

# 中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 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及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责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§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.....	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.....	9
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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	82
7.1 期末基金资产组合情况.....	82
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	82
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.....	84
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	97
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	98
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.....	99
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.....	99
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.....	99
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.....	99
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	99

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	100
7.12 投资组合报告附注.....	100
§8 基金份额持有人信息.....	102
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	102
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	102
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	103
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	103
§9 开放式基金份额变动.....	103
§10 重大事件揭示.....	103
10.1 基金份额持有人大会决议.....	103
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.....	103
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	104
10.4 基金投资策略的改变.....	104
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	104
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	104
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	104
10.8 其他重大事件.....	105
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	107
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.....	107
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	108
§12 备查文件目录.....	108
12.1 备查文件目录.....	108
12.2 存放地点.....	108
12.3 查阅方式.....	108

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF 或 中证 500ETF
基金主代码	510500
交易代码	510500
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	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,147,867,244.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500ETF”或“中证 500ETF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法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	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599

传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	谷澍

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,603,144,454.37
本期利润	3,370,948,772.08
加权平均基金份额本期利润	0.6403
本期加权平均净值利润率	8.91%
本期基金份额净值增长率	7.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	20,812,532,078.07
期末可供分配基金份额利润	4.0429

期末基金资产净值	39,176,523,474.39
期末基金份额净值	7.6102
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	113.33%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

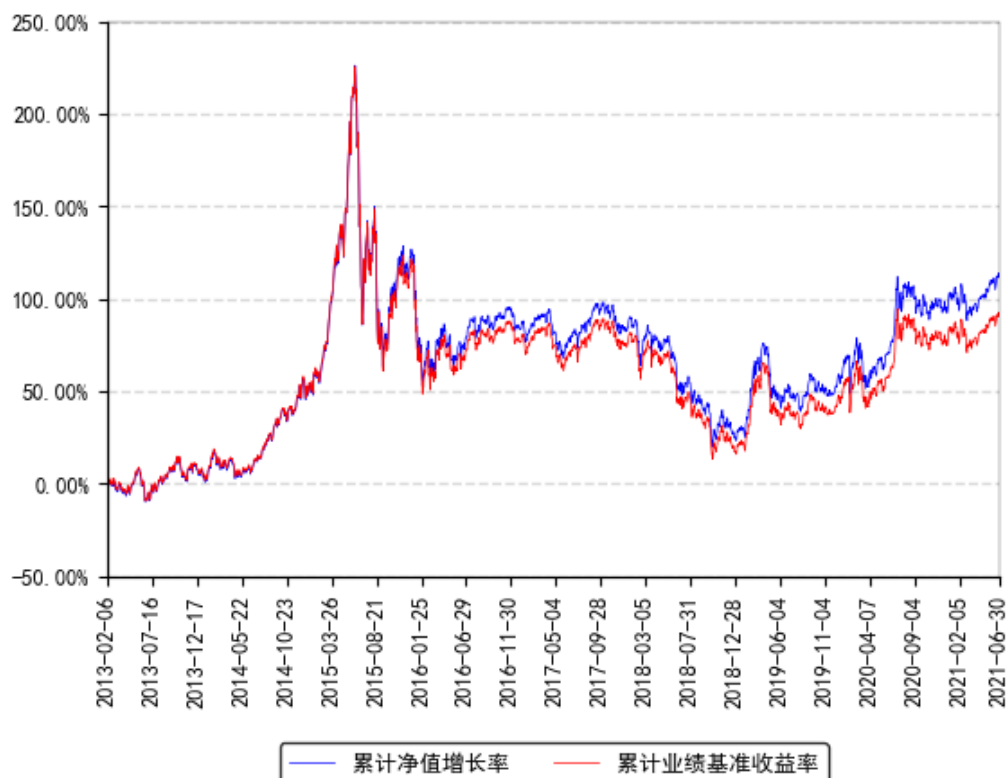
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.59%	0.74%	1.18%	0.73%	0.41%	0.01%
过去三个月	9.73%	0.68%	8.86%	0.68%	0.87%	0.00%
过去六个月	7.87%	0.99%	6.93%	0.99%	0.94%	0.00%
过去一年	18.71%	1.25%	16.09%	1.25%	2.62%	0.00%
过去三年	37.68%	1.48%	30.48%	1.48%	7.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	113.33%	1.67%	92.08%	1.67%	21.25%	0.00%

