

嘉实中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 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	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

§ 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 嘉实
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,241,676,765.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易场所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,889,179,138.95
本期利润	2,667,873,922.29
加权平均基金份额本期利润	0.7063
本期加权平均净值利润率	21.39%
本期基金份额净值增长率	21.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,327,270,149.11
期末可供分配基金份额利润	2.3765
期末基金资产净值	8,189,382,699.87
期末基金份额净值	3.6532
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	205.95%

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。

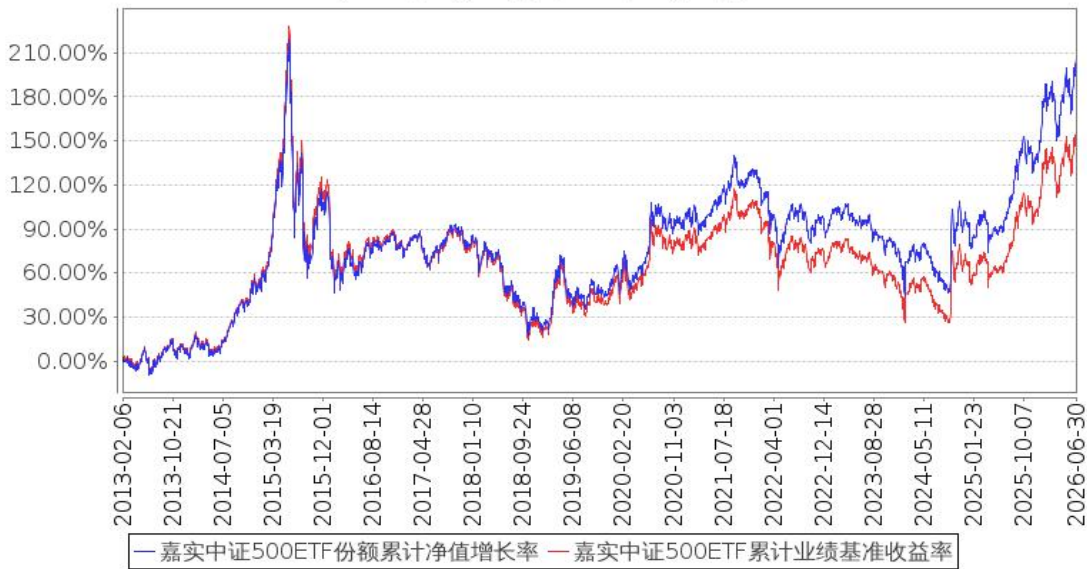
3.2 基金净值表现

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	19.61%	1.64%	18.56%	1.65%	1.05%	-0.01%
过去六个月	21.97%	1.66%	20.97%	1.66%	1.00%	0.00%
过去一年	55.18%	1.42%	52.68%	1.42%	2.50%	0.00%
过去三年	57.20%	1.48%	50.55%	1.49%	6.65%	-0.01%
过去五年	44.44%	1.36%	32.65%	1.36%	11.79%	0.00%
过去七年	110.17%	1.36%	82.43%	1.36%	27.74%	0.00%
过去十年	79.30%	1.34%	47.49%	1.35%	31.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	205.95%	1.55%	156.53%	1.56%	49.42%	-0.01%

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

嘉实中证500ETF份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年02月06日至2026年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。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 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 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、不动产基金等不同类别。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		
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 120ETF 联接、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接、嘉实中证光伏产业	2021 年 9 月 24 日	—	11 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。

	ETF 发起联接、嘉实中证 2000ETF、嘉实中证 A100ETF、嘉实中证 A100ETF 发起联接、嘉实中证港股通汽车产业主题指数发起式、嘉实中证光伏产业 ETF 基金经理				
何如	本基金基金经理	2016 年 1 月 5 日	2026 年 1 月 14 日	20 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。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资

建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 3 次，其中 2 次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，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2026 年上半年，中国经济延续“稳中向新”态势。生产端工业保持韧性，高技术产业与装备制造业表现亮眼，AI 产业链带动效应持续，新质生产力加快培育。需求端投资结构持续优化，基建托底发力，消费稳步释放，出口发挥稳定锚作用。价格端积极变化增多，物价温和回升，企业盈利预期修复。服务业贡献提升，制造业高端化智能化升级明确。政策协同精准有力，总体运行在合理区间。美国上半年经济呈现“前高后低”格局。通胀粘性取代回落预期成为核心矛盾，核心物价持续处于高位。美联储新任主席释放鹰派信号，市场对政策路径的预期在降息、观望与加息之间反复摇摆；中东地缘冲突推升能源价格，进一步加剧通胀压力。欧元区上半年受能源冲击叠加内需疲软，制造业景气持续低迷，通胀快速反弹，欧洲央行在压力下近三年首次加息，成为本轮全球紧缩周期中率先行动的主要央行，利率与增长的两难困境进一步加剧。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.57%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00%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 3.6532 元；本报告期基金份额净值增长率为 21.97%，业绩比较基准收益率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济有望在“结构分化”中走向“盈利修复”。外需与高技术制造保持韧性的

同时，下半年财政支出有望加快落地，货币政策维持适度宽松，为内需回暖提供支撑。产业层面，AI 算力、半导体、高端装备等硬科技赛道受益全球产业周期上行和自主可控，业绩可见度持续提升。权益市场或将从“估值扩张”驱动切换至“业绩验证”驱动。风险上仍需关注海外加息预期扰动与贸易摩擦升温对外需和风险偏好的阶段性冲击。

本基金作为一只投资于中证小盘 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小盘 500 指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行

了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	329,432,840.56	92,354,868.36
结算备付金		102,988,058.27	36,362,060.03
存出保证金		58,950,790.94	17,568,421.56
交易性金融资产	6.4.7.2	7,698,537,811.33	15,470,962,580.74
其中：股票投资		7,695,850,741.63	15,469,357,556.12
基金投资		-	-
债券投资		2,687,069.70	1,605,024.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		19,221,930.86	137,595,109.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		8,209,131,431.96	15,754,843,040.25
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		17,377,578.76	136,596,146.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		927,935.52	1,799,987.38
应付托管费		309,311.83	599,995.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		153,232.55	0.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	980,673.43	446,233.76
负债合计		19,748,732.09	139,442,364.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,862,112,550.76	6,656,682,148.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,327,270,149.11	8,958,718,527.24
净资产合计		8,189,382,699.87	15,615,400,676.15
负债和净资产总计		8,209,131,431.96	15,754,843,040.25

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.6532 元，基金份额总额 2,241,676,765.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,680,569,745.17	573,019,609.66
1. 利息收入		524,738.63	512,360.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	524,738.63	444,748.14
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		-	67,612.37
其他利息收入		-	-

2. 投资收益(损失以“-”填列)		3,892,769,482.31	427,848,007.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,800,066,355.63	327,365,677.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,061,890.31	739,267.03
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	42,499,746.31	-1,737,686.70
股利收益	6.4.7.19	46,141,490.06	101,480,749.72
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.20	-1,221,305,216.66	137,497,368.24
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.21	8,580,740.89	7,161,872.99
减：二、营业总支出		12,695,822.88	11,962,158.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,333,346.02	8,309,982.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,111,115.25	2,769,994.33
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		153,197.87	10,620.21
8. 其他费用	6.4.7.23	98,163.74	871,560.80
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		2,667,873,922.29	561,057,451.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		2,667,873,922.29	561,057,451.37
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		2,667,873,922.29	561,057,451.37

