

嘉实中证 A500 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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	56
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	56
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	56
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	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 嘉实
基金主代码	159351
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 20 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,924,123,357.00 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	2024 年 10 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，力争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%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，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。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	冯萌
	联系电话	(010) 65215588	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95561
传真		(010) 65215588	021-62159217

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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100020	200120
法定代表人	经雷	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告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	1, 169, 384, 217. 81
本期利润	1, 099, 649, 286. 84
加权平均基金份额本期利润	0. 1511
本期加权平均净值利润率	12. 03%
本期基金份额净值增长率	12. 66%
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	1, 668, 638, 913. 09
期末可供分配基金份额利润	0. 2817
期末基金资产净值	7, 980, 324, 383. 80
期末基金份额净值	1. 3471
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	37. 63%

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	14.96%	1.40%	14.26%	1.41%	0.70%	-0.01%
过去六个月	12.66%	1.28%	11.91%	1.29%	0.75%	-0.01%
过去一年	38.64%	1.14%	36.38%	1.14%	2.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	37.63%	1.20%	69.92%	1.36%	-32.29%	-0.16%

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A500ETF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
(2024年09月20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 6 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		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深300ETF 联接(LOF)、嘉实沪深300ETF 、嘉实中证主要消费ETF、嘉实富时中国A50ETF 联接、嘉实富时中国A50ETF 、嘉实央企创新驱动ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费ETF 发起联接、嘉实中证国新央企现代能源ETF、嘉实中证国新央企现代能源 ETF 联接、嘉实中证	2024 年 9 月 20 日	-	17 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	A500ETF 联接基金 经理				
张超 梁	本基金、 嘉实中创 400ETF、 嘉实中创 400ETF 联 接、嘉实 中证信息 安全主题 ETF、嘉实 中证高端 装备细分 50ETF、嘉 实中证细 分化工产 业主题 ETF 发起 联接、嘉 实中证高 端装备细 分 50ETF 发起联接、嘉实 中证 A500ETF 联接、嘉 实创业板 50ETF、嘉 实创业板 50ETF 联 接、嘉实 中证港股 通创新药 ETF、嘉实 恒生港股 通科技主 题 ETF、嘉 实中证港 股通创新 药 ETF 发 起联接、 嘉实恒指 港 股 通	2024 年 9 月 20 日	-	12 年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任 SmartBeta 和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	ETF、嘉实恒生港股通科技主题 ETF 联接、嘉实中证细分化工产业主题 ETF 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 A500 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 A500 指数，中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证

券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。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。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.31%，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 1.3471 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.66%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

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 A500 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 A500 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，本基金实施了利润分配，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 A500 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	30,634,900.03	47,746,981.20
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	7,972,977,153.45	10,577,461,364.94
其中：股票投资		7,972,132,130.24	10,577,461,364.94
基金投资		-	-
债券投资		845,023.21	-
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		-	-
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		8,003,612,053.48	10,625,208,346.14
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 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		21,695,617.32	34,169,960.86
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		940,276.11	1,301,825.28
应付托管费		313,425.35	433,941.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.68	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	338,350.22	237,692.00
负债合计		23,287,669.68	36,143,419.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	5,924,123,357.00	8,798,123,357.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,056,201,026.80	1,790,941,569.25
净资产合计		7,980,324,383.80	10,589,064,926.25

负债和净资产总计		8,003,612,053.48	10,625,208,346.14
----------	--	------------------	-------------------

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3471 元，基金份额总额 5,924,123,357.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 A500 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		1,108,825,635.01	177,703,745.85
1. 利息收入		25,614.74	51,325.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,614.74	51,325.68
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		1,173,517,677.96	-146,274,117.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,107,946,864.88	-326,677,770.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,259.79	446,832.45
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	65,565,553.29	179,956,820.51
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	-69,734,930.97	308,204,045.21
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	5,017,273.28	15,722,492.83
减：二、营业总支出		9,176,348.17	14,216,199.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,811,848.49	10,599,153.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,270,616.10	3,533,051.26
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		0. 07	0. 82
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	93, 883. 51	83, 994. 03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 099, 649, 286. 84	163, 487, 546. 01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 099, 649, 286. 84	163, 487, 546. 01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 099, 649, 286. 84	163, 487, 546. 01

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 A500 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	8, 798, 123, 357. 00	-	1, 790, 941, 569. 25	10, 589, 064, 926. 25
二、本期期初净资产	8, 798, 123, 357. 00	-	1, 790, 941, 569. 25	10, 589, 064, 926. 25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2, 874, 000, 000. 00	-	265, 259, 457. 55	-2, 608, 740, 542. 45
（一）、综合收益总额	-	-	1, 099, 649, 286. 84	1, 099, 649, 286. 84
（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, 874, 000, 000. 00	-	-768, 712, 020. 40	-3, 642, 712, 020. 40
其中：1. 基金申购款	4, 320, 000, 000. 00	-	1, 055, 110, 678. 75	5, 375, 110, 678. 75
2. 基金赎回款	-7, 194, 000, 000. 00	-	-1, 823, 822, 699. 00	-9, 017, 822, 699. 00

	. 00		. 15	15
（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）	-	-	-65,677,808.89	-65,677,808.89
四、本期期末净资产	5,924,123,357.00	-	2,056,201,026.80	7,980,324,383.80
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	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09
二、本期期初净资产	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,812,000,000.00	-	135,841,143.54	4,947,841,143.54
（一）、综合收益总额	-	-	163,487,546.01	163,487,546.01
（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）	4,812,000,000.00	-	2,066,834.56	4,814,066,834.56
其中：1. 基金申购款	14,031,000,000.00	-	-411,221,892.97	13,619,778,107.03
2. 基金赎回款	-9,219,000,000.00	-	413,288,727.53	-8,805,711,272.47
（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）	-	-	-29,713,237.03	-29,713,237.03
四、本期期末净资产	17,951,123,357.00	-	-168,345,102.37	17,782,778,254.63

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	梁凯	李袁
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中证 A500 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[2024]1263 号《关于准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,123,357.00 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第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》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局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。2027年12月31日前，资管产品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，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。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(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。对在该日期之前已发行的国债、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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	416,743.62
等于：本金	416,610.26
加：应计利息	133.36
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	30,218,156.41
等于：本金	30,216,844.05
加：应计利息	1,312.36
减：坏账准备	-
合计	30,634,900.03

