

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 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
3.3 其他指标	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,365,469,931.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司		中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	王小飞
	联系电话	(010)65215588	021-60637103
	电子邮箱	service@jsfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-600-8800		021-60637228
传真	(010)65215588		021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元		北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层		北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100020		100033
法定代表人	经雷		张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-139,129,577.05
本期利润	-702,509,181.43
加权平均基金份额本期利润	-0.3573
本期加权平均净值利润率	-6.50%
本期基金份额净值增长率	-8.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,715,326,332.97
期末可供分配基金份额利润	1.9934
期末基金资产净值	12,265,745,850.21
期末基金份额净值	5.1853
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	62.46%

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

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

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

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

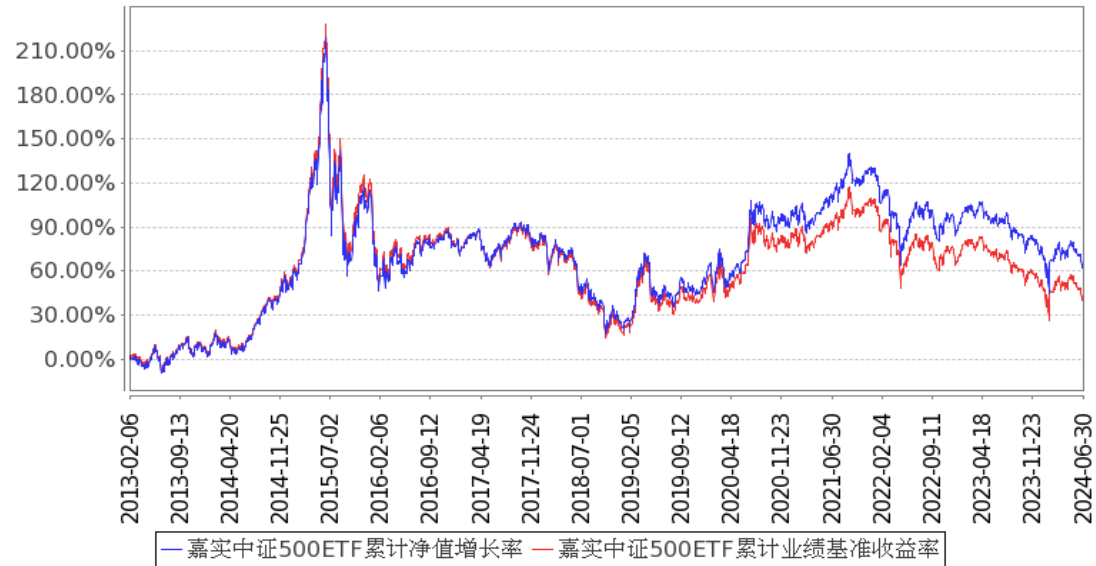
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-6.40%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.49%	0.00%
过去三个月	-5.50%	1.14%	-6.50%	1.14%	1.00%	0.00%
过去六个月	-8.08%	1.60%	-8.96%	1.61%	0.88%	-0.01%
过去一年	-16.53%	1.27%	-17.60%	1.27%	1.07%	0.00%
过去三年	-23.30%	1.19%	-27.40%	1.20%	4.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	62.46%	1.55%	40.39%	1.56%	22.07%	-0.01%

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

嘉实中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年02月06日至2024年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2024 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 351 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、 嘉实沪深 300ETF 联 接 (LOF)、 嘉实沪深 300ETF、 嘉实中证 500ETF 联 接、嘉实 国证通信 ETF 发起 联接、嘉 实 中 证 A50ETF 联 接基金经 理	2016 年 1 月 5 日	-	18 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。加拿大国籍。
李直	本基金、 嘉实基本 面 50 指数 (LOF)、嘉 实深证基 本 面 120ETF、 嘉实深证 基 本 面	2021 年 9 月 24 日	-	9 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

120ETF 联接、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实中证 2000ETF、嘉实中证大农业 ETF 发起联接、嘉实标普石油天然气勘探及生产精选行业 ETF (QDII)、嘉实中证 100ETF 基金经理				
--	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证小盘 500 指数，中证 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

回顾上半年，经济基本面呈现弱复苏态势。1-2 月信贷弱于预期，但制造业开始回暖；3-4 月制造业景气持续上升，出口改善拉动需求，经济超预期恢复；5、6 月制造业 PMI 稍有回落，至荣枯线以下，表明前期稳增长政策落地效果仍有待显现。市场走势方面，呈现为总体波动背景下的结构性行情：年初股市受到了较大的流动性冲击，但在大规模财政资金落地、出口持续改善、暂停新增转融通规模的影响下于春节后迅速恢复，超跌板块大都迎来反弹行情；近期制造业整体热度减退，但在消费电子需求提振、出口韧性及稳增长逻辑支持下，相关板块均有较好表现。回顾上半年海外经济，2 月美国 PCE 价格指数同比小幅反弹，但核心 PCE 同比延续降温趋势，符合

市场预期。在 4 月数据不及预期后，5 月、6 月制造业 PMI 均低于预期，表明美国制造业活动持续疲软。与此同时，美国通胀数据呈现降温趋势，市场降息预期抬升，市场整体上行。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差为 0.40%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.1853 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.08%，业绩比较基准收益率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及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基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	120,948,828.83	90,426,084.27
结算备付金		24,573,905.35	18,586,894.13
存出保证金		18,317,310.76	8,726,087.61
交易性金融资产	6.4.7.2	12,113,067,723.74	6,398,005,274.11
其中：股票投资		12,113,067,723.74	6,397,618,162.23
基金投资		-	-
债券投资		-	387,111.88
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		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		10,558,196.58	2,735,365.83
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	132,495.00
资产总计		12,287,465,965.26	6,518,612,200.95
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		16,065,295.46	43,756,882.74
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,541,574.45	668,986.74
应付托管费		513,858.14	222,995.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	21,302.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,599,387.00	2,827,862.96
负债合计		21,720,115.05	47,498,030.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	7,550,419,517.24	3,661,369,390.11
未分配利润	6.4.7.12	4,715,326,332.97	2,809,744,780.67
净资产合计		12,265,745,850.21	6,471,114,170.78
负债和净资产总计		12,287,465,965.26	6,518,612,200.95

注： 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 5.1853 元，基金份额总额 2,365,469,931.00 份。

6.2 利润表

会计主体： 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期： 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

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

		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-690,173,044.86	533,035,212.04
1. 利息收入		1,809,817.43	8,078,826.72
其中：存款利息收入	6.4.7.13	481,667.86	394,173.41
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		-	6,683.56
其他利息收入		1,328,149.57	7,677,969.75
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-145,067,527.67	203,219,081.70
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-309,051,525.56	144,195,000.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	584,574.46	791,265.31
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-2,733,786.18	-1,290,795.97
股利收益	6.4.7.19	166,133,209.61	59,523,611.91
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-563,379,604.38	313,524,216.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	16,464,269.76	8,213,087.21
减：二、营业总支出		12,336,136.57	6,488,974.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,962,843.01	4,134,812.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,654,281.01	1,378,270.99
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,783.38	38,826.78
8. 其他费用	6.4.7.23	1,714,229.17	937,063.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-702,509,181.43	526,546,237.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-702,509,181.43	526,546,237.87

