

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>78</b>
8.1 期末基金资产组合情况	78
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	79
8.3 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	80
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	94
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	95
8.6 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	95
8.7 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	96
8.8 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	96
8.9 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	96
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	96
8.12 投资组合报告附注	96
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>98</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	98
9.2 期末上市基金前十名持有人	98
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
9.4 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	99
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	99
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>99</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>99</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	99
11.2 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	99
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	100
11.4 基金投资策略的改变	100
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	100
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	100
11.8 其他重大事件	105
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>105</b>
12.1 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	105
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>106</b>
13.1 备查文件目录	106
13.2 存放地点	106
13.3 查阅方式	106

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,147,069,931.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-177,452,328.64	-311,783,883.85	423,544,426.72
本期利润	-76,630,992.80	-856,056,684.97	537,720,658.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0818	-1.2220	1.3526
本期加权平均净值利润率	-1.34%	-19.35%	17.92%
本期基金	-5.81%	-18.56%	17.96%

份额净值增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	2,809,744,780.67	3,856,099,128.04	2,089,051,047.09
期末可供分配基金份额利润	2.4495	2.7978	4.6513
期末基金资产净值	6,471,114,170.78	8,255,443,230.29	3,690,907,858.29
期末基金份额净值	5.6414	5.9897	8.2179
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	76.74%	87.66%	130.42%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

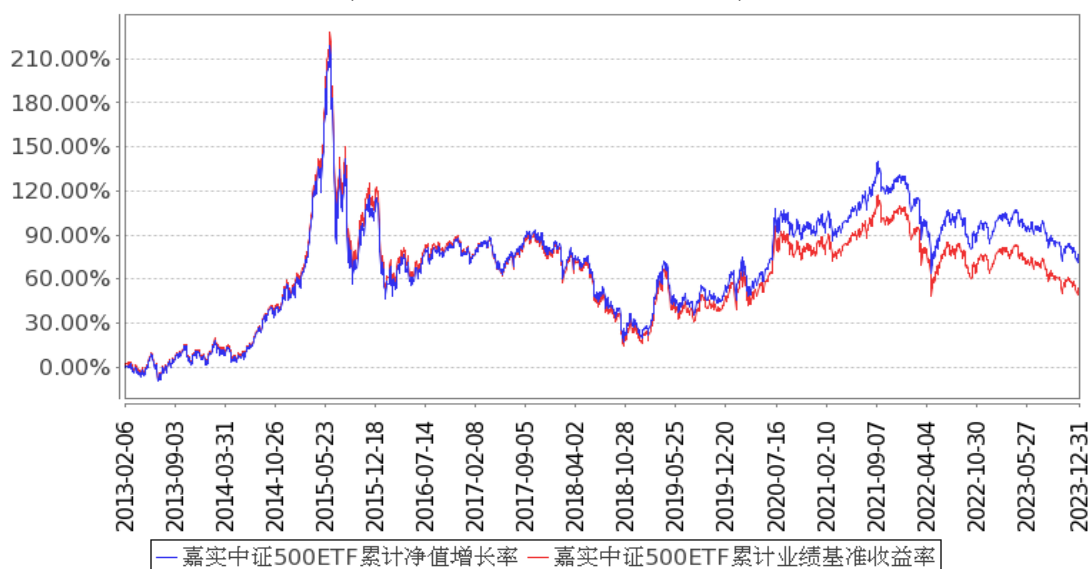
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.64%	0.86%	-4.60%	0.86%	-0.04%	0.00%
过去六个月	-9.19%	0.85%	-9.49%	0.86%	0.30%	-0.01%
过去一年	-5.81%	0.82%	-7.42%	0.82%	1.61%	0.00%
过去三年	-9.52%	1.08%	-14.73%	1.08%	5.21%	0.00%
过去五年	44.81%	1.29%	30.26%	1.29%	14.55%	0.00%
自基金合同生效起至今	76.74%	1.54%	54.21%	1.56%	22.53%	-0.02%

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

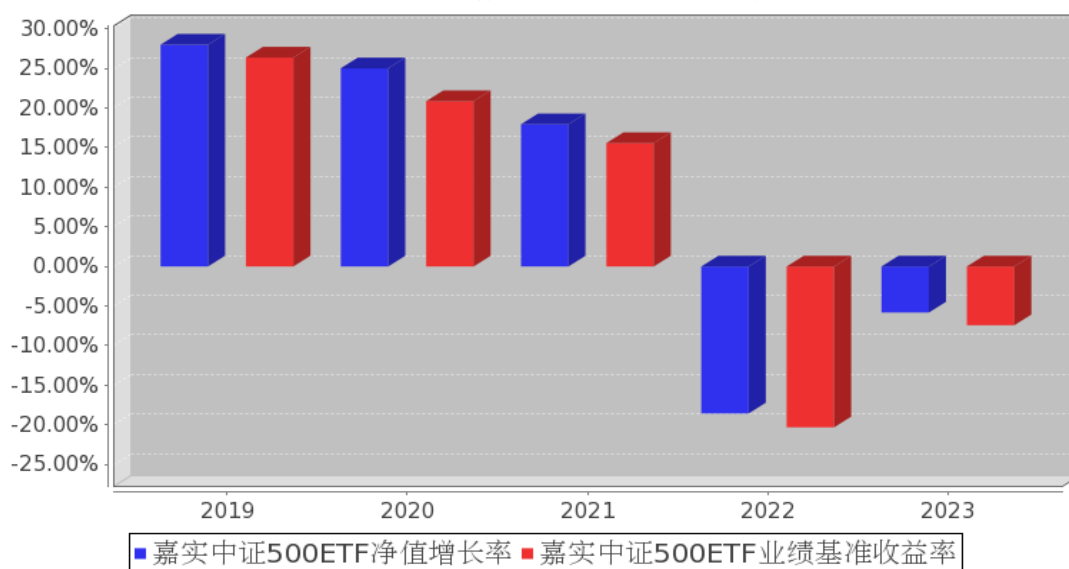
嘉实中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013年02月06日至2023年12月31日)



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

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。



### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2023年12月31日，基金管理人共管理334只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实国证通信ETF发起联接基金经理	2016年1月5日	-	17年	曾任职于IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007年6月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。加拿大国籍。
李直	本基金、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面	2021年9月24日	-	9年	2014年7月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

注：(1) 首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”

指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同

投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.3 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 13 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

国内方面，2023 年我国经济总体呈现恢复态势，GDP 同比增长 5.2%。全年政策支持力度较高，至下半年多项经济数据已经回正，虽然受美联储加息波及，外资多有流出，致市场承压，但在长线资金入市、稳地产政策出台、投资消费数据恢复影响下，触底反转预期逐渐强化。进入四季度美联储已暂停加息，也为国内货币政策提供更充足空间。国外方面，在高通胀、美联储加息、地缘政治的影响下，全球经济波动加剧。主要经济体制造业 PMI 进入下行趋势。扩张性的财政政策导向推动美国债务水平大幅攀升，持续推高利率水平。进入四季度降息预期高企，但美国超预期的经济数据为联储货币政策的选择增加了不确定性。

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年化跟踪误差为 0.33%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.6414 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.81%，业绩比较基准收益率为-7.42%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，降准降息等货币工具或可为宏观流动性提供充足支持，降低融资成本，企业利润有望逐步恢复。在经济基本面符合预期的背景下，长线资金持续流入及更多稳增长政策落地有望强化市场信心，A 股有望迎来复苏行情。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新产品新业务新制度新客户新投资工具并进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 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基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23338 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准</p>

	<p>则在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实中证 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实中证 500ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作</p>

	<p>出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对导致对嘉实中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致嘉实中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 柴瀚英
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	90,426,084.27	89,776,778.49
结算备付金		18,586,894.13	20,358,179.62
存出保证金		8,726,087.61	10,487,737.62
交易性金融资产	7.4.7.2	6,398,005,274.11	8,174,750,196.18
其中: 股票投资		6,397,618,162.23	8,174,750,196.18
基金投资		-	-
债券投资		387,111.88	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-



债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,735,365.83	-
应收股利		-	154,000.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	132,495.00	237,412.12
资产总计		6,518,612,200.95	8,295,764,304.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		43,756,882.74	36,152,652.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		668,986.74	989,578.38
应付托管费		222,995.56	329,859.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,302.17	23,793.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	2,827,862.96	2,825,189.28
负债合计		47,498,030.17	40,321,073.74
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	3,661,369,390.11	4,399,344,102.25
未分配利润	7.4.7.12	2,809,744,780.67	3,856,099,128.04
净资产合计		6,471,114,170.78	8,255,443,230.29
负债和净资产总计		6,518,612,200.95	8,295,764,304.03

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.6414 元，基金份额总额 1,147,069,931.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-63,022,067.27	-845,671,248.81
1. 利息收入		13,970,214.60	14,246,412.51
其中：存款利息收入	7.4.7.13	736,226.93	546,069.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		61,352.05	454,970.50
其他利息收入		13,172,635.62	13,245,372.37
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-192,107,680.89	-326,629,788.85
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-269,098,058.49	-375,707,140.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,225,650.45	2,738,188.52
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-7,332,545.85	-5,416,613.92
股利收益	7.4.7.19	83,097,273.00	51,755,777.35
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	100,821,335.84	-544,272,801.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	14,294,063.18	10,984,928.65
<b>减：二、营业总支出</b>		13,608,925.53	10,385,436.16
1. 管理人报酬		8,680,639.98	6,598,355.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		2,893,546.67	2,199,451.73
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		58,613.35	47,697.68
8. 其他费用	7.4.7.23	1,976,125.53	1,539,931.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-76,630,992.80	-856,056,684.97
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-76,630,992.80	-856,056,684.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-76,630,992.80	-856,056,684.97

### 7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,399,344,102. 25	-	3,856,099,128. 04	8,255,443,230.2 9
二、本期期初净资产	4,399,344,102. 25	-	3,856,099,128. 04	8,255,443,230.2 9
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-737,974,712.1 4	-	-1,046,354,347 .37	-1,784,329,059. 51
(一)、综合收益总额	-	-	-76,630,992.80	-76,630,992.80
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-737,974,712.1 4	-	-969,723,354.5 7	-1,707,698,066. 71
其中：1. 基金申购款	7,153,758,332. 74	-	6,343,097,357. 87	13,496,855,690. 61
2. 基金赎回款	-7,891,733,044 .88	-	-7,312,820,712 .44	-15,204,553,757 .32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,661,369,390. 11	-	2,809,744,780. 67	6,471,114,170.7 8

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29
二、本期期初净资产	1,601,856,811.20	-	2,089,051,047.09	3,690,907,858.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,797,487,291.05	-	1,767,048,080.95	4,564,535,372.00
(一)、综合收益总额	-	-	-856,056,684.97	-856,056,684.97
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,797,487,291.05	-	2,623,104,765.92	5,420,592,056.97
其中：1. 基金申购款	5,622,115,990.01	-	5,308,397,236.12	10,930,513,226.13
2. 基金赎回款	-2,824,628,698.96	-	-2,685,292,470.20	-5,509,921,169.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,399,344,102.25	-	3,856,099,128.04	8,255,443,230.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

### 7.4.2 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其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产

支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定

公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具



有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应

权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号

《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

活期存款	90,426,084.27	89,776,778.49
等于：本金	90,416,938.66	89,770,263.73
加：应计利息	9,145.61	6,514.76
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以 内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	90,426,084.27	89,776,778.49

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	6,670,575,269.67	-	6,397,618,162.23	-272,957,107.44	
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	387,100.00	11.88	387,111.88	0.00
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	387,100.00	11.88	387,111.88	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	6,670,962,369.67	11.88	6,398,005,274.11	-272,957,107.44	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	8,545,707,319.46	-	8,174,750,196.18	-370,957,123.28	
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	-	-	-	
	银行间市 场	-	-	-	

	场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,545,707,319.46	-	8,174,750,196.18	-370,957,123.28

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	65,973,880.00	-	-	-
其中：股指期货投资	65,973,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	65,973,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31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	74,224,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	74,224,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	74,224,000.00	-	-	-

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2401	IC2401	20.00	21,747,200.00	-215,840.00
IC2403	IC2403	40.00	43,316,800.00	-694,040.00
合计				-909,880.00
减：可抵销期货暂收款				-909,880.00
净额				0.00

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

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	132,495.00	237,412.12
待摊费用	-	-
合计	132,495.00	237,412.12

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,682,697.53	2,054,556.59
其中：交易所市场	1,682,697.53	2,054,556.59
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	236,000.00	218,000.00
应付指数使用费	909,165.43	552,632.69
合计	2,827,862.96	2,825,189.28

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,378,269,931.00	4,399,344,102.25
本期申购	2,241,200,000.00	7,153,758,332.74
本期赎回（以“-”号填列）	-2,472,400,000.00	-7,891,733,044.88
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,147,069,931.00	3,661,369,390.11



注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,001,358,737.54	-2,145,259,609.50	3,856,099,128.04
本期期初	6,001,358,737.54	-2,145,259,609.50	3,856,099,128.04
本期利润	-177,452,328.64	100,821,335.84	-76,630,992.80
本期基金份额交易产生的变动数	-985,130,997.35	15,407,642.78	-969,723,354.57
其中：基金申购款	10,051,707,069.39	-3,708,609,711.52	6,343,097,357.87
基金赎回款	-11,036,838,066.74	3,724,017,354.30	-7,312,820,712.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,838,775,411.55	-2,029,030,630.88	2,809,744,780.67

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	219,720.72	119,400.83
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	499,269.83	420,582.98
其他	17,236.38	6,085.83
合计	736,226.93	546,069.64

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-197,467,489.54	-181,244,434.48
股票投资收益——赎回差价收入	-71,630,568.95	-194,462,706.32
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	-269,098,058.49	-375,707,140.80

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出股票成交总额	10,649,207,566.54	5,266,971,960.10
减：卖出股票成本 总额	10,831,171,952.92	5,437,904,156.73
减：交易费用	15,503,103.16	10,312,237.85
买卖股票差价收 入	-197,467,489.54	-181,244,434.48

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
赎回基金份额对价总 额	15,204,553,757.32	5,509,921,169.16
减：现金支付赎回款 总额	7,757,674,191.32	2,882,151,804.16
减：赎回股票成本总 额	7,518,510,134.95	2,822,232,071.32
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-71,630,568.95	-194,462,706.32

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利	852.98	2,282.77

息收入		
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,224,797.47	2,735,905.75
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,225,650.45	2,738,188.52