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

南方中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。



截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.4 万亿元，旗下管理 245 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	16 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 3 月 12 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	54,794,261,094.86	2013年4月22日
	私募资产管理计划	8	3,072,317,026.41	2020年8月7日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	57,866,578,121.27	-

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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%的情况。

#### 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

报告期内，中证 500 指数涨 6.93%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 7.6102 元，报告期内，份额净值增长率为 7.87%，同期业绩基准增长率为 6.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情影响逐渐消退，全球经济继续恢复，上市公司企业盈利高速增长。展望下半年，通胀预期或减弱，流动性将继续相对宽松，中国经济增速在强势反弹后，预期仍增长，大中华地区权益市场仍具长期配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服

务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	1,345,324,985.14	96,110,222.33
结算备付金		113,552,501.39	1,552,092,852.47
存出保证金		283,871,515.59	276,701,157.83
交易性金融资产	6.4.4.2	37,479,360,548.68	36,380,304,237.48
其中：股票投资		37,271,894,548.68	36,377,951,137.48
基金投资		-	-
债券投资		207,466,000.00	2,353,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		15,494,708.28	33,234,346.67
应收利息	6.4.4.5	7,971,933.03	3,614,996.25
应收股利		11,856,219.22	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		39,257,432,411.33	38,342,057,813.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,291,980.16	3,336,764.49
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,870,308.24	16,013,751.33
应付托管费		3,174,061.66	3,202,750.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	2,666,395.43	2,516,409.51
应交税费		4,141,830.79	609,835.37
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	51,764,360.66	79,333,044.79
负债合计		80,908,936.94	105,012,555.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	18,363,991,396.32	19,334,297,239.58
未分配利润	6.4.4.10	20,812,532,078.07	18,902,748,017.66
所有者权益合计		39,176,523,474.39	38,237,045,257.24
负债和所有者权益总计		39,257,432,411.33	38,342,057,813.03

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.6102 元，基金份额总额 5,147,867,244.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		3,526,326,760.50	5,719,883,657.00
1. 利息收入		88,003,862.05	43,293,899.54
其中：存款利息收入	6.4.4.11	11,114,616.05	17,510,900.73
债券利息收入		1,366,116.65	15,574.69

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,533,209.61	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		73,989,919.74	25,767,424.12
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,603,657,467.06	4,322,763,972.26
其中：股票投资收益	6.4.4.12	3,084,692,810.56	3,687,468,603.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	1,664,388.24	24,767,460.60
资产支持证券投资	6.4.4.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	197,040,662.39	356,405,069.52
股利收益	6.4.4.17	320,259,605.87	254,122,838.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-232,195,682.29	1,388,200,926.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	66,861,113.68	-34,375,141.68
减：二、费用		155,377,988.42	169,399,629.38
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	93,602,345.89	103,601,023.59
2. 托管费	6.4.7.2.2	18,720,469.27	20,720,204.70
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.20	36,288,983.21	37,302,585.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		975,717.62	1,375,889.34
7. 其他费用	6.4.4.21	5,790,472.43	6,399,926.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,370,948,772.08	5,550,484,027.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,370,948,772.08	5,550,484,027.62

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,334,297,239.58	18,902,748,017.66	38,237,045,257.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,370,948,772.08	3,370,948,772.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-970,305,843.26	-1,461,164,711.67	-2,431,470,554.93
其中：1. 基金申购款	17,445,528,267.77	17,270,088,104.32	34,715,616,372.09
2. 基金赎回款	-18,415,834,111.03	-18,731,252,815.99	-37,147,086,927.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	18,363,991,396.32	20,812,532,078.07	39,176,523,474.39
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	27,837,315,656.51	16,702,353,517.17	44,539,669,173.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,550,484,027.62	5,550,484,027.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,435,410,812.61	-5,194,786,520.70	-11,630,197,333.31
其中：1. 基金申购款	16,990,340,686.01	10,403,345,651.63	27,393,686,337.64
2. 基金赎回款	-23,425,751,498.62	-15,598,132,172.33	-39,023,883,670.95



四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	21,401,904,843.90	17,058,051,024.09	38,459,955,867.99

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：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
 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 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.2 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。

#### 6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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。

#### 6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------

活期存款	345,324,985.14
定期存款	1,000,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	300,000,000.00
存款期限 3 个月以上	700,000,000.00
其他存款	-
合计	1,345,324,985.14

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	35,015,577,231.12	37,271,894,548.68	2,256,317,317.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	207,368,000.00	207,466,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	207,368,000.00	207,466,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	35,222,945,231.12	37,479,360,548.68	2,256,415,317.56