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-702,509,181.43	526,546,237.87

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,661,369,390.11	-	2,809,744,780.67	6,471,114,170.78
二、本期期初净资产	3,661,369,390.11	-	2,809,744,780.67	6,471,114,170.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,889,050,127.13	-	1,905,581,552.30	5,794,631,679.43
(一)、综合收益总额	-	-	-702,509,181.43	-702,509,181.43
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,889,050,127.13	-	2,608,090,733.73	6,497,140,860.86
其中：1. 基金申购款	8,475,218,237.45	-	5,834,301,200.08	14,309,519,437.53
2. 基金赎回款	-4,586,168,110.32	-	-3,226,210,466.35	-7,812,378,576.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,550,419,517.24	-	4,715,326,332.97	12,265,745,850.21

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,399,344,102.25	—	3,856,099,128.04	8,255,443,230.29
二、本期期初净资产	4,399,344,102.25	—	3,856,099,128.04	8,255,443,230.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,101,854,978.05	—	-735,856,020.57	-1,837,710,998.62
(一)、综合收益总额	—	—	526,546,237.87	526,546,237.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,101,854,978.05	—	-1,262,402,258.44	-2,364,257,236.49
其中：1. 基金申购款	3,069,361,954.29	—	2,950,286,674.98	6,019,648,629.27
2. 基金赎回款	-4,171,216,932.34	—	-4,212,688,933.42	-8,383,905,865.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	—	—
四、本期期末净资产	3,297,489,124.20	—	3,120,243,107.47	6,417,732,231.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷
基金管理人负责人

梁凯
主管会计工作负责人

李袁
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	120,948,828.83
等于：本金	120,937,118.23
加：应计利息	11,710.60
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	120,948,828.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		12,942,513,595.56	-	12,113,067,723.74	-829,445,871.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		12,942,513,595.56	-	12,113,067,723.74	-829,445,871.82

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 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	147,231,440.00	-	-	-
其中：股指期货投资	147,231,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	147,231,440.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	143.00	139,430,720.00	-7,800,720.00
合计				-7,800,720.00
减：可抵销期货暂收款				-7,800,720.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,523,241.32
其中：交易所市场	2,523,241.32
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	117,355.42
应付指数使用费	958,790.26
合计	3,599,387.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,147,069,931.00	3,661,369,390.11
本期申购	2,655,200,000.00	8,475,218,237.45
本期赎回（以“-”号填列）	-1,436,800,000.00	-4,586,168,110.32
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	2,365,469,931.00	7,550,419,517.24

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,838,775,411.55	-2,029,030,630.88	2,809,744,780.67
本期期初	4,838,775,411.55	-2,029,030,630.88	2,809,744,780.67
本期利润	-139,129,577.05	-563,379,604.38	-702,509,181.43
本期基金份额交易产生的变动数	4,734,301,204.15	-2,126,210,470.42	2,608,090,733.73
其中：基金申购款	10,491,371,182.97	-4,657,069,982.89	5,834,301,200.08
基金赎回款	-5,757,069,978.82	2,530,859,512.47	-3,226,210,466.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,433,947,038.65	-4,718,620,705.68	4,715,326,332.97

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	194,123.88
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	277,022.91
其他	10,521.07
合计	481,667.86

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-186,139,196.83
股票投资收益——赎回差价收入	-122,912,328.73
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	-309,051,525.56

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	6,351,158,338.11
减：卖出股票成本总额	6,528,697,841.18
减：交易费用	8,599,693.76
买卖股票差价收入	-186,139,196.83

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	7,812,378,576.67
减：现金支付赎回款总额	3,869,341,215.67
减：赎回股票成本总额	4,065,949,689.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	-122,912,328.73

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	317.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	584,256.50

券到期兑付) 差价收入	
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	584,574.46

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,832,809.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,248,100.00
减：应计利息总额	339.27
减：交易费用	113.28
买卖债券差价收入	584,256.50

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-2,733,786.18

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	166,133,209.61
其中：证券出借权益补偿收入	45,658.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	166,133,209.61

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-556,488,764.38
股票投资	-556,488,764.38
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	-6,890,840.00
权证投资	-
期货投资	-6,890,840.00
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	-563,379,604.38

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	16,464,269.76
合计	16,464,269.76

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	57,683.08
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	728.52
指数使用费	1,592,568.58
存托服务费	3,576.65
合计	1,714,229.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 联接”）	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,962,843.01	4,134,812.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	124,103.22	-
应支付基金管理人的净管理费	7,838,739.79	4,134,812.88

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,654,281.01	1,378,270.99

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
嘉 实 中 证 500ETF联接	396,068,651.00	16.74	382,468,608.00	33.34

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	120,948,828.83	194,123.88	73,745,343.85	110,173.10

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
无。

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
400174	中天3	2023 年 8 月 30 日	重大事项停牌	0.40	-	-	3,046,725	4,150,777.45	1,218,690.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购
无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购
无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券
无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风

险并提出防控措施并有效执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	387,111.88
未评级	-	-
合计	-	387,111.88

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	120,948,828.83	-	-	-	120,948,828.83
结算备付金	24,573,905.35	-	-	-	24,573,905.35
存出保证金	1,585,624.36	-	-	16,731,686.40	18,317,310.76
交易性金融资产	-	-	-	12,113,067,723.74	12,113,067,723.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,558,196.58	10,558,196.58
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	147,108,358.54	-	-	12,140,357,606.72	12,287,465,965.26
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	-	-	-	16,065,295.46	16,065,295.46
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,541,574.45	1,541,574.45
应付托管费	-	-	-	513,858.14	513,858.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,599,387.00	3,599,387.00
负债总计	-	-	-	21,720,115.05	21,720,115.05
利率敏感度缺口	147,108,358.54	-	-	12,118,637,491.67	12,265,745,850.21
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	90,426,084.27	-	-	-	90,426,084.27
结算备付金	18,586,894.13	-	-	-	18,586,894.13
存出保证金	918,407.61	-	-	7,807,680.00	8,726,087.61
交易性金融资产	-	-	387,111.88	6,397,618,162.23	6,398,005,274.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,735,365.83	2,735,365.83
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	132,495.00	132,495.00
资产总计	109,931,386.01	-	387,111.88	6,408,293,703.06	6,518,612,200.95
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	-	-	-	43,756,882.74	43,756,882.74
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	668,986.74	668,986.74
应付托管费	-	-	-	222,995.56	222,995.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21,302.17	21,302.17
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,827,862.96	2,827,862.96
负债总计	-	-	-	47,498,030.17	47,498,030.17
利率敏感度缺口	109,931,386.01	-	387,111.88	6,360,795,672.89	6,471,114,170.78

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-5,557.29
	市场利率下降 25 个基点	-	5,652.70