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,862,898.74	17,295,117.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,637,000.00	14,556,200.00
减：应计利息总额	866.52	2,354.86
减：交易费用	234.75	657.11
买卖债券差价收入	1,224,797.47	2,735,905.75

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-7,332,545.85	-5,416,613.92

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	83,097,273.00	51,755,777.35
其中：证券出借权益补偿收入	14,591,240.28	8,666,612.44
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	83,097,273.00	51,755,777.35

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	98,000,015.84	-536,114,001.12
股票投资	98,000,015.84	-536,114,001.12

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	2,821,320.00	-8,158,800.00
权证投资	-	-
期货投资	2,821,320.00	-8,158,800.00
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	100,821,335.84	-544,272,801.12

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	14,294,063.18	10,984,928.65
合计	14,294,063.18	10,984,928.65

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	116,000.00	98,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	960.00	740.00
指数使用费	1,736,127.98	1,319,671.08
其他	-	68.00
存托服务费	3,037.55	1,452.41
合计	1,976,125.53	1,539,931.49

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“嘉实中证 500ETF 联接”)	本基金的联接基金

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,680,639.98	6,598,355.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	8,680,639.98	6,598,355.26

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每

月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,893,546.67	2,199,451.73

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2023年12月31日		2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
嘉实中证500ETF联接	382,468,608.00	33.34	355,502,628.00	25.79

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	90,426,084.27	219,720.72	89,776,778.49	119,400.83

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期(2023年1月1日至2023年12月31日),本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股锁定	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股锁定	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-



301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股锁定	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股锁定	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股锁定	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股锁定	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股锁定	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-

301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股锁定	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股锁定	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股锁定	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股锁定	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-

301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股锁定	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股锁定	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-

301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股锁定	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股锁定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	新股锁定	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	-

688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股锁定	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股锁定	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股锁定	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股锁定	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-

688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股锁定	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股锁定	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股锁定	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股锁定	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通过受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127102	浙	2023	1个月	新	100.00	100.00	3,871	387,100.00	387,111.88	-

	建 转 债	年 12 月 25 日	内(含)	债 未 上 市						
--	-------------	-------------------	------	------------------	--	--	--	--	--	--

注：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，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日 期	复牌 开 盘 单 价	数量 (股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
400174	中天3	2023 年 8 月 30 日	重大 事项 停牌	0.40	-	-	3,046,725	4,150,777.45	1,218,690.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券 代码	证券名 称	出借到期日	期末估 值 单 价	数量(单位： 股)	期末估值 总额
1	300502	新易盛	2024年1月2日-2024年 1月9日	49.32	110,700	5,459,724 .00
2	002422	科伦药 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	29.05	183,800	5,339,390 .00
3	002028	思源电 气	2024年1月2日-2024年 1月9日	52.04	96,200	5,006,248 .00
4	300418	昆仑万 维	2024年1月2日-2024年 1月9日	37.40	132,500	4,955,500 .00
5	600157	永泰能 源	2024年1月2日-2024年 1月9日	1.37	3,463,800	4,745,406 .00
6	000988	华工科 技	2024年1月2日-2024年 1月9日	29.76	156,900	4,669,344 .00
7	002463	沪电股	2024年1月2日-2024年	22.12	207,800	4,596,536

		份	1月9日			.00
8	601058	赛轮轮胎	2024年1月2日-2024年1月9日	11.75	389,100	4,571,925.00
9	601555	东吴证券	2024年1月2日-2024年1月9日	7.31	624,600	4,565,826.00
10	000975	银泰黄金	2024年1月2日-2024年1月9日	15.00	302,900	4,543,500.00
11	600079	人福医药	2024年1月2日-2024年1月9日	24.86	178,100	4,427,566.00
12	600418	江淮汽车	2024年1月2日-2024年1月9日	16.15	272,300	4,397,645.00
13	002340	格林美	2024年1月2日-2024年1月9日	5.46	800,600	4,371,276.00
14	601168	西部矿业	2024年1月2日-2024年1月9日	14.27	297,200	4,241,044.00
15	000933	神火股份	2024年1月2日-2024年1月9日	16.80	245,600	4,126,080.00
16	301236	软通动力	2024年1月2日-2024年1月9日	46.20	89,100	4,116,420.00
17	601233	桐昆股份	2024年1月2日-2024年1月9日	15.13	263,200	3,982,216.00
18	600161	天坛生物	2024年1月2日-2024年1月9日	30.94	128,500	3,975,790.00
19	601077	渝农商行	2024年1月2日-2024年1月9日	4.08	965,200	3,938,016.00
20	300394	天孚通信	2024年1月2日-2024年1月9日	91.52	43,000	3,935,360.00
21	601108	财通证券	2024年1月2日-2024年1月9日	7.76	506,700	3,931,992.00
22	000630	铜陵有色	2024年1月2日-2024年1月9日	3.28	1,184,800	3,886,144.00
23	002384	东山精密	2024年1月2日-2024年1月9日	18.18	213,200	3,875,976.00
24	300037	新宙邦	2024年1月2日-2024年1月9日	47.30	81,800	3,869,140.00
25	002156	通富微电	2024年1月2日-2024年1月9日	23.12	165,300	3,821,736.00
26	000009	中国宝安	2024年1月2日-2024年1月9日	11.74	321,700	3,776,758.00
27	688122	西部超导	2024年1月2日-2024年1月9日	53.23	70,800	3,768,684.00
28	002517	恺英网络	2024年1月2日-2024年1月9日	11.17	335,600	3,748,652.00
29	300012	华测检	2024年1月2日-2024年	14.20	262,300	3,724,660



		测	1月9日			.00
30	002966	苏州银行	2024年1月2日-2024年1月9日	6.46	571,700	3,693,182.00
31	600109	国金证券	2024年1月2日-2024年1月9日	9.08	406,400	3,690,112.00
32	600988	赤峰黄金	2024年1月2日-2024年1月9日	14.01	259,400	3,634,194.00
33	600885	宏发股份	2024年1月2日-2024年1月9日	27.64	130,200	3,598,728.00
34	300136	信维通信	2024年1月2日-2024年1月9日	23.60	150,900	3,561,240.00
35	002465	海格通信	2024年1月2日-2024年1月9日	12.85	271,000	3,482,350.00
36	688169	石头科技	2024年1月2日-2024年1月9日	282.95	12,300	3,480,285.00
37	002625	光启技术	2024年1月2日-2024年1月9日	14.78	235,000	3,473,300.00
38	600160	巨化股份	2024年1月2日-2024年1月9日	16.49	210,400	3,469,496.00
39	000423	东阿阿胶	2024年1月2日-2024年1月9日	49.32	70,200	3,462,264.00
40	300207	欣旺达	2024年1月2日-2024年1月9日	14.76	232,200	3,427,272.00
41	600352	浙江龙盛	2024年1月2日-2024年1月9日	8.40	405,800	3,408,720.00
42	600536	中国软件	2024年1月2日-2024年1月9日	36.26	94,000	3,408,440.00
43	002185	华天科技	2024年1月2日-2024年1月9日	8.52	399,700	3,405,444.00
44	002138	顺络电子	2024年1月2日-2024年1月9日	27.01	125,800	3,397,858.00
45	002738	中矿资源	2024年1月2日-2024年1月9日	37.31	90,200	3,365,362.00
46	688072	拓荆科技	2024年1月2日-2024年1月9日	231.30	14,500	3,353,850.00
47	601162	天风证券	2024年1月2日-2024年1月9日	3.09	1,080,700	3,339,363.00
48	600298	安琪酵母	2024年1月2日-2024年1月9日	35.18	94,700	3,331,546.00
49	000932	华菱钢铁	2024年1月2日-2024年1月9日	5.15	646,300	3,328,445.00
50	300003	乐普医疗	2024年1月2日-2024年1月9日	16.16	205,300	3,317,648.00
51	603596	伯特利	2024年1月2日-2024年	69.30	47,300	3,277,890.00

			1月9日			.00
52	000783	长江证 券	2024年1月2日-2024年 1月9日	5.38	603,500	3,246,830 .00
53	688099	晶晨股 份	2024年1月2日-2024年 1月9日	62.63	51,800	3,244,234 .00
54	002223	鱼跃医 疗	2024年1月2日-2024年 1月9日	34.58	93,600	3,236,688 .00
55	300144	宋城演 艺	2024年1月2日-2024年 1月9日	9.87	326,800	3,225,516 .00
56	300724	捷佳伟 创	2024年1月2日-2024年 1月9日	74.01	43,400	3,212,034 .00
57	002078	太阳纸 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	12.17	261,500	3,182,455 .00
58	002439	启明星 辰	2024年1月2日-2024年 1月9日	27.00	117,600	3,175,200 .00
59	603939	益丰药 房	2024年1月2日-2024年 1月9日	40.04	78,900	3,159,156 .00
60	000723	美锦能 源	2024年1月2日-2024年 1月9日	6.66	472,100	3,144,186 .00
61	600415	小商品 城	2024年1月2日-2024年 1月9日	7.32	427,500	3,129,300 .00
62	600096	云天化	2024年1月2日-2024年 1月9日	15.60	200,300	3,124,680 .00
63	300568	星源材 质	2024年1月2日-2024年 1月9日	15.42	199,800	3,080,916 .00
64	002385	大北农	2024年1月2日-2024年 1月9日	5.96	516,000	3,075,360 .00
65	002756	永兴材 料	2024年1月2日-2024年 1月9日	52.21	58,900	3,075,169 .00
66	600765	中航重 机	2024年1月2日-2024年 1月9日	19.11	160,800	3,072,888 .00
67	600482	中国动 力	2024年1月2日-2024年 1月9日	18.01	170,400	3,068,904 .00
68	600873	梅花生 物	2024年1月2日-2024年 1月9日	9.55	321,200	3,067,460 .00
69	000066	中国长 城	2024年1月2日-2024年 1月9日	10.12	301,700	3,053,204 .00
70	002532	天山铝 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	6.01	507,700	3,051,277 .00
71	002797	第一创 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	5.81	524,300	3,046,183 .00
72	600839	四川长 虹	2024年1月2日-2024年 1月9日	5.29	575,700	3,045,453 .00
73	688180	君实生	2024年1月2日-2024年	41.83	71,800	3,003,394

		物	1月9日			.00
74	300474	景嘉微	2024年1月2日-2024年1月9日	70.71	42,400	2,998,104.00
75	300017	网宿科技	2024年1月2日-2024年1月9日	7.85	380,100	2,983,785.00
76	300395	菲利华	2024年1月2日-2024年1月9日	36.56	81,200	2,968,672.00
77	603160	汇顶科技	2024年1月2日-2024年1月9日	69.10	42,900	2,964,390.00
78	002600	领益智造	2024年1月2日-2024年1月9日	6.76	437,000	2,954,120.00
79	600155	华创云信	2024年1月2日-2024年1月9日	8.34	352,500	2,939,850.00
80	002273	水晶光电	2024年1月2日-2024年1月9日	13.54	216,700	2,934,118.00
81	002044	美年健康	2024年1月2日-2024年1月9日	6.01	488,200	2,934,082.00
82	300285	国瓷材料	2024年1月2日-2024年1月9日	23.12	125,200	2,894,624.00
83	600862	中航高科	2024年1月2日-2024年1月9日	22.15	130,300	2,886,145.00
84	300601	康泰生物	2024年1月2日-2024年1月9日	27.15	104,600	2,839,890.00
85	002294	信立泰	2024年1月2日-2024年1月9日	32.66	86,900	2,838,154.00
86	600177	雅戈尔	2024年1月2日-2024年1月9日	6.55	433,100	2,836,805.00
87	600129	太极集团	2024年1月2日-2024年1月9日	46.46	60,700	2,820,122.00
88	688120	华海清科	2024年1月2日-2024年1月9日	187.70	15,000	2,815,500.00
89	300866	安克创新	2024年1月2日-2024年1月9日	88.60	31,700	2,808,620.00
90	600497	驰宏锌锗	2024年1月2日-2024年1月9日	5.05	555,600	2,805,780.00
91	000728	国元证券	2024年1月2日-2024年1月9日	6.83	408,100	2,787,323.00
92	300058	蓝色光标	2024年1月2日-2024年1月9日	7.18	387,900	2,785,122.00
93	688114	华大智造	2024年1月2日-2024年1月9日	86.02	32,300	2,778,446.00
94	002472	双环传动	2024年1月2日-2024年1月9日	26.02	106,200	2,763,324.00
95	600699	均胜电	2024年1月2日-2024年	17.96	153,700	2,760,452

		子	1月9日			.00
96	603606	东方电 缆	2024年1月2日-2024年 1月9日	42.75	64,500	2,757,375 .00
97	601990	南京证 券	2024年1月2日-2024年 1月9日	7.98	344,700	2,750,706 .00
98	603882	金城医 学	2024年1月2日-2024年 1月9日	62.57	43,900	2,746,823 .00
99	002607	中公教 育	2024年1月2日-2024年 1月9日	4.08	673,100	2,746,248 .00
100	000831	中国稀 土	2024年1月2日-2024年 1月9日	27.67	99,200	2,744,864 .00
101	600348	华阳股 份	2024年1月2日-2024年 1月9日	9.76	281,200	2,744,512 .00
102	600066	宇通客 车	2024年1月2日-2024年 1月9日	13.25	207,100	2,744,075 .00
103	002195	岩山科 技	2024年1月2日-2024年 1月9日	3.07	892,500	2,739,975 .00
104	601128	常熟银 行	2024年1月2日-2024年 1月9日	6.39	427,400	2,731,086 .00
105	002008	大族激 光	2024年1月2日-2024年 1月9日	20.72	131,300	2,720,536 .00
106	300146	汤臣倍 健	2024年1月2日-2024年 1月9日	17.03	159,100	2,709,473 .00
107	600546	山煤国 际	2024年1月2日-2024年 1月9日	17.51	154,700	2,708,797 .00
108	002353	杰瑞股 份	2024年1月2日-2024年 1月9日	28.11	95,800	2,692,938 .00
109	603816	顾家家 居	2024年1月2日-2024年 1月9日	35.00	76,900	2,691,500 .00
110	601696	中银证 券	2024年1月2日-2024年 1月9日	10.29	259,900	2,674,371 .00
111	002673	西部证 券	2024年1月2日-2024年 1月9日	6.37	418,100	2,663,297 .00
112	000893	亚钾国 际	2024年1月2日-2024年 1月9日	26.24	101,400	2,660,736 .00
113	600529	山东药 玻	2024年1月2日-2024年 1月9日	25.60	103,500	2,649,600 .00
114	300604	长川科 技	2024年1月2日-2024年 1月9日	37.99	68,000	2,583,320 .00
115	600985	淮北矿 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	16.63	154,700	2,572,661 .00
116	688301	奕瑞科 技	2024年1月2日-2024年 1月9日	325.26	7,900	2,569,554 .00
117	601577	长沙银	2024年1月2日-2024年	6.82	376,300	2,566,366