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,656,682,148. 91	-	8,958,718,527. 24	15,615,400,676. 15
二、本期期初净资产	6,656,682,148. 91	-	8,958,718,527. 24	15,615,400,676. 15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,794,569,598 .15	-	-3,631,448,378 .13	-7,426,017,976. 28
(一)、综合收益总额	-	-	2,667,873,922. 29	2,667,873,922.2 9
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,794,569,598 .15	-	-6,299,322,300 .42	-10,093,891,898 .57
其中：1. 基金申购款	9,841,366,911. 23	-	15,661,089,348 .86	25,502,456,260. 09
2. 基金赎回款	-13,635,936,50 9.38	-	-21,960,411,64 9.28	-35,596,348,158 .66
(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	2,862,112,550. 76	-	5,327,270,149. 11	8,189,382,699.8 7
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,668,173,106. 86	-	5,268,667,229. 61	11,936,840,336. 47
二、本期期初净资产	6,668,173,106. 86	-	5,268,667,229. 61	11,936,840,336. 47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-575,824,659.5	-	20,886,142.64	-554,938,516.94

号填列)	8			
(一)、综合收益总额	-	-	561,057,451.37	561,057,451.37
(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)	-575,824,659.58	-	-540,171,308.73	-1,115,995,968.31
其中：1. 基金申购款	3,447,287,320.09	-	2,729,110,858.27	6,176,398,178.36
2. 基金赎回款	-4,023,111,979.67	-	-3,269,282,167.00	-7,292,394,146.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,092,348,447.28	-	5,289,553,372.25	11,381,901,819.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷
基金管理人负责人

梁凯
主管会计工作负责人

李袁
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日,公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,可以选择适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税;取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期;

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税;

(4)对基金取得的股票股息红利所得,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。其中,对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股,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;

(5)对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税;自 2023 年 8 月 28 日起,出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税;

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	329,432,840.56
等于：本金	329,404,375.82
加：应计利息	28,464.74
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	329,432,840.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,063,963,540.74	-	7,695,850,741.63	631,887,200.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,687,000.00	69.70	2,687,069.70	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,687,000.00	69.70	2,687,069.70	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,066,650,540.74	69.70	7,698,537,811.33	631,887,200.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日		
		合同/名义 金额	公允价值	
			资产	负债
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	446,913,720.00	-	-	-
其中：股指期货	446,913,720.00	-	-	-

投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	446,913,720.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	249.00	444,624,360.00	15,038,440.00
IC2609	IC2609	11.00	19,275,080.00	1,947,280.00
合计				16,985,720.00
减：可抵销期货暂收款				16,985,720.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债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/负债项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	886,453.88
其中：交易所市场	886,453.88
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	980,673.43

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,213,676,765.00	6,656,682,148.91
本期申购	7,708,000,000.00	9,841,366,911.23
本期赎回（以“-”号填列）	-10,680,000,000.00	-13,635,936,509.38
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,241,676,765.00	2,862,112,550.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,549,434,372.00	-1,590,715,844.76	8,958,718,527.24
本期期初	10,549,434,372.00	-1,590,715,844.76	8,958,718,527.24
本期利润	3,889,179,138.95	-1,221,305,216.66	2,667,873,922.29
本期基金份额交易产生的变动数	-7,530,401,320.86	1,231,079,020.44	-6,299,322,300.42
其中：基金申购款	19,787,404,292.69	-4,126,314,943.83	15,661,089,348.86
基金赎回款	-27,317,805,613.55	5,357,393,964.27	-21,960,411,649.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,908,212,190.09	-1,580,942,040.98	5,327,270,149.11

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	221,628.10
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	299,360.96
其他	3,749.57
合计	524,738.63

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,715,961,117.51
股票投资收益——赎回差价收入	2,084,105,238.12
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	3,800,066,355.63

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	22,100,594,852.20
减：卖出股票成本总额	20,369,461,473.30
减：交易费用	15,172,261.39

买卖股票差价收入	1,715,961,117.51
----------	------------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	35,596,348,158.66
减：现金支付赎回款总额	17,429,907,069.66
减：赎回股票成本总额	16,082,335,850.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,084,105,238.12

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	212.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,061,677.88
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	4,061,890.31

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	123,838,665.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	119,195,587.27
减：应计利息总额	576,494.45
减：交易费用	4,906.38
买卖债券差价收入	4,061,677.88

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	42,499,746.31

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	46,141,490.06

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	46,141,490.06

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,228,999,656.66
股票投资	-1,228,999,656.66
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	7,694,440.00
权证投资	-
期货投资	7,694,440.00
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	-1,221,305,216.66

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	8,580,740.89
合计	8,580,740.89

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	544.84
存托服务费	3,399.35
合计	98,163.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,333,346.02	8,309,982.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	349,106.16	176,906.71
应支付基金管理人的净管理费	8,984,239.86	8,133,076.24

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,111,115.25	2,769,994.33

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	541,666,601.00	24.16	572,836,551.00	10.99
--------------	----------------	-------	----------------	-------

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	329,432,840.56	221,628.10	149,060,687.24	245,201.50

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华	2026	6 个月	新	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-

	润 新 能 源	年 6 月 24 日		股 锁 定						
001248	华 润 新 能 源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新发未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301666	大 普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301682	宏 明 电 子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧 谷 新 材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新 广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三 瑞 智	2026 年 3 月 31	6 个月	新股锁	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

	能	日		定						
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科	2026年6月16日	6个月	新股锁	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	技	日		定						
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新 股 锁 定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位 ： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
111025	圣 泉 转 债	2026 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新 债 未 上 市	100.00	100.00	13,420	1,342,000.00	1,342,017.65	-
113704	春 风 转 债	2026 年 6 月 11 日	1 个月 内(含)	新 债 未 上 市	100.00	100.00	9,990	999,000.00	999,045.98	-
118071	华 峰 转 债	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新 债 未 上 市	100.00	100.00	3,460	346,000.00	346,006.07	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年8月30日	重大事项停牌	0.40	-	-	3,046,725	4,150,777.45	1,218,690.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金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 risk 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，还有董事会合规与风险控制委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,687,069.70	1,605,024.62
未评级	-	-
合计	2,687,069.70	1,605,024.62

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	329,432,840.56	-	-	-	329,432,840.56
结算备付金	102,988,058.27	-	-	-	102,988,058.27
存出保证金	3,282,858.14	-	-	55,667,932.80	58,950,790.94
交易性金融资产	-	-	2,687,069.70	7,695,850,741.63	7,698,537,811.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	19,221,930.86	19,221,930.86
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	435,703,756.97	-	2,687,069.70	7,770,740,605.29	8,209,131,431.96
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	-	-	-	17,377,578.76	17,377,578.76
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	927,935.52	927,935.52
应付托管费	-	-	-	309,311.83	309,311.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	153,232.55	153,232.55
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	980,673.43	980,673.43
负债总计	-	-	-	19,748,732.09	19,748,732.09
利率敏感度缺口	435,703,756.97	-	2,687,069.70	7,750,991,873.20	8,189,382,699.87
上年度末 2025 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	92,354,868.36	-	-	-	92,354,868.36