注：于 2021 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 345.00 元(2020 年 12 月 31 日：628.00 元)。

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	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	1,856,090,160.00	-	-	-
股指期货	1,856,090,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,856,090,160.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
----	----	----------	------	--------

IC2107	IC2107	45.00	60,904,800.00	1,241,800.00
IC2108	IC2108	5.00	6,712,000.00	-31,000.00
IC2109	IC2109	92.00	122,672,800.00	3,703,320.00
IC2112	IC2112	1,326.00	1,729,422,240.00	58,707,560.00
总额合计	-	1,468.00	1,919,711,840.00	63,621,680.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	63,621,680.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	148,252.31
应收定期存款利息	2,884,777.73
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	46,814.77
应收债券利息	1,363,989.00
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	3,521,978.86
其他	6,120.36
合计	7,971,933.03

#### 6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,666,395.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,666,395.43

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
应退替代款	48,691,523.21
预提费用	133,891.13
应付指数使用费	2,921,600.12
可退替代款	17,346.20
其他	-
合计	51,764,360.66

注：1. 可退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,419,867,244.00	19,334,297,239.58
本期申购	4,890,400,000.00	17,445,528,267.77
本期赎回（以“-”号填列）	-5,162,400,000.00	-18,415,834,111.03
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,147,867,244.00	18,363,991,396.32

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	33,442,012,746.85	-14,539,264,729.19	18,902,748,017.66
本期利润	3,603,144,454.37	-232,195,682.29	3,370,948,772.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,674,004,721.60	212,840,009.93	-1,461,164,711.67
其中：基金申购款	31,490,542,641.71	-14,220,454,537.39	17,270,088,104.32
基金赎回款	-33,164,547,363.31	14,433,294,547.32	-18,731,252,815.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,371,152,479.62	-14,558,620,401.55	20,812,532,078.07

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,938,211.04
定期存款利息收入	5,285,111.07
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,776,372.22
其他	114,921.72
合计	11,114,616.05

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,034,924,251.26
股票投资收益——赎回差价收入	1,049,768,559.30
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	3,084,692,810.56

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	26,251,331,222.71
减：卖出股票成本总额	24,216,406,971.45
买卖股票差价收入	2,034,924,251.26

##### 6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	37,147,086,927.02
减：现金支付赎回款总额	19,708,298,003.02
减：赎回股票成本总额	16,389,020,364.70

赎回差价收入	1,049,768,559.30
--------	------------------

#### 6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.4.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

#### 6.4.4.13 债券投资收益

##### 6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,664,388.24
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,664,388.24

##### 6.4.4.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,607,572.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,940,800.00
减：应收利息总额	2,384.62
买卖债券差价收入	1,664,388.24

##### 6.4.4.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.4.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.4.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.4.15 贵金属投资收益

##### 6.4.4.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.4.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.4.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

#### 6.4.4.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.4.16 衍生工具收益

##### 6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	197,040,662.39

#### 6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	320,259,605.87
其中：证券出借权益补偿收入	60,926,255.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	320,259,605.87

#### 6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-270,110,840.03
——股票投资	-270,208,840.03
——债券投资	98,000.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	37,915,157.74
——权证投资	-
——期货投资	37,915,157.74
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	-232,195,682.29

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为-283.00 元(2020 上半年度：0.00 元)。

#### 6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	66,861,113.68
合计	66,861,113.68

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.4.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	36,288,983.21
银行间市场交易费用	-
合计	36,288,983.21

#### 6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	5,616,140.75
银行费用	40,440.55
合计	5,790,472.43

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。于 2019 年度，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元；自 2020 年度起，当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.5.1 或有事项

无。

#### 6.4.5.2 资产负债表日后事项



无。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
华泰长城资本管理有限公司(“华泰长城”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“南方中证 500ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	37,994,025,298.75	73.27%	36,054,292,557.15	71.55%

#### 6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	3,799,901.98	73.28%	1,493,722.67	56.02%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	3,605,951.48	71.55%	1,283,867.11	52.06%

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	93,602,345.89	103,601,023.59
其中: 支付销售机构的客户维护费	12,515.19	18,801.45

注: 支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,720,469.27	20,720,204.70

注: 支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.7.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.7.4 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

##### 6.4.7.4.1 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

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	17,241,727,498.00	11,360,682.19	1,740,687,622.00	506,021.87
兴业证券	2,042,445,351.00	1,336,211.57	96,554,802.00	31,782.09