		行	1月9日			.00
118	600499	科达制造	2024年1月2日-2024年1月9日	10.55	243,200	2,565,760.00
119	300088	长信科技	2024年1月2日-2024年1月9日	6.69	382,600	2,559,594.00
120	600060	海信视像	2024年1月2日-2024年1月9日	20.90	122,400	2,558,160.00
121	002262	恩华药业	2024年1月2日-2024年1月9日	27.12	94,200	2,554,704.00
122	603589	口子窖	2024年1月2日-2024年1月9日	45.30	56,200	2,545,860.00
123	600369	西南证券	2024年1月2日-2024年1月9日	4.09	621,700	2,542,753.00
124	000997	新大陆	2024年1月2日-2024年1月9日	19.61	128,700	2,523,807.00
125	002444	巨星科技	2024年1月2日-2024年1月9日	22.52	111,900	2,519,988.00
126	300118	东方日升	2024年1月2日-2024年1月9日	17.65	142,100	2,508,065.00
127	002624	完美世界	2024年1月2日-2024年1月9日	11.84	211,600	2,505,344.00
128	601666	平煤股份	2024年1月2日-2024年1月9日	11.56	216,500	2,502,740.00
129	601198	东兴证券	2024年1月2日-2024年1月9日	8.23	302,300	2,487,929.00
130	688728	格科微	2024年1月2日-2024年1月9日	20.47	121,500	2,487,105.00
131	002409	雅克科技	2024年1月2日-2024年1月9日	55.73	44,500	2,479,985.00
132	688390	固德威	2024年1月2日-2024年1月9日	130.58	18,900	2,467,962.00
133	688002	睿创微纳	2024年1月2日-2024年1月9日	44.22	55,700	2,463,054.00
134	603688	石英股份	2024年1月2日-2024年1月9日	86.88	28,300	2,458,704.00
135	600642	申能股份	2024年1月2日-2024年1月9日	6.42	381,400	2,448,588.00
136	000400	许继电气	2024年1月2日-2024年1月9日	21.96	111,300	2,444,148.00
137	300699	光威复材	2024年1月2日-2024年1月9日	26.67	90,700	2,418,969.00
138	603000	人民网	2024年1月2日-2024年1月9日	27.98	86,200	2,411,876.00
139	300073	当升科	2024年1月2日-2024年	38.20	63,000	2,406,600

		技	1月9日			.00
140	600637	东方明珠	2024年1月2日-2024年1月9日	7.52	319,500	2,402,640.00
141	002131	利欧股份	2024年1月2日-2024年1月9日	2.28	1,053,200	2,401,296.00
142	002558	巨人网络	2024年1月2日-2024年1月9日	11.14	215,400	2,399,556.00
143	600884	杉杉股份	2024年1月2日-2024年1月9日	13.62	176,000	2,397,120.00
144	000683	远兴能源	2024年1月2日-2024年1月9日	5.87	408,100	2,395,547.00
145	600486	扬农化工	2024年1月2日-2024年1月9日	63.12	37,900	2,392,248.00
146	600399	抚顺特钢	2024年1月2日-2024年1月9日	9.72	246,000	2,391,120.00
147	600535	天士力	2024年1月2日-2024年1月9日	17.02	140,300	2,387,906.00
148	600118	中国卫星	2024年1月2日-2024年1月9日	25.82	92,300	2,383,186.00
149	000878	云南铜业	2024年1月2日-2024年1月9日	10.89	218,700	2,381,643.00
150	000591	太阳能	2024年1月2日-2024年1月9日	5.58	426,500	2,379,870.00
151	600879	航天电子	2024年1月2日-2024年1月9日	7.71	308,500	2,378,535.00
152	000629	钒钛股份	2024年1月2日-2024年1月9日	3.28	724,700	2,377,016.00
153	002152	广电运通	2024年1月2日-2024年1月9日	12.26	193,700	2,374,762.00
154	000021	深科技	2024年1月2日-2024年1月9日	16.21	145,900	2,365,039.00
155	600867	通化东宝	2024年1月2日-2024年1月9日	10.83	217,600	2,356,608.00
156	002497	雅化集团	2024年1月2日-2024年1月9日	13.09	179,800	2,353,582.00
157	601997	贵阳银行	2024年1月2日-2024年1月9日	5.14	456,000	2,343,840.00
158	688521	芯原股份	2024年1月2日-2024年1月9日	49.96	46,800	2,338,128.00
159	600895	张江高科	2024年1月2日-2024年1月9日	19.30	120,800	2,331,440.00
160	600143	金发科技	2024年1月2日-2024年1月9日	7.99	291,700	2,330,683.00
161	300001	特锐德	2024年1月2日-2024年	20.10	115,200	2,315,520

			1月9日			.00
162	000998	隆平高科	2024年1月2日-2024年1月9日	14.10	164,200	2,315,220.00
163	300390	天华新能	2024年1月2日-2024年1月9日	25.35	91,300	2,314,455.00
164	605358	立昂微	2024年1月2日-2024年1月9日	27.39	84,500	2,314,455.00
165	688772	珠海冠宇	2024年1月2日-2024年1月9日	22.01	105,100	2,313,251.00
166	000703	恒逸石化	2024年1月2日-2024年1月9日	6.72	342,900	2,304,288.00
167	688220	翱捷科技	2024年1月2日-2024年1月9日	70.44	32,700	2,303,388.00
168	600516	方大炭素	2024年1月2日-2024年1月9日	5.24	439,300	2,301,932.00
169	600416	湘电股份	2024年1月2日-2024年1月9日	15.88	144,700	2,297,836.00
170	300024	机器人	2024年1月2日-2024年1月9日	11.87	193,300	2,294,471.00
171	002240	盛新锂能	2024年1月2日-2024年1月9日	22.75	100,700	2,290,925.00
172	002432	九安医疗	2024年1月2日-2024年1月9日	37.67	60,600	2,282,802.00
173	603712	七一二	2024年1月2日-2024年1月9日	31.51	72,300	2,278,173.00
174	600549	厦门钨业	2024年1月2日-2024年1月9日	17.18	132,600	2,278,068.00
175	688188	柏楚电子	2024年1月2日-2024年1月9日	253.11	9,000	2,277,990.00
176	603077	和邦生物	2024年1月2日-2024年1月9日	2.36	963,700	2,274,332.00
177	600170	上海建工	2024年1月2日-2024年1月9日	2.34	969,800	2,269,332.00
178	002407	多氟多	2024年1月2日-2024年1月9日	15.22	148,700	2,263,214.00
179	600153	建发股份	2024年1月2日-2024年1月9日	9.63	234,300	2,256,309.00
180	002430	杭氧股份	2024年1月2日-2024年1月9日	29.21	76,800	2,243,328.00
181	600392	盛和资源	2024年1月2日-2024年1月9日	10.18	218,700	2,226,366.00
182	688052	纳芯微	2024年1月2日-2024年1月9日	166.85	13,300	2,219,105.00
183	600141	兴发集	2024年1月2日-2024年	18.25	121,300	2,213,725.00

		团	1月9日			.00
184	601966	玲珑轮胎	2024年1月2日-2024年1月9日	19.23	114,800	2,207,604.00
185	000960	锡业股份	2024年1月2日-2024年1月9日	14.32	154,100	2,206,712.00
186	000623	吉林敖东	2024年1月2日-2024年1月9日	15.14	145,200	2,198,328.00
187	000039	中集集团	2024年1月2日-2024年1月9日	7.65	287,200	2,197,080.00
188	300383	光环新网	2024年1月2日-2024年1月9日	9.72	224,300	2,180,196.00
189	300748	金力永磁	2024年1月2日-2024年1月9日	20.22	106,900	2,161,518.00
190	002065	东华软件	2024年1月2日-2024年1月9日	6.17	349,700	2,157,649.00
191	600704	物产中大	2024年1月2日-2024年1月9日	4.43	485,900	2,152,537.00
192	600909	华安证券	2024年1月2日-2024年1月9日	4.88	439,300	2,143,784.00
193	600998	九州通	2024年1月2日-2024年1月9日	7.01	304,600	2,135,246.00
194	300212	易华录	2024年1月2日-2024年1月9日	31.45	67,800	2,132,310.00
195	601717	郑煤机	2024年1月2日-2024年1月9日	12.65	167,700	2,121,405.00
196	000750	国海证券	2024年1月2日-2024年1月9日	3.54	597,400	2,114,796.00
197	300487	蓝晓科技	2024年1月2日-2024年1月9日	53.06	39,500	2,095,870.00
198	603658	安图生物	2024年1月2日-2024年1月9日	57.01	36,700	2,092,267.00
199	002203	海亮股份	2024年1月2日-2024年1月9日	11.15	186,400	2,078,360.00
200	002064	华峰化学	2024年1月2日-2024年1月9日	6.71	309,500	2,076,745.00
201	002268	电科网安	2024年1月2日-2024年1月9日	22.46	92,400	2,075,304.00
202	600673	东阳光	2024年1月2日-2024年1月9日	7.33	281,800	2,065,594.00
203	002025	航天电器	2024年1月2日-2024年1月9日	48.02	42,800	2,055,256.00
204	600583	海油工程	2024年1月2日-2024年1月9日	5.94	344,600	2,046,924.00
205	600166	福田汽	2024年1月2日-2024年	2.73	748,700	2,043,951.00



		车	1月9日			.00
206	000738	航发控制	2024年1月2日-2024年1月9日	19.90	102,500	2,039,750.00
207	000050	深天马A	2024年1月2日-2024年1月9日	10.65	191,500	2,039,475.00
208	603456	九洲药业	2024年1月2日-2024年1月9日	24.21	84,100	2,036,061.00
209	600521	华海药业	2024年1月2日-2024年1月9日	14.67	138,600	2,033,262.00
210	000513	丽珠集团	2024年1月2日-2024年1月9日	35.01	58,000	2,030,580.00
211	603338	浙江鼎力	2024年1月2日-2024年1月9日	51.17	39,500	2,021,215.00
212	601456	国联证券	2024年1月2日-2024年1月9日	10.84	186,400	2,020,576.00
213	300114	中航电测	2024年1月2日-2024年1月9日	43.75	46,100	2,016,875.00
214	300558	贝达药业	2024年1月2日-2024年1月9日	51.55	39,100	2,015,605.00
215	002568	百润股份	2024年1月2日-2024年1月9日	24.61	81,800	2,013,098.00
216	002939	长城证券	2024年1月2日-2024年1月9日	8.00	251,600	2,012,800.00
217	002368	太极股份	2024年1月2日-2024年1月9日	29.53	68,000	2,008,040.00
218	002506	协鑫集成	2024年1月2日-2024年1月9日	2.74	729,800	1,999,652.00
219	689009	九号公司	2024年1月2日-2024年1月9日	29.66	67,400	1,999,084.00
220	600398	海澜之家	2024年1月2日-2024年1月9日	7.42	269,400	1,998,948.00
221	002299	圣农发展	2024年1月2日-2024年1月9日	17.18	116,300	1,998,034.00
222	002128	电投能源	2024年1月2日-2024年1月9日	14.27	139,800	1,994,946.00
223	600863	内蒙华电	2024年1月2日-2024年1月9日	3.90	508,800	1,984,320.00
224	600859	王府井	2024年1月2日-2024年1月9日	15.97	124,000	1,980,280.00
225	600820	隧道股份	2024年1月2日-2024年1月9日	5.76	343,000	1,975,680.00
226	002092	中泰化学	2024年1月2日-2024年1月9日	6.10	323,000	1,970,300.00
227	000636	风华高	2024年1月2日-2024年	13.66	144,200	1,969,772

		科	1月9日			.00
228	002429	兆驰股份	2024年1月2日-2024年1月9日	5.58	352,900	1,969,182.00
229	601216	君正集团	2024年1月2日-2024年1月9日	3.74	526,100	1,967,614.00
230	600739	辽宁成大	2024年1月2日-2024年1月9日	11.78	167,000	1,967,260.00
231	600563	法拉电子	2024年1月2日-2024年1月9日	92.60	21,100	1,953,860.00
232	002414	高德红外	2024年1月2日-2024年1月9日	7.30	266,200	1,943,260.00
233	002373	千方科技	2024年1月2日-2024年1月9日	11.21	172,500	1,933,725.00
234	300253	卫宁健康	2024年1月2日-2024年1月9日	7.19	267,800	1,925,482.00
235	600435	北方导航	2024年1月2日-2024年1月9日	11.74	163,600	1,920,664.00
236	002926	华西证券	2024年1月2日-2024年1月9日	7.76	245,500	1,905,080.00
237	000729	燕京啤酒	2024年1月2日-2024年1月9日	8.63	219,800	1,896,874.00
238	300595	欧普康视	2024年1月2日-2024年1月9日	22.58	84,000	1,896,720.00
239	300296	利亚德	2024年1月2日-2024年1月9日	6.00	315,600	1,893,600.00
240	600655	豫园股份	2024年1月2日-2024年1月9日	6.21	303,500	1,884,735.00
241	300009	安科生物	2024年1月2日-2024年1月9日	10.22	183,100	1,871,282.00
242	300676	华大基因	2024年1月2日-2024年1月9日	48.00	38,900	1,867,200.00
243	300251	光线传媒	2024年1月2日-2024年1月9日	8.15	228,700	1,863,905.00
244	300373	扬杰科技	2024年1月2日-2024年1月9日	36.70	50,700	1,860,690.00
245	300244	迪安诊断	2024年1月2日-2024年1月9日	23.81	78,100	1,859,561.00
246	688567	孚能科技	2024年1月2日-2024年1月9日	16.31	114,000	1,859,340.00
247	002595	豪迈科技	2024年1月2日-2024年1月9日	29.77	62,400	1,857,648.00
248	600021	上海电力	2024年1月2日-2024年1月9日	8.46	219,400	1,856,124.00
249	600325	华发股	2024年1月2日-2024年	7.21	257,300	1,855,133

