

# 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>73</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	73
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	73
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 .....	74
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	82
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	83
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 .....	84
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 .....	84
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 .....	84

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 .....	84
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	84
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
7.12 投资组合报告附注 .....	85
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>86</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	86
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
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 .....	87
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>87</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>87</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	87
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 .....	87
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	87
10.4 基金投资策略的改变 .....	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
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 .....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	88
10.8 其他重大事件 .....	96
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>96</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	96
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>97</b>
12.1 备查文件目录 .....	97
12.2 存放地点 .....	97
12.3 查阅方式 .....	97

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实沪深 300ETF
场内简称	300ETF
基金主代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,338,116,676.00 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	2012 年 5 月 28 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。
业绩比较基准	沪深 300 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	(010)66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818

法定代表人	经雷	刘连舸
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2020 年 01 月 01 日-2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,833,657,193.47
本期利润	892,248,287.52
加权平均基金份额本期利润	0.1319
本期加权平均净值利润率	3.30%
本期基金份额净值增长率	2.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	10,150,936,122.85
期末可供分配基金份额利润	1.9016
期末基金资产净值	22,725,320,782.31
期末基金份额净值	4.2572
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	80.73%

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

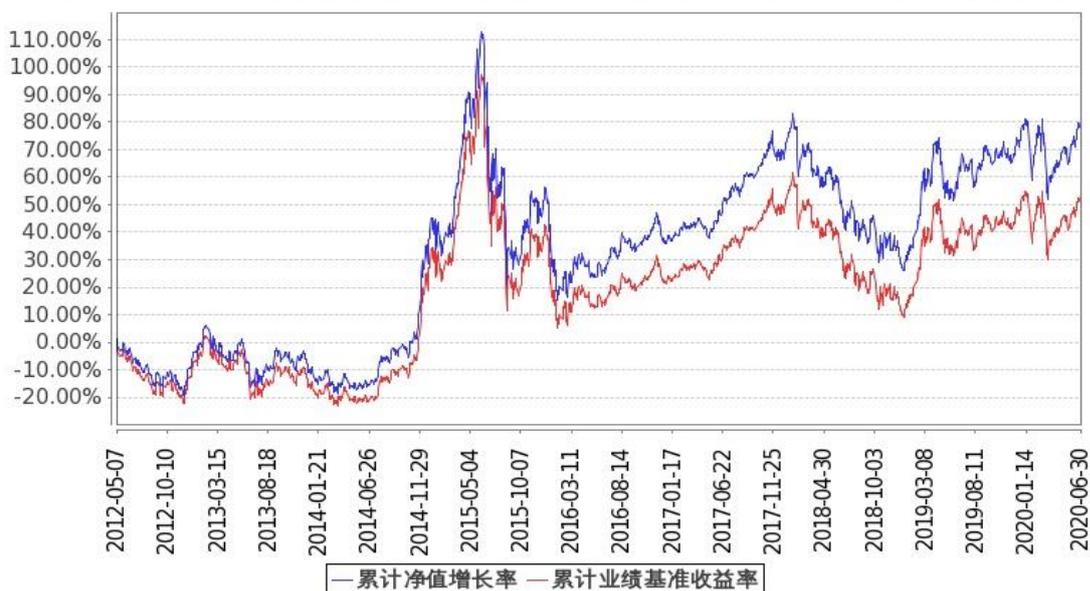
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.31%	0.90%	7.68%	0.90%	0.63%	0.00%
过去三个月	13.89%	0.90%	12.96%	0.90%	0.93%	0.00%
过去六个月	2.36%	1.52%	1.64%	1.52%	0.72%	0.00%
过去一年	10.50%	1.22%	8.85%	1.22%	1.65%	0.00%
过去三年	18.76%	1.25%	13.56%	1.25%	5.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	80.73%	1.46%	53.32%	1.46%	27.41%	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

#### 嘉实沪深300ETF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



图：嘉实沪深 300ETF 基金份额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

(2012 年 5 月 7 日至 2020 年 6 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 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“十五（二）投资范围和（八）投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

## § 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的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，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 190 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII) 混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝

货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数	2016 年 1 月 5 日		17 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月

	(LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理				加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日		14 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)任职日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪深 300 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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差为 0.44%，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 4.2572 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.36%，业绩比较基准收益率为 1.64%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于沪深 300 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沪深 300 指数的投资工具。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参

加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	110,010,228.35	21,703,693.53

结算备付金		34,878,823.59	26,697,797.36
存出保证金		18,055,896.06	16,519,683.62
交易性金融资产	6.4.7.2	22,566,039,593.80	27,007,495,900.25
其中：股票投资		22,559,526,193.80	27,005,582,800.25
基金投资		-	-
债券投资		6,513,400.00	1,913,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	133,000,000.00	134,000,000.00
应收证券清算款		17,643,843.48	21,616,190.17
应收利息	6.4.7.5	397,375.34	61,641.94
应收股利		1,493,707.96	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		22,881,519,468.58	27,228,094,906.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		137,981,613.46	27,591,856.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,208,215.03	10,418,555.77
应付托管费		2,041,643.02	2,083,711.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,694,412.79	2,490,274.14
应交税费		118,401.75	42,243.71
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,154,400.22	2,079,066.30
负债合计		156,198,686.27	44,705,707.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,574,384,659.46	15,396,139,278.53
未分配利润	6.4.7.10	10,150,936,122.85	11,787,249,921.12
所有者权益合计		22,725,320,782.31	27,183,389,199.65
负债和所有者权益总计		22,881,519,468.58	27,228,094,906.87

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.2572 元，基金份额总额 5,338,116,676.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至2020 年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
一、收入		996,379,047.97	5,075,895,972.66
1. 利息收入		4,397,145.93	337,561.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	539,033.62	156,898.68
债券利息收入		3,603.86	4,998.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,196,310.52	175,664.74
证券出借利息收入		2,658,197.93	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,921,583,129.23	629,270,443.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,641,935,733.26	355,213,699.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,469,862.33	3,558,986.92
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	5,250,291.26	4,644,766.60
股利收益	6.4.7.15	268,927,242.38	265,852,990.38
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-941,408,905.95	4,445,680,028.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,807,678.76	607,938.32
减：二、费用		104,130,760.45	72,744,100.88
1. 管理人报酬		67,088,293.71	54,208,237.85
2. 托管费		13,417,658.71	10,841,647.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	19,408,135.71	4,246,332.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		18,914.05	15,339.69
7. 其他费用	6.4.7.19	4,197,758.27	3,432,543.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		892,248,287.52	5,003,151,871.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		892,248,287.52	5,003,151,871.78

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	15,396,139,278.53	11,787,249,921.12	27,183,389,199.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	892,248,287.52	892,248,287.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,821,754,619.07	-2,528,562,085.79	-5,350,316,704.86
其中：1. 基金申购款	7,555,772,696.89	4,901,391,393.80	12,457,164,090.69
2. 基金赎回款	-10,377,527,315.96	-7,429,953,479.59	-17,807,480,795.55
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	12,574,384,659.46	10,150,936,122.85	22,725,320,782.31
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	14,660,468,397.68	4,083,151,385.90	18,743,619,783.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,003,151,871.78	5,003,151,871.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,365,318,604.92	1,099,961,644.13	2,465,280,249.05

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	4,358,552,474.06	2,728,660,036.56	7,087,212,510.62
2. 基金赎回款	-2,993,233,869.14	-1,628,698,392.43	-4,621,932,261.57
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	16,025,787,002.60	10,186,264,901.81	26,212,051,904.41

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

罗丽丽

罗丽丽

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

嘉实沪深 300 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]393 号《关于核准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《嘉实沪深 300 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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 19,332,261,440.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 128 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 19,333,307,392.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,045,952.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第 131 号文审核同意,本基金 19,333,307,392.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 指数,追求跟踪偏离度

与跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。在正常市场情况下，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%。本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数。

根据于 2012 年 8 月 6 日嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议通过的《关于嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》，并经中国证监会 2012 年 8 月 21 日证监许可[2012]1146 号文核准，嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)自 2012 年 8 月 21 日起变更投资范围及相关事宜而成为嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“嘉实沪深 300ETF 联接基金”)。嘉实沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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基金净值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 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	110,010,228.35
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月及以上	-
其他存款	-
合计	110,010,228.35

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,752,730,883.63	22,559,526,193.80	2,806,795,310.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,513,400.00	6,513,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,513,400.00	6,513,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	19,759,244,283.63	22,566,039,593.80	2,806,795,310.17

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	144,184,140.00	-	-	-

其中：股指期货投资	144,184,140.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	144,184,140.00	-	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IF2009	IF2009	30	36,608,400.00	699,300.00
IF2012	IF2012	94	113,617,800.00	5,342,760.00
总额合计	-	-	-	6,042,060.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	6,042,060.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	133,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	133,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	24,616.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	18,832.53
应收债券利息	597.69
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	352,100.10
其他	1,228.50
合计	397,375.34

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,694,412.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,694,412.79

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-
预提费用	144,207.70
应付指数使用费	2,010,192.52
合计	2,154,400.22

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,536,016,676.00	15,396,139,278.53
本期申购	3,207,600,000.00	7,555,772,696.89
本期赎回（以“-”号填列）	-4,405,500,000.00	-10,377,527,315.96
本期末	5,338,116,676.00	12,574,384,659.46

#### 6.4.7.10 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	16,824,235,927.64	-5,036,986,006.52	11,787,249,921.12
本期利润	1,833,657,193.47	-941,408,905.95	892,248,287.52
本期基金份额交易产生的变动数	-3,398,901,529.34	870,339,443.55	-2,528,562,085.79
其中：基金申购款	8,518,427,435.04	-3,617,036,041.24	4,901,391,393.80

基金赎回款	-11,917,328,964.38	4,487,375,484.79	-7,429,953,479.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,258,991,591.77	-5,108,055,468.92	10,150,936,122.85

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	237,203.84
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	286,060.47
其他	15,769.31
合计	539,033.62

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	619,823,435.44
股票投资收益——赎回差价收入	1,022,112,297.82
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	1,641,935,733.26

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	12,943,615,227.79
减：卖出股票成本总额	12,323,791,792.35
买卖股票差价收入	619,823,435.44

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

赎回基金份额对价总额	17,807,480,795.55
减：现金支付赎回款总额	10,538,772,898.55
减：赎回股票成本总额	6,246,595,599.18
赎回差价收入	1,022,112,297.82

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	27,486,053.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,012,900.00
减：应收利息总额	3,291.13
买卖债券差价收入	5,469,862.33

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.14.2 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
	2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	5,250,291.26

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	268,927,242.38
其中：证券出借权益补偿收入	2,248,740.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	268,927,242.38

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-938,354,965.95

股票投资	-938,354,965.95
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	-3,053,940.00
权证投资	-
期货	-3,053,940.00
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	-941,408,905.95

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,807,678.76
合计	11,807,678.76

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	19,408,135.71
银行间市场交易费用	-
合计	19,408,135.71

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	84,535.36
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	28,252.93
指数使用费	4,025,297.64
合计	4,197,758.27

## 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	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)（“嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)”）	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

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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	67,088,293.71	54,208,237.85
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%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×0.5%/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	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,417,658.71	10,841,647.52

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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×0.1%/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

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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(%)
嘉实沪深300ETF联接(LOF)	3,814,880,079.00	71.46	4,491,383,192.00	68.72

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国银行股份有限公司_活期	110,010,228.35	237,203.84	39,535,471.25	57,842.98

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

## 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。

## 6.4.11 利润分配情况

本期（2020年1月1日至2020年6月30日），本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2020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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新发未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688026	洁特生物	2020年1月15日	2020年7月22日	科创板新股锁定	16.49	83.32	4,433	73,100.17	369,357.56	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新发未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688186	广大特材	2020年1月23日	2020年8月11日	科创板新股锁定	17.16	34.15	8,033	137,846.28	274,326.95	-
688520	神州细胞	2020年6月11日	2020年12月22日	科创板新股锁定	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新发未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位: 张)			
128112	歌尔转2	2020年6月12日	2020年7月13日	新债未上市	100.00	100.00	51,142	5,114,200.00	5,114,200.00	-
128114	正邦转债	2020年6月17日	2020年7月15日	新债未上市	100.00	100.00	13,992	1,399,200.00	1,399,200.00	-

注:1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期, 最终日期以上市公司公告为准。

2. 基金持有的股票在流通受限期内, 如获得股票红利、送股、转增股、配股的, 则该股票的数量和期末成本总额相应调整, 新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位: 人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末估值总额
202006170000514	000066	中国长城	2020-06-17	2020-07-01	13.20	300,000	3,960,000.00
2020061700001342	601727	上海电气	2020-06-17	2020-07-01	5.04	107,100	539,784.00
2020061700001395	601727	上海电气	2020-06-17	2020-07-01	5.04	144,200	726,768.00
2020061700001535	600118	中国卫星	2020-06-17	2020-07-01	30.83	140,000	4,316,200.00
2020061700001708	600068	葛洲坝	2020-06-17	2020-07-01	5.95	89,000	529,550.00
202006	600516	方大	2020-06-17	2020-07-01	6.28	112,000	703,360.00