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023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	12, 113, 067, 723. 74	98. 76	6, 397, 618, 162. 23	98. 86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	12, 113, 067, 723. 74	98. 76	6, 397, 618, 162. 23	98. 86

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	611, 355, 158. 90	322, 785, 620. 14
	业绩比较基准下降 5%	-611, 355, 158. 90	-322, 785, 620. 14

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	12,111,849,033.74	6,393,016,202.12
第二层次	—	387,111.88
第三层次	1,218,690.00	4,601,960.11
合计	12,113,067,723.74	6,398,005,274.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,113,067,723.74	98.58
	其中：股票	12,113,067,723.74	98.58
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	145,522,734.18	1.18
8	其他各项资产	28,875,507.34	0.23
9	合计	12,287,465,965.26	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	75,938,330.55	0.62
B	采矿业	566,191,994.23	4.62
C	制造业	7,659,723,731.03	62.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	487,674,080.73	3.98
E	建筑业	123,262,093.72	1.00
F	批发和零售业	257,162,247.14	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	243,798,509.37	1.99
H	住宿和餐饮业	38,339,674.21	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	860,451,379.58	7.02
J	金融业	1,125,681,138.91	9.18
K	房地产业	136,970,829.66	1.12
L	租赁和商务服务业	92,471,137.75	0.75
M	科学研究和技术服务业	96,953,650.67	0.79

N	水利、环境和公共设施管理业	54,934,182.93	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	13,474,098.00	0.11
Q	卫生和社会工作	75,077,590.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	182,086,567.50	1.48
S	综合	21,657,813.76	0.18
	合计	12,111,849,049.74	98.75

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	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	1,218,690.00	0.01
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	1,218,690.00	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	1,449,740	153,020,057.00	1.25
2	002028	思源电气	1,258,050	84,163,545.00	0.69
3	601058	赛轮轮胎	5,369,700	75,175,800.00	0.61
4	688169	石头科技	188,324	73,936,002.40	0.60
5	600066	宇通客车	2,711,100	69,946,380.00	0.57
6	002340	格林美	10,482,900	66,776,073.00	0.54
7	000933	神火股份	3,213,900	65,017,197.00	0.53
8	601077	渝农商行	12,651,500	63,510,530.00	0.52
9	000988	华工科技	2,051,851	61,411,900.43	0.50
10	601168	西部矿业	3,404,842	61,116,913.90	0.50
11	300394	天孚通信	678,600	60,001,812.00	0.49
12	002384	东山精密	2,792,044	57,795,310.80	0.47
13	000423	东阿阿胶	919,699	57,573,157.40	0.47
14	000630	铜陵有色	15,667,900	56,561,119.00	0.46
15	600418	江淮汽车	3,566,586	56,494,722.24	0.46
16	600988	赤峰黄金	3,396,300	55,495,542.00	0.45
17	601233	桐昆股份	3,445,000	54,982,200.00	0.45
18	600157	永泰能源	45,352,000	53,515,360.00	0.44
19	002625	光启技术	3,078,940	53,419,609.00	0.44
20	600096	云天化	2,621,600	50,911,472.00	0.42
21	601567	三星医疗	1,440,900	50,431,500.00	0.41
22	000400	许继电气	1,456,675	50,124,186.75	0.41
23	688777	中控技术	1,290,217	48,641,180.90	0.40
24	002156	通富微电	2,161,790	48,402,478.10	0.39
25	002128	电投能源	2,287,655	48,269,520.50	0.39
26	002273	水晶光电	2,838,490	48,197,560.20	0.39
27	601555	东吴证券	8,113,770	47,871,243.00	0.39
28	002078	太阳纸业	3,422,440	47,743,038.00	0.39
29	600885	宏发股份	1,702,570	47,127,137.60	0.38
30	601128	常熟银行	6,153,842	46,584,583.94	0.38
31	002532	天山铝业	5,696,965	46,202,386.15	0.38
32	002223	鱼跃医疗	1,227,910	46,169,416.00	0.38
33	300207	欣旺达	3,041,300	46,136,521.00	0.38
34	600352	浙江龙盛	5,312,800	45,636,952.00	0.37
35	600398	海澜之家	4,902,300	45,297,252.00	0.37
36	002138	顺络电子	1,645,714	45,191,306.44	0.37
37	002966	苏州银行	5,988,142	44,911,065.00	0.37
38	002353	杰瑞股份	1,254,136	43,995,090.88	0.36

39	601108	财通证券	6,635,800	43,862,638.00	0.36
40	688617	惠泰医疗	95,565	43,587,196.50	0.36
41	600765	中航重机	2,116,510	43,176,804.00	0.35
42	002185	华天科技	5,231,962	42,640,490.30	0.35
43	002517	恺英网络	4,393,200	41,955,060.00	0.34
44	600879	航天电子	5,388,084	41,865,412.68	0.34
45	603606	东方电缆	842,800	41,137,068.00	0.34
46	301236	软通动力	1,166,867	41,085,387.07	0.33
47	600873	梅花生物	4,076,200	40,843,524.00	0.33
48	688099	晶晨股份	682,055	40,459,502.60	0.33
49	600177	雅戈尔	5,668,900	40,362,568.00	0.33
50	601577	长沙银行	4,926,000	40,294,680.00	0.33
51	600109	国金证券	5,304,900	40,051,995.00	0.33
52	600079	人福医药	2,332,500	40,049,025.00	0.33
53	002738	中矿资源	1,489,230	39,911,364.00	0.33
54	300003	乐普医疗	2,684,540	39,838,573.60	0.32
55	600060	海信视像	1,598,557	39,548,300.18	0.32
56	300017	网宿科技	4,981,600	39,354,640.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	7,275,500	38,851,170.00	0.32
58	300136	信维通信	1,975,563	38,681,523.54	0.32
59	603160	汇顶科技	560,900	38,561,875.00	0.31
60	603979	金诚信	756,631	38,232,564.43	0.31
61	002202	金风科技	5,635,700	37,871,904.00	0.31
62	002739	万达电影	3,114,500	37,654,305.00	0.31
63	689009	九号公司	1,021,146	37,588,384.26	0.31
64	000932	华菱钢铁	8,462,041	37,486,841.63	0.31
65	688120	华海清科	195,089	36,984,972.62	0.30
66	000683	远兴能源	5,331,000	36,837,210.00	0.30
67	600985	淮北矿业	2,198,824	36,808,313.76	0.30
68	600536	中国软件	1,228,525	36,757,468.00	0.30
69	002465	海格通信	3,546,300	36,739,668.00	0.30
70	600348	华阳股份	3,682,300	36,675,708.00	0.30
71	002409	雅克科技	582,800	36,663,948.00	0.30
72	002444	巨星科技	1,472,084	36,360,474.80	0.30
73	002281	光迅科技	972,323	36,335,710.51	0.30
74	000009	中国宝安	4,212,117	36,224,206.20	0.30
75	002008	大族激光	1,718,100	35,736,480.00	0.29
76	000878	云南铜业	2,862,800	35,670,488.00	0.29
77	002436	兴森科技	3,448,800	35,591,616.00	0.29
78	688122	西部超导	927,766	35,551,993.12	0.29
79	300474	景嘉微	561,723	35,517,745.29	0.29
80	600642	申能股份	3,996,000	35,284,680.00	0.29
81	601615	明阳智能	3,710,000	35,022,400.00	0.29