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		6,872,347,765.28	-	7,972,132,130.24	1,099,784,364.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	845,000.00	23.21	845,023.21	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	845,000.00	23.21	845,023.21	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,873,192,765.28	23.21	7,972,977,153.45	1,099,784,364.96

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,227.67
其他	245,122.55
合计	338,350.22

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	8,798,123,357.00	8,798,123,357.00
本期申购	4,320,000,000.00	4,320,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,194,000,000.00	-7,194,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,924,123,357.00	5,924,123,357.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 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	1,116,988,220.21	673,953,349.04	1,790,941,569.25
本期期初	1,116,988,220.21	673,953,349.04	1,790,941,569.25
本期利润	1,169,384,217.81	-69,734,930.97	1,099,649,286.84
本期基金份额交易产生的变动数	-552,055,716.04	-216,656,304.36	-768,712,020.40
其中：基金申购款	828,787,904.09	226,322,774.66	1,055,110,678.75
基金赎回款	-1,380,843,620.13	-442,979,079.02	-1,823,822,699.15
本期已分配利润	-65,677,808.89	-	-65,677,808.89
本期末	1,668,638,913.09	387,562,113.71	2,056,201,026.80

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	2,349.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	23,265.05
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	25,614.74

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	457,459,432.23
股票投资收益——赎回差价收入	650,487,432.65
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,107,946,864.88

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	5,839,555,645.40
减：卖出股票成本总额	5,376,710,081.26
减：交易费用	5,386,131.91
买卖股票差价收入	457,459,432.23

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	9,017,822,699.15
减：现金支付赎回款总额	4,696,737,228.15
减：赎回股票成本总额	3,670,598,038.35
减：交易费用	—
赎回差价收入	650,487,432.65

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	22.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,237.01
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	5,259.79

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	2,530,816.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,516,245.84
减：应计利息总额	9,207.41
减：交易费用	126.26
买卖债券差价收入	5,237.01

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

无。

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	65,565,553.29
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	65,565,553.29

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	-69,734,930.97
股票投资	-69,734,930.97
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	—
权证投资	—
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	-69,734,930.97

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	5,017,273.28
合计	5,017,273.28

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	33,720.30
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	655.84
合计	93,883.51

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

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 14 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0620 元。

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 A500ETF 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 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管理费	6,811,848.49	10,599,153.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	418,874.27	1,037,105.02
应支付基金管理人的净管理费	6,392,974.22	9,562,048.71

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	2,270,616.10	3,533,051.26

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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	200,013,611.00	200,013,611.00
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	200,013,611.00	200,013,611.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.38%	1.11%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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 A500ETF联接	1,194,557,200.00	20.16	1,519,080,000.00	17.27
中诚信托	82,698,374.00	1.40	165,177,374.00	1.88

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
兴业银行股份有限公司 _活期	416,743.62	2,349.69	1,965,575.10	2,749.83

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

报告期末(2026年06月30日)，本基金持有4,067,300股兴业银行的A股普通股，估值总额为人民币67,354,488.00元，占基金资产净值的比例为0.84%（2025年12月31日：6,240,800股，估值总额为人民币131,431,248.00元，占基金资产净值的比例为1.24%）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发 放 总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 01 月 16 日	-	2026 年 1 月 19 日	0.0550	46,442,677.17	-	46,442,677.17	-
2	2026 年 04 月 14 日	-	2026 年 4 月 15 日	0.0270	19,235,131.72	-	19,235,131.72	-
合计	-	-	-	0.0820	65,677,808.89	-	65,677,808.89	-

注：根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 14 日登记在册的全
体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0620 元。

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	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股 锁定	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新	2026 年 6 月 24	1 个月 内(含)	新发未	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-

	能 源	日		上 市						
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 能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
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	2026 年 4	6 个月	新 股	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	克	月 9 日		锁定						
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	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688797	臻宝	2026 年 6 月	6 个月	新股	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	科技	月 16 日		锁定						
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	有研新材	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	4,770	477,000.00	477,006.27	-
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	3,680	368,000.00	368,016.94	-

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大 事项 停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	47,451	14,125,317.93	39,479,232.00	-
--------	------	-----------------	----------------	--------	-----------------	--------	--------	---------------	---------------	---

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	845,023.21	-
未评级	-	-
合计	845,023.21	-

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。

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2026 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	30,634,900.03	-	-	-	30,634,900.03
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	845,023.21	7,972,132,130.24	7,972,977,153.45
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	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,634,900.03	-	845,023.21	7,972,132,130.24	8,003,612,053.48
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	-	-	-	21,695,617.32	21,695,617.32
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	940,276.11	940,276.11
应付托管费	-	-	-	313,425.35	313,425.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.68	0.68
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	338,350.22	338,350.22
负债总计	-	-	-	23,287,669.68	23,287,669.68
利率敏感度缺口	30,634,900.03	-	845,023.21	7,948,844,460.56	7,980,324,383.80
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	47,746,981.20	-	-	-	47,746,981.20
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	10,577,461,364.94	10,577,461,364.94
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	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	47,746,981.20	-	-	10,577,461,364.94	10,625,208,346.14
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	-	-	-	34,169,960.86	34,169,960.86
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,301,825.28	1,301,825.28
应付托管费	-	-	-	433,941.75	433,941.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	237,692.00	237,692.00
负债总计	-	-	-	36,143,419.89	36,143,419.89
利率敏感度缺口	47,746,981.20	-	-	10,541,317,945.05	10,589,064,926.25

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	12,339.79	-
	市场利率上升 25 个基点	-12,131.72	-

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	7,972,132,130.24	99.90	10,577,461,364.94	99.89
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	7,972,132,130.24	99.90	10,577,461,364.94	99.89

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%	397,582,496.73	528,849,062.34
	业绩比较基准下降5%	-397,582,496.73	-528,849,062.34

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	7,921,965,390.06	10,510,154,156.12
第二层次	41,174,546.65	62,058,890.56
第三层次	9,837,216.74	5,248,318.26
合计	7,972,977,153.45	10,577,461,364.94