170000 1806		炭素					
202006 170000 2189	600795	国电 电力	2020-06-17	2020-07-01	1.85	291,600	539,460.00
202006 170000 2626	600482	中国 动力	2020-06-17	2020-07-01	15.70	32,800	514,960.00
202006 170000 2757	603799	华友 钴业	2020-06-17	2020-07-01	38.86	84,000	3,264,240.00
202006 170000 2802	603799	华友 钴业	2020-06-17	2020-07-01	38.86	37,000	1,437,820.00
202006 170000 3149	002129	中环 股份	2020-06-17	2020-07-01	22.46	23,100	518,826.00
202006 170000 3150	002129	中环 股份	2020-06-17	2020-07-01	22.46	130,000	2,919,800.00
202006 170000 3230	600221	海航 控股	2020-06-17	2020-07-01	1.50	332,000	498,000.00
202006 170000 3820	601117	中国 化学	2020-06-17	2020-07-01	5.48	96,800	530,464.00
202006 170000 3858	601117	中国 化学	2020-06-17	2020-07-01	5.48	123,700	677,876.00
202006 170000 4023	601212	白银 有色	2020-06-17	2020-07-01	2.55	203,900	519,945.00
202006 170000 4239	600297	广汇 汽车	2020-06-17	2020-07-01	3.19	162,400	518,056.00
202006 170000 4504	600208	新湖 中宝	2020-06-17	2020-07-01	2.98	224,900	670,202.00
202006 170000 4518	600208	新湖 中宝	2020-06-17	2020-07-01	2.98	175,900	524,182.00
202006 170000 4704	600498	烽火 通信	2020-06-17	2020-07-01	28.91	50,000	1,445,500.00

202006 170000 4764	600010	包钢 股份	2020-06-17	2020-07-01	1.08	990,000	1,069,200.00
202006 170000 4792	600010	包钢 股份	2020-06-17	2020-07-01	1.08	919,000	992,520.00
202006 170000 5089	002460	赣锋 锂业	2020-06-17	2020-07-01	53.57	29,100	1,558,887.00
202006 170000 5280	002602	世纪 华通	2020-06-17	2020-07-01	15.31	82,100	1,256,951.00
202006 170000 5283	002602	世纪 华通	2020-06-17	2020-07-01	15.31	36,600	560,346.00
202006 170000 5397	002714	牧原 股份	2020-06-17	2020-07-01	82.00	10,000	820,000.00
202006 180000 0122	000063	中兴 通讯	2020-06-18	2020-07-02	40.13	10,000	401,300.00
202006 180000 0136	000100	TCL 科技	2020-06-18	2020-07-02	6.20	10,000	62,000.00
202006 180000 0138	000069	华侨 城 A	2020-06-18	2020-07-02	6.06	10,000	60,600.00
202006 180000 0141	000157	中联 重科	2020-06-18	2020-07-02	6.43	10,000	64,300.00
202006 180000 0143	000338	潍柴 动力	2020-06-18	2020-07-02	13.72	10,000	137,200.00
202006 180000 0148	000425	徐工 机械	2020-06-18	2020-07-02	5.91	10,000	59,100.00
202006 180000 0159	000538	云南 白药	2020-06-18	2020-07-02	93.81	10,000	938,100.00
202006 180000 0169	000625	长安 汽车	2020-06-18	2020-07-02	11.00	10,000	110,000.00
202006 180000	000627	天茂 集团	2020-06-18	2020-07-02	5.21	10,000	52,100.00

0170							
202006 180000 0173	000656	金科 股份	2020-06-18	2020-07-02	8.16	10,000	81,600.00
202006 180000 0175	000725	京东 方 A	2020-06-18	2020-07-02	4.67	10,000	46,700.00
202006 180000 0180	000671	阳光 城	2020-06-18	2020-07-02	6.34	10,000	63,400.00
202006 180000 0184	000709	河钢 股份	2020-06-18	2020-07-02	2.04	10,000	20,400.00
202006 180000 0185	000703	恒逸 石化	2020-06-18	2020-07-02	9.13	10,000	91,300.00
202006 180000 0186	000768	中航 飞机	2020-06-18	2020-07-02	17.74	10,000	177,400.00
202006 180000 0190	000786	北新 建材	2020-06-18	2020-07-02	21.33	10,000	213,300.00
202006 180000 0193	000876	新希 望	2020-06-18	2020-07-02	29.80	10,000	298,000.00
202006 180000 0202	000895	双汇 发展	2020-06-18	2020-07-02	46.09	10,000	460,900.00
202006 180000 0205	000963	华东 医药	2020-06-18	2020-07-02	25.30	10,000	253,000.00
202006 180000 0211	000961	中南 建设	2020-06-18	2020-07-02	8.90	10,000	89,000.00
202006 180000 0216	000938	紫光 股份	2020-06-18	2020-07-02	42.98	10,000	429,800.00
202006 180000 0218	001979	招商 蛇口	2020-06-18	2020-07-02	16.44	10,000	164,400.00
202006 180000 0220	002007	华兰 生物	2020-06-18	2020-07-02	50.11	10,000	501,100.00
202006	002001	新和	2020-06-18	2020-07-02	29.10	10,000	291,000.00

180000 0225		成					
202006 180000 0229	002024	苏宁 易购	2020-06-18	2020-07-02	8.77	10,000	87,700.00
202006 180000 0231	002008	大族 激光	2020-06-18	2020-07-02	35.95	10,000	359,500.00
202006 180000 0234	002027	分众 传媒	2020-06-18	2020-07-02	5.57	10,000	55,700.00
202006 180000 0241	002032	苏泊 尔	2020-06-18	2020-07-02	71.00	10,000	710,000.00
202006 180000 0249	002050	三花 智控	2020-06-18	2020-07-02	21.90	10,000	219,000.00
202006 180000 0265	002120	韵达 股份	2020-06-18	2020-07-02	24.45	10,000	244,500.00
202006 180000 0282	002142	宁波 银行	2020-06-18	2020-07-02	26.27	10,000	262,700.00
202006 180000 0284	002146	荣盛 发展	2020-06-18	2020-07-02	8.10	10,000	81,000.00
202006 180000 0285	002153	石基 信息	2020-06-18	2020-07-02	39.03	10,000	390,300.00
202006 180000 0297	002179	中航 光电	2020-06-18	2020-07-02	41.01	10,000	410,100.00
202006 180000 0307	002236	大华 股份	2020-06-18	2020-07-02	19.21	10,000	192,100.00
202006 180000 0308	002230	科大 讯飞	2020-06-18	2020-07-02	37.43	10,000	374,300.00
202006 180000 0310	002202	金风 科技	2020-06-18	2020-07-02	9.97	10,000	99,700.00
202006 180000 0315	002241	歌尔 股份	2020-06-18	2020-07-02	29.36	10,000	293,600.00

202006 180000 0324	002252	上海 莱士	2020-06-18	2020-07-02	8.46	10,000	84,600.00
202006 180000 0328	002311	海大 集团	2020-06-18	2020-07-02	47.59	10,000	475,900.00
202006 180000 0330	002271	东方 雨虹	2020-06-18	2020-07-02	40.63	10,000	406,300.00
202006 180000 0350	002422	科伦 药业	2020-06-18	2020-07-02	21.00	10,000	210,000.00
202006 180000 0356	002410	广联 达	2020-06-18	2020-07-02	69.70	10,000	697,000.00
202006 180000 0357	002460	赣锋 锂业	2020-06-18	2020-07-02	53.57	10,000	535,700.00
202006 180000 0361	002468	申通 快递	2020-06-18	2020-07-02	16.41	10,000	164,100.00
202006 180000 0363	002493	荣盛 石化	2020-06-18	2020-07-02	12.30	10,000	123,000.00
202006 180000 0373	002508	老板 电器	2020-06-18	2020-07-02	31.11	10,000	311,100.00
202006 180000 0377	002555	三七 互娱	2020-06-18	2020-07-02	46.80	10,000	468,000.00
202006 180000 0380	002601	龙蟠 佰利	2020-06-18	2020-07-02	18.50	10,000	185,000.00
202006 180000 0384	002594	比亚 迪	2020-06-18	2020-07-02	71.80	10,000	718,000.00
202006 180000 0385	002558	巨人 网络	2020-06-18	2020-07-02	17.40	10,000	174,000.00
202006 180000 0389	002602	世纪 华通	2020-06-18	2020-07-02	15.31	10,000	153,100.00
202006 180000	002607	中公 教育	2020-06-18	2020-07-02	27.75	10,000	277,500.00

0393							
202006 180000 0400	002714	牧原 股份	2020-06-18	2020-07-02	82.00	10,500	861,000.00
202006 180000 0401	002714	牧原 股份	2020-06-18	2020-07-02	82.00	10,000	820,000.00
202006 180000 0414	002739	万达 电影	2020-06-18	2020-07-02	15.27	10,000	152,700.00
202006 180000 0415	002739	万达 电影	2020-06-18	2020-07-02	15.27	96,000	1,465,920.00
202006 180000 0426	002773	康弘 药业	2020-06-18	2020-07-02	49.60	10,000	496,000.00
202006 180000 0432	002958	青农 商行	2020-06-18	2020-07-02	4.43	10,000	44,300.00
202006 180000 0433	300003	乐普 医疗	2020-06-18	2020-07-02	36.52	10,000	365,200.00
202006 180000 0439	300015	爱尔 眼科	2020-06-18	2020-07-02	43.45	10,000	434,500.00
202006 180000 0478	300124	汇川 技术	2020-06-18	2020-07-02	37.99	10,000	379,900.00
202006 180000 0482	300136	信维 通信	2020-06-18	2020-07-02	53.02	10,000	530,200.00
202006 180000 0483	300122	智飞 生物	2020-06-18	2020-07-02	100.15	10,000	1,001,500.00
202006 180000 0485	300142	沃森 生物	2020-06-18	2020-07-02	52.36	10,000	523,600.00
202006 180000 0491	300144	宋城 演艺	2020-06-18	2020-07-02	17.30	10,000	173,000.00
202006 180000 0509	300347	泰格 医药	2020-06-18	2020-07-02	101.88	10,000	1,018,800.00
202006	300408	三环	2020-06-18	2020-07-02	27.70	10,000	277,000.00

180000 0515		集团					
202006 180000 0517	300413	芒果 超媒	2020-06-18	2020-07-02	65.20	10,000	652,000.00
202006 180000 0523	300433	蓝思 科技	2020-06-18	2020-07-02	28.04	10,000	280,400.00
202006 180000 0524	300433	蓝思 科技	2020-06-18	2020-07-02	28.04	20,000	560,800.00
202006 180000 0550	601155	新城 控股	2020-06-18	2020-07-02	31.24	10,000	312,400.00
202006 180000 0569	600018	上港 集团	2020-06-18	2020-07-02	4.20	10,000	42,000.00
202006 180000 0575	600372	中航 电子	2020-06-18	2020-07-02	13.32	10,000	133,200.00
202006 180000 0578	601727	上海 电气	2020-06-18	2020-07-02	5.04	118,600	597,744.00
202006 180000 0587	601229	上海 银行	2020-06-18	2020-07-02	8.30	10,000	83,000.00
202006 180000 0588	601727	上海 电气	2020-06-18	2020-07-02	5.04	326,200	1,644,048.00
202006 180000 0589	600760	中航 沈飞	2020-06-18	2020-07-02	32.82	10,000	328,200.00
202006 180000 0592	600588	用友 网络	2020-06-18	2020-07-02	44.10	10,000	441,000.00
202006 180000 0593	601600	中国 铝业	2020-06-18	2020-07-02	2.76	10,000	27,600.00
202006 180000 0594	600332	白云 山	2020-06-18	2020-07-02	32.33	10,000	323,300.00
202006 180000 0595	600998	九州 通	2020-06-18	2020-07-02	18.62	10,000	186,200.00

202006 180000 0596	600655	豫园 股份	2020-06-18	2020-07-02	8.86	10,000	88,600.00
202006 180000 0598	601898	中煤 能源	2020-06-18	2020-07-02	3.80	10,000	38,000.00
202006 180000 0599	601018	宁波 港	2020-06-18	2020-07-02	3.57	10,000	35,700.00
202006 180000 0600	600183	生益 科技	2020-06-18	2020-07-02	29.27	10,000	292,700.00
202006 180000 0601	601577	长沙 银行	2020-06-18	2020-07-02	7.94	10,000	79,400.00
202006 180000 0602	600188	兖州 煤业	2020-06-18	2020-07-02	8.76	10,000	87,600.00
202006 180000 0603	601607	上海 医药	2020-06-18	2020-07-02	18.38	10,000	183,800.00
202006 180000 0604	600188	兖州 煤业	2020-06-18	2020-07-02	8.76	11,500	100,740.00
202006 180000 0620	600068	葛洲 坝	2020-06-18	2020-07-02	5.95	10,000	59,500.00
202006 180000 0621	601328	交通 银行	2020-06-18	2020-07-02	5.13	50,000	256,500.00
202006 180000 0627	600346	恒力 石化	2020-06-18	2020-07-02	14.00	10,000	140,000.00
202006 180000 0630	600741	华域 汽车	2020-06-18	2020-07-02	20.79	10,000	207,900.00
202006 180000 0631	601390	中国 中铁	2020-06-18	2020-07-02	5.02	10,000	50,200.00
202006 180000 0636	600848	上海 临港	2020-06-18	2020-07-02	21.47	10,000	214,700.00
202006 180000	600019	宝钢 股份	2020-06-18	2020-07-02	4.56	10,000	45,600.00