结算备付金	36,362,060.03	-	-	-	36,362,060.03
存出保证金	928,415.16	-	-	16,640,006.40	17,568,421.56
交易性金融资产	-	-	1,605,024.62	15,469,357,556.12	15,470,962,580.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	137,595,109.56	137,595,109.56
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	129,645,343.55	-	1,605,024.62	15,623,592,672.08	15,754,843,040.25
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	-	-	-	136,596,146.37	136,596,146.37
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,799,987.38	1,799,987.38
应付托管费	-	-	-	599,995.81	599,995.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.78	0.78
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	446,233.76	446,233.76
负债总计	-	-	-	139,442,364.10	139,442,364.10
利率敏感度缺口	129,645,343.55	-	1,605,024.62	15,484,150,307.98	15,615,400,676.15

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 25 个基点	39,245.42	23,522.31
	市场利率上升 25 个基点	-38,583.64	-23,124.52

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	7,695,850,741.63	93.97	15,469,357,556.12	99.06
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	7,695,850,741.63	93.97	15,469,357,556.12	99.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	408,961,478.08	780,397,510.62
	业绩比较基准下降5%	-408,961,478.08	-780,397,510.62

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
---------------	-------------------	---------------------

第一层次	7,691,567,687.32	15,466,640,273.93
第二层次	3,537,361.14	1,605,024.62
第三层次	3,432,762.87	2,717,282.19
合计	7,698,537,811.33	15,470,962,580.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,695,850,741.63	93.75
	其中：股票	7,695,850,741.63	93.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,687,069.70	0.03
	其中：债券	2,687,069.70	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	432,420,898.83	5.27
8	其他各项资产	78,172,721.80	0.95

9	合计	8,209,131,431.96	100.00
---	----	------------------	--------

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	25,052,253.36	0.31
B	采矿业	237,139,745.58	2.90
C	制造业	5,789,604,819.92	70.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	187,160,608.84	2.29
E	建筑业	45,185,191.31	0.55
F	批发和零售业	145,499,976.41	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	93,294,453.13	1.14
H	住宿和餐饮业	5,581,973.18	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	496,448,974.85	6.06
J	金融业	421,066,513.00	5.14
K	房地产业	30,926,441.72	0.38
L	租赁和商务服务业	78,439,262.86	0.96
M	科学研究和技术服务业	55,760,903.58	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	26,469,701.66	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	17,941,381.88	0.22
R	文化、体育和娱乐业	35,956,404.29	0.44
S	综合	—	—
	合计	7,691,528,605.57	93.92

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	2,162,707.34	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.01
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 583. 46	0. 00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1, 218, 690. 00	0. 01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4, 269, 422. 06	0. 05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	67, 664	127, 614, 304. 00	1. 56
2	300604	长川科技	302, 200	103, 177, 124. 00	1. 26
3	001309	德明利	108, 141	101, 966, 148. 90	1. 25
4	688347	华虹宏力	279, 009	93, 830, 726. 70	1. 15
5	002281	光迅科技	329, 314	84, 613, 939. 16	1. 03
6	002008	大族激光	559, 640	84, 007, 560. 40	1. 03
7	688120	华海清科	260, 604	83, 961, 396. 72	1. 03
8	300857	协创数据	233, 173	79, 255, 502. 70	0. 97
9	300136	信维通信	658, 663	78, 545, 562. 75	0. 96
10	688361	中科飞测	166, 521	71, 604, 030. 00	0. 87
11	300475	香农芯创	223, 800	67, 140, 000. 00	0. 82
12	300223	北京君正	263, 414	65, 563, 744. 60	0. 80
13	002436	兴森科技	1, 153, 614	58, 776, 633. 30	0. 72

14	300285	国瓷材料	542,302	55,954,720.36	0.68
15	300054	鼎龙股份	518,662	54,962,612.14	0.67
16	600105	永鼎股份	798,600	53,889,528.00	0.66
17	300666	江丰电子	144,400	53,225,840.00	0.65
18	688777	中控技术	432,002	50,760,235.00	0.62
19	688200	华峰测控	95,384	50,086,138.40	0.61
20	300757	罗博特科	79,800	49,396,200.00	0.60
21	688037	芯源微	109,582	48,111,977.10	0.59
22	000021	深科技	740,510	47,592,577.70	0.58
23	002851	麦格米特	276,525	46,229,449.50	0.56
24	601869	长飞光纤	82,900	45,255,110.00	0.55
25	300548	长芯博创	160,496	44,617,888.00	0.54
26	300346	南大光电	470,816	43,621,102.40	0.53
27	002409	雅克科技	193,358	43,408,871.00	0.53
28	300567	精测电子	133,245	42,318,612.00	0.52
29	688019	安集科技	123,640	41,970,834.40	0.51
30	600498	烽火通信	556,612	40,966,643.20	0.50
31	002185	华天科技	1,804,290	40,253,709.90	0.49
32	688313	仕佳光子	216,943	40,058,524.95	0.49
33	002138	顺络电子	546,814	39,972,103.40	0.49
34	688002	睿创微纳	257,413	39,819,216.97	0.49
35	002407	多氟多	792,100	39,787,183.00	0.49
36	300620	光库科技	101,600	38,425,120.00	0.47
37	600879	航天电子	1,802,154	38,367,858.66	0.47
38	300395	菲利华	285,965	38,242,099.45	0.47
39	300390	天华新能	395,672	36,999,288.72	0.45
40	688017	绿的谐波	87,183	36,430,288.38	0.44
41	688469	芯联集成	3,432,918	36,423,259.98	0.44
42	301526	国际复材	769,900	35,931,233.00	0.44
43	300373	扬杰科技	222,032	34,910,091.36	0.43
44	300058	蓝色光标	2,440,247	33,577,798.72	0.41
45	002273	水晶光电	942,197	33,429,149.56	0.41
46	300037	新宙邦	359,171	33,349,027.35	0.41
47	603256	宏和科技	123,900	32,874,387.00	0.40
48	688172	燕东微	389,947	32,622,966.02	0.40
49	688702	盛科通信	83,561	32,587,954.39	0.40
50	300751	迈为股份	114,181	32,251,565.26	0.39
51	605358	立昂微	404,510	31,389,976.00	0.38
52	301377	鼎泰高科	55,900	30,795,310.00	0.38
53	600988	赤峰黄金	1,135,400	29,883,728.00	0.36
54	688099	晶晨股份	289,587	29,798,502.30	0.36
55	605589	圣泉集团	462,100	29,375,697.00	0.36
56	600885	宏发股份	845,198	29,150,879.02	0.36