		份	1月9日			.00
250	600008	首创环 保	2024年1月2日-2024年 1月9日	2.69	686,500	1,846,685 .00
251	600498	烽火通 信	2024年1月2日-2024年 1月9日	16.64	110,800	1,843,712 .00
252	600271	航天信 息	2024年1月2日-2024年 1月9日	10.64	173,200	1,842,848 .00
253	000519	中兵红 箭	2024年1月2日-2024年 1月9日	14.04	130,300	1,829,412 .00
254	601016	节能风 电	2024年1月2日-2024年 1月9日	3.00	605,700	1,817,100 .00
255	002500	山西证 券	2024年1月2日-2024年 1月9日	5.39	335,700	1,809,423 .00
256	600380	健康元	2024年1月2日-2024年 1月9日	12.43	145,300	1,806,079 .00
257	600566	济川药 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	31.43	57,400	1,804,082 .00
258	600004	白云机 场	2024年1月2日-2024年 1月9日	9.78	184,400	1,803,432 .00
259	688536	思瑞浦	2024年1月2日-2024年 1月9日	146.30	12,300	1,799,490 .00
260	002507	涪陵榨 菜	2024年1月2日-2024年 1月9日	14.29	125,900	1,799,111 .00
261	688005	容百科 技	2024年1月2日-2024年 1月9日	39.80	45,200	1,798,960 .00
262	000830	鲁西化 工	2024年1月2日-2024年 1月9日	10.03	179,300	1,798,379 .00
263	002372	伟星新 材	2024年1月2日-2024年 1月9日	14.47	124,100	1,795,727 .00
264	002850	科达利	2024年1月2日-2024年 1月9日	84.46	21,100	1,782,106 .00
265	688032	禾迈股 份	2024年1月2日-2024年 1月9日	270.00	6,600	1,782,000 .00
266	600282	南钢股 份	2024年1月2日-2024年 1月9日	3.70	480,500	1,777,850 .00
267	600038	中直股 份	2024年1月2日-2024年 1月9日	38.53	46,100	1,776,233 .00
268	603233	大参林	2024年1月2日-2024年 1月9日	24.90	71,200	1,772,880 .00
269	002936	郑州银 行	2024年1月2日-2024年 1月9日	2.01	881,900	1,772,619 .00
270	688234	天岳先 进	2024年1月2日-2024年 1月9日	66.07	26,800	1,770,676 .00
271	002281	光迅科	2024年1月2日-2024年	28.50	61,900	1,764,150

		技	1月9日			.00
272	000060	中金岭南	2024年1月2日-2024年1月9日	4.32	408,000	1,762,560.00
273	688063	派能科技	2024年1月2日-2024年1月9日	106.00	16,600	1,759,600.00
274	002192	融捷股份	2024年1月2日-2024年1月9日	54.21	32,300	1,750,983.00
275	688331	荣昌生物	2024年1月2日-2024年1月9日	62.06	27,700	1,719,062.00
276	002056	横店东磁	2024年1月2日-2024年1月9日	13.54	126,900	1,718,226.00
277	601636	旗滨集团	2024年1月2日-2024年1月9日	6.84	251,000	1,716,840.00
278	601880	辽港股份	2024年1月2日-2024年1月9日	1.45	1,174,100	1,702,445.00
279	002019	亿帆医药	2024年1月2日-2024年1月9日	14.78	114,700	1,695,266.00
280	603225	新风鸣	2024年1月2日-2024年1月9日	14.20	119,200	1,692,640.00
281	300070	碧水源	2024年1月2日-2024年1月9日	4.99	339,000	1,691,610.00
282	002670	国盛金控	2024年1月2日-2024年1月9日	9.32	181,000	1,686,920.00
283	002120	韵达股份	2024年1月2日-2024年1月9日	7.46	226,000	1,685,960.00
284	600511	国药股份	2024年1月2日-2024年1月9日	28.62	58,900	1,685,718.00
285	300529	健帆生物	2024年1月2日-2024年1月9日	22.23	75,600	1,680,588.00
286	300682	朗新科技	2024年1月2日-2024年1月9日	16.39	102,500	1,679,975.00
287	603156	养元饮品	2024年1月2日-2024年1月9日	21.26	79,000	1,679,540.00
288	600580	卧龙电驱	2024年1月2日-2024年1月9日	11.73	143,100	1,678,563.00
289	300677	英科医疗	2024年1月2日-2024年1月9日	23.36	71,700	1,674,912.00
290	000547	航天发展	2024年1月2日-2024年1月9日	8.37	199,300	1,668,141.00
291	603927	中科软	2024年1月2日-2024年1月9日	29.98	55,600	1,666,888.00
292	002080	中材科技	2024年1月2日-2024年1月9日	15.92	104,700	1,666,824.00
293	603885	吉祥航	2024年1月2日-2024年	12.00	138,100	1,657,200

		空	1月9日			.00
294	603893	瑞芯微	2024年1月2日-2024年1月9日	63.40	26,100	1,654,740.00
295	002557	洽洽食品	2024年1月2日-2024年1月9日	34.82	47,400	1,650,468.00
296	603444	吉比特	2024年1月2日-2024年1月9日	245.12	6,700	1,642,304.00
297	600390	五矿资本	2024年1月2日-2024年1月9日	4.68	350,700	1,641,276.00
298	600258	首旅酒店	2024年1月2日-2024年1月9日	15.62	104,600	1,633,852.00
299	002531	天顺风能	2024年1月2日-2024年1月9日	11.60	140,200	1,626,320.00
300	601000	唐山港	2024年1月2日-2024年1月9日	3.50	462,000	1,617,000.00
301	002508	老板电器	2024年1月2日-2024年1月9日	21.78	74,000	1,611,720.00
302	688385	复旦微电	2024年1月2日-2024年1月9日	38.63	41,600	1,607,008.00
303	601933	永辉超市	2024年1月2日-2024年1月9日	2.82	566,100	1,596,402.00
304	002831	裕同科技	2024年1月2日-2024年1月9日	27.51	58,000	1,595,580.00
305	000598	兴蓉环境	2024年1月2日-2024年1月9日	5.69	279,400	1,589,786.00
306	300026	红日药业	2024年1月2日-2024年1月9日	4.24	374,700	1,588,728.00
307	002572	索菲亚	2024年1月2日-2024年1月9日	15.95	99,600	1,588,620.00
308	002958	青农商行	2024年1月2日-2024年1月9日	2.62	606,300	1,588,506.00
309	002487	大金重工	2024年1月2日-2024年1月9日	26.62	59,600	1,586,552.00
310	603517	绝味食品	2024年1月2日-2024年1月9日	26.86	59,000	1,584,740.00
311	601179	中国西电	2024年1月2日-2024年1月9日	4.93	319,600	1,575,628.00
312	688516	奥特维	2024年1月2日-2024年1月9日	90.50	17,400	1,574,700.00
313	688538	和辉光电	2024年1月2日-2024年1月9日	2.43	648,000	1,574,640.00
314	000970	中科三环	2024年1月2日-2024年1月9日	10.35	151,500	1,568,025.00
315	603737	三棵树	2024年1月2日-2024年	47.61	32,900	1,566,369.00

			1月9日			.00
316	601231	环旭电子	2024年1月2日-2024年1月9日	15.11	103,500	1,563,885.00
317	688200	华峰测控	2024年1月2日-2024年1月9日	122.80	12,700	1,559,560.00
318	601778	晶科科技	2024年1月2日-2024年1月9日	3.50	445,400	1,558,900.00
319	300438	鹏辉能源	2024年1月2日-2024年1月9日	28.29	55,000	1,555,950.00
320	600970	中材国际	2024年1月2日-2024年1月9日	9.34	164,800	1,539,232.00
321	000155	川能动力	2024年1月2日-2024年1月9日	13.29	115,200	1,531,008.00
322	000887	中鼎股份	2024年1月2日-2024年1月9日	12.37	123,100	1,522,747.00
323	600906	财达证券	2024年1月2日-2024年1月9日	7.50	202,500	1,518,750.00
324	600707	彩虹股份	2024年1月2日-2024年1月9日	6.75	223,800	1,510,650.00
325	603185	弘元绿能	2024年1月2日-2024年1月9日	33.28	45,100	1,500,928.00
326	600848	上海临港	2024年1月2日-2024年1月9日	10.05	149,200	1,499,460.00
327	600329	达仁堂	2024年1月2日-2024年1月9日	33.65	44,500	1,497,425.00
328	002030	达安基因	2024年1月2日-2024年1月9日	9.68	153,100	1,482,008.00
329	600481	双良节能	2024年1月2日-2024年1月9日	8.46	174,900	1,479,654.00
330	600995	南网储能	2024年1月2日-2024年1月9日	9.86	149,600	1,475,056.00
331	600959	江苏有线	2024年1月2日-2024年1月9日	3.14	467,700	1,468,578.00
332	603858	步长制药	2024年1月2日-2024年1月9日	17.01	86,300	1,467,963.00
333	002155	湖南黄金	2024年1月2日-2024年1月9日	11.14	131,300	1,462,682.00
334	000563	陕国投A	2024年1月2日-2024年1月9日	3.04	478,300	1,454,032.00
335	601866	中远海发	2024年1月2日-2024年1月9日	2.34	617,400	1,444,716.00
336	600208	新湖中宝	2024年1月2日-2024年1月9日	2.17	663,200	1,439,144.00
337	600755	厦门国贸	2024年1月2日-2024年	6.97	206,100	1,436,517

		贸	1月9日			.00
338	000027	深圳能源	2024年1月2日-2024年1月9日	6.45	222,600	1,435,770.00
339	601958	金铂股份	2024年1月2日-2024年1月9日	9.45	150,900	1,426,005.00
340	000778	新兴铸管	2024年1月2日-2024年1月9日	3.82	373,100	1,425,242.00
341	600977	中国电影	2024年1月2日-2024年1月9日	12.24	116,400	1,424,736.00
342	600316	洪都航空	2024年1月2日-2024年1月9日	21.17	67,200	1,422,624.00
343	300357	我武生物	2024年1月2日-2024年1月9日	29.00	49,000	1,421,000.00
344	600131	国网通信	2024年1月2日-2024年1月9日	15.15	93,600	1,418,040.00
345	000739	普洛药业	2024年1月2日-2024年1月9日	15.39	91,900	1,414,341.00
346	000987	越秀资本	2024年1月2日-2024年1月9日	6.02	234,800	1,413,496.00
347	688029	南微医学	2024年1月2日-2024年1月9日	96.80	14,600	1,413,280.00
348	002244	滨江集团	2024年1月2日-2024年1月9日	7.27	194,200	1,411,834.00
349	688082	盛美上海	2024年1月2日-2024年1月9日	104.41	13,500	1,409,535.00
350	002683	广东宏大	2024年1月2日-2024年1月9日	20.08	70,100	1,407,608.00
351	600582	天地科技	2024年1月2日-2024年1月9日	5.44	258,200	1,404,608.00
352	601991	大唐发电	2024年1月2日-2024年1月9日	2.42	579,600	1,402,632.00
353	603127	昭衍新药	2024年1月2日-2024年1月9日	23.71	59,000	1,398,890.00
354	601665	齐鲁银行	2024年1月2日-2024年1月9日	3.91	357,000	1,395,870.00
355	600373	中文传媒	2024年1月2日-2024年1月9日	13.18	105,700	1,393,126.00
356	002266	浙富控股	2024年1月2日-2024年1月9日	3.40	408,700	1,389,580.00
357	300888	稳健医疗	2024年1月2日-2024年1月9日	37.25	37,200	1,385,700.00
358	000709	河钢股份	2024年1月2日-2024年1月9日	2.13	644,700	1,373,211.00
359	600737	中粮糖	2024年1月2日-2024年	8.24	166,600	1,372,784

		业	1月9日			.00
360	603883	老百姓	2024年1月2日-2024年1月9日	29.89	45,600	1,362,984.00
361	002032	苏泊尔	2024年1月2日-2024年1月9日	53.01	25,100	1,330,551.00
362	000825	太钢不锈	2024年1月2日-2024年1月9日	3.73	356,700	1,330,491.00
363	600598	北大荒	2024年1月2日-2024年1月9日	11.97	110,800	1,326,276.00
364	002326	永太科技	2024年1月2日-2024年1月9日	11.62	114,100	1,325,842.00
365	600378	昊华科技	2024年1月2日-2024年1月9日	30.48	42,800	1,304,544.00
366	601611	中国核建	2024年1月2日-2024年1月9日	6.93	188,200	1,304,226.00
367	600801	华新水泥	2024年1月2日-2024年1月9日	12.43	104,700	1,301,421.00
368	600056	中国医药	2024年1月2日-2024年1月9日	11.17	116,500	1,301,305.00
369	603379	三美股份	2024年1月2日-2024年1月9日	34.00	38,000	1,292,000.00
370	000883	湖北能源	2024年1月2日-2024年1月9日	4.23	305,000	1,290,150.00
371	601598	中国外运	2024年1月2日-2024年1月9日	5.24	246,000	1,289,040.00
372	600528	中铁工业	2024年1月2日-2024年1月9日	7.44	173,200	1,288,608.00
373	300363	博腾股份	2024年1月2日-2024年1月9日	25.15	51,200	1,287,680.00
374	603826	坤彩科技	2024年1月2日-2024年1月9日	59.03	21,800	1,286,854.00
375	600901	江苏金租	2024年1月2日-2024年1月9日	4.84	264,900	1,282,116.00
376	603267	鸿远电子	2024年1月2日-2024年1月9日	50.20	25,500	1,280,100.00
377	300776	帝尔激光	2024年1月2日-2024年1月9日	60.26	21,200	1,277,512.00
378	603568	伟明环保	2024年1月2日-2024年1月9日	16.00	79,700	1,275,200.00
379	600517	国网英大	2024年1月2日-2024年1月9日	4.77	267,300	1,275,021.00
380	002511	中顺洁柔	2024年1月2日-2024年1月9日	10.00	124,800	1,248,000.00
381	002153	石基信	2024年1月2日-2024年	9.74	127,600	1,242,824