0639							
202006 180000 0640	601628	中国人寿	2020-06-18	2020-07-02	27.21	10,000	272,100.00
202006 180000 0642	600118	中国卫星	2020-06-18	2020-07-02	30.83	10,000	308,300.00
202006 180000 0644	601006	大秦铁路	2020-06-18	2020-07-02	7.04	10,000	70,400.00
202006 180000 0645	600028	中国石化	2020-06-18	2020-07-02	3.91	10,000	39,100.00
202006 180000 0646	600016	民生银行	2020-06-18	2020-07-02	5.67	45,100	255,717.00
202006 180000 0647	600066	宇通客车	2020-06-18	2020-07-02	12.20	10,000	122,000.00
202006 180000 0662	600050	中国联通	2020-06-18	2020-07-02	4.84	10,000	48,400.00
202006 180000 0666	600219	南山铝业	2020-06-18	2020-07-02	2.03	10,000	20,300.00
202006 180000 0672	600050	中国联通	2020-06-18	2020-07-02	4.84	52,200	252,648.00
202006 180000 0674	600089	特变电工	2020-06-18	2020-07-02	6.77	10,000	67,700.00
202006 180000 0678	600516	方大炭素	2020-06-18	2020-07-02	6.28	10,000	62,800.00
202006 180000 0680	600299	安迪苏	2020-06-18	2020-07-02	12.22	10,000	122,200.00
202006 180000 0683	601933	永辉超市	2020-06-18	2020-07-02	9.38	10,000	93,800.00
202006 180000 0685	600690	海尔智家	2020-06-18	2020-07-02	17.70	10,000	177,000.00
202006	601225	陕西	2020-06-18	2020-07-02	7.21	10,000	72,100.00

180000 0687		煤业					
202006 180000 0693	600061	国投资 本	2020-06-18	2020-07-02	12.73	10,000	127,300.00
202006 180000 0702	600795	国电电 力	2020-06-18	2020-07-02	1.85	350,200	647,870.00
202006 180000 0703	600011	华能国 际	2020-06-18	2020-07-02	4.22	61,400	259,108.00
202006 180000 0707	600968	海油发 展	2020-06-18	2020-07-02	2.33	10,000	23,300.00
202006 180000 0711	601319	中国人 保	2020-06-18	2020-07-02	6.44	10,000	64,400.00
202006 180000 0716	600025	华能水 电	2020-06-18	2020-07-02	3.79	10,000	37,900.00
202006 180000 0720	600893	航发动 力	2020-06-18	2020-07-02	23.48	10,000	234,800.00
202006 180000 0722	600038	中直股 份	2020-06-18	2020-07-02	41.07	10,000	410,700.00
202006 180000 0724	601088	中国神 华	2020-06-18	2020-07-02	14.36	10,000	143,600.00
202006 180000 0726	601021	春秋航 空	2020-06-18	2020-07-02	35.24	10,000	352,400.00
202006 180000 0728	601298	青岛港	2020-06-18	2020-07-02	5.68	10,000	56,800.00
202006 180000 0730	600011	华能国 际	2020-06-18	2020-07-02	4.22	10,000	42,200.00
202006 180000 0740	601828	美凯龙	2020-06-18	2020-07-02	10.59	10,000	105,900.00
202006 180000 0748	600482	中国动 力	2020-06-18	2020-07-02	15.70	39,700	623,290.00

202006 180000 0763	600674	川投 能源	2020-06-18	2020-07-02	9.27	10,000	92,700.00
202006 180000 0767	601899	紫金 矿业	2020-06-18	2020-07-02	4.40	10,000	44,000.00
202006 180000 0770	600176	中国 巨石	2020-06-18	2020-07-02	9.15	10,000	91,500.00
202006 180000 0771	601998	中信 银行	2020-06-18	2020-07-02	5.15	10,000	51,500.00
202006 180000 0773	600000	浦发 银行	2020-06-18	2020-07-02	10.58	24,300	257,094.00
202006 180000 0774	600867	通化 东宝	2020-06-18	2020-07-02	17.43	10,000	174,300.00
202006 180000 0776	600438	通威 股份	2020-06-18	2020-07-02	17.38	10,000	173,800.00
202006 180000 0790	601633	长城 汽车	2020-06-18	2020-07-02	7.72	10,000	77,200.00
202006 180000 0792	600309	万华 化学	2020-06-18	2020-07-02	49.99	10,000	499,900.00
202006 180000 0794	601992	金隅 集团	2020-06-18	2020-07-02	3.06	10,000	30,600.00
202006 180000 0797	601800	中国 交建	2020-06-18	2020-07-02	7.34	10,000	73,400.00
202006 180000 0802	600009	上海 机场	2020-06-18	2020-07-02	72.07	10,000	720,700.00
202006 180000 0803	600383	金地 集团	2020-06-18	2020-07-02	13.70	10,000	137,000.00
202006 180000 0805	600104	上汽 集团	2020-06-18	2020-07-02	16.99	10,000	169,900.00
202006 180000	600583	海油 工程	2020-06-18	2020-07-02	4.55	10,000	45,500.00

0809							
202006 180000 0810	601919	中远 海控	2020-06-18	2020-07-02	3.47	10,000	34,700.00
202006 180000 0811	600340	华夏 幸福	2020-06-18	2020-07-02	22.86	10,000	228,600.00
202006 180000 0813	600522	中天 科技	2020-06-18	2020-07-02	11.45	10,000	114,500.00
202006 180000 0815	600482	中国 动力	2020-06-18	2020-07-02	15.70	32,000	502,400.00
202006 180000 0816	601877	正泰 电器	2020-06-18	2020-07-02	26.35	10,000	263,500.00
202006 180000 0818	600015	华夏 银行	2020-06-18	2020-07-02	6.12	10,000	61,200.00
202006 180000 0819	600085	同仁 堂	2020-06-18	2020-07-02	27.12	10,000	271,200.00
202006 180000 0822	600406	国电 南瑞	2020-06-18	2020-07-02	20.25	10,000	202,500.00
202006 180000 0824	601169	北京 银行	2020-06-18	2020-07-02	4.90	10,000	49,000.00
202006 180000 0826	600271	航天 信息	2020-06-18	2020-07-02	16.24	10,000	162,400.00
202006 180000 0827	601838	成都 银行	2020-06-18	2020-07-02	7.96	10,000	79,600.00
202006 180000 0839	601360	三六 零	2020-06-18	2020-07-02	18.31	10,000	183,100.00
202006 180000 0841	600115	东方 航空	2020-06-18	2020-07-02	4.22	10,000	42,200.00
202006 180000 0846	603899	晨光 文具	2020-06-18	2020-07-02	54.60	10,000	546,000.00
202006	600177	雅戈	2020-06-18	2020-07-02	5.96	10,000	59,600.00

180000 0851		尔					
202006 180000 0854	600705	中航 资本	2020-06-18	2020-07-02	3.96	10,000	39,600.00
202006 180000 0857	601997	贵阳 银行	2020-06-18	2020-07-02	7.16	10,000	71,600.00
202006 180000 0858	600221	海航 控股	2020-06-18	2020-07-02	1.50	408,200	612,300.00
202006 180000 0860	600606	绿地 控股	2020-06-18	2020-07-02	6.18	10,000	61,800.00
202006 180000 0861	601997	贵阳 银行	2020-06-18	2020-07-02	7.16	85,900	615,044.00
202006 180000 0864	600398	海澜 之家	2020-06-18	2020-07-02	5.82	10,000	58,200.00
202006 180000 0866	603260	合盛 硅业	2020-06-18	2020-07-02	27.34	10,000	273,400.00
202006 180000 0867	601336	新华 保险	2020-06-18	2020-07-02	44.28	10,000	442,800.00
202006 180000 0868	600170	上海 建工	2020-06-18	2020-07-02	3.07	10,000	30,700.00
202006 180000 0869	600029	南方 航空	2020-06-18	2020-07-02	5.17	10,000	51,700.00
202006 180000 0882	601818	光大 银行	2020-06-18	2020-07-02	3.58	10,000	35,800.00
202006 180000 0893	600919	江苏 银行	2020-06-18	2020-07-02	5.67	10,000	56,700.00
202006 180000 0894	601012	隆基 股份	2020-06-18	2020-07-02	40.73	10,000	407,300.00
202006 180000 0897	600362	江西 铜业	2020-06-18	2020-07-02	13.46	10,000	134,600.00

202006 180000 0898	600487	亨通 光电	2020-06-18	2020-07-02	16.41	10,000	164,100.00
202006 180000 0901	600390	五矿 资本	2020-06-18	2020-07-02	7.06	10,000	70,600.00
202006 180000 0903	601808	中海 油服	2020-06-18	2020-07-02	13.14	10,000	131,400.00
202006 180000 0904	601117	中国 化学	2020-06-18	2020-07-02	5.48	10,000	54,800.00
202006 180000 0906	601117	中国 化学	2020-06-18	2020-07-02	5.48	142,700	781,996.00
202006 180000 0907	601939	建设 银行	2020-06-18	2020-07-02	6.31	10,000	63,100.00
202006 180000 0909	601117	中国 化学	2020-06-18	2020-07-02	5.48	117,600	644,448.00
202006 180000 0913	600637	东方 明珠	2020-06-18	2020-07-02	9.65	10,000	96,500.00
202006 180000 0918	601989	中国 重工	2020-06-18	2020-07-02	4.00	10,000	40,000.00
202006 180000 0923	601669	中国 电建	2020-06-18	2020-07-02	3.46	10,000	34,600.00
202006 180000 0925	600297	广汇 汽车	2020-06-18	2020-07-02	3.19	119,200	380,248.00
202006 180000 0931	600926	杭州 银行	2020-06-18	2020-07-02	8.92	10,000	89,200.00
202006 180000 0932	600233	圆通 速递	2020-06-18	2020-07-02	14.56	10,000	145,600.00
202006 180000 0936	600297	广汇 汽车	2020-06-18	2020-07-02	3.19	238,500	760,815.00
202006 180000	601186	中国 铁建	2020-06-18	2020-07-02	8.38	10,000	83,800.00

0939							
202006 180000 0942	600297	广汇 汽车	2020-06-18	2020-07-02	3.19	196,600	627,154.00
202006 180000 0945	603259	药明 康德	2020-06-18	2020-07-02	96.60	10,000	966,000.00
202006 180000 0948	601985	中国 核电	2020-06-18	2020-07-02	4.09	10,000	40,900.00
202006 180000 0952	600928	西安 银行	2020-06-18	2020-07-02	5.26	10,000	52,600.00
202006 180000 0954	600489	中金 黄金	2020-06-18	2020-07-02	9.14	10,000	91,400.00
202006 180000 0955	601111	中国 国航	2020-06-18	2020-07-02	6.61	10,000	66,100.00
202006 180000 0965	603156	养元 饮品	2020-06-18	2020-07-02	21.50	10,000	215,000.00
202006 180000 0971	600004	白云 机场	2020-06-18	2020-07-02	15.24	10,000	152,400.00
202006 180000 0973	600111	北方 稀土	2020-06-18	2020-07-02	9.32	10,000	93,200.00
202006 180000 0984	600977	中国 电影	2020-06-18	2020-07-02	13.13	10,000	131,300.00
202006 180000 0993	601216	君正 集团	2020-06-18	2020-07-02	2.54	10,000	25,400.00
202006 180000 0999	601618	中国 中冶	2020-06-18	2020-07-02	2.51	10,000	25,100.00
202006 180000 1002	603993	洛阳 钼业	2020-06-18	2020-07-02	3.67	10,000	36,700.00
202006 180000 1007	601138	工业 富联	2020-06-18	2020-07-02	15.15	10,000	151,500.00
202006	600208	新湖	2020-06-18	2020-07-02	2.98	128,700	383,526.00

180000 1013		中宝					
202006 180000 1014	601238	广汽集团	2020-06-18	2020-07-02	9.00	10,000	90,000.00
202006 180000 1018	600208	新湖中宝	2020-06-18	2020-07-02	2.98	259,200	772,416.00
202006 180000 1020	600886	国投电力	2020-06-18	2020-07-02	7.86	32,700	257,022.00
202006 180000 1021	600208	新湖中宝	2020-06-18	2020-07-02	2.98	213,600	636,528.00
202006 180000 1022	600027	华电国际	2020-06-18	2020-07-02	3.42	10,000	34,200.00
202006 180000 1023	600886	国投电力	2020-06-18	2020-07-02	7.86	10,000	78,600.00
202006 180000 1024	600547	山东黄金	2020-06-18	2020-07-02	36.62	10,000	366,200.00
202006 180000 1026	603019	中科曙光	2020-06-18	2020-07-02	38.40	10,000	384,000.00
202006 180000 1027	600498	烽火通信	2020-06-18	2020-07-02	28.91	10,000	289,100.00
202006 180000 1028	600660	福耀玻璃	2020-06-18	2020-07-02	20.87	10,000	208,700.00
202006 190000 0159	000063	中兴通讯	2020-06-19	2020-07-03	40.13	10,000	401,300.00
202006 190000 0171	000063	中兴通讯	2020-06-19	2020-07-03	40.13	101,000	4,053,130.00
202006 190000 0172	000063	中兴通讯	2020-06-19	2020-07-03	40.13	24,200	971,146.00
202006 190000 0183	000066	中国长城	2020-06-19	2020-07-03	13.20	65,900	869,880.00