57	002126	银轮股份	575,687	28,669,212.60	0.35
58	002738	中矿资源	485,963	28,666,957.37	0.35
59	000960	锡业股份	670,993	28,644,691.17	0.35
60	600392	盛和资源	957,570	28,506,858.90	0.35
61	000831	中国稀土	504,700	28,005,803.00	0.34
62	600601	方正科技	2,017,434	27,921,286.56	0.34
63	001389	广合科技	115,612	27,428,947.00	0.33
64	600141	兴发集团	574,441	26,981,493.77	0.33
65	002812	恩捷股份	400,638	26,806,688.58	0.33
66	300570	太辰光	108,294	26,717,212.74	0.33
67	301358	湖南裕能	344,400	26,129,628.00	0.32
68	601179	中国西电	1,749,200	26,098,064.00	0.32
69	600378	昊华科技	345,400	26,036,252.00	0.32
70	688234	天岳先进	145,964	25,326,213.64	0.31
71	002195	岩山科技	3,851,529	25,188,999.66	0.31
72	600497	驰宏锌锗	2,064,600	25,002,306.00	0.31
73	002850	科达利	131,788	24,947,468.40	0.30
74	002261	拓维信息	856,785	23,998,547.85	0.29
75	600157	永泰能源	14,892,200	23,976,442.00	0.29
76	688629	华丰科技	125,272	23,489,752.72	0.29
77	600711	盛屯矿业	2,109,700	23,143,409.00	0.28
78	002340	格林美	3,465,500	22,906,955.00	0.28
79	600909	华安证券	2,057,970	22,864,046.70	0.28
80	600143	金发科技	1,460,000	22,557,000.00	0.28
81	688052	纳芯微	77,463	22,333,357.53	0.27
82	003031	中瓷电子	122,562	22,097,928.60	0.27
83	300017	网宿科技	1,698,415	22,096,379.15	0.27
84	000783	长江证券	2,253,087	21,967,598.25	0.27
85	002131	利欧股份	4,593,632	21,819,752.00	0.27
86	688411	海博思创	74,372	21,657,126.40	0.26
87	600352	浙江龙盛	1,776,200	21,509,782.00	0.26
88	601555	东吴证券	2,713,470	21,490,682.40	0.26
89	301611	珂玛科技	119,000	21,428,330.00	0.26
90	002203	海亮股份	935,098	21,366,989.30	0.26
91	002966	苏州银行	3,040,787	21,163,877.52	0.26
92	301200	大族数控	58,606	21,136,253.90	0.26
93	688027	国盾量子	41,928	21,132,131.28	0.26
94	601233	桐昆股份	974,800	21,104,420.00	0.26
95	603659	璞泰来	728,700	21,081,291.00	0.26
96	688220	翱捷科技	169,506	21,072,985.92	0.26
97	002821	凯莱英	129,413	20,964,906.00	0.26
98	300339	润和软件	542,200	20,880,122.00	0.25
99	688213	思特威	193,318	20,698,558.26	0.25

100	300759	康龙化成	702,400	20,320,432.00	0.25
101	688578	艾力斯	185,427	20,248,628.40	0.25
102	688235	百济神州	78,164	19,901,336.04	0.24
103	603308	应流股份	324,900	19,623,960.00	0.24
104	688122	西部超导	310,949	19,530,706.69	0.24
105	601108	财通证券	2,218,300	19,188,295.00	0.23
106	300207	欣旺达	1,005,888	19,101,813.12	0.23
107	002472	双环传动	459,809	19,086,671.59	0.23
108	300001	特锐德	502,357	19,004,165.31	0.23
109	002517	恺英网络	1,161,950	18,881,687.50	0.23
110	002797	第一创业	2,854,311	18,752,823.27	0.23
111	002601	龙佰集团	1,134,200	18,691,616.00	0.23
112	603129	春风动力	73,038	18,683,120.40	0.23
113	300458	全志科技	473,330	18,677,601.80	0.23
114	601958	金钼股份	660,700	18,572,277.00	0.23
115	688387	信科移动	933,025	18,511,216.00	0.23
116	688385	复旦微电	258,508	18,429,035.32	0.23
117	300115	长盈精密	645,980	18,048,681.20	0.22
118	601198	东兴证券	1,323,600	17,987,724.00	0.22
119	601991	大唐发电	2,538,500	17,972,580.00	0.22
120	688322	奥比中光	136,261	17,788,873.55	0.22
121	002155	湖南黄金	743,812	17,754,792.44	0.22
122	688301	奕瑞科技	142,798	17,706,952.00	0.22
123	600563	法拉电子	91,766	17,508,952.80	0.21
124	000703	恒逸石化	1,289,284	17,495,583.88	0.21
125	002465	海格通信	1,350,406	17,244,684.62	0.21
126	601665	齐鲁银行	2,940,500	16,966,685.00	0.21
127	603179	新泉股份	341,600	16,960,440.00	0.21
128	300454	深信服	176,161	16,946,688.20	0.21
129	603156	养元饮品	344,451	16,902,210.57	0.21
130	002056	横店东磁	553,507	16,870,893.36	0.21
131	600884	杉杉股份	1,228,545	16,646,784.75	0.20
132	603650	彤程新材	168,368	16,496,696.64	0.20
133	300024	机器人	852,333	16,475,596.89	0.20
134	600707	彩虹股份	967,700	16,344,453.00	0.20
135	002130	沃尔核材	856,439	16,238,083.44	0.20
136	601162	天风证券	4,813,800	16,222,506.00	0.20
137	002402	和而泰	622,300	16,074,009.00	0.20
138	688676	金盘科技	189,416	16,032,170.24	0.20
139	002429	兆驰股份	1,539,528	15,995,695.92	0.20
140	000060	中金岭南	2,111,978	15,987,673.46	0.20
141	300012	华测检测	1,145,149	15,871,765.14	0.19
142	688331	荣昌生物	120,891	15,747,261.66	0.19