		息	1月9日			.00
382	603650	彤程新材	2024年1月2日-2024年1月9日	33.30	37,300	1,242,090.00
383	003035	南网能源	2024年1月2日-2024年1月9日	5.26	236,100	1,241,886.00
384	601992	金隅集团	2024年1月2日-2024年1月9日	1.91	650,100	1,241,691.00
385	600500	中化国际	2024年1月2日-2024年1月9日	4.42	279,900	1,237,158.00
386	601106	中国一重	2024年1月2日-2024年1月9日	2.88	427,600	1,231,488.00
387	002653	海思科	2024年1月2日-2024年1月9日	23.15	52,200	1,208,430.00
388	600062	华润双鹤	2024年1月2日-2024年1月9日	18.60	64,700	1,203,420.00
389	600827	百联股份	2024年1月2日-2024年1月9日	9.49	125,200	1,188,148.00
390	603228	景旺电子	2024年1月2日-2024年1月9日	22.56	52,400	1,182,144.00
391	000937	冀中能源	2024年1月2日-2024年1月9日	7.14	165,300	1,180,242.00
392	000581	威孚高科	2024年1月2日-2024年1月9日	15.07	77,800	1,172,446.00
393	002408	齐翔腾达	2024年1月2日-2024年1月9日	5.28	221,600	1,170,048.00
394	600871	石化油服	2024年1月2日-2024年1月9日	1.83	634,600	1,161,318.00
395	603026	胜华新材	2024年1月2日-2024年1月9日	45.86	25,200	1,155,672.00
396	603305	旭升集团	2024年1月2日-2024年1月9日	19.73	58,300	1,150,259.00
397	600022	山东钢铁	2024年1月2日-2024年1月9日	1.37	834,000	1,142,580.00
398	003022	联泓新科	2024年1月2日-2024年1月9日	18.31	62,400	1,142,544.00
399	601098	中南传媒	2024年1月2日-2024年1月9日	10.17	111,900	1,138,023.00
400	603707	健友股份	2024年1月2日-2024年1月9日	15.00	75,700	1,135,500.00
401	601118	海南橡胶	2024年1月2日-2024年1月9日	4.24	266,800	1,131,232.00
402	600126	杭钢股份	2024年1月2日-2024年1月9日	5.33	210,500	1,121,965.00
403	600315	上海家	2024年1月2日-2024年	21.18	52,800	1,118,304

		化	1月9日			.00
404	688520	神州细胞	2024年1月2日-2024年1月9日	53.87	20,700	1,115,109.00
405	600764	中国海防	2024年1月2日-2024年1月9日	24.95	44,400	1,107,780.00
406	600967	内蒙一机	2024年1月2日-2024年1月9日	8.26	132,900	1,097,754.00
407	688779	长远锂科	2024年1月2日-2024年1月9日	7.30	150,300	1,097,190.00
408	601156	东航物流	2024年1月2日-2024年1月9日	14.78	74,100	1,095,198.00
409	002690	美亚光电	2024年1月2日-2024年1月9日	19.64	55,100	1,082,164.00
410	688349	三一重能	2024年1月2日-2024年1月9日	28.62	37,700	1,078,974.00
411	000559	万向钱潮	2024年1月2日-2024年1月9日	5.19	206,000	1,069,140.00
412	000156	华数传媒	2024年1月2日-2024年1月9日	7.37	144,300	1,063,491.00
413	688276	百克生物	2024年1月2日-2024年1月9日	54.81	19,400	1,063,314.00
414	000401	冀东水泥	2024年1月2日-2024年1月9日	6.39	165,800	1,059,462.00
415	601928	凤凰传媒	2024年1月2日-2024年1月9日	8.81	119,100	1,049,271.00
416	601608	中信重工	2024年1月2日-2024年1月9日	3.86	270,600	1,044,516.00
417	688778	厦钨新能	2024年1月2日-2024年1月9日	39.64	26,200	1,038,568.00
418	002867	周大生	2024年1月2日-2024年1月9日	15.18	68,400	1,038,312.00
419	000089	深圳机场	2024年1月2日-2024年1月9日	6.43	159,800	1,027,514.00
420	600808	马钢股份	2024年1月2日-2024年1月9日	2.72	375,100	1,020,272.00
421	600663	陆家嘴	2024年1月2日-2024年1月9日	8.75	115,800	1,013,250.00
422	002518	科士达	2024年1月2日-2024年1月9日	27.60	36,700	1,012,920.00
423	688208	道通科技	2024年1月2日-2024年1月9日	23.75	42,300	1,004,625.00
424	600095	湘财股份	2024年1月2日-2024年1月9日	7.51	133,700	1,004,087.00
425	002010	传化智	2024年1月2日-2024年	4.62	217,200	1,003,464

		联	1月9日			.00
426	001286	陕西能源	2024年1月2日-2024年1月9日	8.55	116,900	999,495.00
427	300861	美畅股份	2024年1月2日-2024年1月9日	33.29	30,000	998,700.00
428	603218	日月股份	2024年1月2日-2024年1月9日	12.37	80,300	993,311.00
429	000958	电投产融	2024年1月2日-2024年1月9日	3.94	251,700	991,698.00
430	688425	铁建重工	2024年1月2日-2024年1月9日	3.97	249,400	990,118.00
431	300257	开山股份	2024年1月2日-2024年1月9日	15.76	61,900	975,544.00
432	000930	中粮科技	2024年1月2日-2024年1月9日	6.64	145,300	964,792.00
433	002423	中粮资本	2024年1月2日-2024年1月9日	6.68	143,700	959,916.00
434	603866	桃李面包	2024年1月2日-2024年1月9日	7.66	124,700	955,202.00
435	002505	鹏都农牧	2024年1月2日-2024年1月9日	1.60	596,200	953,920.00
436	002925	盈趣科技	2024年1月2日-2024年1月9日	19.47	48,500	944,295.00
437	000967	盈峰环境	2024年1月2日-2024年1月9日	4.75	198,200	941,450.00
438	600597	光明乳业	2024年1月2日-2024年1月9日	8.73	107,400	937,602.00
439	000898	鞍钢股份	2024年1月2日-2024年1月9日	2.49	373,600	930,264.00
440	002468	申通快递	2024年1月2日-2024年1月9日	7.79	119,200	928,568.00
441	688107	安路科技	2024年1月2日-2024年1月9日	36.78	25,000	919,500.00
442	603786	科博达	2024年1月2日-2024年1月9日	71.36	12,700	906,272.00
443	600968	海油发展	2024年1月2日-2024年1月9日	2.85	316,900	903,165.00
444	688281	华秦科技	2024年1月2日-2024年1月9日	135.66	6,600	895,356.00
445	300850	新强联	2024年1月2日-2024年1月9日	31.83	27,900	888,057.00
446	003031	中瓷电子	2024年1月2日-2024年1月9日	88.23	10,000	882,300.00
447	601568	北元集	2024年1月2日-2024年	4.74	185,900	881,166.00

		团	1月9日			0
448	688006	杭可科技	2024年1月2日-2024年1月9日	23.48	37,500	880,500.00
449	688348	昱能科技	2024年1月2日-2024年1月9日	122.38	7,100	868,898.00
450	688690	纳微科技	2024年1月2日-2024年1月9日	27.42	31,600	866,472.00
451	002761	浙江建投	2024年1月2日-2024年1月9日	10.26	84,200	863,892.00
452	000959	首钢股份	2024年1月2日-2024年1月9日	3.46	243,500	842,510.00
453	000537	中绿电	2024年1月2日-2024年1月9日	9.63	87,000	837,810.00
454	002791	坚朗五金	2024年1月2日-2024年1月9日	40.49	20,000	809,800.00
455	688297	中无人机	2024年1月2日-2024年1月9日	38.33	21,100	808,763.00
456	600167	联美控股	2024年1月2日-2024年1月9日	5.67	142,600	808,542.00
457	600377	宁沪高速	2024年1月2日-2024年1月9日	10.25	77,400	793,350.00
458	001914	招商积余	2024年1月2日-2024年1月9日	11.96	66,200	791,752.00
459	600339	中油工程	2024年1月2日-2024年1月9日	3.03	261,100	791,133.00
460	688387	信科移动	2024年1月2日-2024年1月9日	7.21	106,500	767,865.00
461	601228	广州港	2024年1月2日-2024年1月9日	3.13	235,400	736,802.00
462	600350	山东高速	2024年1月2日-2024年1月9日	6.94	105,700	733,558.00
463	002563	森马服饰	2024年1月2日-2024年1月9日	5.77	125,900	726,443.00
464	301029	怡合达	2024年1月2日-2024年1月9日	25.78	27,200	701,216.00
465	603056	德邦股份	2024年1月2日-2024年1月9日	14.47	47,900	693,113.00
466	600928	西安银行	2024年1月2日-2024年1月9日	3.33	207,800	691,974.00
467	002399	海普瑞	2024年1月2日-2024年1月9日	11.73	58,400	685,032.00
468	000539	粤电力A	2024年1月2日-2024年1月9日	4.89	138,700	678,243.00
469	000402	金融	2024年1月2日-2024年	3.63	186,400	676,632.00

		街	1月9日			0
470	601298	青岛港	2024年1月2日-2024年1月9日	6.18	109,200	674,856.00
471	603317	天味食品	2024年1月2日-2024年1月9日	13.29	50,000	664,500.00
472	601828	美凯龙	2024年1月2日-2024年1月9日	3.87	169,100	654,417.00
473	688153	唯捷创芯	2024年1月2日-2024年1月9日	65.50	9,900	648,450.00
474	002945	华林证券	2024年1月2日-2024年1月9日	15.10	42,200	637,220.00
475	601139	深圳燃气	2024年1月2日-2024年1月9日	6.89	89,700	618,033.00
476	688105	诺唯赞	2024年1月2日-2024年1月9日	32.02	18,800	601,976.00
477	000031	大悦城	2024年1月2日-2024年1月9日	2.97	200,400	595,188.00
478	688295	中复神鹰	2024年1月2日-2024年1月9日	30.31	19,600	594,076.00
479	688819	天能股份	2024年1月2日-2024年1月9日	27.92	21,200	591,904.00
480	601061	中信金属	2024年1月2日-2024年1月9日	7.71	76,300	588,273.00
481	001872	招商港口	2024年1月2日-2024年1月9日	15.96	36,200	577,752.00
482	603529	爱玛科技	2024年1月9日	25.04	21,600	540,864.00
483	601158	重庆水务	2024年1月2日-2024年1月9日	5.67	89,700	508,599.00
484	600299	安迪苏	2024年1月2日-2024年1月9日	8.00	62,800	502,400.00
485	002608	江苏国信	2024年1月2日-2024年1月9日	6.57	75,500	496,035.00
486	000553	安道麦A	2024年1月2日-2024年1月9日	6.94	67,900	471,226.00
487	600956	新天绿能	2024年1月2日-2024年1月9日	8.13	55,000	447,150.00
488	688375	国博电子	2024年1月2日-2024年1月9日	79.53	5,600	445,368.00
489	603355	莱克电气	2024年1月2日-2024年1月9日	22.30	17,800	396,940.00
490	603868	飞科电器	2024年1月2日-2024年1月9日	50.50	7,300	368,650.00
491	688248	南网科	2024年1月2日-2024年	24.97	13,300	332,101.00

		技	1月9日			0
492	600032	浙江新能	2024年1月2日-2024年1月9日	8.06	33,900	273,234.00
合计	-	-	-	-	101,390,600	984,855,991.00

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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	387,111.88	-
未评级	-	-
合计	387,111.88	-

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	90,426,084.27	-	-	-	90,426,084.27
结算备付金	18,586,894.13	-	-	-	18,586,894.13
存出保证金	918,407.61	-	-	7,807,680.00	8,726,087.61



交易性金融资产			387,111.88	6,397,618,162.23	6,398,005,274.11
衍生金融资产			-	-	-
买入返售金融资产			-	-	-
应收清算款			-	2,735,365.83	2,735,365.83
债权投资			-	-	-
应收股利			-	-	-
应收申购款			-	-	-
递延所得税资产			-	-	-
其他资产			-	132,495.00	132,495.00
资产总计	109,931,386.01		387,111.88	6,408,293,703.06	6,518,612,200.95
负债					
短期借款			-	-	-
交易性金融负债			-	-	-
衍生金融负债			-	-	-
卖出回购金融资产款			-	-	-
应付清算款			-	43,756,882.74	43,756,882.74
应付赎回款			-	-	-
应付管理人报酬			-	668,986.74	668,986.74
应付托管费			-	222,995.56	222,995.56
应付销售服务费			-	-	-
应付投资顾问费			-	-	-
应交税费			-	21,302.17	21,302.17
应付利润			-	-	-
递延所得税负债			-	-	-
其他负债			-	2,827,862.96	2,827,862.96
负债总计			-	47,498,030.17	47,498,030.17
利率敏感度缺口	109,931,386.01		387,111.88	6,360,795,672.89	6,471,114,170.78
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	89,776,778.49	-	-	-	89,776,778.49
结算备付金	20,358,179.62	-	-	-	20,358,179.62
存出保证金	618,745.62	-	-	9,868,992.00	10,487,737.62
交易性金融资产	-	-	-	8,174,750,196.18	8,174,750,196.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	154,000.00	154,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	237,412.12	237,412.12
资产总计	110,753,703.73	-	-	8,185,010,600.30	8,295,764,304.03
负债					

短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	36,152,652.95	36,152,652.95
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	989,578.38	989,578.38
应付托管费	-	-	329,859.47	329,859.47
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	23,793.66	23,793.66
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	2,825,189.28	2,825,189.28
负债总计	-	-	40,321,073.74	40,321,073.74
利率敏感度缺口	110,753,703.73	-	-8,144,689,526.56	8,255,443,230.29

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-5,557.29	-
市场利率下降25个基点	5,652.70	-	

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	6,397,618,162.23	98.86	8,174,750,196.18	99.02
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	6,397,618,162.23	98.86	8,174,750,196.18	99.02

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%		322,785,620.14
业绩比较基准下降 5%		-322,785,620.14	-412,659,024.28

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	6,393,016,202.12	8,143,578,347.51
第二层次	387,111.88	30,084,340.41
第三层次	4,601,960.11	1,087,508.26
合计	6,398,005,274.11	8,174,750,196.18

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,087,508.26	1,087,508.26
当期购买	-	3,918,242.28	3,918,242.28
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,218,690.00	1,218,690.00
转出第三层次	-	1,268,443.74	1,268,443.74
当期利得或损失总额	-	-354,036.69	-354,036.69
其中：计入损益的利得或损失	-	-354,036.69	-354,036.69
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	4,601,960.11	4,601,960.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-534,972.17	-534,972.17
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,078,180.88	1,078,180.88
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	9,327.38	9,327.38
其中：计入损益的利得或损失	-	9,327.38	9,327.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,087,508.26	1,087,508.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	9,327.38	9,327.38