202006 190000 0232	000938	紫光 股份	2020-06-19	2020-07-03	42.98	20,000	859,600.00
202006 190000 0233	000938	紫光 股份	2020-06-19	2020-07-03	42.98	30,000	1,289,400.00
202006 190000 0241	000977	浪潮 信息	2020-06-19	2020-07-03	39.18	30,000	1,175,400.00
202006 190000 0309	002241	歌尔 股份	2020-06-19	2020-07-03	29.36	38,200	1,121,552.00
202006 190000 0351	002714	牧原 股份	2020-06-19	2020-07-03	82.00	10,000	820,000.00
202006 190000 0418	300433	蓝思 科技	2020-06-19	2020-07-03	28.04	63,000	1,766,520.00
202006 190000 0442	600188	兖州 煤业	2020-06-19	2020-07-03	8.76	10,000	87,600.00
202006 190000 0466	600016	民生 银行	2020-06-19	2020-07-03	5.67	25,900	146,853.00
202006 190000 0502	600050	中国 联通	2020-06-19	2020-07-03	4.84	29,800	144,232.00
202006 190000 0515	600482	中国 动力	2020-06-19	2020-07-03	15.70	28,300	444,310.00
202006 190000 0520	600516	方大 炭素	2020-06-19	2020-07-03	6.28	46,500	292,020.00
202006 190000 0529	600000	浦发 银行	2020-06-19	2020-07-03	10.58	13,900	147,062.00
202006 190000 0539	600011	华能 国际	2020-06-19	2020-07-03	4.22	34,400	145,168.00
202006 190000 0559	600221	海航 控股	2020-06-19	2020-07-03	1.50	285,900	428,850.00
202006 190000	601997	贵阳 银行	2020-06-19	2020-07-03	7.16	100,000	716,000.00

0581							
202006 190000 0595	601997	贵阳 银行	2020-06-19	2020-07-03	7.16	19,500	139,620.00
202006 190000 0618	600297	广汇 汽车	2020-06-19	2020-07-03	3.19	138,200	440,858.00
202006 190000 0624	600398	海澜 之家	2020-06-19	2020-07-03	5.82	24,700	143,754.00
202006 190000 0644	601117	中国 化学	2020-06-19	2020-07-03	5.48	80,500	441,140.00
202006 190000 0648	600498	烽火 通信	2020-06-19	2020-07-03	28.91	50,000	1,445,500.00
202006 190000 0649	601117	中国 化学	2020-06-19	2020-07-03	5.48	80,800	442,784.00
202006 220000 0375	000063	中兴 通讯	2020-06-22	2020-07-06	40.13	100,000	4,013,000.00
202006 220000 0390	000066	中国 长城	2020-06-22	2020-07-06	13.20	68,400	902,880.00
202006 220000 0726	000651	格力 电器	2020-06-22	2020-07-06	56.57	10,700	605,299.00
202006 220000 1268	001979	招商 蛇口	2020-06-22	2020-07-06	16.44	30,800	506,352.00
202006 220000 1391	002050	三花 智控	2020-06-22	2020-07-06	21.90	10,000	219,000.00
202006 220000 1879	600588	用友 网络	2020-06-22	2020-07-06	44.10	10,000	441,000.00
202006 220000 1906	601727	上海 电气	2020-06-22	2020-07-06	5.04	114,400	576,576.00
202006 220000 2265	600050	中国 联通	2020-06-22	2020-07-06	4.84	35,400	171,336.00
202006	600795	国电	2020-06-22	2020-07-06	1.85	276,000	510,600.00

220000 2697		电力					
202006 220000 2891	600011	华能 国际	2020-06-22	2020-07-06	4.22	40,800	172,176.00
202006 220000 3024	002371	北方 华创	2020-06-22	2020-07-06	170.91	10,000	1,709,100.00
202006 220000 3073	600482	中国 动力	2020-06-22	2020-07-06	15.70	21,600	339,120.00
202006 220000 3173	600000	浦发 银行	2020-06-22	2020-07-06	10.58	48,400	512,072.00
202006 220000 3910	601997	贵阳 银行	2020-06-22	2020-07-06	7.16	23,200	166,112.00
202006 220000 4247	600398	海澜 之家	2020-06-22	2020-07-06	5.82	29,300	170,526.00
202006 220000 4617	600016	民生 银行	2020-06-22	2020-07-06	5.67	30,800	174,636.00
202006 220000 4627	600297	广汇 汽车	2020-06-22	2020-07-06	3.19	51,600	164,604.00
202006 220000 4729	601985	中国 核电	2020-06-22	2020-07-06	4.09	42,100	172,189.00
202006 220000 5110	603993	洛阳 钼业	2020-06-22	2020-07-06	3.67	50,000	183,500.00
202006 220000 5746	300433	蓝思 科技	2020-06-22	2020-07-06	28.04	61,000	1,710,440.00
202006 090000 1295	601857	中国 石油	2020-06-09	2020-07-07	4.19	1,000,000	4,190,000.00
202006 090000 1525	601857	中国 石油	2020-06-09	2020-07-07	4.19	1,000,000	4,190,000.00
202006 090000 2869	601857	中国 石油	2020-06-09	2020-07-07	4.19	1,000,000	4,190,000.00

202006 090000 4349	601857	中国 石油	2020-06-09	2020-07-07	4.19	1,000,000	4,190,000.00
202006 230000 0203	000723	美锦 能源	2020-06-23	2020-07-07	6.26	48,200	301,732.00
202006 230000 0237	001979	招商 蛇口	2020-06-23	2020-07-07	16.44	80,000	1,315,200.00
202006 230000 0242	001979	招商 蛇口	2020-06-23	2020-07-07	16.44	26,100	429,084.00
202006 230000 0596	600016	民生 银行	2020-06-23	2020-07-07	5.67	76,300	432,621.00
202006 230000 0625	600219	南山 铝业	2020-06-23	2020-07-07	2.03	200,000	406,000.00
202006 230000 0701	600795	国电 电力	2020-06-23	2020-07-07	1.85	145,900	269,915.00
202006 230000 0706	600221	海航 控股	2020-06-23	2020-07-07	1.50	121,400	182,100.00
202006 230000 0720	600000	浦发 银行	2020-06-23	2020-07-07	10.58	41,000	433,780.00
202006 230000 0738	600487	亨通 光电	2020-06-23	2020-07-07	16.41	35,100	575,991.00
202006 230000 0739	600745	闻泰 科技	2020-06-23	2020-07-07	125.95	10,000	1,259,500.00
202006 230000 0751	600297	广汇 汽车	2020-06-23	2020-07-07	3.19	86,400	275,616.00
202006 230000 0760	600297	广汇 汽车	2020-06-23	2020-07-07	3.19	49,300	157,267.00
202006 230000 0785	601985	中国 核电	2020-06-23	2020-07-07	4.09	39,800	162,782.00
202006 230000	603019	中科 曙光	2020-06-23	2020-07-07	38.40	15,600	599,040.00

0817							
202006 230000 0839	600010	包钢 股份	2020-06-23	2020-07-07	1.08	300,000	324,000.00
202006 240000 0989	600516	方大 炭素	2020-06-24	2020-07-08	6.28	13,700	86,036.00
202006 240000 1888	600177	雅戈 尔	2020-06-24	2020-07-08	5.96	561,100	3,344,156.00
202006 240000 2336	002475	立讯 精密	2020-06-24	2020-07-08	51.35	36,800	1,889,680.00
202006 240000 2536	600977	中国 电影	2020-06-24	2020-07-08	13.13	24,700	324,311.00
202006 240000 2542	002602	世纪 华通	2020-06-24	2020-07-08	15.31	55,800	854,298.00
202006 240000 2704	300033	同花 顺	2020-06-24	2020-07-08	133.08	50,500	6,720,540.00
202006 240000 2764	300122	智飞 生物	2020-06-24	2020-07-08	100.15	18,100	1,812,715.00
202006 240000 2888	300408	三环 集团	2020-06-24	2020-07-08	27.70	20,000	554,000.00
202006 150000 0210	000066	中国 长城	2020-06-15	2020-07-13	13.20	60,000	792,000.00
202006 150000 0645	002352	顺丰 控股	2020-06-15	2020-07-13	54.70	238,400	13,040,480.00
202006 150000 0826	002916	深南 电路	2020-06-15	2020-07-13	167.52	10,000	1,675,200.00
202006 150000 0829	002916	深南 电路	2020-06-15	2020-07-13	167.52	15,000	2,512,800.00
202006 150000 0988	300433	蓝思 科技	2020-06-15	2020-07-13	28.04	81,800	2,293,672.00
202006	600516	方大	2020-06-15	2020-07-13	6.28	50,000	314,000.00

150000 1021		炭素					
202006 150000 1037	600196	复星医药	2020-06-15	2020-07-13	33.85	450,000	15,232,500.00
202006 150000 1074	603986	兆易创新	2020-06-15	2020-07-13	235.91	50,000	11,795,500.00
202006 150000 1100	601066	中信建投	2020-06-15	2020-07-13	39.38	60,000	2,362,800.00
202006 150000 1254	603799	华友钴业	2020-06-15	2020-07-13	38.86	110,000	4,274,600.00
202006 150000 1560	603658	安图生物	2020-06-15	2020-07-13	162.44	54,100	8,788,004.00
202006 150000 1678	600028	中国石化	2020-06-15	2020-07-13	3.91	1,000,000	3,910,000.00
202006 290000 0200	000100	TCL科技	2020-06-29	2020-07-13	6.20	60,000	372,000.00
202006 290000 0248	000651	格力电器	2020-06-29	2020-07-13	56.57	13,800	780,666.00
202006 290000 0395	002129	中环股份	2020-06-29	2020-07-13	22.46	52,600	1,181,396.00
202006 290000 0485	002415	海康威视	2020-06-29	2020-07-13	30.35	268,500	8,148,975.00
202006 290000 0539	002602	世纪华通	2020-06-29	2020-07-13	15.31	100,000	1,531,000.00
202006 290000 0608	300015	爱尔眼科	2020-06-29	2020-07-13	43.45	16,200	703,890.00
202006 290000 0741	300433	蓝思科技	2020-06-29	2020-07-13	28.04	60,000	1,682,400.00
202006 290000 0790	300628	亿联网络	2020-06-29	2020-07-13	68.26	26,000	1,774,760.00

202006 290000 0835	600118	中国 卫星	2020-06-29	2020-07-13	30.83	18,700	576,521.00
202006 290000 0874	600016	民生 银行	2020-06-29	2020-07-13	5.67	108,600	615,762.00
202006 290000 0939	600588	用友 网络	2020-06-29	2020-07-13	44.10	72,000	3,175,200.00
202006 290000 0977	601992	金隅 集团	2020-06-29	2020-07-13	3.06	199,800	611,388.00
202006 290000 1077	601360	三六 零	2020-06-29	2020-07-13	18.31	13,600	249,016.00
202006 290000 1209	601985	中国 核电	2020-06-29	2020-07-13	4.09	40,100	164,009.00
202006 290000 1252	601138	工业 富联	2020-06-29	2020-07-13	15.15	100,000	1,515,000.00
202006 290000 1281	601138	工业 富联	2020-06-29	2020-07-13	15.15	22,000	333,300.00
202006 160000 0255	000066	中国 长城	2020-06-16	2020-07-14	13.20	60,000	792,000.00
202006 160000 0291	000100	TCL 科技	2020-06-16	2020-07-14	6.20	229,100	1,420,420.00
202006 160000 0435	000625	长安 汽车	2020-06-16	2020-07-14	11.00	96,000	1,056,000.00
202006 160000 0486	000709	河钢 股份	2020-06-16	2020-07-14	2.04	350,000	714,000.00
202006 160000 0556	000776	广发 证券	2020-06-16	2020-07-14	14.12	800,000	11,296,000.00
202006 160000 0624	000876	新希 望	2020-06-16	2020-07-14	29.80	100,000	2,980,000.00
202006 160000	000876	新希	2020-06-16	2020-07-14	29.80	35,000	1,043,000.00

0627		望					
202006 160000 0630	000876	新 希 望	2020-06-16	2020-07-14	29.80	70,000	2,086,000.00
202006 160000 0720	000977	浪潮 信息	2020-06-16	2020-07-14	39.18	26,000	1,018,680.00
202006 160000 0745	600118	中国 卫星	2020-06-16	2020-07-14	30.83	30,000	924,900.00
202006 160000 0779	001979	招商 蛇口	2020-06-16	2020-07-14	16.44	750,000	12,330,000.00
202006 160000 0805	600516	方大 炭素	2020-06-16	2020-07-14	6.28	158,000	992,240.00
202006 160000 1001	600029	南方 航空	2020-06-16	2020-07-14	5.17	10,000	51,700.00
202006 160000 1017	600221	海航 控股	2020-06-16	2020-07-14	1.50	632,000	948,000.00
202006 160000 1029	600109	国金 证券	2020-06-16	2020-07-14	11.41	15,800	180,278.00
202006 160000 1067	600109	国金 证券	2020-06-16	2020-07-14	11.41	1,000,000	11,410,000.00
202006 160000 1132	600352	浙江 龙盛	2020-06-16	2020-07-14	12.79	10,000	127,900.00
202006 160000 1136	600352	浙江 龙盛	2020-06-16	2020-07-14	12.79	990,000	12,662,100.00
202006 160000 1293	002044	美年 健康	2020-06-16	2020-07-14	14.41	152,100	2,191,761.00
202006 160000 1294	002044	美年 健康	2020-06-16	2020-07-14	14.41	1,000,000	14,410,000.00
202006 160000 1379	601857	中国 石油	2020-06-16	2020-07-14	4.19	79,400	332,686.00
202006	601989	中国	2020-06-16	2020-07-14	4.00	990,000	3,960,000.00