82	002797	第一创业	6,862,100	34,928,089.00	0.28
83	000039	中集集团	3,760,802	34,825,026.52	0.28
84	300054	鼎龙股份	1,531,800	34,741,224.00	0.28
85	601990	南京证券	4,514,645	34,672,473.60	0.28
86	600298	安琪酵母	1,241,361	34,671,212.73	0.28
87	000066	中国长城	3,950,600	34,567,750.00	0.28
88	300012	华测检测	3,434,949	34,555,586.94	0.28
89	600529	山东药玻	1,354,985	34,335,319.90	0.28
90	601666	平煤股份	3,033,100	33,970,720.00	0.28
91	002673	西部证券	5,474,600	33,887,774.00	0.28
92	600839	四川长虹	7,538,200	33,846,518.00	0.28
93	603596	伯特利	867,240	33,735,636.00	0.28
94	688525	佰维存储	525,624	33,718,779.60	0.27
95	601179	中国西电	4,185,500	33,651,420.00	0.27
96	000831	中国稀土	1,300,000	32,955,000.00	0.27
97	000783	长江证券	6,772,500	32,711,175.00	0.27
98	300395	菲利华	1,060,900	32,622,675.00	0.27
99	601717	郑煤机	2,203,471	32,611,370.80	0.27
100	300002	神州泰岳	4,002,900	32,503,548.00	0.26
101	603816	顾家家居	1,006,360	32,495,364.40	0.26
102	002432	九安医疗	800,900	32,468,486.00	0.26
103	000728	国元证券	5,344,700	32,388,882.00	0.26
104	000738	航发控制	1,612,600	32,364,882.00	0.26
105	600862	中航高科	1,708,100	32,078,118.00	0.26
106	000703	恒逸石化	4,489,910	31,833,461.90	0.26
107	688180	君实生物	1,095,074	31,811,899.70	0.26
108	601198	东兴证券	3,958,700	31,511,252.00	0.26
109	601997	贵阳银行	5,970,900	31,466,643.00	0.26
110	000960	锡业股份	2,016,293	31,232,378.57	0.25
111	603338	浙江鼎力	516,600	31,212,972.00	0.25
112	002595	豪迈科技	816,985	31,184,317.45	0.25
113	603345	安井食品	418,800	31,121,028.00	0.25
114	002155	湖南黄金	1,717,417	31,085,247.70	0.25
115	688188	柏楚电子	168,127	31,027,837.85	0.25
116	600863	内蒙华电	6,662,100	30,912,144.00	0.25
117	601696	中银证券	3,402,200	30,891,976.00	0.25
118	601162	天风证券	14,151,600	30,850,488.00	0.25
119	300037	新宙邦	1,077,042	30,760,319.52	0.25
120	600038	中直股份	747,061	30,711,677.71	0.25
121	300724	捷佳伟创	568,530	30,706,305.30	0.25
122	300866	安克创新	431,100	30,698,631.00	0.25
123	600521	华海药业	1,796,500	30,630,325.00	0.25
124	000921	海信家电	946,300	30,508,712.00	0.25

125	002472	双环传动	1,381,100	30,411,822.00	0.25
126	603939	益丰药房	1,237,867	30,389,634.85	0.25
127	300001	特锐德	1,508,257	30,346,130.84	0.25
128	002984	森麒麟	1,259,280	30,336,055.20	0.25
129	002294	信立泰	1,137,735	30,297,883.05	0.25
130	600141	兴发集团	1,576,041	30,070,862.28	0.25
131	600549	厦门钨业	1,736,980	29,962,905.00	0.24
132	600699	均胜电子	2,013,400	29,838,588.00	0.24
133	002407	多氟多	2,436,406	29,797,245.38	0.24
134	600546	山煤国际	2,023,900	29,589,418.00	0.24
135	300699	光威复材	1,187,894	29,495,408.02	0.24
136	002850	科达利	385,428	29,438,990.64	0.24
137	600820	隧道股份	4,492,220	29,334,196.60	0.24
138	002262	恩华药业	1,234,200	29,299,908.00	0.24
139	600895	张江高科	1,580,362	29,205,089.76	0.24
140	301358	湖南裕能	926,800	29,157,128.00	0.24
141	600369	西南证券	8,138,600	29,136,188.00	0.24
142	002195	岩山科技	11,597,278	29,109,167.78	0.24
143	600872	中炬高新	1,282,739	29,105,347.91	0.24
144	300285	国瓷材料	1,627,948	29,058,871.80	0.24
145	002064	华峰化学	4,051,800	29,051,406.00	0.24
146	000021	深科技	1,910,492	28,886,639.04	0.24
147	603589	口子窖	735,174	28,811,469.06	0.23
148	600021	上海电力	2,874,800	28,431,772.00	0.23
149	601000	唐山港	6,048,666	28,428,730.20	0.23
150	603087	甘李药业	613,600	28,421,952.00	0.23
151	300073	当升科技	827,572	28,393,995.32	0.23
152	300146	汤臣倍健	2,082,641	28,219,785.55	0.23
153	600486	扬农化工	497,578	28,088,278.10	0.23
154	000513	丽珠集团	752,435	27,998,106.35	0.23
155	300058	蓝色光标	5,077,282	27,620,414.08	0.23
156	601966	玲珑轮胎	1,503,400	27,617,458.00	0.23
157	600704	物产中大	6,360,400	27,604,136.00	0.23
158	002756	永兴材料	770,640	27,573,499.20	0.22
159	600153	建发股份	3,066,300	27,382,059.00	0.22
160	603179	新泉股份	696,100	27,314,964.00	0.22
161	300114	中航电测	602,927	27,282,446.75	0.22
162	600155	华创云信	4,616,000	27,280,560.00	0.22
163	000830	鲁西化工	2,347,183	27,203,850.97	0.22
164	688065	凯赛生物	594,142	26,968,105.38	0.22
165	300529	健帆生物	988,734	26,903,452.14	0.22
166	600118	中国卫星	1,208,288	26,860,242.24	0.22
167	600583	海油工程	4,512,300	26,667,693.00	0.22