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	4,892,829,857.00	3,563,524.65	1,427,898,253.00	491,256.54
兴业证券	210,803,746.00	13,793.78	196,157,995.00	-

#### 6.4.7.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

#### 6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.7.5.2 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
华泰长城资本管理有限公司	5,200.00	0.00%	214,900.00	0.00%
华泰证券股份有限公司	19,216,433.00	0.37%	3,957,517.00	0.07%
华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	18,843,530.00	0.37%	33,437,061.00	0.62%
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,048,870,727.00	20.37%	1,222,329,927.00	22.55%
兴业证券股份有限公司	86,000.00	0.00%	741,300.00	0.01%
兴业证券股份有限公司融券专用证券账户	22,493,900.00	0.44%	957,500.00	0.02%

注：华泰证券、兴业证券、华泰长城，南方中证 500ETF 联接基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6.4.7.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国农业银行	345,324,985.14	2,938,211.04	166,837,589.28	5,266,584.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合证券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	9,246	307,152.12
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80

兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/张）	总金额
兴业证券股 份有限公司	000750	国海证券	网上申购	8,707,956	28,300,857.0 0

#### 6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.9 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位： 股）	期末成本 总额	期末估值 总额	备
002294	信立泰	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 24 日	非公开 发行锁 定期	28.37	30.82	2,114,90 9	59,999,968. 33	65,181,495. 38	
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	创业板 新股锁 定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板 新股锁 定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板 新股锁 定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	
300942	易瑞生物	2021 年	2021 年	创业板	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	

		2月2日	8月9日	新股锁定期						
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	创业板新股锁定期	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	锁定期转增	-	27.42	108	-	2,961.36	
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板新股锁定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	创业板新股锁定期	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板新股锁定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板新股锁定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板新股锁定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板新股锁定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	创业板新股锁定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板新股锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板新股锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月	创业板新股锁	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	

		日	26 日	定期						
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业板 新股锁 定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板 新股锁 定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	创业板 新股锁 定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	创业板 新股锁 定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	创业板 新股锁 定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 新股锁 定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 新股锁 定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	创业板 新股锁 定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板 新股锁 定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	创业板 新股锁 定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板 新股锁 定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	

301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	创业板 新股锁 定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	创业板 新股锁 定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	创业板 新股锁 定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	创业板 新股锁 定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	
600733	北汽蓝谷	2021 年 5 月 10 日	2021 年 11 月 10 日	大宗受 限锁定	12.84	12.12	5,000,00 0	64,200,000. 00	60,600,000. 00	
600733	北汽蓝谷	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 12 日	大宗受 限锁定	14.13	12.11	4,500,00 0	63,585,000. 00	54,495,000. 00	
601865	福莱特	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 19 日	非公开 发行锁 定期	29.57	38.08	287,447	8,499,807.7 9	10,945,981. 76	
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
688067	爱威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	科创板 新股锁 定期	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	
688076	诺泰生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	科创板 新股锁 定期	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	
688208	道通科技	2021 年	2021 年	大宗受	68.75	80.19	660,000	45,375,000.	52,925,400.	



		6月1日	12月1日	限锁定				00	00	
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	科创板新股锁定期	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	科创板新股锁定期	2.65	3.38	313,555	830,920.75	1,059,815.90	
688628	优利德	2021年1月22日	2021年8月2日	科创板新股锁定期	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	创业板新股锁定期	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备
113051	节能转债	2021年6月22日	2021年7月22日	配债未上市	200.00	100.00	95,260	9,526,000.00	9,526,000.00	

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，

自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.9.2 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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	4,811,973	120,886,885.34	271,154,678.55	
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	18,153,579	65,675,972.19	55,368,415.95	

本基金截至 2021 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	002709	天赐材料	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	106.58	942,500.00	100,451,650.00
2	000799	酒鬼酒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	255.60	350,000.00	89,460,000.00
3	600089	特变电工	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.85	6,109,700.00	78,509,645.00
4	000009	中国宝安	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.27	4,245,900.00	77,572,593.00
5	002340	格林美	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.35	7,873,900.00	73,620,965.00
6	002074	国轩高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	43.56	1,684,900.00	73,394,244.00
7	600460	士兰微	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	56.35	1,294,800.00	72,961,980.00
8	300285	国瓷材料	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	48.75	1,319,700.00	64,335,375.00
9	601233	桐昆股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	24.09	2,635,700.00	63,494,013.00
10	300207	欣旺达	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	32.56	1,814,000.00	59,063,840.00