160000 1712		重工					
202006 160000 1723	601989	中国 重工	2020-06-16	2020-07-14	4.00	1,000,000	4,000,000.00
202006 160000 1728	601989	中国 重工	2020-06-16	2020-07-14	4.00	10,000	40,000.00
202006 160000 1734	601989	中国 重工	2020-06-16	2020-07-14	4.00	1,000,000	4,000,000.00
202006 160000 1739	601108	财通 证券	2020-06-16	2020-07-14	10.25	990,000	10,147,500.00
202006 160000 1744	601108	财通 证券	2020-06-16	2020-07-14	10.25	10,000	102,500.00
202006 160000 1773	601231	环旭 电子	2020-06-16	2020-07-14	21.84	53,000	1,157,520.00
202006 160000 1878	600703	三安 光电	2020-06-16	2020-07-14	25.00	990,000	24,750,000.00
202006 160000 1884	600703	三安 光电	2020-06-16	2020-07-14	25.00	10,000	250,000.00
202006 160000 1998	601009	南京 银行	2020-06-16	2020-07-14	7.33	1,000,000	7,330,000.00
202006 160000 2006	601009	南京 银行	2020-06-16	2020-07-14	7.33	1,000,000	7,330,000.00
202006 160000 2014	601009	南京 银行	2020-06-16	2020-07-14	7.33	300,000	2,199,000.00
202006 160000 2073	601319	中国 人保	2020-06-16	2020-07-14	6.44	160,000	1,030,400.00
202006 160000 2080	600977	中国 电影	2020-06-16	2020-07-14	13.13	78,000	1,024,140.00
202006 160000 2358	600028	中国 石化	2020-06-16	2020-07-14	3.91	1,000,000	3,910,000.00

202006 160000 2382	600028	中国 石化	2020-06-16	2020-07-14	3.91	1,000,000	3,910,000.00
202006 160000 2396	600028	中国 石化	2020-06-16	2020-07-14	3.91	1,000,000	3,910,000.00
202006 160000 2434	600028	中国 石化	2020-06-16	2020-07-14	3.91	200,000	782,000.00
202006 160000 2455	600522	中天 科技	2020-06-16	2020-07-14	11.45	90,000	1,030,500.00
202006 160000 2582	601377	兴业 证券	2020-06-16	2020-07-14	6.85	700,000	4,795,000.00
202006 160000 2595	601377	兴业 证券	2020-06-16	2020-07-14	6.85	1,000,000	6,850,000.00
202006 160000 2603	600837	海通 证券	2020-06-16	2020-07-14	12.58	10,000	125,800.00
202006 160000 2609	600837	海通 证券	2020-06-16	2020-07-14	12.58	990,000	12,454,200.00
202006 160000 2683	601727	上海 电气	2020-06-16	2020-07-14	5.04	204,000	1,028,160.00
202006 160000 2826	002422	科伦 药业	2020-06-16	2020-07-14	21.00	200,000	4,200,000.00
202006 160000 2857	002456	欧菲 光	2020-06-16	2020-07-14	18.39	63,000	1,158,570.00
202006 160000 2862	002456	欧菲 光	2020-06-16	2020-07-14	18.39	650,000	11,953,500.00
202006 160000 2890	002468	申通 快递	2020-06-16	2020-07-14	16.41	55,000	902,550.00
202006 160000 2953	002558	巨人 网络	2020-06-16	2020-07-14	17.40	57,000	991,800.00
202006 160000	002607	中公 教育	2020-06-16	2020-07-14	27.75	35,000	971,250.00

2998							
202006 160000 3048	002714	牧原 股份	2020-06-16	2020-07-14	82.00	14,000	1,148,000.00
202006 160000 3056	002739	万达 电影	2020-06-16	2020-07-14	15.27	63,000	962,010.00
202006 160000 3105	002939	长城 证券	2020-06-16	2020-07-14	12.32	82,000	1,010,240.00
202006 160000 3186	300059	东方 财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	200,000	4,040,000.00
202006 160000 3203	300059	东方 财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	600,000	12,120,000.00
202006 300000 0981	001979	招商 蛇口	2020-06-30	2020-07-14	16.44	26,600	437,304.00
202006 300000 1212	002129	中环 股份	2020-06-30	2020-07-14	22.46	52,600	1,181,396.00
202006 300000 1655	002463	沪电 股份	2020-06-30	2020-07-14	24.98	30,000	749,400.00
202006 300000 1781	002602	世纪 华通	2020-06-30	2020-07-14	15.31	100,000	1,531,000.00
202006 300000 1944	300015	爱尔 眼科	2020-06-30	2020-07-14	43.45	10,100	438,845.00
202006 300000 2262	300628	亿联 网络	2020-06-30	2020-07-14	68.26	26,000	1,774,760.00
202006 300000 2398	600118	中国 卫星	2020-06-30	2020-07-14	30.83	18,400	567,272.00
202006 300000 2572	600028	中国 石化	2020-06-30	2020-07-14	3.91	55,400	216,614.00
202006 300000 2734	600795	国电 电力	2020-06-30	2020-07-14	1.85	236,600	437,710.00
202006	600438	通威	2020-06-30	2020-07-14	17.38	43,400	754,292.00

300000 2990		股份					
202006 300000 3012	601992	金隅 集团	2020-06-30	2020-07-14	3.06	142,700	436,662.00
202006 300000 3364	601360	三六 零	2020-06-30	2020-07-14	18.31	13,600	249,016.00
202006 300000 3706	600016	民生 银行	2020-06-30	2020-07-14	5.67	38,500	218,295.00
202006 300000 3731	601985	中国 核电	2020-06-30	2020-07-14	4.09	53,300	217,997.00
202006 300000 3982	600498	烽火 通信	2020-06-30	2020-07-14	28.91	20,000	578,200.00
202006 300000 7944	002352	顺丰 控股	2020-06-30	2020-07-14	54.70	247,900	13,560,130.00
202006 300000 7994	000723	美锦 能源	2020-06-30	2020-07-14	6.26	247,600	1,549,976.00
202006 300000 8216	002466	天齐 锂业	2020-06-30	2020-07-14	22.95	204,600	4,695,570.00
202006 170000 0501	000063	中兴 通讯	2020-06-17	2020-07-15	40.13	20,000	802,600.00
202006 170000 0555	000100	TCL 科技	2020-06-17	2020-07-15	6.20	280,000	1,736,000.00
202006 170000 1069	600795	国电 电力	2020-06-17	2020-07-15	1.85	273,000	505,050.00
202006 170000 1101	600516	方大 炭素	2020-06-17	2020-07-15	6.28	142,700	896,156.00
202006 170000 1165	000876	新希 望	2020-06-17	2020-07-15	29.80	35,000	1,043,000.00
202006 170000 1398	600221	海航 控股	2020-06-17	2020-07-15	1.50	310,700	466,050.00

202006 170000 1586	600068	葛洲 坝	2020-06-17	2020-07-15	5.95	83,300	495,635.00
202006 170000 1594	600219	南山 铝业	2020-06-17	2020-07-15	2.03	485,000	984,550.00
202006 170000 2102	601212	白银 有色	2020-06-17	2020-07-15	2.55	101,400	258,570.00
202006 170000 2276	603799	华友 钴业	2020-06-17	2020-07-15	38.86	15,000	582,900.00
202006 170000 2315	002024	苏宁 易购	2020-06-17	2020-07-15	8.77	11,300	99,101.00
202006 170000 2873	600482	中国 动力	2020-06-17	2020-07-15	15.70	30,700	481,990.00
202006 170000 3251	601117	中国 化学	2020-06-17	2020-07-15	5.48	90,700	497,036.00
202006 170000 3295	603019	中科 曙光	2020-06-17	2020-07-15	38.40	24,000	921,600.00
202006 170000 4055	002236	大华 股份	2020-06-17	2020-07-15	19.21	60,000	1,152,600.00
202006 170000 4285	600276	恒瑞 医药	2020-06-17	2020-07-15	92.30	10,000	923,000.00
202006 170000 4434	600297	广汇 汽车	2020-06-17	2020-07-15	3.19	152,000	484,880.00
202006 170000 4469	601727	上海 电气	2020-06-17	2020-07-15	5.04	250,200	1,261,008.00
202006 170000 4533	600183	生益 科技	2020-06-17	2020-07-15	29.27	35,000	1,024,450.00
202006 180000 0132	000066	中国 长城	2020-06-18	2020-07-16	13.20	60,000	792,000.00
202006 180000	002007	华兰 生物	2020-06-18	2020-07-16	50.11	20,000	1,002,200.00

0221							
202006 180000 0317	002241	歌尔 股份	2020-06-18	2020-07-16	29.36	130,000	3,816,800.00
202006 180000 0365	002475	立讯 精密	2020-06-18	2020-07-16	51.35	50,000	2,567,500.00
202006 180000 0386	002601	龙蟒 佰利	2020-06-18	2020-07-16	18.50	57,000	1,054,500.00
202006 180000 0391	002602	世纪 华通	2020-06-18	2020-07-16	15.31	50,000	765,500.00
202006 180000 0442	300015	爱尔 眼科	2020-06-18	2020-07-16	43.45	22,000	955,900.00
202006 180000 0450	300033	同花 顺	2020-06-18	2020-07-16	133.08	10,000	1,330,800.00
202006 180000 0563	600795	国电 电力	2020-06-18	2020-07-16	1.85	194,500	359,825.00
202006 180000 0597	603899	晨光 文具	2020-06-18	2020-07-16	54.60	19,000	1,037,400.00
202006 180000 0637	600221	海航 控股	2020-06-18	2020-07-16	1.50	226,700	340,050.00
202006 180000 0742	603833	欧派 家居	2020-06-18	2020-07-16	115.90	10,000	1,159,000.00
202006 180000 0758	600690	海尔 智家	2020-06-18	2020-07-16	17.70	29,800	527,460.00
202006 180000 0759	603833	欧派 家居	2020-06-18	2020-07-16	115.90	10,000	1,159,000.00
202006 180000 0870	600498	烽火 通信	2020-06-18	2020-07-16	28.91	20,000	578,200.00
202006 180000 0873	600498	烽火 通信	2020-06-18	2020-07-16	28.91	17,000	491,470.00
202006	603369	今世	2020-06-18	2020-07-16	39.79	27,000	1,074,330.00

180000 0950		缘					
202006 180000 0985	601360	三六 零	2020-06-18	2020-07-16	18.31	26,500	485,215.00
202006 180000 1025	600848	上海 临港	2020-06-18	2020-07-16	21.47	23,200	498,104.00
202006 190000 0184	000100	TCL 科技	2020-06-19	2020-07-17	6.20	100,000	620,000.00
202006 190000 0219	000876	新 希 望	2020-06-19	2020-07-17	29.80	15,000	447,000.00
202006 190000 0282	002129	中环 股份	2020-06-19	2020-07-17	22.46	10,000	224,600.00
202006 190000 0336	002463	沪电 股份	2020-06-19	2020-07-17	24.98	40,000	999,200.00
202006 190000 0364	300033	同花 顺	2020-06-19	2020-07-17	133.08	10,000	1,330,800.00
202006 190000 0391	300142	沃森 生物	2020-06-19	2020-07-17	52.36	50,000	2,618,000.00
202006 190000 0396	300144	宋城 演艺	2020-06-19	2020-07-17	17.30	55,000	951,500.00
202006 190000 0429	300601	康泰 生物	2020-06-19	2020-07-17	162.16	20,000	3,243,200.00
202006 190000 0437	600516	方大 炭素	2020-06-19	2020-07-17	6.28	45,300	284,484.00
202006 190000 0440	600516	方大 炭素	2020-06-19	2020-07-17	6.28	36,000	226,080.00
202006 190000 0452	600221	海航 控股	2020-06-19	2020-07-17	1.50	113,900	170,850.00
202006 190000 0482	601800	中国 交建	2020-06-19	2020-07-17	7.34	127,000	932,180.00

202006 190000 0528	601600	中国 铝业	2020-06-19	2020-07-17	2.76	353,000	974,280.00
202006 190000 0552	600482	中国 动力	2020-06-19	2020-07-17	15.70	18,700	293,590.00
202006 190000 0633	600025	华能 水电	2020-06-19	2020-07-17	3.79	273,000	1,034,670.00
202006 190000 0638	601997	贵阳 银行	2020-06-19	2020-07-17	7.16	39,800	284,968.00
202006 190000 0642	600297	广汇 汽车	2020-06-19	2020-07-17	3.19	91,100	290,609.00
202006 190000 0667	601216	君正 集团	2020-06-19	2020-07-17	2.54	200,000	508,000.00
202006 150000 1736	600999	招商 证券	2020-06-15	2020-07-20	21.95	600,000	13,170,000.00
202006 220000 0448	000100	TCL 科技	2020-06-22	2020-07-20	6.20	100,000	620,000.00
202006 220000 0648	000596	古井 贡酒	2020-06-22	2020-07-20	150.24	10,000	1,502,400.00
202006 220000 1006	000876	新希 望	2020-06-22	2020-07-20	29.80	40,000	1,192,000.00
202006 220000 1631	601985	中国 核电	2020-06-22	2020-07-20	4.09	89,900	367,691.00
202006 220000 1639	600795	国电 电力	2020-06-22	2020-07-20	1.85	200,000	370,000.00
202006 220000 1889	600745	闻泰 科技	2020-06-22	2020-07-20	125.95	10,000	1,259,500.00
202006 220000 2376	603501	韦尔 股份	2020-06-22	2020-07-20	201.95	65,000	13,126,750.00
202006 220000	002352	顺丰 控股	2020-06-22	2020-07-20	54.70	11,000	601,700.00

