	603605	珀莱雅	1,755,302.20	0.09
15	300760	迈瑞医疗	1,683,957.00	0.09
16	300168	万达信息	1,608,834.00	0.09
17	002415	海康威视	1,600,906.00	0.09
18	603606	东方电缆	1,548,371.00	0.08
19	603613	国联股份	1,542,077.00	0.08
20	000651	格力电器	1,509,942.00	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	236,487,396.97
卖出股票收入（成交）总额	187,233,388.18

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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,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	6,740,011.53
2	应收清算款	78,395.31
3	应收股利	41,798.55
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	23,210.05
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,883,415.44

#### 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

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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	301358	湖南裕能	86,766.47	0.00	新股流通受限
2	001286	陕西能源	35,447.47	0.00	新股流通受限
3	688484	南芯科技	33,626.36	0.00	新股流通受限
4	301301	川宁生物	32,023.04	0.00	新股流通受限
5	301260	格力博	31,380.64	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 (%)
4,152	432,908.77	1,615,450,610.00	89.88	181,986,588.00	10.12	26,150,000.00	1.45

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	72.75
2	张虹	75,136,019.00	4.18
3	光大理财有限责任公司—阳光橙增盈绝对收益策略	68,780,600.00	3.83
4	香港中央结算有限公司	43,875,500.00	2.44
5	大家保险集团有限责任公司—自有资金	35,817,600.00	1.99
6	中原证券股份有限公司	18,800,000.00	1.05
7	兴业证券股份有限公司	11,037,900.00	0.61
8	中信建投证券股份有限公司	10,084,758.00	0.56
9	广发证券股份有限公司	8,808,234.00	0.49
10	招商证券股份有限公司	8,552,791.00	0.48
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	26,150,000.00	1.45

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	200,000.00	0.01

## 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	1,745,437,198.00
本报告期基金总申购份额	216,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	164,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,797,437,198.00

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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

### 10.6.2 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，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到稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
海通证券	2	207,638,147.09	49.52	108,240.55	57.51	
中泰证券	1	181,840,794.57	43.36	58,425.14	31.04	
东方证券	2	29,852,376.34	7.12	21,533.97	11.44	
广发证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	3	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例 (%)		购成交 总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)
海通 证券	148,215.36	22.02	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	524,980.78	77.98	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 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，同一基金管理人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：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：中信建投证券（北交所单元）。

## 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旗下基金 2022 年第四季度报告	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	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 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	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	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	2023 年 04 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 17 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		区间					
机构	1	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	72.75
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

2023 年 08 月 31 日