11	002185	华天科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	15.39	3,603,100.0 0	55,451,709. 00
12	600885	宏发股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	62.70	858,600.00	53,834,220. 00
13	300316	晶盛机电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	50.50	1,058,700.0 0	53,464,350. 00
14	601636	旗滨集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.56	2,652,300.0 0	49,226,688. 00
15	300146	汤臣倍健	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	32.90	1,399,000.0 0	46,027,100. 00
16	300253	卫宁健康	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 26 日	16.27	2,810,000.0 0	45,718,700. 00
17	300037	新 宙 邦	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	100.10	455,100.00	45,555,510. 00
18	002648	卫星石化	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	39.19	1,133,400.0 0	44,417,946. 00
19	600884	杉杉股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	23.32	1,872,100.0 0	43,657,372. 00
20	600219	南山铝业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.60	11,803,500. 00	42,492,600. 00
21	002223	鱼跃医疗	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	38.13	1,112,000.0 0	42,400,560. 00

			月 21 日			
22	002353	杰瑞股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	44.70	946,200.00	42,295,140.00
23	002138	顺络电子	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	38.77	1,062,400.00	41,189,248.00
24	603737	三棵树	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	176.00	230,000.00	40,480,000.00
25	000547	航天发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.87	2,112,800.00	39,868,536.00
26	002797	第一创业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.14	5,536,100.00	39,527,754.00
27	601127	小康股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	66.67	587,800.00	39,188,626.00
28	000988	华工科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	23.52	1,651,700.00	38,847,984.00
29	002212	天融信	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	19.77	1,950,500.00	38,561,385.00
30	002444	巨星科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	34.08	1,128,800.00	38,469,504.00
31	600704	物产中大	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.87	4,877,100.00	38,382,777.00
32	601099	太平洋	2021 年 7 月 1 日-	3.39	11,209,500.00	38,000,205.00

			2021 年 7 月 21 日			
33	600779	水井坊	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 16 日	126.35	300,000.00	37,905,000.00
34	603589	口子窖	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	67.69	557,500.00	37,737,175.00
35	002385	大北农	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	6.80	5,518,800.00	37,527,840.00
36	601168	西部矿业	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	11.93	3,137,400.00	37,429,182.00
37	600739	辽宁成大	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	20.81	1,785,400.00	37,154,174.00
38	000807	云铝股份	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	11.90	3,087,600.00	36,742,440.00
39	300308	中际旭创	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	38.52	949,200.00	36,563,184.00
40	002422	科伦药业	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	19.95	1,827,000.00	36,448,650.00
41	600563	法拉电子	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 16 日	158.36	230,000.00	36,422,800.00
42	002439	启明星辰	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 21 日	29.01	1,243,200.00	36,065,232.00
43	688099	晶晨股份	2021 年 7	112.20	320,000.00	35,904,000.00

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			00
44	300699	光威复材	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	75.95	471,500.00	35,810,425. 00
45	600862	中航高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	30.78	1,159,200.0 0	35,680,176. 00
46	000830	鲁西化工	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.73	1,903,000.0 0	35,643,190. 00
47	000636	风华高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	30.22	1,178,600.0 0	35,617,292. 00
48	600392	盛和资源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.36	2,045,800.0 0	35,515,088. 00
49	002078	太阳纸业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.35	2,625,400.0 0	35,049,090. 00
50	688002	睿创微纳	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	99.83	350,000.00	34,940,500. 00
51	600699	均胜电子	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	25.52	1,365,400.0 0	34,845,008. 00
52	002030	达安基因	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	21.24	1,638,000.0 0	34,791,120. 00
53	002180	纳思达	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	32.20	1,075,200.0 0	34,621,440. 00

54	600068	葛洲坝	2021年7月1日-2021年7月21日	7.49	4,604,000.00	34,483,960.00
55	002250	联化科技	2021年7月1日-2021年7月21日	27.90	1,231,000.00	34,344,900.00
56	601117	中国化学	2021年7月1日-2021年7月21日	8.76	3,916,300.00	34,306,788.00
57	300088	长信科技	2021年7月1日-2021年7月21日	8.26	4,084,000.00	33,733,840.00
58	000630	铜陵有色	2021年7月1日-2021年7月21日	2.72	12,274,000.00	33,385,280.00
59	002507	涪陵榨菜	2021年7月1日-2021年7月21日	37.66	876,100.00	32,993,926.00
60	600201	生物股份	2021年7月1日-2021年7月21日	17.45	1,873,200.00	32,687,340.00
61	002013	中航机电	2021年7月1日-2021年7月21日	10.07	3,237,800.00	32,604,646.00
62	600486	扬农化工	2021年7月1日-2021年7月16日	111.77	290,000.00	32,413,300.00
63	000039	中集集团	2021年7月1日-2021年7月21日	18.18	1,777,000.00	32,305,860.00
64	002075	沙钢股份	2021年7月1日-2021年7月21日	10.91	2,937,000.00	32,042,670.00