2979							
202006 220000 3944	600498	烽火 通信	2020-06-22	2020-07-20	28.91	33,000	954,030.00
202006 220000 4061	002460	赣锋 锂业	2020-06-22	2020-07-20	53.57	18,000	964,260.00
202006 220000 4218	600398	海澜 之家	2020-06-22	2020-07-20	5.82	62,500	363,750.00
202006 220000 4818	600297	广汇 汽车	2020-06-22	2020-07-20	3.19	110,100	351,219.00
202006 220000 5280	300014	亿纬 锂能	2020-06-22	2020-07-20	47.85	15,000	717,750.00
202006 230000 0185	000651	格力 电器	2020-06-23	2020-07-21	56.57	10,000	565,700.00
202006 230000 0215	000876	新希 望	2020-06-23	2020-07-21	29.80	48,000	1,430,400.00
202006 230000 0216	000876	新希 望	2020-06-23	2020-07-21	29.80	250,000	7,450,000.00
202006 230000 0220	000876	新希 望	2020-06-23	2020-07-21	29.80	87,200	2,598,560.00
202006 230000 0229	000938	紫光 股份	2020-06-23	2020-07-21	42.98	23,000	988,540.00
202006 230000 0249	002007	华兰 生物	2020-06-23	2020-07-21	50.11	300,000	15,033,000.00
202006 230000 0267	002129	中环 股份	2020-06-23	2020-07-21	22.46	76,600	1,720,436.00
202006 230000 0297	002371	北方 华创	2020-06-23	2020-07-21	170.91	12,000	2,050,920.00
202006 230000 0352	300015	爱尔 眼科	2020-06-23	2020-07-21	43.45	10,000	434,500.00
202006	601985	中国	2020-06-23	2020-07-21	4.09	94,500	386,505.00

230000 0551		核电					
202006 230000 0557	600795	国电 电力	2020-06-23	2020-07-21	1.85	211,500	391,275.00
202006 230000 0560	600016	民生 银行	2020-06-23	2020-07-21	5.67	68,600	388,962.00
202006 230000 0687	600655	豫园 股份	2020-06-23	2020-07-21	8.86	113,000	1,001,180.00
202006 230000 0712	603799	华友 钴业	2020-06-23	2020-07-21	38.86	12,000	466,320.00
202006 230000 0719	600346	恒力 石化	2020-06-23	2020-07-21	14.00	74,000	1,036,000.00
202006 230000 0802	600297	广汇 汽车	2020-06-23	2020-07-21	3.19	116,900	372,911.00
202006 240000 0220	000100	TCL 科技	2020-06-24	2020-07-22	6.20	65,600	406,720.00
202006 240000 0415	600516	方大 炭素	2020-06-24	2020-07-22	6.28	37,000	232,360.00
202006 240000 0736	000977	浪潮 信息	2020-06-24	2020-07-22	39.18	100,000	3,918,000.00
202006 240000 1473	002157	正邦 科技	2020-06-24	2020-07-22	17.48	100,000	1,748,000.00
202006 240000 2321	002460	赣锋 锂业	2020-06-24	2020-07-22	53.57	210,600	11,281,842.00
202006 240000 2341	601360	三六 零	2020-06-24	2020-07-22	18.31	53,000	970,430.00
202006 240000 2529	600848	上海 临港	2020-06-24	2020-07-22	21.47	162,300	3,484,581.00
202006 240000 2647	002714	牧原 股份	2020-06-24	2020-07-22	82.00	29,200	2,394,400.00

202006 290000 0284	000860	顺鑫 农业	2020-06-29	2020-07-27	56.98	18,000	1,025,640.00
202006 290000 0312	000961	中南 建设	2020-06-29	2020-07-27	8.90	112,000	996,800.00
202006 290000 0396	002129	中环 股份	2020-06-29	2020-07-27	22.46	19,800	444,708.00
202006 290000 0596	300015	爱尔 眼科	2020-06-29	2020-07-27	43.45	10,000	434,500.00
202006 290000 0823	601985	中国 核电	2020-06-29	2020-07-27	4.09	70,100	286,709.00
202006 290000 0860	600795	国电 电力	2020-06-29	2020-07-27	1.85	600,000	1,110,000.00
202006 290000 0900	601006	大秦 铁路	2020-06-29	2020-07-27	7.04	40,500	285,120.00
202006 290000 0953	600010	包钢 股份	2020-06-29	2020-07-27	1.08	200,000	216,000.00
202006 290000 0992	600010	包钢 股份	2020-06-29	2020-07-27	1.08	1,000,000	1,080,000.00
202006 290000 1013	603019	中科 曙光	2020-06-29	2020-07-27	38.40	10,000	384,000.00
202006 290000 1113	601012	隆基 股份	2020-06-29	2020-07-27	40.73	12,000	488,760.00
202006 290000 1248	600438	通威 股份	2020-06-29	2020-07-27	17.38	58,000	1,008,040.00
202006 290000 1317	601992	金隅 集团	2020-06-29	2020-07-27	3.06	93,100	284,886.00
202006 300000 0402	000066	中国 长城	2020-06-30	2020-07-28	13.20	31,600	417,120.00
202006 300000	000723	美锦 能源	2020-06-30	2020-07-28	6.26	65,300	408,778.00

0684							
202006 300000 0687	000723	美锦 能源	2020-06-30	2020-07-28	6.26	13,700	85,762.00
202006 300000 1885	002958	青农 商行	2020-06-30	2020-07-28	4.43	227,000	1,005,610.00
202006 300000 1931	300014	亿纬 锂能	2020-06-30	2020-07-28	47.85	10,000	478,500.00
202006 300000 2209	300413	芒果 超媒	2020-06-30	2020-07-28	65.20	15,000	978,000.00
202006 300000 2705	601155	新城 控股	2020-06-30	2020-07-28	31.24	15,700	490,468.00
202006 300000 2925	600390	五矿 资本	2020-06-30	2020-07-28	7.06	64,800	457,488.00
202006 300000 3109	600085	同仁 堂	2020-06-30	2020-07-28	27.12	18,700	507,144.00
202006 300000 3613	603156	养元 饮品	2020-06-30	2020-07-28	21.50	23,700	509,550.00
202006 300000 3681	600893	航发 动力	2020-06-30	2020-07-28	23.48	21,400	502,472.00
202006 300000 3781	603369	今世 缘	2020-06-30	2020-07-28	39.79	13,200	525,228.00
合计	-	-	-	-	-	-	661,777,833.00

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟

踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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同责任，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股份制商业银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近

1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并通过券款对付的方式进行交割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。

本基金债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	168,000.00
AAA 以下	6,513,400.00	1,745,100.00
未评级	-	-
合计	6,513,400.00	1,913,100.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日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，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即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《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流

动性情况良好。

#### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	110,010,228.35	-	-	-	110,010,228.35
结算备付金	34,878,823.59	-	-	-	34,878,823.59
存出保证金	3,033,276.06	-	-	15,022,620.00	18,055,896.06
交易性金融资产	-	-	6,513,400.00	22,559,526,193.80	22,566,039,593.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	133,000,000.00	-	-	-	133,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	17,643,843.48	17,643,843.48
应收利息	-	-	-	397,375.34	397,375.34
应收股利	-	-	-	1,493,707.96	1,493,707.96
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	280,922,328.00	-	6,513,400.00	22,594,083,740.58	22,881,519,468.58
负债					
短期借款	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	137,981,613.46	137,981,613.46
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,208,215.03	10,208,215.03
应付托管费	-	-	-	2,041,643.02	2,041,643.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,694,412.79	3,694,412.79
应付税费	-	-	-	118,401.75	118,401.75
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,154,400.22	2,154,400.22
负债总计	-	-	-	156,198,686.27	156,198,686.27
利率敏感度缺口	280,922,328.00	-	6,513,400.00	22,437,885,054.31	22,725,320,782.31
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,703,693.53	-	-	-	21,703,693.53
结算备付金	26,697,797.36	-	-	-	26,697,797.36
存出保证金	1,203,615.62	-	-	15,316,068.00	16,519,683.62
交易性金融资产	-	-	1,913,100.00	27,005,582,800.25	27,007,495,900.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	134,000,000.00	-	-	-	134,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	21,616,190.17	21,616,190.17
应收利息	-	-	-	61,641.94	61,641.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	183,605,106.51	-	1,913,100.00	27,042,576,700.36	27,228,094,906.87

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	27,591,856.16	27,591,856.16
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,418,555.77	10,418,555.77
应付托管费	-	-	-	2,083,711.14	2,083,711.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,490,274.14	2,490,274.14
应付税费	-	-	-	42,243.71	42,243.71
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,079,066.30	2,079,066.30
负债总计	-	-	-	44,705,707.22	44,705,707.22
利率敏感度缺口	183,605,106.51	-	1,913,100.00	26,997,870,993.14	27,183,389,199.65

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03% (2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数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 2020年6月30日		上年度末 2019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	22,559,526,193.80	99.27	27,005,582,800.25	99.35
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	22,559,526,193.80	99.27	27,005,582,800.25	99.35

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)		
	本期末(2020年6月30日)	上年度末(2019年12月31日)	
分析	业绩比较基准上升5%	1,137,589,224.75	1,357,032,026.50
	业绩比较基准下降5%	-1,137,589,224.75	-1,357,032,026.50

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 22,557,845,523.05 元，属于第二层次的余额为 8,194,070.75 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 26,954,276,081.10 元，第二层次 53,219,819.15 元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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）。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 除公允价值外，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	22,559,526,193.80	98.59
	其中：股票	22,559,526,193.80	98.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,513,400.00	0.03
	其中：债券	6,513,400.00	0.03
	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	133,000,000.00	0.58
	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	144,889,051.94	0.63
8	其他各项资产	37,590,822.84	0.16
9	合计	22,881,519,468.58	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 661,777,833.00 元，占基金资产净值的比例为 2.91%。

### 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	335,546,786.00	1.48
B	采矿业	544,974,260.90	2.40
C	制造业	10,825,656,114.77	47.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	459,543,105.19	2.02
E	建筑业	447,196,389.18	1.97
F	批发和零售业	232,600,164.79	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	634,016,483.09	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	923,708,729.65	4.06
J	金融业	6,385,064,306.48	28.10
K	房地产业	844,270,481.28	3.72
L	租赁和商务服务业	322,292,089.62	1.42
M	科学研究和技术服务业	152,542,315.80	0.67
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	28,681,095.75	0.13

Q	卫生和社会工作	275,180,816.47	1.21
R	文化、体育和娱乐业	146,407,392.52	0.64
S	综合	-	-
	合计	22,557,680,531.49	99.26

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,654,930.54	0.01
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	190,731.77	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,845,662.31	0.01

### 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	601318	中国平安	16,509,144	1,178,752,881.60	5.19
2	600519	贵州茅台	766,822	1,121,768,567.36	4.94
3	600036	招商银行	15,724,456	530,228,656.32	2.33
4	600276	恒瑞医药	5,661,824	522,586,355.20	2.30
5	000858	五粮液	2,957,765	506,132,746.80	2.23
6	000333	美的集团	7,466,737	446,436,205.23	1.96
7	000651	格力电器	7,334,886	414,934,501.02	1.83
8	002475	立讯精密	6,385,905	327,916,221.75	1.44

9	600030	中信证券	12,982,740	313,013,861.40	1.38
10	601166	兴业银行	18,999,532	299,812,614.96	1.32
11	600887	伊利股份	9,247,342	287,869,756.46	1.27
12	000002	万科A	10,373,385	271,160,283.90	1.19
13	601398	工商银行	53,415,757	266,010,469.86	1.17
14	600900	长江电力	13,411,022	254,004,756.68	1.12
15	601888	中国中免	1,483,991	228,579,133.73	1.01
16	601328	交通银行	41,873,326	214,810,162.38	0.95
17	300059	东方财富	9,824,911	198,463,202.20	0.87
18	600585	海螺水泥	3,657,567	193,521,869.97	0.85
19	000725	京东方A	41,285,425	192,802,934.75	0.85
20	600000	浦发银行	17,899,538	189,377,112.04	0.83
21	000001	平安银行	14,787,487	189,279,833.60	0.83
22	000661	长春高新	431,388	187,783,196.40	0.83
23	002714	牧原股份	2,284,479	187,327,278.00	0.82
24	603288	海天味业	1,480,936	184,228,438.40	0.81
25	600016	民生银行	32,426,878	183,860,398.26	0.81
26	002415	海康威视	5,696,326	172,883,494.10	0.76
27	600031	三一重工	8,999,349	168,827,787.24	0.74
28	601688	华泰证券	8,970,739	168,649,893.20	0.74
29	000063	中兴通讯	4,110,981	164,973,667.53	0.73
30	601012	隆基股份	4,023,824	163,890,351.52	0.72
31	600048	保利地产	10,910,794	161,261,535.32	0.71
32	600837	海通证券	12,332,386	155,141,415.88	0.68
33	603259	药明康德	1,579,113	152,542,315.80	0.67
34	601668	中国建筑	31,978,032	152,535,212.64	0.67
35	300498	温氏股份	6,799,060	148,219,508.00	0.65
36	601288	农业银行	43,788,297	148,004,443.86	0.65
37	600570	恒生电子	1,273,864	137,195,152.80	0.60
38	300015	爱尔眼科	3,068,919	133,344,530.55	0.59
39	000100	TCL科技	20,617,564	127,828,896.80	0.56
40	601229	上海银行	15,155,310	125,789,073.00	0.55
41	300142	沃森生物	2,342,981	122,678,485.16	0.54
42	002142	宁波银行	4,577,846	120,260,014.42	0.53
43	600309	万华化学	2,393,283	119,640,217.17	0.53
44	601211	国泰君安	6,873,567	118,637,766.42	0.52
45	603986	兆易创新	502,205	118,475,181.55	0.52
46	601601	中国太保	4,147,323	113,014,551.75	0.50
47	601988	中国银行	32,120,429	111,779,092.92	0.49
48	601169	北京银行	22,555,849	110,523,660.10	0.49
49	002352	顺丰控股	2,019,600	110,472,120.00	0.49
50	600588	用友网络	2,475,701	109,178,414.10	0.48