143	601099	太平洋	4,652,800	15,679,936.00	0.19
144	000878	云南铜业	987,360	15,679,276.80	0.19
145	002432	九安医疗	221,497	15,655,407.96	0.19
146	603379	三美股份	206,276	15,654,285.64	0.19
147	600109	国金证券	1,770,100	15,541,478.00	0.19
148	300496	中科创达	251,240	15,524,119.60	0.19
149	000893	亚钾国际	377,130	15,420,845.70	0.19
150	002271	东方雨虹	1,296,672	15,391,496.64	0.19
151	002414	高德红外	1,158,890	15,366,881.40	0.19
152	000034	神州数码	552,612	15,334,983.00	0.19
153	300623	捷捷微电	339,600	15,278,604.00	0.19
154	603688	石英股份	184,920	15,276,241.20	0.19
155	689009	九号公司	399,422	15,237,949.30	0.19
156	002444	巨星科技	486,695	15,136,214.50	0.18
157	002487	大金重工	260,300	15,089,591.00	0.18
158	002335	科华数据	355,408	15,087,069.60	0.18
159	600256	广汇能源	3,053,800	15,085,772.00	0.18
160	603979	金诚信	255,331	15,072,188.93	0.18
161	300474	景嘉微	249,041	15,061,999.68	0.18
162	600298	安琪酵母	414,761	15,014,348.20	0.18
163	000733	振华科技	263,585	14,929,454.40	0.18
164	688266	泽璟制药	127,883	14,918,830.78	0.18
165	600060	海信视像	534,877	14,907,021.99	0.18
166	301536	星宸科技	114,900	14,788,779.00	0.18
167	688728	格科微	702,794	14,786,785.76	0.18
168	000661	长春高新	221,956	14,782,269.60	0.18
169	300763	锦浪科技	162,597	14,690,638.95	0.18
170	002756	永兴材料	256,769	14,543,396.16	0.18
171	600021	上海电力	963,400	14,518,438.00	0.18
172	601128	常熟银行	2,490,478	14,494,581.96	0.18
173	600699	均胜电子	666,740	14,408,251.40	0.18
174	601696	中银证券	1,137,400	14,388,110.00	0.18
175	300748	金力永磁	465,870	14,372,089.50	0.18
176	601577	长沙银行	1,647,300	14,347,983.00	0.18
177	601615	明阳智能	1,235,100	14,290,107.00	0.17
178	300073	当升科技	296,372	14,237,710.88	0.17
179	002078	太阳纸业	1,136,925	14,200,193.25	0.17
180	603920	世运电路	294,800	14,162,192.00	0.17
181	002025	航天电器	185,765	14,159,008.30	0.17
182	300142	沃森生物	1,087,830	14,130,911.70	0.17
183	688343	云天励飞	173,010	14,127,996.60	0.17
184	002157	正邦科技	4,997,256	14,042,289.36	0.17
185	300432	富临精工	697,046	14,003,654.14	0.17

186	300919	中伟新材	318,640	13,940,500.00	0.17
187	000423	东阿阿胶	306,199	13,889,186.64	0.17
188	603087	甘李药业	244,512	13,878,501.12	0.17
189	603606	东方电缆	333,981	13,863,551.31	0.17
190	688169	石头科技	142,905	13,571,687.85	0.17
191	002252	上海莱士	3,123,900	13,557,726.00	0.17
192	688599	天合光能	959,868	13,553,336.16	0.17
193	688608	恒玄科技	80,223	13,412,483.37	0.16
194	300724	捷佳伟创	189,619	13,387,101.40	0.16
195	000728	国元证券	1,779,395	13,327,668.55	0.16
196	300953	震裕科技	99,300	13,276,410.00	0.16
197	688375	国博电子	123,473	12,878,233.90	0.16
198	603119	浙江荣泰	193,810	12,857,355.40	0.16
199	002064	华峰化学	1,348,347	12,795,813.03	0.16
200	000786	北新建材	692,600	12,529,134.00	0.15
201	001203	大中矿业	417,400	12,501,130.00	0.15
202	603290	斯达半导	81,417	12,451,915.98	0.15
203	002831	裕同科技	349,412	12,425,090.72	0.15
204	688180	君实生物	366,460	12,393,677.20	0.15
205	600171	上海贝岭	387,300	12,370,362.00	0.15
206	688187	时代电气	179,090	12,296,319.40	0.15
207	688018	乐鑫科技	95,539	12,221,348.88	0.15
208	300677	英科医疗	311,699	12,209,249.83	0.15
209	300383	光环新网	978,613	12,173,945.72	0.15
210	300679	电连技术	202,000	12,117,980.00	0.15
211	000519	中兵红箭	568,229	11,972,585.03	0.15
212	603806	福斯特	712,000	11,954,480.00	0.15
213	600177	雅戈尔	1,577,500	11,878,575.00	0.15
214	600516	方大炭素	1,923,500	11,867,995.00	0.14
215	688065	凯赛生物	247,008	11,819,332.80	0.14
216	002673	西部证券	1,820,682	11,816,226.18	0.14
217	603160	汇顶科技	190,848	11,777,230.08	0.14
218	688188	柏楚电子	110,209	11,759,300.30	0.14
219	601699	潞安环能	817,300	11,671,044.00	0.14
220	600642	申能股份	1,336,000	11,663,280.00	0.14
221	000559	万向钱潮	902,004	11,662,911.72	0.14
222	300972	万辰集团	67,105	11,636,678.05	0.14
223	688568	中科星图	276,688	11,474,251.36	0.14
224	600637	东方明珠	1,377,408	11,446,260.48	0.14
225	002624	完美世界	917,209	11,391,735.78	0.14
226	000623	吉林敖东	640,337	11,353,175.01	0.14
227	001696	宗申动力	545,306	11,347,817.86	0.14
228	300699	光威复材	396,031	11,346,288.15	0.14

229	603345	安井食品	140,398	11,258,515.62	0.14
230	603225	新凤鸣	572,716	11,253,869.40	0.14
231	000983	山西焦煤	1,930,583	11,197,381.40	0.14
232	002085	万丰奥威	1,008,182	11,180,738.38	0.14
233	300558	贝达药业	171,511	11,160,220.77	0.14
234	000750	国海证券	3,031,693	11,156,630.24	0.14
235	002318	久立特材	464,351	11,097,988.90	0.14
236	002739	儒意电影	1,148,532	11,025,907.20	0.13
237	600100	同方股份	1,601,300	10,968,905.00	0.13
238	600369	西南证券	2,721,700	10,941,234.00	0.13
239	002065	东华软件	1,523,525	10,877,968.50	0.13
240	600499	科达制造	785,791	10,843,915.80	0.13
241	600595	中孚实业	1,915,000	10,762,300.00	0.13
242	600536	中国软件	382,625	10,759,415.00	0.13
243	002266	浙富控股	2,124,063	10,747,758.78	0.13
244	300627	华测导航	377,424	10,718,841.60	0.13
245	002044	美年健康	2,126,800	10,697,804.00	0.13
246	603596	伯特利	428,850	10,652,634.00	0.13
247	603699	纽威股份	211,700	10,648,510.00	0.13
248	688772	珠海冠宇	541,413	10,627,937.19	0.13
249	000629	钒钛股份	3,159,778	10,553,658.52	0.13
250	603444	吉比特	29,400	10,537,548.00	0.13
251	000155	川能动力	877,785	10,515,864.30	0.13
252	000400	许继电气	484,068	10,504,275.60	0.13
253	002223	鱼跃医疗	408,226	10,475,079.16	0.13
254	688617	惠泰医疗	57,690	10,474,196.40	0.13
255	300002	神州泰岳	1,338,554	10,454,106.74	0.13
256	601016	节能风电	2,680,685	10,401,057.80	0.13
257	300003	乐普医疗	877,309	10,396,111.65	0.13
258	600985	淮北矿业	734,900	10,325,345.00	0.13
259	002430	杭氧股份	332,784	10,302,992.64	0.13
260	600521	华海药业	715,110	10,297,584.00	0.13
261	600862	中航高科	570,800	10,291,524.00	0.13
262	000032	深桑达 A	412,146	10,283,042.70	0.13
263	601216	君正集团	2,304,000	10,275,840.00	0.13
264	601212	白银有色	2,022,300	10,273,284.00	0.13
265	000415	渤海租赁	2,518,302	10,249,489.14	0.13
266	601717	中创智领	736,371	10,242,920.61	0.13
267	601997	贵阳银行	1,996,160	10,240,300.80	0.13
268	300487	蓝晓科技	173,194	10,192,466.90	0.12
269	000683	博源化工	1,767,151	10,178,789.76	0.12
270	000039	中集集团	1,250,606	10,142,414.66	0.12
271	600863	华能蒙电	2,139,200	10,054,240.00	0.12