168	002558	巨人网络	2,819,800	26,618,912.00	0.22
169	002152	广电运通	2,535,035	26,516,466.10	0.22
170	601156	东航物流	1,296,500	26,383,775.00	0.22
171	000591	太阳能	5,585,200	26,306,292.00	0.21
172	000623	吉林敖东	1,943,388	26,041,399.20	0.21
173	600970	中材国际	2,156,877	26,011,936.62	0.21
174	002025	航天电器	559,600	25,954,248.00	0.21
175	300373	扬杰科技	665,200	25,876,280.00	0.21
176	002385	大北农	6,714,948	25,852,549.80	0.21
177	300144	宋城演艺	3,209,100	25,769,073.00	0.21
178	002439	启明星辰	1,491,707	25,746,862.82	0.21
179	600380	健康元	2,286,023	25,534,876.91	0.21
180	601216	君正集团	6,889,400	25,421,886.00	0.21
181	000729	燕京啤酒	2,876,530	25,399,759.90	0.21
182	605358	立昂微	1,096,240	25,366,993.60	0.21
183	000723	美锦能源	5,298,700	25,221,812.00	0.21
184	600143	金发科技	3,815,500	25,220,455.00	0.21
185	300251	光线传媒	2,994,300	25,182,063.00	0.21
186	600998	九州通	5,146,254	25,113,719.52	0.20
187	600282	南钢股份	5,033,400	25,066,332.00	0.20
188	000519	中兵红箭	1,707,529	25,049,450.43	0.20
189	600637	东方明珠	4,117,508	25,034,448.64	0.20
190	300677	英科医疗	925,259	24,806,193.79	0.20
191	300383	光环新网	2,935,519	24,805,135.55	0.20
192	600516	方大炭素	5,752,400	24,792,844.00	0.20
193	000636	风华高科	1,889,677	24,679,181.62	0.20
194	600392	盛和资源	2,862,170	24,671,905.40	0.20
195	300024	机器人	2,531,933	24,661,027.42	0.20
196	600763	通策医疗	456,100	24,652,205.00	0.20
197	000818	航锦科技	1,109,000	24,486,720.00	0.20
198	002958	青农商行	9,071,800	24,312,424.00	0.20
199	600909	华安证券	5,760,270	24,250,736.70	0.20
200	601665	齐鲁银行	4,935,300	24,232,323.00	0.20
201	002044	美年健康	6,391,900	24,161,382.00	0.20
202	600008	首创环保	8,990,930	24,095,692.40	0.20
203	000883	湖北能源	3,992,900	23,997,329.00	0.20
204	600566	济川药业	753,000	23,877,630.00	0.19
205	600511	国药股份	770,409	23,720,893.11	0.19
206	000629	钒钛股份	9,487,072	23,717,680.00	0.19
207	601016	节能风电	7,929,485	23,709,160.15	0.19
208	600867	通化东宝	2,831,500	23,699,655.00	0.19
209	688213	思特威	488,490	23,691,765.00	0.19
210	300088	长信科技	5,010,559	23,549,627.30	0.19

211	601456	国联证券	2,438,600	23,508,104.00	0.19
212	000997	新大陆	1,685,274	23,442,161.34	0.19
213	600170	上海建工	10,882,770	23,397,955.50	0.19
214	600582	天地科技	3,379,000	23,281,310.00	0.19
215	600499	科达制造	2,740,091	23,098,967.13	0.19
216	600498	烽火通信	1,452,500	23,094,750.00	0.19
217	600129	太极集团	796,200	23,026,104.00	0.19
218	600535	天士力	1,829,900	23,020,142.00	0.19
219	601933	永辉超市	9,262,100	22,970,008.00	0.19
220	000598	兴蓉环境	3,046,300	22,908,176.00	0.19
221	002120	韵达股份	2,959,100	22,903,434.00	0.19
222	600004	白云机场	2,415,700	22,900,836.00	0.19
223	601991	大唐发电	7,591,100	22,849,211.00	0.19
224	600580	卧龙电驱	1,873,819	22,766,900.85	0.19
225	000750	国海证券	7,821,991	22,761,993.81	0.19
226	002261	拓维信息	2,046,181	22,651,223.67	0.18
227	000060	中金岭南	5,340,771	22,644,869.04	0.18
228	603000	人民网	1,128,500	22,558,715.00	0.18
229	300118	东方日升	1,861,900	22,528,990.00	0.18
230	300568	星源材质	2,745,300	22,511,460.00	0.18
231	300567	精测电子	397,100	22,440,121.00	0.18
232	002430	杭氧股份	1,003,984	22,338,644.00	0.18
233	002429	兆驰股份	4,620,243	22,223,368.83	0.18
234	603486	科沃斯	470,500	22,198,190.00	0.18
235	002939	长城证券	3,293,700	22,067,790.00	0.18
236	600166	福田汽车	9,802,400	22,055,400.00	0.18
237	603658	安图生物	478,500	22,044,495.00	0.18
238	603156	养元饮品	1,033,006	21,972,037.62	0.18
239	600325	华发股份	3,370,477	21,908,100.50	0.18
240	603228	景旺电子	687,580	21,865,044.00	0.18
241	600816	建元信托	8,037,700	21,782,167.00	0.18
242	601231	环旭电子	1,354,100	21,733,305.00	0.18
243	300765	新诺威	860,640	21,713,947.20	0.18
244	600673	东阳光	3,076,394	21,657,813.76	0.18
245	300487	蓝晓科技	515,350	21,521,016.00	0.18
246	603927	中科软	1,187,481	21,481,531.29	0.18
247	603568	伟明环保	1,043,667	21,478,666.86	0.18
248	000893	亚钾国际	1,327,500	21,452,400.00	0.17
249	600754	锦江酒店	932,482	21,428,436.36	0.17
250	002508	老板电器	968,200	21,397,220.00	0.17
251	300601	康泰生物	1,368,384	21,360,474.24	0.17
252	000027	深圳能源	2,913,284	21,266,973.20	0.17
253	601636	旗滨集团	3,286,200	21,195,990.00	0.17

254	002926	华西证券	3,214,633	21,184,431.47	0.17
255	000998	隆平高科	2,150,297	21,137,419.51	0.17
256	603290	斯达半导	244,780	21,078,005.80	0.17
257	002624	完美世界	2,771,700	21,064,920.00	0.17
258	002497	雅化集团	2,355,480	21,010,881.60	0.17
259	603298	杭叉集团	1,069,340	21,001,837.60	0.17
260	688052	纳芯微	204,111	20,978,528.58	0.17
261	600563	法拉电子	274,966	20,946,909.88	0.17
262	002653	海思科	682,290	20,946,303.00	0.17
263	600737	中粮糖业	2,182,686	20,931,958.74	0.17
264	300604	长川科技	768,000	20,866,560.00	0.17
265	601866	中远海发	8,083,100	20,854,398.00	0.17
266	603077	和邦生物	12,618,348	20,820,274.20	0.17
267	300253	卫宁健康	3,527,398	20,811,648.20	0.17
268	002299	圣农发展	1,522,436	20,766,027.04	0.17
269	002056	横店东磁	1,660,116	20,701,646.52	0.17
270	002065	东华软件	4,580,000	20,701,600.00	0.17
271	600131	国网信通	1,226,900	20,697,803.00	0.17
272	002500	山西证券	4,401,514	20,687,115.80	0.17
273	688772	珠海冠宇	1,381,131	20,578,851.90	0.17
274	601958	金钼股份	1,976,400	20,574,324.00	0.17
275	300390	天华新能	1,196,790	20,560,852.20	0.17
276	002414	高德红外	3,487,030	20,538,606.70	0.17
277	600373	中文传媒	1,383,500	20,531,140.00	0.17
278	688385	复旦微电	653,776	20,515,490.88	0.17
279	600655	豫园股份	3,976,300	20,477,945.00	0.17
280	300009	安科生物	2,395,436	20,457,023.44	0.17
281	688002	睿创微纳	731,338	20,455,523.86	0.17
282	300763	锦浪科技	490,500	20,424,420.00	0.17
283	002507	涪陵榨菜	1,648,651	20,195,974.75	0.16
284	603893	瑞芯微	340,992	20,176,496.64	0.16
285	002368	太极股份	889,995	20,069,387.25	0.16
286	002372	伟星新材	1,300,156	20,048,405.52	0.16
287	688114	华大智造	422,718	20,041,060.38	0.16
288	600707	彩虹股份	2,929,900	19,952,619.00	0.16
289	601611	中国核建	2,464,700	19,939,423.00	0.16
290	603885	吉祥航空	1,807,800	19,867,722.00	0.16
291	000887	中鼎股份	1,612,000	19,730,880.00	0.16
292	002203	海亮股份	2,447,694	19,532,598.12	0.16
293	603379	三美股份	498,276	19,502,522.64	0.16
294	002831	裕同科技	760,157	19,452,417.63	0.16
295	688390	固德威	346,563	19,449,115.56	0.16
296	603225	新凤鸣	1,245,116	19,411,358.44	0.16