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,972,132,130.24	99.61
	其中：股票	7,972,132,130.24	99.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	845,023.21	0.01
	其中：债券	845,023.21	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	30,634,900.03	0.38
8	其他各项资产	-	-
9	合计	8,003,612,053.48	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	25,088,425.69	0.31
B	采矿业	327,662,534.95	4.11
C	制造业	5,629,035,202.70	70.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	173,518,246.60	2.17
E	建筑业	97,010,940.08	1.22
F	批发和零售业	61,396,736.03	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	177,348,975.94	2.22
H	住宿和餐饮业	3,723,335.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	445,192,009.93	5.58
J	金融业	771,778,470.79	9.67
K	房地产业	44,514,021.04	0.56
L	租赁和商务服务业	57,560,822.24	0.72
M	科学研究和技术服务业	95,176,392.67	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	13,667,911.58	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	2,666,880.00	0.03
Q	卫生和社会工作	15,578,525.20	0.20
R	文化、体育和娱乐业	6,100,505.62	0.08
S	综合	14,394,516.00	0.18
	合计	7,961,414,452.06	99.76

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	9,799,483.46	0.12
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	-	-
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	10,687,508.18	0.13

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	300308	中际旭创	267,929	340,269,830.00	4.26
2	300750	宁德时代	635,463	249,743,313.63	3.13
3	300502	新易盛	334,884	203,274,588.00	2.55
4	600519	贵州茅台	150,186	178,044,001.14	2.23
5	603986	兆易创新	160,400	130,726,000.00	1.64
6	601318	中国平安	2,560,900	122,257,366.00	1.53
7	688256	寒武纪	75,430	120,352,336.50	1.51
8	600036	招商银行	2,973,500	105,559,250.00	1.32
9	601899	紫金矿业	3,959,480	99,541,327.20	1.25
10	002371	北方华创	103,975	91,972,126.00	1.15
11	000333	美的集团	1,168,112	88,227,499.36	1.11
12	002475	立讯精密	1,225,141	86,249,926.40	1.08
13	688008	澜起科技	275,469	85,367,843.10	1.07
14	688012	中微公司	179,982	84,321,567.00	1.06
15	688041	海光信息	223,439	82,739,461.70	1.04
16	002384	东山精密	308,000	80,803,800.00	1.01
17	600900	长江电力	2,939,100	77,797,977.00	0.97

18	688981	中芯国际	489,401	77,726,666.82	0.97
19	000725	京东方 A	8,731,247	75,787,223.96	0.95
20	603259	药明康德	594,200	73,983,842.00	0.93
21	600030	中信证券	2,344,809	67,366,362.57	0.84
22	601166	兴业银行	4,067,300	67,354,488.00	0.84
23	300059	东方财富	3,040,759	61,970,668.42	0.78
24	600183	生益科技	350,100	60,707,340.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	1,072,744	55,825,597.76	0.70
26	300274	阳光电源	348,640	55,440,732.80	0.69
27	601398	工商银行	7,772,400	54,950,868.00	0.69
28	300408	三环集团	322,100	53,758,490.00	0.67
29	002594	比亚迪	652,577	52,010,386.90	0.65
30	600487	亨通光电	474,020	51,829,346.80	0.65
31	300476	胜宏科技	146,755	50,840,334.65	0.64
32	002463	沪电股份	323,598	49,445,774.40	0.62
33	601211	国泰海通	2,714,396	49,402,007.20	0.62
34	300394	天孚通信	157,183	47,576,150.44	0.60
35	688498	源杰科技	23,883	45,043,338.00	0.56
36	688525	佰维存储	90,583	44,814,127.59	0.56
37	000988	华工科技	241,099	44,509,286.39	0.56
38	301308	江波龙	61,000	42,931,800.00	0.54
39	600176	中国巨石	577,093	42,058,537.84	0.53
40	601288	农业银行	6,902,400	41,897,568.00	0.53
41	601328	交通银行	6,408,565	41,207,072.95	0.52
42	000651	格力电器	1,076,478	40,367,925.00	0.51
43	600522	中天科技	655,900	39,800,012.00	0.50
44	688072	拓荆科技	47,451	39,479,232.00	0.49
45	603019	中科曙光	351,200	37,659,176.00	0.47
46	688521	芯原股份	101,022	37,493,305.08	0.47
47	603993	洛阳钼业	2,097,400	36,809,370.00	0.46
48	600150	中国船舶	1,084,786	36,654,918.94	0.46
49	600887	伊利股份	1,519,580	36,409,136.80	0.46
50	300604	长川科技	106,496	36,359,864.32	0.46
51	600584	长电科技	343,900	35,610,845.00	0.45
52	000338	潍柴动力	1,291,350	35,189,287.50	0.44
53	000858	五粮液	466,275	34,504,350.00	0.43
54	688347	华虹宏力	97,905	32,925,451.50	0.41
55	601816	京沪高铁	7,052,200	31,946,466.00	0.40
56	600309	万华化学	451,200	30,866,592.00	0.39
57	688120	华海清科	94,905	30,576,492.90	0.38
58	300124	汇川技术	455,350	30,203,365.50	0.38
59	002415	海康威视	880,689	30,119,563.80	0.38
60	002916	深南电路	65,448	29,968,639.20	0.38

61	002281	光迅科技	116,297	29,881,351.18	0.37
62	002008	大族激光	197,800	29,691,758.00	0.37
63	600111	北方稀土	608,000	29,214,400.00	0.37
64	000100	TCL 科技	4,981,375	28,991,602.50	0.36
65	000063	中兴通讯	774,100	28,014,679.00	0.35
66	300857	协创数据	82,300	27,973,770.00	0.35
67	300136	信维通信	232,400	27,713,700.00	0.35
68	600000	浦发银行	3,200,525	27,556,520.25	0.35
69	600089	特变电工	1,213,830	27,311,175.00	0.34
70	601857	中国石油	3,112,000	27,012,160.00	0.34
71	002028	思源电气	149,600	25,880,800.00	0.32
72	601088	中国神华	659,901	25,762,535.04	0.32
73	300433	蓝思科技	478,300	25,665,578.00	0.32
74	600031	三一重工	1,425,100	24,625,728.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	365,419	23,763,197.57	0.30
76	300475	香农芯创	79,000	23,700,000.00	0.30
77	002050	三花智控	537,870	23,574,842.10	0.30
78	601601	中国太保	822,200	23,449,144.00	0.29
79	000001	平安银行	2,328,500	23,401,425.00	0.29
80	300223	北京君正	92,910	23,125,299.00	0.29
81	000792	盐湖股份	762,650	23,024,403.50	0.29
82	002714	牧原股份	656,207	22,960,682.93	0.29
83	600549	厦门钨业	267,000	22,748,400.00	0.29
84	002353	杰瑞股份	147,600	22,509,000.00	0.28
85	002156	通富微电	291,700	22,131,279.00	0.28
86	600406	国电南瑞	964,808	22,045,862.80	0.28
87	601668	中国建筑	4,963,320	21,540,808.80	0.27
88	000657	中钨高新	219,000	20,962,680.00	0.26
89	002436	兴森科技	408,300	20,802,885.00	0.26
90	601919	中远海控	1,508,200	19,998,732.00	0.25
91	002602	世纪华通	1,416,500	19,972,650.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	145,631	19,781,058.73	0.25
93	601988	中国银行	3,439,000	19,671,080.00	0.25
94	600660	福耀玻璃	385,000	19,419,400.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	183,100	19,403,107.00	0.24
96	601728	中国电信	3,729,900	19,358,181.00	0.24
97	603501	豪威集团	203,575	19,309,088.75	0.24
98	601012	隆基绿能	1,456,400	19,107,968.00	0.24
99	601225	陕西煤业	931,600	18,958,060.00	0.24
100	002230	科大讯飞	461,300	18,839,492.00	0.24
101	600941	中国移动	216,900	18,681,597.00	0.23
102	600690	海尔智家	901,283	18,395,186.03	0.23
103	002352	顺丰控股	575,800	17,999,508.00	0.23