51	600009	上海机场	1,469,958	105,939,873.06	0.47
52	601766	中国中车	18,541,596	103,276,689.72	0.45
53	600690	海尔智家	5,769,284	102,116,326.80	0.45
54	000568	泸州老窖	1,116,027	101,692,380.24	0.45
55	002241	歌尔股份	3,459,422	101,568,629.92	0.45
56	000338	潍柴动力	7,304,484	100,217,520.48	0.44
57	002594	比亚迪	1,382,747	99,281,234.60	0.44
58	300122	智飞生物	974,900	97,636,235.00	0.43
59	002304	洋河股份	918,170	96,536,393.80	0.42
60	002410	广联达	1,379,334	96,139,579.80	0.42
61	000876	新希望	3,214,472	95,791,265.60	0.42
62	600999	招商证券	4,360,122	95,704,677.90	0.42
63	600703	三安光电	3,729,911	93,247,775.00	0.41
64	601899	紫金矿业	20,959,228	92,220,603.20	0.41
65	600104	上汽集团	5,343,520	90,786,404.80	0.40
66	002555	三七互娱	1,932,663	90,448,628.40	0.40
67	002230	科大讯飞	2,344,668	87,760,923.24	0.39
68	002027	分众传媒	15,657,977	87,214,931.89	0.38
69	601818	光大银行	24,269,009	86,883,052.22	0.38
70	600745	闻泰科技	685,800	86,376,510.00	0.38
71	002007	华兰生物	1,667,945	83,580,723.95	0.37
72	300601	康泰生物	512,298	83,074,243.68	0.37
73	300347	泰格医药	800,707	81,576,029.16	0.36
74	600919	江苏银行	14,075,000	79,805,250.00	0.35
75	600028	中国石化	20,387,970	79,716,962.70	0.35
76	001979	招商蛇口	4,824,602	79,316,456.88	0.35
77	600436	片仔癀	459,606	78,247,921.50	0.34
78	000538	云南白药	779,744	73,147,784.64	0.32
79	600547	山东黄金	1,982,956	72,615,848.72	0.32
80	601088	中国神华	5,025,927	72,172,311.72	0.32
81	600406	国电南瑞	3,521,852	71,317,503.00	0.31
82	300413	芒果超媒	1,085,074	70,746,824.80	0.31
83	000895	双汇发展	1,517,075	69,921,986.75	0.31
84	300003	乐普医疗	1,901,413	69,439,602.76	0.31
85	000166	申万宏源	13,738,333	69,378,581.65	0.31
86	601628	中国人寿	2,539,869	69,109,835.49	0.30
87	600050	中国联通	14,189,851	68,678,878.84	0.30
88	600438	通威股份	3,920,426	68,137,003.88	0.30
89	002271	东方雨虹	1,674,399	68,030,831.37	0.30
90	300014	亿纬锂能	1,403,595	67,162,020.75	0.30
91	601009	南京银行	9,149,991	67,069,434.03	0.30
92	000938	紫光股份	1,556,244	66,887,367.12	0.29

93	002129	中环股份	2,971,265	66,734,611.90	0.29
94	601939	建设银行	10,234,979	64,582,717.49	0.28
95	002371	北方华创	376,800	64,398,888.00	0.28
96	601006	大秦铁路	9,063,225	63,805,104.00	0.28
97	000776	广发证券	4,510,078	63,682,301.36	0.28
98	300136	信维通信	1,180,732	62,602,410.64	0.28
99	002460	赣锋锂业	1,165,517	62,436,745.69	0.27
100	601390	中国中铁	12,415,862	62,327,627.24	0.27
101	600196	复星医药	1,838,953	62,248,559.05	0.27
102	601857	中国石油	14,806,406	62,038,841.14	0.27
103	600019	宝钢股份	13,581,297	61,930,714.32	0.27
104	603160	汇顶科技	277,607	61,878,600.30	0.27
105	603019	中科曙光	1,587,098	60,944,563.20	0.27
106	002044	美年健康	4,181,836	60,260,256.76	0.27
107	000977	浪潮信息	1,536,972	60,218,562.96	0.26
108	300124	汇川技术	1,583,115	60,142,538.85	0.26
109	002050	三花智控	2,736,690	59,933,511.00	0.26
110	601186	中国铁建	7,012,344	58,763,442.72	0.26
111	002602	世纪华通	3,797,250	58,135,897.50	0.26
112	600809	山西汾酒	398,271	57,749,295.00	0.25
113	600015	华夏银行	9,383,194	57,425,147.28	0.25
114	002311	海大集团	1,204,196	57,307,687.64	0.25
115	002001	新和成	1,966,200	57,216,420.00	0.25
116	002624	完美世界	984,600	56,752,344.00	0.25
117	300433	蓝思科技	2,017,152	56,560,942.08	0.25
118	601336	新华保险	1,272,173	56,331,820.44	0.25
119	601989	中国重工	13,902,135	55,608,540.00	0.24
120	601933	永辉超市	5,834,026	54,723,163.88	0.24
121	603501	韦尔股份	262,574	53,026,819.30	0.23
122	002456	欧菲光	2,874,630	52,864,445.70	0.23
123	002236	大华股份	2,745,835	52,747,490.35	0.23
124	600958	东方证券	5,457,887	51,795,347.63	0.23
125	000157	中联重科	7,907,123	50,842,800.89	0.22
126	600183	生益科技	1,734,400	50,765,888.00	0.22
127	600352	浙江龙盛	3,967,548	50,744,938.92	0.22
128	600741	华域汽车	2,403,216	49,962,860.64	0.22
129	002024	苏宁易购	5,674,979	49,769,565.83	0.22
130	601377	兴业证券	7,145,383	48,945,873.55	0.22
131	601788	光大证券	2,975,762	47,790,737.72	0.21
132	600383	金地集团	3,439,971	47,127,602.70	0.21
133	002008	大族激光	1,301,827	46,800,680.65	0.21
134	002463	沪电股份	1,840,000	45,963,200.00	0.20

135	601138	工业富联	3,028,600	45,883,290.00	0.20
136	000860	顺鑫农业	792,500	45,156,650.00	0.20
137	600346	恒力石化	3,221,140	45,095,960.00	0.20
138	600660	福耀玻璃	2,136,703	44,592,991.61	0.20
139	601901	方正证券	6,272,502	44,409,314.16	0.20
140	300408	三环集团	1,588,700	44,006,990.00	0.19
141	601225	陕西煤业	6,096,396	43,955,015.16	0.19
142	300033	同花顺	327,177	43,540,715.16	0.19
143	002120	韵达股份	1,767,378	43,212,392.10	0.19
144	601877	正泰电器	1,638,585	43,176,714.75	0.19
145	601155	新城控股	1,377,000	43,017,480.00	0.19
146	600522	中天科技	3,738,900	42,810,405.00	0.19
147	002736	国信证券	3,749,876	42,373,598.80	0.19
148	000425	徐工机械	7,163,269	42,334,919.79	0.19
149	600109	国金证券	3,688,153	42,081,825.73	0.19
150	600340	华夏幸福	1,837,614	42,007,856.04	0.18
151	002202	金风科技	4,208,215	41,955,903.55	0.18
152	300144	宋城演艺	2,390,942	41,363,296.60	0.18
153	603799	华友钴业	1,043,328	40,543,726.08	0.18
154	601669	中国电建	11,657,677	40,335,562.42	0.18
155	000783	长江证券	5,898,981	39,759,131.94	0.17
156	002841	视源股份	399,297	39,738,037.44	0.17
157	603993	洛阳钼业	10,769,387	39,523,650.29	0.17
158	601800	中国交建	5,371,023	39,423,308.82	0.17
159	601108	财通证券	3,829,600	39,253,400.00	0.17
160	601985	中国核电	9,492,100	38,822,689.00	0.17
161	601555	东吴证券	4,731,937	38,612,605.92	0.17
162	600089	特变电工	5,662,230	38,333,297.10	0.17
163	603369	今世缘	955,506	38,019,583.74	0.17
164	000069	华侨城 A	6,249,894	37,874,357.64	0.17
165	600867	通化东宝	2,169,468	37,813,827.24	0.17
166	600010	宝钢股份	34,736,075	37,514,961.00	0.17
167	000768	中航飞机	2,109,193	37,417,083.82	0.16
168	002916	深南电路	218,503	36,603,622.56	0.16
169	002493	荣盛石化	2,876,100	35,376,030.00	0.16
170	000066	中国长城	2,677,000	35,336,400.00	0.16
171	600029	南方航空	6,739,126	34,841,281.42	0.15
172	002179	中航光电	840,336	34,462,179.36	0.15
173	600606	绿地控股	5,563,800	34,384,284.00	0.15
174	600487	亨通光电	2,083,040	34,182,686.40	0.15
175	000963	华东医药	1,334,721	33,768,441.30	0.15
176	002157	正邦科技	1,908,300	33,357,084.00	0.15

177	600795	国电电力	17,967,889	33,240,594.65	0.15
178	600061	国投资本	2,579,283	32,834,272.59	0.14
179	000625	长安汽车	2,972,350	32,695,850.00	0.14
180	600886	国投电力	4,136,801	32,515,255.86	0.14
181	600705	中航资本	8,209,298	32,508,820.08	0.14
182	601100	恒立液压	404,600	32,448,920.00	0.14
183	601607	上海医药	1,758,931	32,329,151.78	0.14
184	600926	杭州银行	3,615,796	32,252,900.32	0.14
185	002422	科伦药业	1,535,469	32,244,849.00	0.14
186	600893	航发动力	1,372,548	32,227,427.04	0.14
187	603658	安图生物	198,000	32,163,120.00	0.14
188	002466	天齐锂业	1,351,612	31,019,495.40	0.14
189	600111	北方稀土	3,322,904	30,969,465.28	0.14
190	600498	烽火通信	1,070,903	30,959,805.73	0.14
191	603899	晨光文具	565,400	30,870,840.00	0.14
192	601162	天风证券	5,079,050	30,779,043.00	0.14
193	601066	中信建投	779,773	30,707,460.74	0.14
194	600637	东方明珠	3,123,355	30,140,375.75	0.13
195	601111	中国国航	4,554,347	30,104,233.67	0.13
196	600176	中国巨石	3,204,722	29,323,206.30	0.13
197	600115	东方航空	6,828,800	28,817,536.00	0.13
198	002607	中公教育	1,033,553	28,681,095.75	0.13
199	002601	龙麟佰利	1,547,930	28,636,705.00	0.13
200	601360	三六零	1,545,850	28,304,513.50	0.12
201	600011	华能国际	6,704,600	28,293,412.00	0.12
202	600233	圆通速递	1,930,204	28,103,770.24	0.12
203	601727	上海电气	5,569,043	28,067,976.72	0.12
204	300628	亿联网络	410,704	28,034,655.04	0.12
205	601816	京沪高铁	4,491,500	27,982,045.00	0.12
206	600118	中国卫星	900,532	27,763,401.56	0.12
207	600332	白云山	858,577	27,757,794.41	0.12
208	600271	航天信息	1,703,568	27,665,944.32	0.12
209	601600	中国铝业	9,965,965	27,506,063.40	0.12
210	000786	北新建材	1,288,100	27,475,173.00	0.12
211	601618	中国中冶	10,883,510	27,317,610.10	0.12
212	003816	中国广核	8,992,300	26,617,208.00	0.12
213	000656	金科股份	3,254,600	26,557,536.00	0.12
214	000596	古井贡酒	176,424	26,505,941.76	0.12
215	600221	海航控股	17,537,561	26,306,341.50	0.12
216	601838	成都银行	3,302,600	26,288,696.00	0.12
217	002252	上海莱士	3,082,142	26,074,921.32	0.11
218	600489	中金黄金	2,829,912	25,865,395.68	0.11