297	600755	厦门国贸	2,699,111	19,352,625.87	0.16
298	688521	芯原股份	713,308	19,080,989.00	0.16
299	600859	王府井	1,621,600	19,037,584.00	0.16
300	600995	南网储能	1,957,600	18,910,416.00	0.15
301	601880	辽港股份	15,373,849	18,909,834.27	0.15
302	600801	华新水泥	1,372,425	18,870,843.75	0.15
303	600329	达仁堂	581,909	18,848,032.51	0.15
304	600416	湘电股份	1,894,114	18,827,493.16	0.15
305	002683	广东宏大	929,918	18,719,249.34	0.15
306	600884	杉杉股份	2,304,700	18,714,164.00	0.15
307	300070	碧水源	4,437,438	18,592,865.22	0.15
308	600390	五矿资本	4,590,700	18,592,335.00	0.15
309	300296	利亚德	4,130,600	18,587,700.00	0.15
310	002019	亿帆医药	1,501,060	18,553,101.60	0.15
311	002506	协鑫集成	9,554,083	18,534,921.02	0.15
312	600435	北方导航	2,147,210	18,508,950.20	0.15
313	002244	滨江集团	2,540,970	18,447,442.20	0.15
314	600739	辽宁成大	2,185,500	18,292,635.00	0.15
315	600483	福能股份	1,567,820	18,280,781.20	0.15
316	000050	深天马 A	2,508,784	18,263,947.52	0.15
317	601098	中南传媒	1,465,900	18,206,478.00	0.15
318	300803	指南针	499,800	18,197,718.00	0.15
319	300748	金力永磁	1,402,200	18,172,512.00	0.15
320	600598	北大荒	1,452,100	18,136,729.00	0.15
321	600399	抚顺特钢	3,219,500	18,125,785.00	0.15
322	601598	中国外运	3,218,700	18,121,281.00	0.15
323	002572	索菲亚	1,179,464	18,081,183.12	0.15
324	002568	百润股份	1,071,196	18,028,228.68	0.15
325	600901	江苏金租	3,568,100	18,018,905.00	0.15
326	000155	川能动力	1,662,000	17,899,740.00	0.15
327	002487	大金重工	781,500	17,880,720.00	0.15
328	300676	华大基因	509,200	17,827,092.00	0.15
329	600848	上海临港	1,955,052	17,810,523.72	0.15
330	002080	中材科技	1,370,600	17,680,740.00	0.14
331	002240	盛新锂能	1,316,700	17,670,114.00	0.14
332	001286	陕西能源	1,530,400	17,645,512.00	0.14
333	002373	千方科技	1,935,672	17,556,545.04	0.14
334	002557	洽洽食品	621,012	17,506,328.28	0.14
335	002936	郑州银行	10,104,946	17,481,556.58	0.14
336	300595	欧普康视	1,098,649	17,226,816.32	0.14
337	000563	陕国投 A	6,262,879	17,222,917.25	0.14
338	002268	电科网安	1,208,455	17,196,314.65	0.14
339	603712	七一二	945,032	17,190,132.08	0.14

340	603858	步长制药	1,128,861	17,102,244.15	0.14
341	600968	海油发展	4,150,100	17,098,412.00	0.14
342	601928	凤凰传媒	1,558,100	17,076,776.00	0.14
343	603883	老百姓	929,710	17,069,475.60	0.14
344	000778	新兴铸管	4,887,275	17,007,717.00	0.14
345	688017	绿的谐波	207,043	16,998,230.30	0.14
346	688538	和辉光电	8,548,105	16,925,247.90	0.14
347	600258	首旅酒店	1,369,331	16,911,237.85	0.14
348	688301	奕瑞科技	145,999	16,823,464.77	0.14
349	601212	白银有色	6,046,500	16,809,270.00	0.14
350	600271	航天信息	2,269,106	16,700,620.16	0.14
351	300558	贝达药业	512,400	16,678,620.00	0.14
352	600062	华润双鹤	849,446	16,632,152.68	0.14
353	600528	中铁工业	2,267,310	16,596,709.20	0.14
354	688234	天岳先进	351,644	16,499,136.48	0.13
355	600977	中国电影	1,524,000	16,398,240.00	0.13
356	002531	天顺风能	1,834,100	16,396,854.00	0.13
357	000709	河钢股份	8,440,200	16,373,988.00	0.13
358	601155	新城控股	1,845,900	16,373,133.00	0.13
359	603688	石英股份	552,820	16,369,000.20	0.13
360	002408	齐翔腾达	2,901,383	16,247,744.80	0.13
361	000739	普洛药业	1,193,505	16,195,862.85	0.13
362	600959	江苏有线	6,125,270	16,170,712.80	0.13
363	600378	昊华科技	558,200	16,131,980.00	0.13
364	688005	容百科技	690,843	16,082,825.04	0.13
365	688220	翱捷科技	425,283	15,931,101.18	0.13
366	688536	思瑞浦	162,693	15,913,002.33	0.13
367	601118	海南橡胶	3,494,100	15,898,155.00	0.13
368	000825	太钢不锈	4,669,172	15,781,801.36	0.13
369	603444	吉比特	88,379	15,732,345.79	0.13
370	603882	金域医学	574,100	15,609,779.00	0.13
371	603737	三棵树	430,022	15,596,897.94	0.13
372	688331	荣昌生物	360,277	15,563,966.40	0.13
373	600056	中国医药	1,524,987	15,432,868.44	0.13
374	688200	华峰测控	166,162	15,245,363.50	0.12
375	000987	越秀资本	3,072,715	15,240,666.40	0.12
376	601399	国机重装	5,890,000	15,196,200.00	0.12
377	600906	财达证券	2,648,991	15,178,718.43	0.12
378	600517	国网英大	3,501,800	15,162,794.00	0.12
379	603456	九洲药业	1,101,451	15,111,907.72	0.12
380	601019	山东出版	1,278,175	15,108,028.50	0.12
381	600612	老凤祥	259,400	15,094,486.00	0.12
382	300212	易华录	885,259	14,898,908.97	0.12