104	688777	中控技术	151,979	17,857,532.50	0.22
105	601985	中国核电	1,976,500	17,847,795.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	271,403	17,749,756.20	0.22
107	002709	天赐材料	342,400	17,609,632.00	0.22
108	603799	华友钴业	364,500	17,590,770.00	0.22
109	002938	鹏鼎控股	166,900	17,587,922.00	0.22
110	300757	罗博特科	28,200	17,455,800.00	0.22
111	300033	同花顺	72,295	17,423,095.00	0.22
112	000977	浪潮信息	246,951	17,286,570.00	0.22
113	600160	巨化股份	324,220	17,186,902.20	0.22
114	300442	润泽科技	197,100	16,373,097.00	0.21
115	002851	麦格米特	97,800	16,350,204.00	0.20
116	000425	徐工机械	1,967,300	15,915,457.00	0.20
117	688126	沪硅产业	397,119	15,841,076.91	0.20
118	002202	金风科技	662,800	15,840,920.00	0.20
119	000938	紫光股份	548,300	15,823,938.00	0.20
120	601600	中国铝业	1,904,300	15,653,346.00	0.20
121	600028	中国石化	3,500,560	15,612,497.60	0.20
122	600938	中国海油	574,700	15,603,105.00	0.20
123	300346	南大光电	165,984	15,378,417.60	0.19
124	600460	士兰微	279,800	15,293,868.00	0.19
125	002466	天齐锂业	248,376	15,230,416.32	0.19
126	002600	领益智造	877,400	15,214,116.00	0.19
127	601766	中国中车	2,922,200	15,195,440.00	0.19
128	600050	中国联通	3,755,400	15,021,600.00	0.19
129	300661	圣邦股份	104,364	14,974,146.72	0.19
130	300567	精测电子	47,047	14,942,127.20	0.19
131	002837	英维克	183,480	14,597,668.80	0.18
132	002080	中材科技	161,200	14,508,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	163,300	14,492,875.00	0.18
134	002185	华天科技	638,700	14,249,397.00	0.18
135	601628	中国人寿	400,200	14,147,070.00	0.18
136	002407	多氟多	280,876	14,108,401.48	0.18
137	002179	中航光电	305,245	14,102,319.00	0.18
138	002138	顺络电子	192,900	14,100,990.00	0.18
139	688002	睿创微纳	90,272	13,964,175.68	0.17
140	601100	恒立液压	128,800	13,853,728.00	0.17
141	000568	泸州老窖	176,500	13,682,280.00	0.17
142	601872	招商轮船	776,000	13,634,320.00	0.17
143	300395	菲利华	101,033	13,511,143.09	0.17
144	600879	航天电子	634,100	13,499,989.00	0.17
145	002241	歌尔股份	596,400	13,436,892.00	0.17
146	603288	海天味业	400,763	13,289,301.08	0.17

147	601006	大秦铁路	2,863,100	13,198,891.00	0.17
148	000408	藏格矿业	188,434	13,062,244.88	0.16
149	300390	天华新能	139,660	13,059,606.60	0.16
150	601658	邮储银行	2,648,900	13,059,077.00	0.16
151	605117	德业股份	122,313	12,987,194.34	0.16
152	688017	绿的谐波	30,814	12,875,938.04	0.16
153	688469	芯联集成	1,208,264	12,819,681.04	0.16
154	600905	三峡能源	3,433,900	12,739,769.00	0.16
155	600489	中金黄金	698,700	12,611,535.00	0.16
156	601888	中国中免	234,600	12,600,366.00	0.16
157	002625	光启技术	414,040	12,553,692.80	0.16
158	688396	华润微	127,567	12,444,160.85	0.16
159	000630	铜陵有色	1,930,832	12,280,091.52	0.15
160	600893	航发动力	320,200	12,276,468.00	0.15
161	600673	东阳光	361,500	12,139,170.00	0.15
162	600010	包钢股份	5,432,500	12,114,475.00	0.15
163	688271	联影医疗	118,734	12,019,442.82	0.15
164	601127	赛力斯	196,200	12,017,250.00	0.15
165	300058	蓝色光标	862,460	11,867,449.60	0.15
166	688111	金山办公	55,630	11,851,971.50	0.15
167	002273	水晶光电	332,400	11,793,552.00	0.15
168	601689	拓普集团	208,797	11,780,326.74	0.15
169	300037	新宙邦	126,794	11,772,822.90	0.15
170	002027	分众传媒	2,423,771	11,731,051.64	0.15
171	600118	中国卫星	142,000	11,651,100.00	0.15
172	600019	宝钢股份	2,093,200	11,366,076.00	0.14
173	300751	迈为股份	40,208	11,357,151.68	0.14
174	000426	兴业银锡	341,200	11,245,952.00	0.14
175	600760	中航沈飞	272,400	11,195,640.00	0.14
176	000807	云铝股份	499,900	11,067,786.00	0.14
177	601168	西部矿业	400,800	10,877,712.00	0.14
178	600362	江西铜业	249,300	10,794,690.00	0.14
179	600104	上汽集团	1,104,600	10,780,896.00	0.14
180	600989	宝丰能源	528,500	10,744,405.00	0.13
181	300450	先导智能	263,388	10,725,159.36	0.13
182	601727	上海电气	1,515,400	10,607,800.00	0.13
183	600875	东方电气	366,400	10,541,328.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	399,800	10,522,736.00	0.13
185	002001	新 和 成	369,100	10,489,822.00	0.13
186	688099	晶晨股份	101,644	10,459,167.60	0.13
187	605589	圣泉集团	162,600	10,336,482.00	0.13
188	600667	太极实业	351,700	10,262,606.00	0.13
189	002422	科伦药业	266,300	10,257,876.00	0.13