272	603766	隆鑫通用	841,100	10,034,323.00	0.12
273	600704	物产中大	2,117,900	9,996,488.00	0.12
274	601001	晋控煤业	571,500	9,938,385.00	0.12
275	601990	南京证券	1,501,545	9,865,150.65	0.12
276	600873	梅花生物	1,339,575	9,845,876.25	0.12
277	000050	深天马 A	993,370	9,844,296.70	0.12
278	600312	平高电气	556,100	9,820,726.00	0.12
279	688538	和辉光电	3,770,633	9,803,645.80	0.12
280	002841	视源股份	283,871	9,802,065.63	0.12
281	603077	和邦生物	4,219,948	9,790,279.36	0.12
282	603605	珀莱雅	162,406	9,731,367.52	0.12
283	000729	燕京啤酒	958,094	9,705,492.22	0.12
284	600332	白云山	479,600	9,611,184.00	0.12
285	688297	中无人机	231,284	9,609,850.20	0.12
286	000887	中鼎股份	535,995	9,588,950.55	0.12
287	600765	中航重机	742,150	9,588,578.00	0.12
288	000967	盈峰环境	910,267	9,585,111.51	0.12
289	600166	福田汽车	3,242,300	9,435,093.00	0.12
290	600348	华阳股份	1,231,400	9,420,210.00	0.12
291	600153	建发股份	1,187,900	9,420,047.00	0.12
292	688692	达梦数据	38,465	9,396,614.85	0.11
293	000830	鲁西化工	776,082	9,312,984.00	0.11
294	601611	中国核建	823,000	9,176,450.00	0.11
295	002410	广联达	1,121,980	9,155,356.80	0.11
296	002939	长城证券	1,095,700	9,138,138.00	0.11
297	600901	江苏金租	1,582,100	9,097,075.00	0.11
298	002683	广东宏大	309,818	9,074,569.22	0.11
299	000062	深圳华强	284,543	9,054,158.26	0.11
300	688615	合合信息	79,893	9,035,898.30	0.11
301	002007	华兰生物	740,137	9,022,270.03	0.11
302	688582	芯动联科	138,463	9,000,095.00	0.11
303	600737	中粮糖业	721,486	8,895,922.38	0.11
304	600578	京能电力	1,371,600	8,846,820.00	0.11
305	601799	星宇股份	97,100	8,799,202.00	0.11
306	688114	华大智造	171,779	8,774,471.32	0.11
307	002926	华西证券	1,069,715	8,739,571.55	0.11
308	600363	联创光电	243,600	8,716,008.00	0.11
309	603568	伟明环保	560,700	8,623,566.00	0.11
310	000921	海信家电	315,467	8,618,558.44	0.11
311	600398	海澜之家	1,639,500	8,574,585.00	0.10
312	603728	鸣志电器	140,700	8,571,444.00	0.10
313	000737	北方铜业	646,700	8,549,374.00	0.10
314	603298	杭叉集团	357,880	8,539,016.80	0.10

315	000591	太阳能	1,854,607	8,531,192.20	0.10
316	002603	以岭药业	568,265	8,523,975.00	0.10
317	600486	扬农化工	165,718	8,401,902.60	0.10
318	601000	唐山港	2,022,966	8,395,308.90	0.10
319	000528	柳 工	1,108,155	8,366,570.25	0.10
320	600208	衢州发展	2,904,400	8,219,452.00	0.10
321	600316	洪都航空	293,372	8,196,813.68	0.10
322	603341	龙旗科技	192,800	8,192,072.00	0.10
323	600008	首创环保	3,006,230	8,176,945.60	0.10
324	000738	航发控制	446,800	8,171,972.00	0.10
325	688248	南网科技	117,090	8,100,286.20	0.10
326	600435	北方导航	722,210	8,088,752.00	0.10
327	600998	九州通	1,720,854	8,070,805.26	0.10
328	000932	华菱钢铁	2,322,834	8,060,233.98	0.10
329	600995	南网储能	654,400	8,049,120.00	0.10
330	600170	上海建工	3,620,370	8,037,221.40	0.10
331	603486	科沃斯	158,300	8,033,725.00	0.10
332	000987	越秀资本	1,017,027	7,953,151.14	0.10
333	002152	广电运通	842,485	7,902,509.30	0.10
334	000997	新 大 陆	482,376	7,862,728.80	0.10
335	600820	隧道股份	1,502,220	7,826,566.20	0.10
336	600161	天坛生物	674,700	7,813,026.00	0.10
337	002262	恩华药业	414,130	7,764,937.50	0.09
338	000951	中国重汽	397,282	7,750,971.82	0.09
339	600483	福能股份	759,450	7,738,795.50	0.09
340	600282	南钢股份	1,683,400	7,726,806.00	0.09
341	601106	中国一重	2,340,500	7,723,650.00	0.09
342	603885	吉祥航空	745,800	7,674,282.00	0.09
343	000009	中国宝安	1,226,246	7,639,512.58	0.09
344	600583	海油工程	1,508,876	7,589,646.28	0.09
345	688778	厦钨新能	139,147	7,569,596.80	0.09
346	002500	山西证券	1,463,278	7,550,514.48	0.09
347	603816	顾家家居	336,760	7,529,953.60	0.09
348	688295	中复神鹰	124,285	7,524,213.90	0.09
349	603939	益丰药房	413,875	7,441,472.50	0.09
350	600546	山煤国际	676,500	7,394,145.00	0.09
351	603338	浙江鼎力	172,900	7,348,250.00	0.09
352	000582	北部湾港	683,321	7,332,034.33	0.09
353	688166	博瑞医药	209,243	7,325,597.43	0.09
354	600329	达仁堂	194,749	7,248,557.78	0.09
355	600763	通策医疗	213,801	7,243,577.88	0.09
356	601666	平煤股份	1,012,100	7,236,515.00	0.09
357	600562	国睿科技	339,400	7,202,068.00	0.09