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	4,601,960.11	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	14.62%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,087,508.26	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	6,397,618,162.23	98.14
	其中：股票	6,397,618,162.23	98.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	387,111.88	0.01
	其中：债券	387,111.88	0.01

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	109,012,978.40	1.67
8	其他各项资产	11,593,948.44	0.18
9	合计	6,518,612,200.95	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 984,855,991.00 元，占基金资产净值的比例为 15.22%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	43,485,225.96	0.67
B	采矿业	247,475,431.41	3.82
C	制造业	4,033,214,429.28	62.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	208,480,101.00	3.22
E	建筑业	51,075,131.56	0.79
F	批发和零售业	193,365,390.67	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	118,556,459.03	1.83
H	住宿和餐饮业	10,478,364.60	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	483,144,924.86	7.47
J	金融业	578,929,686.67	8.95
K	房地产业	79,942,641.17	1.24
L	租赁和商务服务业	56,929,685.28	0.88
M	科学研究和技术服务业	58,789,264.67	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	34,023,058.37	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,633,760.00	0.27
Q	卫生和社会工作	48,412,741.91	0.75
R	文化、体育和娱乐业	91,537,337.00	1.41
S	综合	37,521,705.60	0.58

	合计	6,392,995,339.04	98.79
--	----	------------------	-------

### 8.2.2 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	3,242,209.66	0.05
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	56,342.59	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,263.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,218,690.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,385.54	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	0.00
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	4,601,960.11	0.07

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	710,300	35,031,996.00	0.54
2	002422	科伦药业	1,181,324	34,317,462.20	0.53
3	002028	思源电气	616,850	32,100,874.00	0.50
4	300418	昆仑万维	851,411	31,842,771.40	0.49



5	600157	永泰能源	22,242,300	30,471,951.00	0.47
6	000988	华工科技	1,006,451	29,951,981.76	0.46
7	002463	沪电股份	1,334,400	29,516,928.00	0.46
8	601058	赛轮轮胎	2,498,800	29,360,900.00	0.45
9	601555	东吴证券	4,010,370	29,315,804.70	0.45
10	000975	银泰黄金	1,945,822	29,187,330.00	0.45
11	600079	人福医药	1,143,900	28,437,354.00	0.44
12	600418	江淮汽车	1,749,186	28,249,353.90	0.44
13	002340	格林美	5,141,200	28,070,952.00	0.43
14	601168	西部矿业	1,908,442	27,233,467.34	0.42
15	000933	神火股份	1,577,300	26,498,640.00	0.41
16	301236	软通动力	572,400	26,444,880.00	0.41
17	601233	桐昆股份	1,689,700	25,565,161.00	0.40
18	600161	天坛生物	824,800	25,519,312.00	0.39
19	300394	天孚通信	276,600	25,314,432.00	0.39
20	601077	渝农商行	6,197,400	25,285,392.00	0.39
21	601108	财通证券	3,254,300	25,253,368.00	0.39
22	000630	铜陵有色	7,608,500	24,955,880.00	0.39
23	002384	东山精密	1,369,344	24,894,673.92	0.38
24	300037	新宙邦	525,342	24,848,676.60	0.38
25	002156	通富微电	1,060,390	24,516,216.80	0.38
26	000009	中国宝安	2,065,717	24,251,517.58	0.37
27	688122	西部超导	455,108	24,225,398.84	0.37
28	002517	恺英网络	2,154,000	24,060,180.00	0.37
29	300012	华测检测	1,684,700	23,922,740.00	0.37
30	002966	苏州银行	3,670,742	23,712,993.32	0.37
31	600109	国金证券	2,610,000	23,698,800.00	0.37
32	600988	赤峰黄金	1,665,700	23,336,457.00	0.36
33	600885	宏发股份	835,070	23,081,334.80	0.36
34	300136	信维通信	968,451	22,855,443.60	0.35
35	688169	石头科技	79,085	22,377,100.75	0.35
36	002465	海格通信	1,739,200	22,348,720.00	0.35
37	002625	光启技术	1,509,940	22,316,913.20	0.34
38	600160	巨化股份	1,351,327	22,283,382.23	0.34
39	000423	东阿阿胶	451,200	22,253,184.00	0.34
40	300207	欣旺达	1,491,500	22,014,540.00	0.34
41	600352	浙江龙盛	2,605,600	21,887,040.00	0.34
42	002185	华天科技	2,566,362	21,865,404.24	0.34
43	600536	中国软件	602,525	21,847,556.50	0.34
44	002138	顺络电子	806,914	21,794,747.14	0.34
45	688072	拓荆科技	93,829	21,702,647.70	0.34
46	002738	中矿资源	579,424	21,618,309.44	0.33
47	601162	天风证券	6,940,400	21,445,836.00	0.33

48	600298	安琪酵母	608,761	21,416,211.98	0.33
49	000932	华菱钢铁	4,149,641	21,370,651.15	0.33
50	300003	乐普医疗	1,317,740	21,294,678.40	0.33
51	603596	伯特利	303,900	21,060,270.00	0.33
52	688099	晶晨股份	333,152	20,865,309.76	0.32
53	000783	长江证券	3,873,700	20,840,506.00	0.32
54	002223	鱼跃医疗	602,160	20,822,692.80	0.32
55	300144	宋城演艺	2,098,500	20,712,195.00	0.32
56	300724	捷佳伟创	278,635	20,621,776.35	0.32
57	002078	太阳纸业	1,678,640	20,429,048.80	0.32
58	002439	启明星辰	755,707	20,404,089.00	0.32
59	603939	益丰药房	505,856	20,254,474.24	0.31
60	000723	美锦能源	3,031,800	20,191,788.00	0.31
61	600415	小商品城	2,745,100	20,094,132.00	0.31
62	600096	云天化	1,285,300	20,050,680.00	0.31
63	002739	万达电影	1,527,300	19,885,446.00	0.31
64	300568	星源材质	1,282,500	19,776,150.00	0.31
65	002385	大北农	3,312,448	19,742,190.08	0.31
66	002756	永兴材料	377,700	19,719,717.00	0.30
67	600482	中国动力	1,094,600	19,713,746.00	0.30
68	600765	中航重机	1,031,510	19,712,156.10	0.30
69	600873	梅花生物	2,062,700	19,698,785.00	0.30
70	000066	中国长城	1,937,600	19,608,512.00	0.30
71	002532	天山铝业	3,259,800	19,591,398.00	0.30
72	600839	四川长虹	3,697,000	19,557,130.00	0.30
73	002797	第一创业	3,364,400	19,547,164.00	0.30
74	300474	景嘉微	273,320	19,326,457.20	0.30
75	688180	君实生物	460,192	19,249,831.36	0.30
76	300017	网宿科技	2,439,800	19,152,430.00	0.30
77	300395	菲利华	520,350	19,023,996.00	0.29
78	603160	汇顶科技	275,100	19,009,410.00	0.29
79	002600	领益智造	2,806,400	18,971,264.00	0.29
80	600155	华创云信	2,263,900	18,880,926.00	0.29
81	002273	水晶光电	1,391,690	18,843,482.60	0.29
82	002044	美年健康	3,134,800	18,840,148.00	0.29
83	300285	国瓷材料	803,936	18,587,000.32	0.29
84	600862	中航高科	836,800	18,535,120.00	0.29
85	002294	信立泰	558,027	18,225,161.82	0.28
86	300601	康泰生物	671,000	18,217,650.00	0.28
87	600177	雅戈尔	2,780,300	18,210,965.00	0.28
88	600129	太极集团	390,400	18,137,984.00	0.28
89	600497	驰宏锌锗	3,567,700	18,016,885.00	0.28
90	300866	安克创新	203,200	18,003,520.00	0.28

91	688120	华海清科	95,486	17,922,722.20	0.28
92	000728	国元证券	2,620,300	17,896,649.00	0.28
93	300058	蓝色光标	2,490,282	17,880,224.76	0.28
94	688114	华大智造	207,541	17,852,676.82	0.28
95	600699	均胜电子	987,300	17,731,908.00	0.27
96	002472	双环传动	681,200	17,724,824.00	0.27
97	601990	南京证券	2,214,245	17,669,675.10	0.27
98	603606	东方电缆	413,200	17,664,300.00	0.27
99	000831	中国稀土	637,500	17,639,625.00	0.27
100	002607	中公教育	4,322,000	17,633,760.00	0.27
101	600348	华阳股份	1,805,800	17,624,608.00	0.27
102	600066	宇通客车	1,329,800	17,619,850.00	0.27
103	603882	金域医学	281,600	17,619,712.00	0.27
104	002195	岩山科技	5,731,178	17,594,716.46	0.27
105	601128	常熟银行	2,743,793	17,532,837.27	0.27
106	002008	大族激光	842,700	17,460,744.00	0.27
107	300146	汤臣倍健	1,021,248	17,391,853.44	0.27
108	600546	山煤国际	992,200	17,373,422.00	0.27
109	002353	杰瑞股份	615,036	17,288,661.96	0.27
110	603816	顾家家居	493,660	17,278,100.00	0.27
111	601696	中银证券	1,668,600	17,169,894.00	0.27
112	002673	西部证券	2,683,900	17,096,443.00	0.26
113	000893	亚钾国际	651,200	17,087,488.00	0.26
114	600529	山东药玻	664,385	17,008,256.00	0.26
115	688301	奕瑞科技	51,099	16,620,460.74	0.26
116	300604	长川科技	436,600	16,586,434.00	0.26
117	600985	淮北矿业	993,400	16,520,242.00	0.26
118	601577	长沙银行	2,415,400	16,473,028.00	0.25
119	600499	科达制造	1,560,291	16,461,070.05	0.25
120	300088	长信科技	2,457,559	16,441,069.71	0.25
121	600060	海信视像	785,456	16,416,030.40	0.25
122	002262	恩华药业	605,200	16,413,024.00	0.25
123	603589	口子窖	360,474	16,329,472.20	0.25
124	600369	西南证券	3,991,400	16,324,826.00	0.25
125	002444	巨星科技	722,184	16,263,583.68	0.25
126	000997	新大陆	826,274	16,203,233.14	0.25
127	300118	东方日升	913,100	16,116,215.00	0.25
128	002624	完美世界	1,359,400	16,095,296.00	0.25
129	601666	平煤股份	1,389,900	16,067,244.00	0.25
130	688728	格科微	780,936	15,985,759.92	0.25
131	601198	东兴证券	1,941,600	15,979,368.00	0.25
132	002409	雅克科技	285,800	15,927,634.00	0.25
133	688390	固德威	121,325	15,842,618.50	0.24

134	688002	睿创微纳	357,942	15,828,195.24	0.24
135	600642	申能股份	2,449,800	15,727,716.00	0.24
136	603688	石英股份	180,780	15,706,166.40	0.24
137	000400	许继电气	713,975	15,678,891.00	0.24
138	300699	光威复材	581,914	15,519,646.38	0.24
139	603000	人民网	553,500	15,486,930.00	0.24
140	300073	当升科技	405,372	15,485,210.40	0.24
141	600637	东方明珠	2,051,008	15,423,580.16	0.24
142	002131	利欧股份	6,762,179	15,417,768.12	0.24
143	002558	巨人网络	1,383,000	15,406,620.00	0.24
144	600486	扬农化工	244,048	15,404,309.76	0.24
145	600884	杉杉股份	1,130,800	15,401,496.00	0.24
146	000683	远兴能源	2,621,100	15,385,857.00	0.24
147	600399	抚顺特钢	1,579,300	15,350,796.00	0.24
148	600535	天士力	900,800	15,331,616.00	0.24
149	000878	云南铜业	1,404,100	15,290,649.00	0.24
150	000591	太阳能	2,739,400	15,285,852.00	0.24
151	600118	中国卫星	591,888	15,282,548.16	0.24
152	600879	航天电子	1,981,684	15,278,783.64	0.24
153	000629	钒钛股份	4,652,772	15,261,092.16	0.24
154	002152	广电运通	1,243,135	15,240,835.10	0.24
155	000021	深科技	937,492	15,196,745.32	0.23
156	600867	通化东宝	1,397,100	15,130,593.00	0.23
157	002497	雅化集团	1,153,780	15,102,980.20	0.23
158	601997	贵阳银行	2,928,300	15,051,462.00	0.23
159	688521	芯原股份	299,803	14,978,157.88	0.23
160	600895	张江高科	775,162	14,960,626.60	0.23
161	600143	金发科技	1,872,400	14,960,476.00	0.23
162	300390	天华新能	586,670	14,872,084.50	0.23
163	000998	隆平高科	1,054,697	14,871,227.70	0.23
164	300001	特锐德	739,857	14,871,125.70	0.23
165	605358	立昂微	542,140	14,849,214.60	0.23
166	688188	柏楚电子	58,664	14,848,445.04	0.23
167	688772	珠海冠宇	674,005	14,834,850.05	0.23
168	000703	恒逸石化	2,202,110	14,798,179.20	0.23
169	600516	方大炭素	2,821,300	14,783,612.00	0.23
170	600416	湘电股份	928,914	14,751,154.32	0.23
171	300024	机器人	1,241,633	14,738,183.71	0.23
172	688220	翱捷科技	208,823	14,709,492.12	0.23
173	002240	盛新锂能	646,000	14,696,500.00	0.23
174	600549	厦门钨业	851,880	14,635,298.40	0.23
175	002432	九安医疗	388,100	14,619,727.00	0.23
176	603712	七一二	463,600	14,608,036.00	0.23