219	000728	国元证券	3,077,596	25,851,806.40	0.11
220	000703	恒逸石化	2,805,179	25,611,284.27	0.11
221	601919	中远海控	7,376,148	25,595,233.56	0.11
222	600177	雅戈尔	4,232,923	25,228,221.08	0.11
223	000961	中南建设	2,826,650	25,157,185.00	0.11
224	600068	葛洲坝	4,210,722	25,053,795.90	0.11
225	600066	宇通客车	2,026,410	24,722,202.00	0.11
226	601997	贵阳银行	3,432,760	24,578,561.60	0.11
227	600390	五矿资本	3,427,960	24,201,397.60	0.11
228	601998	中信银行	4,672,211	24,061,886.65	0.11
229	600004	白云机场	1,576,400	24,024,336.00	0.11
230	601198	东兴证券	2,101,100	22,901,990.00	0.10
231	600085	同仁堂	837,473	22,712,267.76	0.10
232	601881	中国银河	1,966,300	22,553,461.00	0.10
233	002508	老板电器	723,972	22,522,768.92	0.10
234	603833	欧派家居	193,260	22,398,834.00	0.10
235	600018	上港集团	5,297,550	22,249,710.00	0.10
236	600219	南山铝业	10,927,110	22,182,033.30	0.10
237	600516	方大炭素	3,480,698	21,858,783.44	0.10
238	601231	环旭电子	997,300	21,781,032.00	0.10
239	002673	西部证券	2,667,873	21,769,843.68	0.10
240	601018	宁波港	6,022,930	21,501,860.10	0.09
241	002146	荣盛发展	2,651,214	21,474,833.40	0.09
242	600998	九州通	1,144,500	21,310,590.00	0.09
243	600362	江西铜业	1,580,915	21,279,115.90	0.09
244	600760	中航沈飞	640,500	21,021,210.00	0.09
245	600655	豫园股份	2,368,300	20,983,138.00	0.09
246	601319	中国人保	3,246,500	20,907,460.00	0.09
247	600170	上海建工	6,785,762	20,832,289.34	0.09
248	601117	中国化学	3,760,500	20,607,540.00	0.09
249	601878	浙商证券	2,033,410	20,151,093.10	0.09
250	002773	康弘药业	399,930	19,836,528.00	0.09
251	600369	西南证券	4,301,936	19,745,886.24	0.09
252	600297	广汇汽车	6,180,600	19,716,114.00	0.09
253	601021	春秋航空	558,706	19,688,799.44	0.09
254	600848	上海临港	911,500	19,569,905.00	0.09
255	600208	新潮中宝	6,555,030	19,533,989.40	0.09
256	002938	鹏鼎控股	387,110	19,378,726.60	0.09
257	002739	万达电影	1,267,501	19,354,740.27	0.09
258	002153	石基信息	487,852	19,040,863.56	0.08
259	002958	青农商行	4,233,500	18,754,405.00	0.08
260	601658	邮储银行	4,091,700	18,699,069.00	0.08

261	600674	川投能源	2,013,950	18,669,316.50	0.08
262	600038	中直股份	448,847	18,434,146.29	0.08
263	002032	苏泊尔	249,636	17,724,156.00	0.08
264	002939	长城证券	1,420,200	17,496,864.00	0.08
265	600027	华电国际	4,966,275	16,984,660.50	0.07
266	603156	养元饮品	772,724	16,613,566.00	0.07
267	002558	巨人网络	925,060	16,096,044.00	0.07
268	000671	阳光城	2,496,400	15,827,176.00	0.07
269	000627	天茂集团	3,011,900	15,691,999.00	0.07
270	601992	金隅集团	5,083,100	15,554,286.00	0.07
271	600482	中国动力	987,862	15,509,433.40	0.07
272	600583	海油工程	3,369,379	15,330,674.45	0.07
273	002468	申通快递	932,700	15,305,607.00	0.07
274	600977	中国电影	1,138,045	14,942,530.85	0.07
275	601633	长城汽车	1,852,931	14,304,627.32	0.06
276	000709	河钢股份	6,473,126	13,205,177.04	0.06
277	601216	君正集团	5,143,514	13,064,525.56	0.06
278	601916	浙商银行	3,311,100	13,045,734.00	0.06
279	601238	广汽集团	1,415,920	12,743,280.00	0.06
280	601577	长沙银行	1,563,900	12,417,366.00	0.05
281	600188	兖州煤业	1,354,309	11,863,746.84	0.05
282	601808	中海油服	902,000	11,852,280.00	0.05
283	601236	红塔证券	609,100	11,816,540.00	0.05
284	600398	海澜之家	2,022,500	11,770,950.00	0.05
285	000723	美锦能源	1,874,500	11,734,370.00	0.05
286	601698	中国卫通	609,600	10,978,896.00	0.05
287	600372	中航电子	805,716	10,732,137.12	0.05
288	600928	西安银行	2,033,700	10,697,262.00	0.05
289	601898	中煤能源	2,789,200	10,598,960.00	0.05
290	600025	华能水电	2,742,800	10,395,212.00	0.05
291	600989	宝丰能源	1,229,800	10,354,916.00	0.05
292	000708	中信特钢	538,250	9,198,692.50	0.04
293	601077	渝农商行	1,752,000	8,269,440.00	0.04
294	600968	海油发展	3,098,700	7,219,971.00	0.03
295	601828	美凯龙	613,600	6,498,024.00	0.03
296	601298	青岛港	1,068,000	6,066,240.00	0.03
297	603260	合盛硅业	213,688	5,842,229.92	0.03
298	601212	白银有色	2,256,800	5,754,840.00	0.03
299	002945	华林证券	411,100	5,677,291.00	0.02
300	600299	安迪苏	449,299	5,490,433.78	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.00
2	688026	洁特生物	4,433	369,357.56	0.00
3	688186	广大特材	8,033	274,326.95	0.00
4	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
5	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
6	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
7	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
8	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
9	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
10	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
11	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
12	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
13	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	601318	中国平安	257,827,973.26	0.95
2	600519	贵州茅台	204,176,208.77	0.75
3	601398	工商银行	152,030,063.82	0.56
4	600036	招商银行	114,335,790.61	0.42
5	600276	恒瑞医药	95,106,062.65	0.35
6	600030	中信证券	92,161,036.48	0.34
7	603160	汇顶科技	89,648,589.70	0.33
8	600745	闻泰科技	87,415,278.77	0.32
9	300601	康泰生物	86,028,046.51	0.32
10	601166	兴业银行	76,777,994.60	0.28
11	000661	长春高新	73,867,785.94	0.27
12	603986	兆易创新	71,773,225.64	0.26
13	000977	浪潮信息	71,445,737.17	0.26
14	002371	北方华创	70,905,171.09	0.26
15	300014	亿纬锂能	68,487,381.80	0.25
16	002129	中环股份	66,836,259.14	0.25
17	600585	海螺水泥	66,488,132.00	0.24
18	601688	华泰证券	65,461,402.10	0.24
19	600887	伊利股份	61,383,342.54	0.23
20	601229	上海银行	55,619,515.35	0.20

## 7.4.2 累计卖出金额前 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	601318	中国平安	1,047,353,174.27	3.85
2	600519	贵州茅台	767,367,581.18	2.82
3	600036	招商银行	461,588,564.52	1.70
4	600276	恒瑞医药	380,681,111.38	1.40
5	601166	兴业银行	359,655,521.91	1.32
6	600030	中信证券	252,294,389.07	0.93
7	600887	伊利股份	237,878,017.60	0.88
8	601288	农业银行	219,471,629.13	0.81
9	600016	民生银行	216,343,199.55	0.80
10	600900	长江电力	201,953,733.07	0.74
11	601328	交通银行	184,952,349.62	0.68
12	600000	浦发银行	162,577,135.16	0.60
13	601398	工商银行	151,607,981.54	0.56
14	601601	中国太保	145,300,363.07	0.53
15	603160	汇顶科技	143,957,507.18	0.53
16	601668	中国建筑	143,094,475.80	0.53
17	601888	中国中免	141,816,719.71	0.52
18	600031	三一重工	141,281,576.67	0.52
19	600048	保利地产	139,081,663.67	0.51
20	603288	海天味业	136,879,505.11	0.50

## 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	5,289,296,491.61
卖出股票收入（成交）总额	12,943,615,227.79

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,513,400.00	0.03

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,513,400.00	0.03

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	51,142	5,114,200.00	0.02
2	128114	正邦转债	13,992	1,399,200.00	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

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

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2012	IF2012	94	113,617,800.00	5,342,760.00	-
IF2009	IF2009	30	36,608,400.00	699,300.00	-
公允价值变动总额合计（元）					6,042,060.00
股指期货投资本期收益（元）					5,250,291.26
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-3,053,940.00

### 7.10.2 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

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2

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	18,055,896.06
2	应收证券清算款	17,643,843.48
3	应收股利	1,493,707.96
4	应收利息	397,375.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,590,822.84

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002475	立讯精密	4,457,180.00	0.02	转融通出借证券
2	000651	格力电器	1,951,665.00	0.01	转融通出借证券
3	600276	恒瑞医药	923,000.00	0.00	转融通出借证券

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	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	688520	神州细胞	726,485.82	0.00	科创板新股锁定
2	688026	洁特生物	369,357.56	0.00	科创板新股锁定
3	688186	广大特材	274,326.95	0.00	科创板新股锁定

4	688568	中科星图	178,634.20	0.00	新发未上市
---	--------	------	------------	------	-------

## § 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 (%)
24,613	216,882.00	4,954,671,027.00	92.82	383,445,649.00	7.18

#### 8.1.2 ETF 联接基金期末持有份额及占比

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)	3,814,880,079.00	71.46

### 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	327,476,131.00	6.13
2	中国平安财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	85,061,202.00	1.59
3	中央汇金投资有限责任公司	83,301,065.00	1.56
4	国泰君安证券股份有限公司	63,818,493.00	1.20
5	创金合信基金—华夏银行—创金合 信华睿 2 号集合资产管理计划	47,052,234.00	0.88
6	长江养老保险股份有限公司—中国 太平洋人寿权益基金型投资产品 (财 富管家) 委托专户	39,200,072.00	0.73
7	汇丰人寿保险有限公司—自有资金	38,866,921.00	0.73
8	国开金融有限责任公司	30,098,322.00	0.56
9	中国平安人寿保险股份有限公司— 万能—一个险万能	26,968,740.00	0.51
10	中信证券股份有限公司	25,896,385.00	0.49
11	中国银行股份有限公司—嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金	3,814,880,079.00	71.46

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（2012年5月7日）基金份额总额	19,333,307,392.00
本报告期期初基金份额总额	6,536,016,676.00
本报告期基金总申购份额	3,207,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,405,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5,338,116,676.00

### § 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

2020年4月8日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020年5月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020年6月19日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

##### （2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	7	13,416,844,207.96	73.67%	1,580,129.25	32.93%	-
方正证券股份有限公司	5	2,895,216,103.93	15.90%	1,917,953.77	39.97%	-
中信建投证券股份有限公司	4	1,116,448,897.26	6.13%	781,525.06	16.29%	-
长江证券股份有限公司	2	191,355,316.32	1.05%	120,804.34	2.52%	-
中泰证券股份有限公司	5	158,999,171.32	0.87%	111,300.61	2.32%	新增1个
广发证券股份有限公司	4	156,571,139.28	0.86%	109,600.57	2.28%	-

华泰证券 股份有限 公司	5	127,139,346.92	0.70%	80,263.63	1.67%	-
中国国际 金融股份 有限公司	5	119,014,408.08	0.65%	75,136.28	1.57%	-
东方证券 股份有限 公司	4	31,453,726.51	0.17%	22,018.16	0.46%	-
安信证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

光大证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	新增 1 个
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-

华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	新增 2个
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

新时代证 券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 华南股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
--------------	--	--	--	--	--	--

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, 在近一年内无重大违规行为;

(2) 公司财务状况良好;

(3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;

(4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;

(5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。

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. 广州证券股份有限公司更名为中信证券华南股份有限公司。

4. 报告期内, 本基金退租以下交易单元: 天源证券经纪有限公司退租上海交易单元 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
中信证券股份有限公司	22,309,097.08	81.17%	3,260,000,000.00	23.53%	-	-
方正证券股份有限公司	3,910,952.11	14.23%	5,699,000,000.00	41.14%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	650,000,000.00	4.69%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	1,087,000,000.00	7.85%	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股	1,266,004.27	4.61%	1,268,000,000.00	9.15%	-	-

份有限公司						
中国国际金 融股份有限 公司			1,088,000,000.00	7.85%		
东方证券股 份有限公司			801,000,000.00	5.78%		
安信证券股 份有限公司						
北京高华证 券有限责任 公司						
渤海证券股 份有限公司						
长城证券股 份有限公司						
东北证券股 份有限公司						
东吴证券股 份有限公司						
东兴证券股 份有限公司						
光大证券股 份有限公司						
国海证券股 份有限公司						
国金证券股 份有限公司						
国泰君安证 券股份有限 公司						
国信证券股 份有限公司						
国元证券股 份有限公司						
海通证券股 份有限公司						
宏信证券有 限责任公司						
华宝证券有 限责任公司						
华创证券有 限责任公司						
华福证券有 限责任公司						

华西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券华 南股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 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根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月22日
2	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年02月28日
3	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年03月16日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年05月18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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2020/01/01 至 2020/06/30	4,491,383,192.00	3,940,348,400.00	4,616,851,513.00	3,814,880,079.00	71.46

#### 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) 中国证监会批准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实沪深 300 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

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

### 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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 08 月 29 日