358	601567	三星电气	479,400	7,162,236.00	0.09
359	600685	中船防务	280,100	7,125,744.00	0.09
360	600602	云赛智联	439,912	7,073,784.96	0.09
361	600038	中直股份	279,527	7,069,237.83	0.09
362	600380	健康元	749,723	7,062,390.66	0.09
363	003022	联泓新科	272,580	7,059,822.00	0.09
364	603565	中谷物流	716,400	7,027,884.00	0.09
365	002312	川发龙蟒	766,007	7,024,284.19	0.09
366	000723	美锦能源	2,089,563	7,000,036.05	0.09
367	600390	五矿资本	1,535,000	6,999,600.00	0.09
368	601156	东航物流	433,463	6,987,423.56	0.09
369	300676	华大基因	199,000	6,976,940.00	0.09
370	688318	财富趋势	97,439	6,948,375.09	0.08
371	601880	辽港股份	5,027,649	6,938,155.62	0.08
372	000513	丽珠集团	239,892	6,930,479.88	0.08
373	601399	国机重装	1,969,300	6,892,550.00	0.08
374	600132	重庆啤酒	165,300	6,826,890.00	0.08
375	601865	福莱特	648,800	6,818,888.00	0.08
376	600535	天士力	509,500	6,740,685.00	0.08
377	600511	国药股份	257,309	6,700,326.36	0.08
378	688281	华秦科技	131,622	6,611,373.06	0.08
379	600906	财达证券	885,891	6,608,746.86	0.08
380	601236	红塔证券	966,400	6,590,848.00	0.08
381	600977	中国电影	509,400	6,581,448.00	0.08
382	000739	普洛药业	393,925	6,562,790.50	0.08
383	600816	建元信托	2,688,200	6,559,208.00	0.08
384	000598	兴蓉环境	1,013,306	6,505,424.52	0.08
385	300100	双林股份	233,392	6,483,629.76	0.08
386	688336	三生国健	121,772	6,466,093.20	0.08
387	002244	滨江集团	844,392	6,417,379.20	0.08
388	002299	圣农发展	422,411	6,403,750.76	0.08
389	600970	中材国际	894,677	6,379,047.01	0.08
390	601155	新城控股	617,300	6,333,498.00	0.08
391	600967	内蒙一机	581,100	6,304,935.00	0.08
392	002120	韵达股份	984,530	6,261,610.80	0.08
393	300735	光弘科技	275,067	6,255,023.58	0.08
394	300146	汤臣倍健	688,757	6,226,363.28	0.08
395	000883	湖北能源	1,439,640	6,219,244.80	0.08
396	300144	宋城演艺	1,069,589	6,214,312.09	0.08
397	300718	长盛轴承	101,303	6,176,443.91	0.08
398	688278	特宝生物	112,923	6,143,011.20	0.08
399	000027	深圳能源	970,854	6,019,294.80	0.07
400	600131	国网信通	409,100	5,972,860.00	0.07

401	601608	中信重工	1,250,543	5,965,090.11	0.07
402	000800	一汽解放	999,700	5,948,215.00	0.07
403	601866	中远海发	2,663,116	5,885,486.36	0.07
404	600095	湘财股份	781,000	5,880,930.00	0.07
405	688363	华熙生物	163,617	5,852,580.09	0.07
406	002568	百润股份	344,226	5,824,303.92	0.07
407	603737	三棵树	241,616	5,822,945.60	0.07
408	000088	盐田港	1,412,389	5,776,671.01	0.07
409	601118	海南橡胶	1,169,000	5,751,480.00	0.07
410	600801	华新建材	367,213	5,728,522.80	0.07
411	003021	兆威机电	65,440	5,716,184.00	0.07
412	002583	海能达	739,849	5,689,438.81	0.07
413	600126	杭钢股份	921,740	5,650,266.20	0.07
414	600871	石化油服	2,774,000	5,631,220.00	0.07
415	603000	人民网	377,539	5,583,801.81	0.07
416	600566	济川药业	251,600	5,583,004.00	0.07
417	600754	锦江酒店	310,282	5,581,973.18	0.07
418	002984	森麒麟	422,440	5,521,290.80	0.07
419	600517	国网英大	1,171,500	5,482,620.00	0.07
420	600655	豫园股份	1,327,800	5,457,258.00	0.07
421	000709	河钢股份	2,796,643	5,425,487.42	0.07
422	603589	口子窖	285,474	5,332,654.32	0.07
423	000825	太钢不锈	1,546,232	5,272,651.12	0.06
424	600598	北大荒	485,100	5,258,484.00	0.06
425	603858	步长制药	360,161	5,258,350.60	0.06
426	601598	中国外运	1,056,200	5,238,752.00	0.06
427	001286	陕西能源	509,900	5,170,386.00	0.06
428	301606	绿联科技	84,600	5,162,292.00	0.06
429	002423	中粮资本	626,840	5,158,893.20	0.06
430	603899	晨光股份	249,880	5,155,024.40	0.06
431	600350	山东高速	461,900	5,140,947.00	0.06
432	002773	康弘药业	250,628	5,125,342.60	0.06
433	600004	白云机场	703,400	5,106,684.00	0.06
434	601966	玲珑轮胎	499,150	5,086,338.50	0.06
435	600663	陆家嘴	805,893	5,061,008.04	0.06
436	688192	迪哲医药	126,406	5,047,391.58	0.06
437	600582	天地科技	1,129,700	5,027,165.00	0.06
438	688349	三一重能	326,735	4,959,837.30	0.06
439	688709	成都华微	129,795	4,943,891.55	0.06
440	600848	上海临港	653,552	4,895,104.48	0.06
441	000429	粤高速 A	355,527	4,852,943.55	0.06
442	601098	中南传媒	490,100	4,822,584.00	0.06
443	002508	老板电器	321,457	4,699,701.34	0.06

444	688563	航材股份	91,714	4,698,508.22	0.06
445	603233	大参林	310,566	4,667,806.98	0.06
446	600968	海油发展	1,388,200	4,622,706.00	0.06
447	601928	凤凰传媒	520,700	4,576,953.00	0.06
448	600062	华润双鹤	283,246	4,543,265.84	0.06
449	300957	贝泰妮	143,784	4,530,633.84	0.06
450	688561	奇安信	187,398	4,493,804.04	0.05
451	003035	南网能源	771,732	4,491,480.24	0.05
452	300888	稳健医疗	158,053	4,423,903.47	0.05
453	600688	上海石化	1,500,700	4,397,051.00	0.05
454	688425	铁建重工	1,092,010	4,389,880.20	0.05
455	601808	中海油服	404,257	4,370,018.17	0.05
456	600295	鄂尔多斯	404,676	4,338,126.72	0.05
457	002670	国盛证券	393,803	4,331,833.00	0.05
458	002032	苏泊尔	108,642	4,302,223.20	0.05
459	600098	广州发展	717,600	4,241,016.00	0.05
460	688708	佳驰科技	81,525	4,141,470.00	0.05
461	000539	粤电力 A	605,238	4,121,670.78	0.05
462	000537	绿发电力	559,414	4,089,316.34	0.05
463	600808	马钢股份	1,629,800	4,074,500.00	0.05
464	002153	石基信息	554,180	4,006,721.40	0.05
465	600292	电投水电	329,300	3,964,772.00	0.05
466	600377	宁沪高速	338,900	3,921,073.00	0.05
467	601298	青岛港	478,300	3,850,315.00	0.05
468	603833	欧派家居	125,129	3,767,634.19	0.05
469	000959	首钢股份	1,051,268	3,689,950.68	0.05
470	002265	建设工业	210,512	3,662,908.80	0.04
471	301301	川宁生物	453,465	3,600,512.10	0.04
472	002608	江苏国信	513,648	3,544,171.20	0.04
473	600339	中油工程	1,142,900	3,508,703.00	0.04
474	600606	绿地控股	2,878,400	3,482,864.00	0.04
475	600032	浙江新能	492,100	3,469,305.00	0.04
476	603529	爱玛科技	177,800	3,468,878.00	0.04
477	600764	中国海防	194,201	3,384,923.43	0.04
478	603658	安图生物	116,300	3,375,026.00	0.04
479	000785	居然智家	1,686,088	3,372,176.00	0.04
480	603786	科博达	82,400	3,370,984.00	0.04
481	601139	深圳燃气	589,400	3,336,004.00	0.04
482	301498	乖宝宠物	81,700	3,316,203.00	0.04
483	688520	神州细胞	95,858	3,279,302.18	0.04
484	000937	冀中能源	790,593	3,146,560.14	0.04
485	300140	节能环保	630,504	3,133,604.88	0.04
486	000898	鞍钢股份	1,616,575	3,022,995.25	0.04