190	601390	中国中铁	2,459,800	10,257,366.00	0.13
191	600885	宏发股份	297,389	10,256,946.61	0.13
192	002738	中矿资源	173,000	10,205,270.00	0.13
193	000538	云南白药	214,099	10,141,869.63	0.13
194	002126	银轮股份	203,400	10,129,320.00	0.13
195	000960	锡业股份	237,200	10,126,068.00	0.13
196	600392	盛和资源	336,800	10,026,536.00	0.13
197	600547	山东黄金	434,200	10,025,678.00	0.13
198	600795	国电电力	2,142,400	10,005,008.00	0.13
199	000831	中国稀土	178,400	9,899,416.00	0.12
200	600418	江淮汽车	379,000	9,789,570.00	0.12
201	600585	海螺水泥	576,500	9,771,675.00	0.12
202	601669	中国电建	2,069,100	9,724,770.00	0.12
203	002648	卫星化学	404,592	9,503,866.08	0.12
204	300316	晶盛机电	157,300	9,500,920.00	0.12
205	600141	兴发集团	202,100	9,492,637.00	0.12
206	002812	恩捷股份	141,527	9,469,571.57	0.12
207	002129	TCL 中环	776,977	9,339,263.54	0.12
208	600096	云天化	306,600	9,320,640.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	1,119,544	9,247,433.44	0.12
210	301358	湖南裕能	121,300	9,203,031.00	0.12
211	601179	中国西电	615,700	9,186,244.00	0.12
212	300782	卓胜微	82,860	9,079,798.80	0.11
213	600346	恒力石化	507,300	8,984,283.00	0.11
214	601868	中国能建	3,361,284	8,974,628.28	0.11
215	600482	中国动力	272,479	8,937,311.20	0.11
216	002195	岩山科技	1,362,248	8,909,101.92	0.11
217	000066	中国长城	465,004	8,858,326.20	0.11
218	002558	巨人网络	319,600	8,808,176.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	726,500	8,797,915.00	0.11
220	300418	昆仑万维	216,100	8,721,796.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	262,700	8,695,370.00	0.11
222	600066	宇通客车	319,100	8,555,071.00	0.11
223	000625	长安汽车	1,189,800	8,530,866.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	355,700	8,508,344.00	0.11
225	600157	永泰能源	5,241,400	8,438,654.00	0.11
226	002532	天山铝业	778,300	8,351,159.00	0.10
227	600221	海航控股	6,175,800	8,337,330.00	0.10
228	600895	张江高科	223,300	8,317,925.00	0.10
229	000157	中联重科	1,192,600	8,312,422.00	0.10
230	688036	传音控股	138,206	8,147,243.70	0.10
231	600711	盛屯矿业	742,400	8,144,128.00	0.10
232	002340	格林美	1,225,711	8,101,949.71	0.10

233	300803	指南针	87,900	8,057,793.00	0.10
234	600011	华能国际	1,056,800	8,021,112.00	0.10
235	000933	神火股份	378,110	8,015,932.00	0.10
236	605499	东鹏饮料	64,921	8,013,199.03	0.10
237	600048	保利发展	1,725,500	7,989,065.00	0.10
238	600143	金发科技	513,800	7,938,210.00	0.10
239	600436	片仔癀	72,459	7,918,319.52	0.10
240	600438	通威股份	648,900	7,858,179.00	0.10
241	300017	网宿科技	599,498	7,799,468.98	0.10
242	600115	中国东航	2,045,000	7,791,450.00	0.10
243	002821	凯莱英	47,968	7,770,816.00	0.10
244	002236	大华股份	471,200	7,770,088.00	0.10
245	002493	荣盛石化	719,150	7,730,862.50	0.10
246	002131	利欧股份	1,626,700	7,726,825.00	0.10
247	600570	恒生电子	363,900	7,711,041.00	0.10
248	600886	国投电力	576,900	7,678,539.00	0.10
249	002456	欧菲光	806,250	7,627,125.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	625,300	7,572,383.00	0.09
251	688047	龙芯中科	48,142	7,446,123.14	0.09
252	603659	璞泰来	256,635	7,424,450.55	0.09
253	601233	桐昆股份	342,900	7,423,785.00	0.09
254	003816	中国广核	1,887,900	7,381,689.00	0.09
255	300339	润和软件	191,300	7,366,963.00	0.09
256	601360	三六零	840,800	7,306,552.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	632,000	7,286,960.00	0.09
258	000301	东方盛虹	635,300	7,274,185.00	0.09
259	688213	思特威	67,619	7,239,966.33	0.09
260	600026	中远海能	400,700	7,188,558.00	0.09
261	300759	康龙化成	248,119	7,178,082.67	0.09
262	002074	国轩高科	260,300	7,160,853.00	0.09
263	688235	百济神州	27,816	7,082,231.76	0.09
264	688578	艾力斯	64,830	7,079,436.00	0.09
265	300438	鹏辉能源	84,678	7,015,572.30	0.09
266	002555	三七互娱	371,600	7,012,092.00	0.09
267	600009	上海机场	298,900	6,904,590.00	0.09
268	600196	复星医药	305,400	6,862,338.00	0.09
269	688122	西部超导	109,194	6,858,475.14	0.09
270	000768	中航西飞	333,988	6,840,074.24	0.09
271	000975	山金国际	399,600	6,793,200.00	0.09
272	601111	中国国航	1,119,700	6,774,185.00	0.08
273	002472	双环传动	163,000	6,766,130.00	0.08
274	300207	欣旺达	355,057	6,742,532.43	0.08
275	300001	特锐德	177,500	6,714,825.00	0.08