383	002266	浙富控股	5,327,115	14,862,650.85	0.12
384	600316	洪都航空	877,672	14,595,685.36	0.12
385	000937	冀中能源	2,163,500	14,495,450.00	0.12
386	603650	彤程新材	489,568	14,466,734.40	0.12
387	600871	石化油服	8,309,900	14,459,226.00	0.12
388	603529	爱玛科技	527,800	14,424,774.00	0.12
389	688567	孚能科技	1,496,220	14,363,712.00	0.12
390	600925	苏能股份	2,812,200	14,201,610.00	0.12
391	002423	中粮资本	1,881,513	14,092,532.37	0.11
392	688063	派能科技	351,372	13,952,982.12	0.11
393	000032	深桑达 A	928,700	13,911,926.00	0.11
394	601965	中国汽研	819,700	13,844,733.00	0.11
395	001227	兰州银行	5,813,100	13,835,178.00	0.11
396	603728	鸣志电器	342,500	13,778,775.00	0.11
397	600098	广州发展	2,145,500	13,731,200.00	0.11
398	600208	新湖中宝	8,684,300	13,721,194.00	0.11
399	601298	青岛港	1,431,400	13,684,184.00	0.11
400	688297	中无人机	411,678	13,597,724.34	0.11
401	601608	中信重工	3,543,243	13,499,755.83	0.11
402	002607	中公教育	8,806,600	13,474,098.00	0.11
403	688516	奥特维	321,636	13,447,601.16	0.11
404	002670	国盛金控	1,579,688	13,379,957.36	0.11
405	600663	陆家嘴	1,515,093	13,363,120.26	0.11
406	600022	山东钢铁	10,919,220	13,321,448.40	0.11
407	603233	大参林	929,376	13,290,076.80	0.11
408	600578	京能电力	4,099,600	13,282,704.00	0.11
409	300438	鹏辉能源	719,650	13,198,381.00	0.11
410	688561	奇安信	558,095	13,182,203.90	0.11
411	300357	我武生物	641,347	12,968,036.34	0.11
412	601106	中国一重	5,599,000	12,933,690.00	0.11
413	600500	中化国际	3,662,910	12,783,555.90	0.10
414	300776	帝尔激光	277,996	12,776,696.16	0.10
415	600377	宁沪高速	1,012,300	12,754,980.00	0.10
416	003031	中瓷电子	275,580	12,742,819.20	0.10
417	002865	钧达股份	326,073	12,514,681.74	0.10
418	600967	内蒙一机	1,737,694	12,511,396.80	0.10
419	000785	居然之家	5,133,300	12,473,919.00	0.10
420	600315	上海家化	690,377	12,274,903.06	0.10
421	600350	山东高速	1,383,700	12,245,745.00	0.10
422	688349	三一重能	490,655	12,187,870.20	0.10
423	300888	稳健医疗	480,068	12,145,720.40	0.10
424	600827	百联股份	1,637,363	12,083,738.94	0.10
425	000958	电投产融	3,296,200	12,064,092.00	0.10

426	000537	中绿电	1,265,726	12,062,368.78	0.10
427	601568	北元集团	3,242,700	12,030,417.00	0.10
428	000559	万向钱潮	2,697,161	12,029,338.06	0.10
429	688425	铁建重工	3,265,606	12,017,430.08	0.10
430	002608	江苏国信	1,542,000	11,950,500.00	0.10
431	002690	美亚光电	720,706	11,891,649.00	0.10
432	000156	华数传媒	1,891,400	11,877,992.00	0.10
433	688029	南微医学	192,151	11,828,815.56	0.10
434	603707	健友股份	989,659	11,757,148.92	0.10
435	603517	绝味食品	759,640	11,698,456.00	0.10
436	002867	周大生	894,298	11,679,531.88	0.10
437	601992	金隅集团	8,510,600	11,659,522.00	0.10
438	688032	禾迈股份	101,279	11,624,803.62	0.09
439	603826	坤彩科技	400,520	11,603,064.40	0.09
440	600126	杭钢股份	2,757,240	11,332,256.40	0.09
441	300682	朗新集团	1,329,900	11,317,449.00	0.09
442	003022	联泓新科	818,350	11,219,578.50	0.09
443	688475	萤石网络	322,216	10,990,787.76	0.09
444	000967	盈峰环境	2,596,645	10,983,808.35	0.09
445	603218	日月股份	1,052,020	10,804,245.40	0.09
446	688778	厦钨新能	344,328	10,756,806.72	0.09
447	688520	神州细胞	273,322	10,755,220.70	0.09
448	600032	浙江新能	1,472,000	10,716,160.00	0.09
449	600361	创新新材	2,657,900	10,711,337.00	0.09
450	600481	双良节能	2,291,027	10,699,096.09	0.09
451	600339	中油工程	3,418,800	10,666,656.00	0.09
452	301267	华夏眼科	514,200	10,654,224.00	0.09
453	603786	科博达	165,200	10,597,580.00	0.09
454	600095	湘财股份	1,750,900	10,435,364.00	0.09
455	000898	鞍钢股份	4,882,550	10,351,006.00	0.08
456	688248	南网科技	346,582	10,269,224.66	0.08
457	603127	昭衍新药	773,041	10,258,254.07	0.08
458	003035	南网能源	2,317,900	10,198,760.00	0.08
459	688281	华秦科技	119,492	9,956,073.44	0.08
460	600808	马钢股份	4,911,000	9,920,220.00	0.08
461	002563	森马服饰	1,649,600	9,584,176.00	0.08
462	002153	石基信息	1,671,180	9,575,861.40	0.08
463	603185	弘元绿能	554,368	9,474,149.12	0.08
464	601228	广州港	3,080,400	9,395,220.00	0.08
465	000539	粤电力 A	1,817,600	9,233,408.00	0.08
466	688779	长远锂科	1,969,513	9,118,845.19	0.07
467	001872	招商港口	473,236	9,109,793.00	0.07
468	600928	西安银行	2,721,300	8,898,651.00	0.07