487	603049	中策橡胶	65,420	2,931,470.20	0.04
488	688475	萤石网络	106,999	2,926,422.65	0.04
489	603175	超颖电子	32,700	2,913,243.00	0.04
490	601228	广州港	1,030,100	2,904,882.00	0.04
491	601019	山东出版	427,375	2,735,200.00	0.03
492	600927	永安期货	198,800	2,475,060.00	0.03
493	002945	华林证券	182,969	2,457,273.67	0.03
494	601112	振石股份	130,975	2,387,178.25	0.03
495	002461	珠江啤酒	300,681	2,276,155.17	0.03
496	600299	安迪苏	280,100	2,198,785.00	0.03
497	688819	天能股份	92,457	2,052,545.40	0.03
498	603092	德力佳	24,500	1,322,265.00	0.02
499	001221	悍高集团	27,200	1,093,984.00	0.01
500	001386	马可波罗	73,100	1,035,096.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天3	3,046,725	1,218,690.00	0.01
2	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
7	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
8	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
9	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
10	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
11	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
12	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
13	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
14	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
15	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
16	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
17	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
18	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
19	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
20	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
21	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
22	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
23	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
24	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
25	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
26	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

27	001220	世盟股份	57	1, 583. 46	0. 00
----	--------	------	----	------------	-------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688525	佰维存储	443, 565, 776. 19	2. 84
2	688347	华虹宏力	301, 118, 670. 63	1. 93
3	688002	睿创微纳	241, 776, 361. 59	1. 55
4	600487	亨通光电	223, 604, 917. 60	1. 43
5	688266	泽璟制药	208, 566, 470. 18	1. 34
6	688099	晶晨股份	190, 458, 439. 67	1. 22
7	688322	奥比中光	179, 222, 856. 86	1. 15
8	600549	厦门钨业	170, 347, 961. 26	1. 09
9	688375	国博电子	163, 897, 927. 42	1. 05
10	600879	航天电子	145, 598, 567. 66	0. 93
11	600988	赤峰黄金	145, 056, 193. 71	0. 93
12	688778	厦钨新能	142, 973, 851. 57	0. 92
13	688385	复旦微电	142, 092, 925. 98	0. 91
14	688234	天岳先进	136, 765, 763. 86	0. 88
15	605358	立昂微	134, 923, 494. 71	0. 86
16	688122	西部超导	134, 175, 715. 05	0. 86
17	688220	翱捷科技	134, 085, 660. 99	0. 86
18	600498	烽火通信	130, 226, 899. 27	0. 83
19	600118	中国卫星	126, 671, 796. 47	0. 81
20	688777	中控技术	123, 750, 177. 19	0. 79

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688525	佰维存储	600, 867, 593. 66	3. 85
2	600487	亨通光电	472, 866, 724. 88	3. 03
3	688347	华虹宏力	360, 822, 139. 00	2. 31
4	600549	厦门钨业	291, 750, 549. 08	1. 87
5	688002	睿创微纳	289, 633, 063. 40	1. 85
6	688266	泽璟制药	226, 003, 052. 29	1. 45
7	688099	晶晨股份	218, 030, 805. 38	1. 40
8	600118	中国卫星	215, 811, 222. 66	1. 38
9	600988	赤峰黄金	214, 914, 502. 09	1. 38
10	600879	航天电子	212, 258, 167. 83	1. 36
11	600673	东阳光	199, 553, 899. 82	1. 28
12	688322	奥比中光	197, 947, 390. 58	1. 27
13	601168	西部矿业	193, 085, 012. 33	1. 24
14	688375	国博电子	187, 530, 057. 46	1. 20

15	688777	中控技术	173,237,082.09	1.11
16	600498	烽火通信	171,490,711.31	1.10
17	688385	复旦微电	171,062,378.11	1.10
18	688122	西部超导	168,841,609.47	1.08
19	600096	云天化	167,402,441.19	1.07
20	603228	景旺电子	161,541,274.12	1.03

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,486,719,126.45
卖出股票收入（成交）总额	22,100,594,852.20

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,687,069.70	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,687,069.70	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	13,420	1,342,017.65	0.02
2	113704	春风转债	9,990	999,045.98	0.01
3	118071	华峰转债	3,460	346,006.07	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	58,950,790.94
2	应收清算款	19,221,930.86
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	78,172,721.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	400174	中天 3	1,218,690.00	0.01	重大事项停牌
2	001248	华润新能源	595,206.03	0.01	新股锁定
2	001248	华润新能源	255,085.41	0.00	新发未上市
3	301666	大普微	565,262.60	0.01	新股锁定
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股锁定
5	688781	视涯科技	267,083.60	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
19,384	115,645.73	1,958,891,098.00	87.39	282,785,667.00	12.61

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	541,666,601.00	24.16

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,500.00	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 2 月 6 日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	5,213,676,765.00
本报告期基金总申购份额	7,708,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,680,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,241,676,765.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况
2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。

(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无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局

受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
光大证券股份有限公司	2	11,378,443,509.16	28.83	408,961.34	25.68	-
广发证券股份有限公司	5	9,863,176,559.10	24.99	354,579.75	22.26	-

公司						
中国银河证券股份有限公司	2	8,734,304,020.70	22.13	314,011.41	19.72	-
中信建投证券股份有限公司	6	6,193,246,430.92	15.69	222,788.11	13.99	-
招商证券股份有限公司	1	2,137,763,140.74	5.42	76,755.77	4.82	-
国泰海通证券股份有限公司	2	1,159,096,498.28	2.94	215,589.15	13.54	-
长江证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

银泰证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 合规风控能力较强；
- (4) 交易等服务能力较强。

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

3. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国泰海通证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
光大证券股份有限公司	17,871,223.11	14.57	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	73,400,619.47	59.84	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

限公司						
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	31,380,527.29	25.58	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公	-	-	-	-	-	-

司						
西部证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 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	-	-	-	-	-	-
中航证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实中证 500ETF 基金经理变更的公告	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	2026 年 1 月 14 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	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	2026 年 1 月 23 日
3	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 26 日
4	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 25 日
5	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 29 日
6	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 24 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	2026 年 6 月 26 日
---	----------------------	-----------------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	2026-05-11 至 2026-06-30	572,836,551.00	79,000,000.00	110,169,950.00	541,666,601.00	24.16
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日