276	600029	南方航空	1,295,000	6,708,100.00	0.08
277	600415	小商品城	658,700	6,692,392.00	0.08
278	002517	恺英网络	410,600	6,672,250.00	0.08
279	600674	川投能源	468,400	6,637,228.00	0.08
280	002601	龙佰集团	400,900	6,606,832.00	0.08
281	600219	南山铝业	1,655,300	6,604,647.00	0.08
282	603129	春风动力	25,800	6,599,640.00	0.08
283	300458	全志科技	167,040	6,591,398.40	0.08
284	601186	中国铁建	1,105,400	6,577,130.00	0.08
285	002128	电投能源	283,820	6,561,918.40	0.08
286	002595	豪迈科技	139,350	6,493,710.00	0.08
287	600233	圆通速递	411,200	6,476,400.00	0.08
288	601877	正泰电器	258,100	6,470,567.00	0.08
289	601117	中国化学	880,200	6,469,470.00	0.08
290	300115	长盈精密	228,100	6,373,114.00	0.08
291	301236	软通动力	149,208	6,333,879.60	0.08
292	600372	中航机载	581,300	6,307,105.00	0.08
293	002155	湖南黄金	262,833	6,273,823.71	0.08
294	600839	四川长虹	887,200	6,192,656.00	0.08
295	002465	海格通信	477,000	6,091,290.00	0.08
296	300568	星源材质	323,300	6,052,176.00	0.08
297	300454	深信服	62,270	5,990,374.00	0.08
298	300347	泰格医药	123,834	5,944,032.00	0.07
299	000963	华东医药	210,300	5,913,636.00	0.07
300	000547	航天发展	307,200	5,882,880.00	0.07
301	600741	华域汽车	378,700	5,877,424.00	0.07
302	688506	百利天恒	19,964	5,870,014.92	0.07
303	002920	德赛西威	71,702	5,843,713.00	0.07
304	300024	机器人	300,900	5,816,397.00	0.07
305	603650	彤程新材	59,100	5,790,618.00	0.07
306	002130	沃尔核材	302,700	5,739,192.00	0.07
307	002497	雅化集团	276,900	5,640,453.00	0.07
308	688676	金盘科技	66,240	5,606,553.60	0.07
309	300012	华测检测	404,200	5,602,212.00	0.07
310	688331	荣昌生物	42,727	5,565,619.02	0.07
311	001979	招商蛇口	864,800	5,560,664.00	0.07
312	000878	云南铜业	349,500	5,550,060.00	0.07
313	002432	九安医疗	78,393	5,540,817.24	0.07
314	300496	中科创达	88,780	5,485,716.20	0.07
315	002271	东方雨虹	459,100	5,449,517.00	0.07
316	300083	创世纪	399,900	5,446,638.00	0.07
317	002414	高德红外	410,300	5,440,578.00	0.07
318	000034	神州数码	195,305	5,419,713.75	0.07

319	300866	安克创新	51,530	5,384,885.00	0.07
320	601021	春秋航空	117,543	5,357,609.94	0.07
321	002444	巨星科技	172,100	5,352,310.00	0.07
322	300474	景嘉微	87,941	5,318,671.68	0.07
323	603979	金诚信	89,900	5,306,797.00	0.07
324	000733	振华科技	93,168	5,277,035.52	0.07
325	000661	长春高新	78,200	5,208,120.00	0.07
326	688266	泽璟制药	44,492	5,190,436.72	0.07
327	601319	中国人保	767,500	5,188,300.00	0.07
328	300763	锦浪科技	57,400	5,186,090.00	0.06
329	002756	永兴材料	90,670	5,135,548.80	0.06
330	600699	均胜电子	234,700	5,071,867.00	0.06
331	300748	金力永磁	164,400	5,071,740.00	0.06
332	002078	太阳纸业	402,700	5,029,723.00	0.06
333	601615	明阳智能	434,700	5,029,479.00	0.06
334	300073	当升科技	104,600	5,024,984.00	0.06
335	002025	航天电器	65,700	5,007,654.00	0.06
336	300142	沃森生物	383,900	4,986,861.00	0.06
337	601677	明泰铝业	298,700	4,958,420.00	0.06
338	300432	富临精工	246,500	4,952,185.00	0.06
339	603606	东方电缆	118,927	4,936,659.77	0.06
340	300919	中伟新材	112,673	4,929,443.75	0.06
341	000423	东阿阿胶	108,300	4,912,488.00	0.06
342	600039	四川路桥	626,700	4,900,794.00	0.06
343	603087	甘李药业	86,100	4,887,036.00	0.06
344	601800	中国交建	854,500	4,879,195.00	0.06
345	000002	万 科 A	1,632,000	4,830,720.00	0.06
346	002252	上海莱士	1,106,860	4,803,772.40	0.06
347	600226	亨通股份	500,200	4,796,918.00	0.06
348	688608	恒玄科技	28,549	4,773,107.31	0.06
349	688599	天合光能	337,686	4,768,126.32	0.06
350	688169	石头科技	49,801	4,729,600.97	0.06
351	300724	捷佳伟创	66,956	4,727,093.60	0.06
352	688223	晶科能源	986,818	4,687,385.50	0.06
353	002064	华峰化学	476,900	4,525,781.00	0.06
354	601633	长城汽车	299,792	4,523,861.28	0.06
355	600588	用友网络	492,500	4,521,150.00	0.06
356	001965	招商公路	488,800	4,477,408.00	0.06
357	000786	北新建材	245,400	4,439,286.00	0.06
358	688390	固德威	40,853	4,432,959.03	0.06
359	002831	裕同科技	123,800	4,402,328.00	0.06
360	688180	君实生物	128,814	4,356,489.48	0.05
361	300677	英科医疗	110,100	4,312,617.00	0.05