177	603077	和邦生物	6,188,648	14,605,209.28	0.23
178	600170	上海建工	6,226,970	14,571,109.80	0.23
179	002407	多氟多	956,009	14,550,456.98	0.22
180	600153	建发股份	1,503,800	14,481,594.00	0.22
181	002430	杭氧股份	492,684	14,391,299.64	0.22
182	688052	纳芯微	85,732	14,304,384.20	0.22
183	600392	盛和资源	1,403,870	14,291,396.60	0.22
184	600141	兴发集团	778,941	14,215,673.25	0.22
185	601966	玲珑轮胎	737,500	14,182,125.00	0.22
186	000960	锡业股份	988,693	14,158,083.76	0.22
187	000039	中集集团	1,844,002	14,106,615.30	0.22
188	300383	光环新网	1,439,619	13,993,096.68	0.22
189	300748	金力永磁	685,900	13,868,898.00	0.21
190	002065	东华软件	2,246,300	13,859,671.00	0.21
191	000623	吉林敖东	915,388	13,858,974.32	0.21
192	600704	物产中大	3,119,400	13,818,942.00	0.21
193	600909	华安证券	2,821,670	13,769,749.60	0.21
194	600998	九州通	1,956,649	13,716,109.49	0.21
195	300212	易华录	434,259	13,657,445.55	0.21
196	601717	郑煤机	1,077,271	13,627,478.15	0.21
197	000750	国海证券	3,834,391	13,573,744.14	0.21
198	300487	蓝晓科技	252,750	13,410,915.00	0.21
199	603658	安图生物	234,700	13,380,247.00	0.21
200	002203	海亮股份	1,196,694	13,343,138.10	0.21
201	002064	华峰化学	1,987,200	13,334,112.00	0.21
202	002268	电科网安	592,655	13,311,031.30	0.21
203	600673	东阳光	1,810,394	13,270,188.02	0.21
204	002025	航天电器	274,500	13,181,490.00	0.20
205	600583	海油工程	2,213,100	13,145,814.00	0.20
206	600166	福田汽车	4,807,500	13,124,475.00	0.20
207	000050	深天马 A	1,230,284	13,102,524.60	0.20
208	000738	航发控制	658,400	13,102,160.00	0.20
209	603456	九洲药业	540,251	13,079,476.71	0.20
210	600521	华海药业	890,500	13,063,635.00	0.20
211	603338	浙江鼎力	253,500	12,971,595.00	0.20
212	601456	国联证券	1,195,900	12,963,556.00	0.20
213	300558	贝达药业	251,400	12,959,670.00	0.20
214	300114	中航电测	295,627	12,933,681.25	0.20
215	002568	百润股份	525,396	12,929,995.56	0.20
216	002939	长城证券	1,614,900	12,919,200.00	0.20
217	000513	丽珠集团	368,935	12,916,414.35	0.20
218	002368	太极股份	436,595	12,892,650.35	0.20
219	002506	协鑫集成	4,685,283	12,837,675.42	0.20

220	600398	海澜之家	1,729,800	12,835,116.00	0.20
221	689009	九号公司	432,710	12,834,178.60	0.20
222	002299	圣农发展	746,757	12,829,285.26	0.20
223	002128	电投能源	897,607	12,808,851.89	0.20
224	600863	内蒙华电	3,266,900	12,740,910.00	0.20
225	600859	王府井	795,400	12,702,538.00	0.20
226	600820	隧道股份	2,203,220	12,690,547.20	0.20
227	000636	风华高科	926,677	12,658,407.82	0.20
228	002092	中泰化学	2,074,342	12,653,486.20	0.20
229	002429	兆驰股份	2,265,943	12,643,961.94	0.20
230	601216	君正集团	3,378,900	12,637,086.00	0.20
231	600739	辽宁成大	1,071,900	12,626,982.00	0.20
232	600563	法拉电子	135,031	12,503,870.60	0.19
233	002414	高德红外	1,710,100	12,483,730.00	0.19
234	002373	千方科技	1,107,372	12,413,640.12	0.19
235	300253	卫宁健康	1,720,098	12,367,504.62	0.19
236	600435	北方导航	1,049,910	12,325,943.40	0.19
237	002926	华西证券	1,576,000	12,229,760.00	0.19
238	000729	燕京啤酒	1,410,830	12,175,462.90	0.19
239	300595	欧普康视	538,849	12,167,210.42	0.19
240	300296	利亚德	2,025,800	12,154,800.00	0.19
241	600655	豫园股份	1,949,600	12,107,016.00	0.19
242	300009	安科生物	1,175,078	12,009,297.16	0.19
243	300251	光线传媒	1,468,400	11,967,460.00	0.18
244	300244	迪安诊断	502,011	11,952,881.91	0.18
245	300373	扬杰科技	325,200	11,934,840.00	0.18
246	688567	孚能科技	731,598	11,932,363.38	0.18
247	300676	华大基因	248,500	11,928,000.00	0.18
248	600021	上海电力	1,409,900	11,927,754.00	0.18
249	002595	豪迈科技	400,585	11,925,415.45	0.18
250	600325	华发股份	1,653,077	11,918,685.17	0.18
251	600008	首创环保	4,409,030	11,860,290.70	0.18
252	600498	烽火通信	711,900	11,846,016.00	0.18
253	600271	航天信息	1,113,000	11,842,320.00	0.18
254	000519	中兵红箭	836,529	11,744,867.16	0.18
255	601016	节能风电	3,889,085	11,667,255.00	0.18
256	688536	思瑞浦	79,578	11,642,261.40	0.18
257	002500	山西证券	2,155,314	11,617,142.46	0.18
258	600566	济川药业	369,200	11,603,956.00	0.18
259	600380	健康元	932,623	11,592,503.89	0.18
260	600004	白云机场	1,184,700	11,586,366.00	0.18
261	688005	容百科技	290,491	11,561,541.80	0.18
262	002507	涪陵榨菜	808,640	11,555,465.60	0.18

263	000830	鲁西化工	1,151,083	11,545,362.49	0.18
264	002372	伟星新材	796,856	11,530,506.32	0.18
265	600282	南钢股份	3,085,900	11,417,830.00	0.18
266	688234	天岳先进	172,316	11,384,918.12	0.18
267	002936	郑州银行	5,663,446	11,383,526.46	0.18
268	600038	中直股份	295,061	11,368,700.33	0.18
269	603233	大参林	455,976	11,353,802.40	0.18
270	002281	光迅科技	398,023	11,343,655.50	0.18
271	000060	中金岭南	2,619,271	11,315,250.72	0.17
272	688032	禾迈股份	41,763	11,276,010.00	0.17
273	002192	融捷股份	207,800	11,264,838.00	0.17
274	688063	派能科技	105,641	11,197,946.00	0.17
275	002850	科达利	132,068	11,154,463.28	0.17
276	688331	荣昌生物	177,776	11,032,778.56	0.17
277	601636	旗滨集团	1,611,800	11,024,712.00	0.17
278	002056	横店东磁	814,216	11,024,484.64	0.17
279	601880	辽港股份	7,539,549	10,932,346.05	0.17
280	002019	亿帆医药	736,360	10,883,400.80	0.17
281	603225	新凤鸣	765,516	10,870,327.20	0.17
282	300070	碧水源	2,176,838	10,862,421.62	0.17
283	002670	国盛金控	1,161,888	10,828,796.16	0.17
284	002120	韵达股份	1,451,200	10,825,952.00	0.17
285	600511	国药股份	377,709	10,810,031.58	0.17
286	300682	朗新科技	658,800	10,797,732.00	0.17
287	300529	健帆生物	485,016	10,781,905.68	0.17
288	600580	卧龙电驱	918,919	10,778,919.87	0.17
289	603156	养元饮品	506,760	10,773,717.60	0.17
290	300677	英科医疗	459,640	10,737,190.40	0.17
291	000547	航天发展	1,279,500	10,709,415.00	0.17
292	002080	中材科技	672,100	10,699,832.00	0.17
293	603927	中科软	356,615	10,691,317.70	0.17
294	603885	吉祥航空	886,600	10,639,200.00	0.16
295	603444	吉比特	43,279	10,608,548.48	0.16
296	603893	瑞芯微	167,292	10,606,312.80	0.16
297	002557	洽洽食品	304,512	10,603,107.84	0.16
298	600390	五矿资本	2,251,500	10,537,020.00	0.16
299	600258	首旅酒店	670,830	10,478,364.60	0.16
300	002531	天顺风能	899,400	10,433,040.00	0.16
301	601000	唐山港	2,966,366	10,382,281.00	0.16
302	002508	老板电器	475,000	10,345,500.00	0.16
303	688385	复旦微电	266,032	10,276,816.16	0.16
304	002831	裕同科技	372,657	10,251,794.07	0.16
305	601933	永辉超市	3,634,000	10,247,880.00	0.16

306	000598	兴蓉环境	1,793,400	10,204,446.00	0.16
307	300026	红日药业	2,405,800	10,200,592.00	0.16
308	002958	青农商行	3,893,200	10,200,184.00	0.16
309	002572	索菲亚	639,464	10,199,450.80	0.16
310	688516	奥特维	112,688	10,198,264.00	0.16
311	002487	大金重工	383,100	10,198,122.00	0.16
312	603517	绝味食品	379,240	10,186,386.40	0.16
313	601179	中国西电	2,052,700	10,119,811.00	0.16
314	688538	和辉光电	4,161,519	10,112,491.17	0.16
315	000970	中科三环	973,732	10,078,126.20	0.16
316	603737	三棵树	211,022	10,046,757.42	0.16
317	601231	环旭电子	663,700	10,028,507.00	0.15
318	601778	晶科科技	2,859,900	10,009,650.00	0.15
319	688200	华峰测控	81,417	9,998,007.60	0.15
320	300438	鹏辉能源	352,743	9,979,099.47	0.15
321	600970	中材国际	1,058,077	9,882,439.18	0.15
322	002865	钧达股份	127,200	9,855,456.00	0.15
323	000155	川能动力	738,700	9,817,323.00	0.15
324	000887	中鼎股份	790,700	9,780,959.00	0.15
325	600906	财达证券	1,299,300	9,744,750.00	0.15
326	600707	彩虹股份	1,436,900	9,699,075.00	0.15
327	600848	上海临港	958,752	9,635,457.60	0.15
328	603185	弘元绿能	289,200	9,624,576.00	0.15
329	600329	达仁堂	285,409	9,604,012.85	0.15
330	002030	达安基因	983,590	9,521,151.20	0.15
331	600481	双良节能	1,123,627	9,505,884.42	0.15
332	600995	南网储能	960,000	9,465,600.00	0.15
333	600959	江苏有线	3,003,570	9,431,209.80	0.15
334	603858	步长制药	553,661	9,417,773.61	0.15
335	002155	湖南黄金	842,417	9,384,525.38	0.15
336	000563	陕国投 A	3,071,779	9,338,208.16	0.14
337	601866	中远海发	3,964,300	9,276,462.00	0.14
338	600208	新湖中宝	4,259,100	9,242,247.00	0.14
339	600755	厦门国贸	1,323,911	9,227,659.67	0.14
340	000027	深圳能源	1,428,784	9,215,656.80	0.14
341	601958	金钼股份	969,200	9,158,940.00	0.14
342	000778	新兴铸管	2,396,775	9,155,680.50	0.14
343	600977	中国电影	747,500	9,149,400.00	0.14
344	688082	盛美上海	87,360	9,121,257.60	0.14
345	600131	国网信通	601,900	9,118,785.00	0.14
346	300357	我武生物	314,347	9,116,063.00	0.14
347	600316	洪都航空	430,572	9,115,209.24	0.14
348	688029	南微医学	94,160	9,114,688.00	0.14



349	000739	普洛药业	589,905	9,078,637.95	0.14
350	000987	越秀资本	1,506,915	9,071,628.30	0.14
351	002244	滨江集团	1,246,070	9,058,928.90	0.14
352	002683	广东宏大	449,485	9,025,658.80	0.14
353	600582	天地科技	1,657,200	9,015,168.00	0.14
354	601991	大唐发电	3,722,900	9,009,418.00	0.14
355	603127	昭衍新药	379,041	8,987,062.11	0.14
356	601665	齐鲁银行	2,293,000	8,965,630.00	0.14
357	600373	中文传媒	678,400	8,941,312.00	0.14
358	002266	浙富控股	2,625,015	8,925,051.00	0.14
359	300888	稳健医疗	238,021	8,866,282.25	0.14
360	600737	中粮糖业	1,070,586	8,821,628.64	0.14
361	000709	河钢股份	4,139,300	8,816,709.00	0.14
362	603883	老百姓	292,867	8,753,794.63	0.14
363	002032	苏泊尔	161,440	8,557,934.40	0.13
364	000825	太钢不锈	2,289,872	8,541,222.56	0.13
365	600598	北大荒	711,700	8,519,049.00	0.13
366	002326	永太科技	731,700	8,502,354.00	0.13
367	601611	中国核建	1,208,900	8,377,677.00	0.13
368	600801	华新水泥	673,025	8,365,700.75	0.13
369	600056	中国医药	748,687	8,362,833.79	0.13
370	600378	昊华科技	273,800	8,345,424.00	0.13
371	603379	三美股份	244,476	8,312,184.00	0.13
372	000785	居然之家	2,517,700	8,308,410.00	0.13
373	603826	坤彩科技	140,400	8,287,812.00	0.13
374	000883	湖北能源	1,958,500	8,284,455.00	0.13
375	600528	中铁工业	1,112,010	8,273,354.40	0.13
376	601598	中国外运	1,578,400	8,270,816.00	0.13
377	300363	博腾股份	328,000	8,249,200.00	0.13
378	600901	江苏金租	1,699,800	8,227,032.00	0.13
379	300776	帝尔激光	136,216	8,208,376.16	0.13
380	600517	国网英大	1,717,400	8,191,998.00	0.13
381	603568	伟明环保	511,967	8,191,472.00	0.13
382	603267	鸿远电子	162,568	8,160,913.60	0.13
383	002511	中顺洁柔	801,583	8,015,830.00	0.12
384	603650	彤程新材	240,168	7,997,594.40	0.12
385	002153	石基信息	819,680	7,983,683.20	0.12
386	003035	南网能源	1,516,900	7,978,894.00	0.12
387	601992	金隅集团	4,174,000	7,972,340.00	0.12
388	600500	中化国际	1,796,710	7,941,458.20	0.12
389	601106	中国一重	2,746,100	7,908,768.00	0.12
390	600062	华润双鹤	416,446	7,745,895.60	0.12
391	002653	海思科	334,590	7,745,758.50	0.12