469	001203	大中矿业	923,000	8,870,030.00	0.07
470	000401	冀东水泥	2,170,100	8,810,606.00	0.07
471	000959	首钢股份	3,182,747	8,657,071.84	0.07
472	688006	杭可科技	491,401	8,574,947.45	0.07
473	600764	中国海防	434,901	8,537,106.63	0.07
474	002518	科士达	478,900	8,476,530.00	0.07
475	603056	德邦股份	628,899	8,238,576.90	0.07
476	603305	旭升集团	762,300	8,049,888.00	0.07
477	600299	安迪苏	821,700	7,970,490.00	0.06
478	688172	燕东微	488,029	7,896,309.22	0.06
479	601139	深圳燃气	1,174,400	7,844,992.00	0.06
480	300861	美畅股份	391,500	7,575,525.00	0.06
481	603317	天味食品	652,299	7,442,731.59	0.06
482	688276	百克生物	253,880	7,202,575.60	0.06
483	688387	信科移动	1,396,227	7,036,984.08	0.06
484	301029	怡合达	353,200	6,943,912.00	0.06
485	688375	国博电子	98,202	6,936,989.28	0.06
486	002791	坚朗五金	263,109	6,806,629.83	0.06
487	688819	天能股份	278,423	6,643,172.78	0.05
488	600927	永安期货	594,200	6,625,330.00	0.05
489	688153	唯捷创芯	171,160	6,332,920.00	0.05
490	688107	安路科技	246,019	6,253,802.98	0.05
491	601858	中国科传	322,200	6,160,464.00	0.05
492	000031	大悦城	2,624,883	6,142,226.22	0.05
493	601158	重庆水务	1,175,800	5,643,840.00	0.05
494	601828	美凯龙	2,212,596	5,642,119.80	0.05
495	002945	华林证券	550,600	5,494,988.00	0.04
496	688348	昱能科技	91,653	5,407,527.00	0.04
497	600956	新天绿能	628,100	5,131,577.00	0.04
498	301165	锐捷网络	139,400	4,159,696.00	0.03
499	688295	中复神鹰	202,536	4,111,480.80	0.03
500	603868	飞科电器	98,005	3,763,392.00	0.03

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	400174	中天3	3,046,725	1,218,690.00	0.01

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	688114	华大智造	100,885,315.71	1.56

2	601058	赛轮轮胎	84,754,536.94	1.31
3	688099	晶晨股份	76,487,565.20	1.18
4	601168	西部矿业	75,179,276.00	1.16
5	600563	法拉电子	72,249,640.88	1.12
6	688220	翱捷科技	70,815,647.40	1.09
7	600157	永泰能源	68,338,723.00	1.06
8	601077	渝农商行	63,771,285.00	0.99
9	601555	东吴证券	62,333,808.20	0.96
10	600066	宇通客车	62,197,287.25	0.96
11	600160	巨化股份	61,516,907.35	0.95
12	600096	云天化	59,314,270.07	0.92
13	688777	中控技术	58,113,762.55	0.90
14	600418	江淮汽车	56,989,540.74	0.88
15	688521	芯原股份	56,168,912.41	0.87
16	688169	石头科技	55,996,698.92	0.87
17	600988	赤峰黄金	55,880,324.00	0.86
18	601108	财通证券	55,441,035.82	0.86
19	600079	人福医药	54,584,452.58	0.84
20	688122	西部超导	54,052,239.92	0.84

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	600160	巨化股份	99,864,297.12	1.54
2	002463	沪电股份	97,509,472.63	1.51
3	688114	华大智造	89,103,817.88	1.38
4	002422	科伦药业	85,807,730.21	1.33
5	600161	天坛生物	83,614,960.38	1.29
6	600415	小商品城	75,623,999.00	1.17
7	600482	中国动力	71,213,876.28	1.10
8	000975	银泰黄金	67,235,272.64	1.04
9	688220	翱捷科技	62,551,527.52	0.97
10	688099	晶晨股份	60,151,166.72	0.93
11	600563	法拉电子	59,498,175.29	0.92
12	300418	昆仑万维	59,300,874.94	0.92
13	601168	西部矿业	55,355,025.64	0.86
14	688072	拓荆科技	51,622,823.55	0.80
15	601058	赛轮轮胎	47,606,013.00	0.74
16	688521	芯原股份	43,114,174.15	0.67
17	688728	格科微	42,018,419.28	0.65
18	603688	石英股份	40,692,310.47	0.63
19	600066	宇通客车	39,568,645.07	0.61
20	600157	永泰能源	39,239,209.00	0.61

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	9,573,782,190.88
卖出股票收入（成交）总额	6,351,158,338.11

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,317,310.76
2	应收清算款	10,558,196.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,875,507.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	400174	中天 3	1,218,690.00	0.01	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 （户）	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）

18,630	126,971.01	2,218,909,102.00	93.80	146,560,829.00	6.20
--------	------------	------------------	-------	----------------	------

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
嘉实中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	396,068,651.00	16.74

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	中央汇金投资有限责 任公司	924,288,152.00	39.07
2	中国人寿保险股份有 限公司	224,742,046.00	9.50
3	大家人寿保险股份有 限公司－万能产品	78,284,300.00	3.31
4	中国平安人寿保险股 份有限公司－分红－ 一个险分红	75,894,700.00	3.21
5	中国平安人寿保险股 份有限公司－自有资 金	46,461,940.00	1.96
6	海港人寿保险股份有 限公司－传统 2	44,101,000.00	1.86
7	华泰证券股份有限公 司	31,238,736.00	1.32
8	北京诚通金控投资有 限公司	30,776,500.00	1.30
9	安信证券股份有限公 司	30,254,267.00	1.28
10	东方证券股份有限公 司	24,549,882.00	1.04
11	嘉实中证 500 交易型开 放式指数证券投资基 金联接基金	396,068,651.00	16.74

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 2 月 6 日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	1,147,069,931.00
本报告期基金总申购份额	2,655,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,436,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,365,469,931.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况
本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况
本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	8,218,525,559.01	51.61	1,560,105.10	35.43	-
广发证券股份有限公司	5	3,980,221,486.02	24.99	381,199.44	8.66	-
浙商证券股份有限公司	2	1,005,300,834.50	6.31	649,384.70	14.75	-
开源证券股份有限公司	2	950,773,225.11	5.97	614,208.12	13.95	-
招商证券股份有限公司	1	665,286,256.57	4.18	465,710.90	10.58	-
兴业证券股份有限公司	2	343,263,467.24	2.16	221,724.88	5.04	-
中航证券有限公司	2	293,511,727.21	1.84	189,602.97	4.31	-
华泰证券股份有限公司	1	215,281,370.32	1.35	150,697.25	3.42	-
申万宏源证券有限公司	2	86,354,114.60	0.54	60,447.93	1.37	-
国投证券股份有限公司	2	71,745,110.55	0.45	46,348.40	1.05	-
海通证券股份有限公司	1	52,689,616.59	0.33	36,882.75	0.84	-
长江证券股份有限公司	1	41,987,761.27	0.26	27,125.58	0.62	-
财信证券	1	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
东北证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
银泰证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信建投证券股份有限公司	2,010,831.65	70.98	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	423,727.40	14.96	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公	-	-	-	-	-	-

司						
国投证 券股份 有限公 司	398,250.00	14.06	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛高 华证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国元证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
西部证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
银泰证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 8 日
2	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 28 日
3	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 29 日
4	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 29 日
5	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2024-02-19 至 2024-06-30	-	924,288,152.00	-	924,288,152.00	39.07
联接基金	1	2024-01-01 至 2024-02-20, 2	382,468,608.00	33,600,000.00	19,999,957.00	396,068,651.00	16.74

		024-02-23 至 2024-02-26					
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

- (1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
 - (2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>
- 投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日