362	002294	信立泰	133,228	4,248,640.92	0.05
363	000519	中兵红箭	200,700	4,228,749.00	0.05
364	603806	福斯特	250,700	4,209,253.00	0.05
365	601618	中国中冶	1,715,600	4,186,064.00	0.05
366	600177	雅戈尔	555,300	4,181,409.00	0.05
367	600516	方大炭素	677,000	4,177,090.00	0.05
368	688188	柏楚电子	38,951	4,156,071.70	0.05
369	688065	凯赛生物	86,595	4,143,570.75	0.05
370	601607	上海医药	268,000	4,127,200.00	0.05
371	302132	中航成飞	70,600	4,117,392.00	0.05
372	603260	合盛硅业	85,200	4,111,752.00	0.05
373	300972	万辰集团	23,708	4,111,204.28	0.05
374	002176	江特电机	409,900	4,103,099.00	0.05
375	000623	吉林敖东	227,647	4,036,181.31	0.05
376	300699	光威复材	139,620	4,000,113.00	0.05
377	000617	中油资本	606,160	3,994,594.40	0.05
378	300832	新产业	94,400	3,964,800.00	0.05
379	002085	万丰奥威	357,012	3,959,263.08	0.05
380	300558	贝达药业	60,700	3,949,749.00	0.05
381	002318	久立特材	164,300	3,926,770.00	0.05
382	300251	光线传媒	351,900	3,902,571.00	0.05
383	002459	晶澳科技	477,038	3,864,007.80	0.05
384	002065	东华软件	538,400	3,844,176.00	0.05
385	300342	天银机电	81,700	3,839,900.00	0.05
386	600499	科达制造	276,400	3,814,320.00	0.05
387	002266	浙富控股	752,300	3,806,638.00	0.05
388	600085	同仁堂	164,701	3,806,240.11	0.05
389	688472	阿特斯	350,033	3,787,357.06	0.05
390	002044	美年健康	751,800	3,781,554.00	0.05
391	605090	九丰能源	101,700	3,780,189.00	0.05
392	600515	海南机场	1,372,400	3,760,376.00	0.05
393	603596	伯特利	150,923	3,748,927.32	0.05
394	300409	道氏技术	187,900	3,744,847.00	0.05
395	688617	惠泰医疗	20,530	3,727,426.80	0.05
396	000400	许继电气	171,300	3,717,210.00	0.05
397	002223	鱼跃医疗	144,505	3,707,998.30	0.05
398	301550	斯菱智驱	40,300	3,684,629.00	0.05
399	002405	四维图新	569,426	3,684,186.22	0.05
400	688005	容百科技	120,129	3,675,947.40	0.05
401	300003	乐普医疗	310,031	3,673,867.35	0.05
402	000032	深桑达 A	145,900	3,640,205.00	0.05
403	000415	渤海租赁	891,400	3,627,998.00	0.05
404	600521	华海药业	251,800	3,625,920.00	0.05

405	600862	中航高科	200,800	3,620,424.00	0.05
406	601216	君正集团	810,900	3,616,614.00	0.05
407	000683	博源化工	625,100	3,600,576.00	0.05
408	000999	华润三九	159,656	3,590,663.44	0.04
409	000039	中集集团	442,600	3,589,486.00	0.04
410	603766	隆鑫通用	296,000	3,531,280.00	0.04
411	600803	新奥股份	223,137	3,525,564.60	0.04
412	600704	物产中大	745,300	3,517,816.00	0.04
413	600312	平高电气	195,600	3,454,296.00	0.04
414	600018	上港集团	727,000	3,431,440.00	0.04
415	603605	珀莱雅	57,100	3,421,432.00	0.04
416	000887	中鼎股份	189,707	3,393,858.23	0.04
417	600332	白云山	168,800	3,382,752.00	0.04
418	000967	盈峰环境	320,554	3,375,433.62	0.04
419	600765	中航重机	261,100	3,373,412.00	0.04
420	688116	天奈科技	88,008	3,361,905.60	0.04
421	300122	智飞生物	287,500	3,360,875.00	0.04
422	600166	福田汽车	1,141,200	3,320,892.00	0.04
423	600153	建发股份	418,000	3,314,740.00	0.04
424	000830	鲁西化工	274,500	3,294,000.00	0.04
425	002410	广联达	396,800	3,237,888.00	0.04
426	600323	瀚蓝环境	117,500	3,226,550.00	0.04
427	002007	华兰生物	262,734	3,202,727.46	0.04
428	300896	爱美客	36,360	3,170,592.00	0.04
429	601799	星宇股份	34,342	3,112,072.04	0.04
430	688114	华大智造	60,006	3,065,106.48	0.04
431	603568	伟明环保	197,180	3,032,628.40	0.04
432	600398	海澜之家	576,900	3,017,187.00	0.04
433	002603	以岭药业	200,500	3,007,500.00	0.04
434	688009	中国通号	621,300	2,957,388.00	0.04
435	600486	扬农化工	58,300	2,955,810.00	0.04
436	601000	唐山港	711,800	2,953,970.00	0.04
437	601018	宁波港	934,700	2,944,305.00	0.04
438	002389	航天彩虹	165,600	2,942,712.00	0.04
439	600529	山东药玻	159,400	2,940,930.00	0.04
440	600208	衢州发展	1,022,100	2,892,543.00	0.04
441	600316	洪都航空	103,400	2,888,996.00	0.04
442	000738	航发控制	157,900	2,887,991.00	0.04
443	600008	首创环保	1,058,100	2,878,032.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	821,400	2,850,258.00	0.04
445	600170	上海建工	1,280,800	2,843,376.00	0.04
446	600998	九州通	605,700	2,840,733.00	0.04
447	603486	科沃斯	55,661	2,824,795.75	0.04