392	600827	百联股份	803,063	7,621,067.87	0.12
393	603228	景旺电子	337,180	7,606,780.80	0.12
394	000937	冀中能源	1,061,200	7,576,968.00	0.12
395	000581	威孚高科	498,590	7,513,751.30	0.12
396	002408	齐翔腾达	1,422,983	7,513,350.24	0.12
397	600871	石化油服	4,075,400	7,457,982.00	0.12
398	603026	胜华新材	162,194	7,438,216.84	0.11
399	001227	兰州银行	2,851,000	7,412,600.00	0.11
400	603305	旭升集团	373,600	7,371,128.00	0.11
401	003022	联泓新科	401,200	7,345,972.00	0.11
402	600022	山东钢铁	5,355,320	7,336,788.40	0.11
403	601098	中南传媒	719,100	7,313,247.00	0.11
404	603707	健友股份	485,459	7,281,885.00	0.11
405	601118	海南橡胶	1,713,600	7,265,664.00	0.11
406	688520	神州细胞	133,936	7,215,132.32	0.11
407	600126	杭钢股份	1,352,340	7,207,972.20	0.11
408	600315	上海家化	338,477	7,168,942.86	0.11
409	600764	中国海防	284,501	7,098,299.95	0.11
410	688779	长远锂科	965,833	7,050,580.90	0.11
411	601156	东航物流	476,700	7,045,626.00	0.11
412	600967	内蒙一机	852,794	7,044,078.44	0.11
413	002690	美亚光电	353,408	6,940,933.12	0.11
414	688349	三一重能	240,754	6,890,379.48	0.11
415	000559	万向钱潮	1,322,861	6,865,648.59	0.11
416	000156	华数传媒	927,500	6,835,675.00	0.11
417	688276	百克生物	124,163	6,805,374.03	0.11
418	000401	冀东水泥	1,064,400	6,801,516.00	0.11
419	601928	凤凰传媒	764,200	6,732,602.00	0.10
420	601608	中信重工	1,737,643	6,707,301.98	0.10
421	601187	厦门银行	1,320,900	6,696,963.00	0.10
422	688778	厦钨新能	168,731	6,688,496.84	0.10
423	002867	周大生	438,698	6,659,435.64	0.10
424	000089	深圳机场	1,026,391	6,599,694.13	0.10
425	600808	马钢股份	2,408,400	6,550,848.00	0.10
426	600663	陆家嘴	743,193	6,502,938.75	0.10
427	002518	科士达	234,900	6,483,240.00	0.10
428	603529	爱玛科技	258,900	6,482,856.00	0.10
429	600095	湘财股份	858,700	6,448,837.00	0.10
430	002010	传化智联	1,395,500	6,447,210.00	0.10
431	688208	道通科技	270,918	6,434,302.50	0.10
432	001286	陕西能源	750,700	6,418,485.00	0.10
433	300861	美畅股份	192,100	6,395,009.00	0.10
434	603218	日月股份	516,020	6,383,167.40	0.10

435	000958	电投产融	1,616,700	6,369,798.00	0.10
436	688425	铁建重工	1,601,670	6,358,629.90	0.10
437	300257	开山股份	398,048	6,273,236.48	0.10
438	000930	中粮科技	933,427	6,197,955.28	0.10
439	002423	中粮资本	922,700	6,163,636.00	0.10
440	603866	桃李面包	800,686	6,133,254.76	0.09
441	002505	鹏都农牧	3,828,430	6,125,488.00	0.09
442	002925	盈趣科技	312,579	6,085,913.13	0.09
443	000967	盈峰环境	1,272,445	6,044,113.75	0.09
444	600597	光明乳业	690,123	6,024,773.79	0.09
445	000898	鞍钢股份	2,398,250	5,971,642.50	0.09
446	002468	申通快递	765,900	5,966,361.00	0.09
447	688107	安路科技	160,743	5,912,127.54	0.09
448	600968	海油发展	2,035,300	5,800,605.00	0.09
449	603786	科博达	80,900	5,773,024.00	0.09
450	300850	新强联	179,480	5,712,848.40	0.09
451	003031	中瓷电子	64,500	5,690,835.00	0.09
452	688281	华秦科技	41,825	5,673,979.50	0.09
453	688006	杭可科技	241,276	5,665,160.48	0.09
454	601568	北元集团	1,193,000	5,654,820.00	0.09
455	002761	浙江建投	541,263	5,553,358.38	0.09
456	688690	纳微科技	201,615	5,528,283.30	0.09
457	688348	昱能科技	44,913	5,496,452.94	0.08
458	000959	首钢股份	1,560,647	5,399,838.62	0.08
459	000537	中绿电	559,400	5,387,022.00	0.08
460	002791	坚朗五金	128,631	5,208,269.19	0.08
461	600167	联美控股	916,250	5,195,137.50	0.08
462	688297	中无人机	135,339	5,187,543.87	0.08
463	600377	宁沪高速	496,500	5,089,125.00	0.08
464	600339	中油工程	1,676,800	5,080,704.00	0.08
465	001914	招商积余	423,834	5,069,054.64	0.08
466	002608	江苏国信	756,400	4,969,548.00	0.08
467	688387	信科移动	684,668	4,936,456.28	0.08
468	601228	广州港	1,510,600	4,728,178.00	0.07
469	600350	山东高速	678,500	4,708,790.00	0.07
470	002563	森马服饰	809,100	4,668,507.00	0.07
471	001203	大中矿业	452,800	4,604,976.00	0.07
472	600927	永安期货	291,400	4,577,894.00	0.07
473	301029	怡合达	173,400	4,470,252.00	0.07
474	603056	德邦股份	308,399	4,462,533.53	0.07
475	600928	西安银行	1,334,700	4,444,551.00	0.07
476	002399	海普瑞	374,658	4,394,738.34	0.07
477	000539	粤电力 A	891,400	4,358,946.00	0.07

478	000402	金融街	1,196,900	4,344,747.00	0.07
479	601298	青岛港	701,900	4,337,742.00	0.07
480	603317	天味食品	319,999	4,252,786.71	0.07
481	601828	美凯龙	1,085,196	4,199,708.52	0.06
482	600925	苏能股份	758,500	4,179,335.00	0.06
483	688153	唯捷创芯	62,882	4,118,771.00	0.06
484	002945	华林证券	270,100	4,078,510.00	0.06
485	601139	深圳燃气	575,900	3,967,951.00	0.06
486	688105	诺唯赞	120,305	3,852,166.10	0.06
487	688295	中复神鹰	126,317	3,828,668.27	0.06
488	000031	大悦城	1,287,183	3,822,933.51	0.06
489	688819	天能股份	136,436	3,809,293.12	0.06
490	601061	中信金属	490,500	3,781,755.00	0.06
491	001872	招商港口	232,142	3,704,986.32	0.06
492	601158	重庆水务	576,600	3,269,322.00	0.05
493	600299	安迪苏	402,800	3,222,400.00	0.05
494	000553	安道麦 A	435,800	3,024,452.00	0.05
495	688375	国博电子	36,091	2,870,317.23	0.04
496	600956	新天绿能	352,600	2,866,638.00	0.04
497	603355	莱克电气	115,038	2,565,347.40	0.04
498	603868	飞科电器	48,005	2,424,252.50	0.04
499	688248	南网科技	84,918	2,120,402.46	0.03
500	600032	浙江新能	216,600	1,745,796.00	0.03

### 8.3.2 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	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.04
2	400174	中天3	3,046,725	1,218,690.00	0.02
3	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
4	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
5	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
6	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
7	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
8	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
9	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
10	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
11	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
12	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
13	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
14	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
15	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
16	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
17	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00

18	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
19	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
20	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
21	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
22	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
23	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
24	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
25	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
26	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
27	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
28	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
29	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
30	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
31	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
32	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
33	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
34	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
35	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
36	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
37	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
38	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
39	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
40	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
41	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
42	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
43	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
44	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
45	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
46	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
47	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
48	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
49	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
50	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
51	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
52	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
53	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
54	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
55	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
56	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
57	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
58	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
59	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
60	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00

61	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
62	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
63	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
64	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
65	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
66	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
67	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
68	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
69	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688099	晶晨股份	116,731,239.12	1.41
2	600563	法拉电子	97,886,624.85	1.19
3	688777	中控技术	82,572,911.38	1.00
4	688122	西部超导	78,619,478.74	0.95
5	688220	翱捷科技	77,886,468.68	0.94
6	603688	石英股份	71,831,825.26	0.87
7	688521	芯原股份	70,301,663.22	0.85
8	688002	睿创微纳	66,420,563.39	0.80
9	600157	永泰能源	64,266,273.00	0.78
10	601555	东吴证券	61,220,158.44	0.74
11	603737	三棵树	59,301,463.89	0.72
12	600372	中航机载	57,715,014.13	0.70
13	600079	人福医药	55,624,388.78	0.67
14	688385	复旦微电	53,998,765.50	0.65
15	601058	赛轮轮胎	53,658,080.92	0.65
16	603893	瑞芯微	52,658,443.28	0.64
17	603267	鸿远电子	52,120,897.11	0.63
18	603605	珀莱雅	51,994,283.30	0.63
19	600486	扬农化工	51,777,827.86	0.63
20	600765	中航重机	51,757,778.54	0.63

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688099	晶晨股份	124,232,952.50	1.50
2	688777	中控技术	116,834,028.91	1.42
3	600563	法拉电子	109,682,386.34	1.33
4	688122	西部超导	94,728,393.62	1.15

5	600489	中金黄金	89,343,111.63	1.08
6	603605	珀莱雅	84,281,752.27	1.02
7	603688	石英股份	83,895,741.56	1.02
8	603345	安井食品	82,074,335.11	0.99
9	600487	亨通光电	80,762,996.54	0.98
10	600157	永泰能源	78,501,148.00	0.95
11	688002	睿创微纳	73,444,091.30	0.89
12	688521	芯原股份	72,357,155.73	0.88
13	601555	东吴证券	72,351,034.00	0.88
14	600372	中航机载	71,839,809.23	0.87
15	688256	寒武纪	71,118,367.30	0.86
16	603737	三棵树	69,715,922.35	0.84
17	600079	人福医药	66,326,875.50	0.80
18	300308	中际旭创	66,282,391.56	0.80
19	600418	江淮汽车	64,781,854.33	0.78
20	600885	宏发股份	64,683,284.09	0.78

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,510,621,819.24
卖出股票收入（成交）总额	10,649,207,566.54

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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

#### 8.5 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）	387,111.88	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	387,111.88	0.01

#### 8.6 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	127102	浙建转债	3,871	387,111.88	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

#### **8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

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

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

#### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**  
无。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**  
无。

#### **8.12 投资组合报告附注**

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

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

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**8.12.3 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	8,726,087.61
2	应收清算款	2,735,365.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-



5	应收申购款	-
6	其他应收款	132,495.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,593,948.44

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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	300502	新易盛	5,459,724.00	0.08	转融通出借证券
2	002422	科伦药业	5,339,390.00	0.08	转融通出借证券
3	002028	思源电气	5,006,248.00	0.08	转融通出借证券
4	300418	昆仑万维	4,955,500.00	0.08	转融通出借证券
5	600157	永泰能源	4,745,406.00	0.07	转融通出借证券
6	000988	华工科技	4,669,344.00	0.07	转融通出借证券
7	002463	沪电股份	4,596,536.00	0.07	转融通出借证券
8	601058	赛轮轮胎	4,571,925.00	0.07	转融通出借证券
9	601555	东吴证券	4,565,826.00	0.07	转融通出借证券
10	000975	银泰黄金	4,543,500.00	0.07	转融通出借证券

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688347	华虹公司	2,432,119.50	0.04	新股锁定
2	400174	中天3	1,218,690.00	0.02	重大事项停牌
3	688563	航材股份	90,795.49	0.00	新股锁定

4	688548	广钢气体	51,612.00	0.00	新股锁定
5	688549	中巨芯	34,738.46	0.00	新股锁定

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
16,984	67,538.27	1,017,761,389.00	88.73	129,308,542.00	11.27

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	382,468,608.00	33.34

### 9.2 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	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	57,006,000.00	4.97
2	中国人寿保险股份有限公司	53,640,600.00	4.68
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	35,495,000.00	3.09
4	国泰君安证券股份有限公司	34,580,713.00	3.01
5	中国国际金融股份有限公司	32,642,881.00	2.85
6	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	25,405,722.00	2.21
7	招商证券股份有限公司	25,002,613.00	2.18
8	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	24,611,793.00	2.15

9	申万宏源证券有限公司	22,023,745.00	1.92
10	广发证券股份有限公司	21,539,603.00	1.88
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	382,468,608.00	33.34

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 9.3 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。

### 9.4 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、基金投资和研发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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	1,378,269,931.00
本报告期基金总申购份额	2,241,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,472,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,147,069,931.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

2023年4月29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》，张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》，程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 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》，姚志鹏先生任公司副总经理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 116,000.00 元,该审计机构已连续 11 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	14,698,430,067.32	73.02	1,795,348.20	33.33	-
开源证券	2	1,353,352,47	6.72	856,620.55	15.90	-

股份有限 公司		5.97				
申万宏源 证券有限 公司	2	1,026,882,48 9.28	5.10	718,826.92	13.34	-
广发证券 股份有限 公司	3	800,637,834. 11	3.98	516,424.39	9.59	-
招商证券 股份有限 公司	1	548,191,528. 99	2.72	383,738.86	7.12	-
长江证券 股份有限 公司	1	534,735,272. 15	2.66	337,591.30	6.27	-
海通证券 股份有限 公司	1	485,116,240. 91	2.41	339,584.10	6.30	-
国投证券 股份有限 公司	2	274,100,061. 33	1.36	176,382.88	3.27	-
兴业证券 股份有限 公司	2	228,789,182. 82	1.14	145,657.13	2.70	-
中航证券 有限公司	2	134,223,230. 71	0.67	86,527.59	1.61	-
华泰证券 股份有限 公司	1	23,166,511.7 7	0.12	16,217.25	0.30	-
西部证券 股份有限 公司	2	22,738,431.1 6	0.11	14,355.11	0.27	-
财信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券有 限责任公 司	1	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

3. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。安信证券股份有限公司更名为国投证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国盛证券有限责任公司退租交易单元 2 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：东北证券股份有限公司新增交易单元 1 个，华福证券有限责任公司新增交易单元 2 个，银泰证券有限责任公司新增交易单元 1 个，浙商证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中航证券有限公司新增交易单元 2 个。

## 11.7.2 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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
中信建投证券股份有限公司	600,862.38	10.25	17,000,000.00	29.82	-	-
开源证券股份有限公司	4,376,509.60	74.65	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	266,867.44	4.55	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	40,000,000.00	70.18	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	618,659.32	10.55	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

西部证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国元证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
银泰证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-



## 11.8 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防范不法分子诈骗活动的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 21 日
2	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 19 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
4	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 15 日
5	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 30 日
6	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 20 日
8	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 29 日
9	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 27 日
10	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 8 日
11	关于嘉实中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 (%)

联接基金	1	2023-01-01 至 2023-12-31	355,502,6 28.00	513,998, 808.00	487,032,8 28.00	382,468,608.0 0	33.34
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日