448	600820	隧道股份	528,700	2,754,527.00	0.03
449	600161	天坛生物	237,532	2,750,620.56	0.03
450	300118	东方日升	219,100	2,727,795.00	0.03
451	601238	广汽集团	532,100	2,703,068.00	0.03
452	603885	吉祥航空	262,400	2,700,096.00	0.03
453	688303	大全能源	154,526	2,693,388.18	0.03
454	002607	中公教育	1,481,600	2,666,880.00	0.03
455	603816	顾家家居	118,400	2,647,424.00	0.03
456	603939	益丰药房	145,600	2,617,888.00	0.03
457	688166	博瑞医药	73,247	2,564,377.47	0.03
458	600763	通策医疗	75,252	2,549,537.76	0.03
459	601567	三星电气	168,800	2,521,872.00	0.03
460	600038	中直股份	98,500	2,491,065.00	0.03
461	300676	华大基因	70,400	2,468,224.00	0.03
462	300049	福瑞医科	63,400	2,464,992.00	0.03
463	603392	万泰生物	91,120	2,457,506.40	0.03
464	300573	兴齐眼药	60,075	2,448,657.00	0.03
465	601880	辽港股份	1,769,400	2,441,772.00	0.03
466	600535	天士力	179,400	2,373,462.00	0.03
467	600511	国药股份	90,600	2,359,224.00	0.03
468	600816	建元信托	946,000	2,308,240.00	0.03
469	300100	双林股份	82,300	2,286,294.00	0.03
470	002244	滨江集团	299,000	2,272,400.00	0.03
471	000833	粤桂股份	96,300	2,255,346.00	0.03
472	601155	新城控股	217,300	2,229,498.00	0.03
473	002120	韵达股份	348,200	2,214,552.00	0.03
474	300144	宋城演艺	378,302	2,197,934.62	0.03
475	688063	派能科技	41,239	2,196,801.53	0.03
476	000998	隆平高科	282,194	2,127,742.76	0.03
477	002544	普天科技	114,400	2,084,368.00	0.03
478	600064	南京高科	291,000	2,074,830.00	0.03
479	601866	中远海发	937,100	2,070,991.00	0.03
480	600635	大众公用	464,900	1,989,772.00	0.02
481	600754	锦江酒店	109,300	1,966,307.00	0.02
482	300457	赢合科技	93,000	1,960,440.00	0.02
483	000035	中国天楹	401,546	1,939,467.18	0.02
484	600655	豫园股份	467,400	1,921,014.00	0.02
485	300601	康泰生物	160,820	1,823,698.80	0.02
486	603899	晨光股份	88,001	1,815,460.63	0.02
487	600004	白云机场	247,700	1,798,302.00	0.02
488	600663	陆家嘴	283,600	1,781,008.00	0.02
489	600258	首旅酒店	160,900	1,757,028.00	0.02
490	600859	王府井	189,000	1,735,020.00	0.02

491	002091	江苏国泰	234,500	1,695,435.00	0.02
492	300070	碧水源	521,200	1,662,628.00	0.02
493	000069	华侨城 A	965,386	1,583,233.04	0.02
494	600864	哈投股份	299,900	1,556,481.00	0.02
495	301078	孩子王	212,700	1,437,852.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	213,100	1,397,936.00	0.02
497	603833	欧派家居	43,900	1,321,829.00	0.02
498	002891	中宠股份	46,400	1,239,808.00	0.02
499	600325	华发股份	528,900	1,221,759.00	0.02
500	002572	索菲亚	138,800	1,013,240.00	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	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.09
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	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
6	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
7	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
8	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
9	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
10	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
11	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
12	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
13	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
14	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
15	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
16	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
17	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
18	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
19	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
20	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
21	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
22	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
23	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
24	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
25	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
26	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
27	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
28	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
29	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	600519	贵州茅台	241,080,388.29	2.28
2	601318	中国平安	114,318,717.16	1.08
3	601899	紫金矿业	105,437,577.44	1.00
4	688041	海光信息	103,054,548.39	0.97
5	600036	招商银行	91,888,214.59	0.87
6	688008	澜起科技	63,120,942.28	0.60
7	600900	长江电力	59,301,932.89	0.56
8	688981	中芯国际	57,682,063.71	0.54
9	601166	兴业银行	57,557,611.23	0.54
10	603986	兆易创新	55,803,809.72	0.53
11	600276	恒瑞医药	50,330,540.02	0.48
12	600030	中信证券	46,612,982.61	0.44
13	601398	工商银行	44,178,133.00	0.42
14	603259	药明康德	43,207,156.10	0.41
15	601211	国泰海通	36,993,402.42	0.35
16	600183	生益科技	36,245,912.51	0.34
17	601288	农业银行	35,388,052.75	0.33
18	688498	源杰科技	35,372,951.03	0.33
19	301308	江波龙	33,298,280.15	0.31
20	002371	北方华创	33,278,924.00	0.31

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	600519	贵州茅台	355,401,099.13	3.36
2	601318	中国平安	197,948,839.80	1.87
3	601899	紫金矿业	181,124,555.82	1.71
4	600036	招商银行	154,411,904.13	1.46
5	688041	海光信息	136,417,615.23	1.29
6	600900	长江电力	101,320,902.40	0.96
7	601166	兴业银行	98,085,345.25	0.93
8	688008	澜起科技	89,857,158.54	0.85
9	688981	中芯国际	86,451,328.27	0.82
10	600276	恒瑞医药	83,092,076.93	0.78
11	603986	兆易创新	83,079,706.92	0.78
12	600030	中信证券	80,024,405.98	0.76
13	603259	药明康德	75,677,198.85	0.71
14	601398	工商银行	74,765,429.00	0.71
15	601211	国泰海通	62,568,815.42	0.59
16	601288	农业银行	60,607,796.00	0.57

17	601088	中国神华	56,587,624.29	0.53
18	601328	交通银行	56,523,458.00	0.53
19	603993	洛阳钼业	55,880,840.36	0.53
20	688256	寒武纪	53,528,421.02	0.51

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	4,029,922,498.12
卖出股票收入（成交）总额	5,839,555,645.40

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）	845,023.21	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	845,023.21	0.01

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	4,770	477,006.27	0.01
2	113704	春风转债	3,680	368,016.94	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 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

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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

无。

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	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.09	新股锁定
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	688790	昂瑞微	293,237.55	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 (%)
9,723	609,289.66	5,566,634,252.00	93.97	357,489,105.00	6.03

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,194,557,200.00	20.16

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	800.00	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 (2024 年 9 月 20 日) 基金份额总额	2,000,123,357.00
本报告期期初基金份额总额	8,798,123,357.00
本报告期基金总申购份额	4,320,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,194,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	5,924,123,357.00

§ 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

报告期内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，会计师事务所为容诚会计师事务所（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

报告期内, 本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内, 本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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(%)	
国泰海通证券股份有限公司	8	9,863,791,658.65	100.00	1,833,801.02	100.00	-
兴业银行股份有限公司	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，本基金新增以下交易单元：兴业银行股份有限公司新增交易单元 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 (%)
国泰海通证券股份有限公司	2, 525, 453. 07	100. 00	-	-	-	-
兴业银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第四次收益分配公告	中国证券报、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调整证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、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
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	中国证券报、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
4	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第一次收益分配公告	中国证券报、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 11 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	中国证券报、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高级管理人员变更公告	中国证券报、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 (%)
机构	1	2026-05-13 至 2026-06-30	1,433,219,700.00	137,788,800.00	232,355,200.00	1,338,653,300.00	22.60
联接基金	1	2026-04-09 至 2026-06-30	1,519,080,000.00	160,750,000.00	485,272,800.00	1,194,557,200.00	20.16
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) 中国证监会准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (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 A500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

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

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，

或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日