			月 21 日			
65	600754	锦江酒店	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	56.95	559,600.00	31,869,220.00
66	600315	上海家化	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	60.14	522,000.00	31,393,080.00
67	002127	南极电商	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.77	3,194,300.00	31,208,311.00
68	002028	思源电气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	30.79	1,012,600.00	31,177,954.00
69	601997	贵阳银行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.16	4,267,200.00	30,553,152.00
70	300001	特锐德	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	30.11	1,013,100.00	30,504,441.00
71	600177	雅戈尔	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.59	4,627,600.00	30,495,884.00
72	002511	中顺洁柔	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	27.55	1,092,000.00	30,084,600.00
73	601005	重庆钢铁	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.67	11,178,800.00	29,847,396.00
74	000021	深科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	19.14	1,558,600.00	29,831,604.00
75	002273	水晶光电	2021 年 7 月 1 日-	14.69	2,029,000.00	29,806,010.00

			2021 年 7 月 21 日			
76	002299	圣农发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	23.88	1,243,200.0 0	29,687,616. 00
77	600549	厦门钨业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.83	1,415,800.0 0	29,491,114. 00
78	002092	中泰化学	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.27	2,856,800.0 0	29,339,336. 00
79	300223	北京君正	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	100.92	290,000.00	29,266,800. 00
80	002080	中材科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	26.17	1,117,200.0 0	29,237,124. 00
81	002603	以岭药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	29.16	995,800.00	29,037,528. 00
82	002465	海格通信	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.46	3,066,800.0 0	29,011,928. 00
83	000050	深天马 A	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.18	2,045,800.0 0	29,009,444. 00
84	300168	万达信息	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.60	1,978,600.0 0	28,887,560. 00
85	000739	普洛药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	29.40	979,000.00	28,782,600. 00
86	300009	安科生物	2021 年 7	14.90	1,911,400.0	28,479,860.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日		0	00
87	000825	太钢不锈	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.49	3,800,600.0 0	28,466,494. 00
88	000983	山西焦煤	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.31	3,410,400.0 0	28,340,424. 00
89	600867	通化东宝	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.94	2,373,400.0 0	28,338,396. 00
90	600516	方大炭素	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.44	3,801,400.0 0	28,282,416. 00
91	601128	常熟银行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.20	4,557,400.0 0	28,255,880. 00
92	600171	上海贝岭	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	30.43	926,600.00	28,196,438. 00
93	000998	隆平高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.04	1,755,600.0 0	28,159,824. 00
94	600637	东方明珠	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.19	3,415,000.0 0	27,968,850. 00
95	300357	我武生物	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	64.12	435,800.00	27,943,496. 00
96	600988	赤峰黄金	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.99	1,848,000.0 0	27,701,520. 00

97	600418	江淮汽车	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.43	2,209,200.0 0	27,460,356. 00
98	000513	丽珠集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	50.02	547,600.00	27,390,952. 00
99	300482	万孚生物	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	64.69	423,100.00	27,370,339. 00
100	600879	航天电子	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.52	3,621,200.0 0	27,231,424. 00
101	600369	西南证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.87	5,535,600.0 0	26,958,372. 00
102	300070	碧水源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.31	3,684,600.0 0	26,934,426. 00
103	000932	华菱钢铁	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.60	4,078,600.0 0	26,918,760. 00
104	600487	亨通光电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.40	2,361,200.0 0	26,917,680. 00
105	600827	百联股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.15	1,335,600.0 0	26,912,340. 00
106	600066	宇通客车	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.49	2,152,600.0 0	26,885,974. 00
107	000750	国海证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	4.24	6,340,600.0 0	26,884,144. 00

			月 21 日			
108	600380	健康元	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.73	1,953,400.0 0	26,820,182. 00
109	300618	寒锐钴业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	78.84	340,000.00	26,805,600. 00
110	002156	通富微电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	24.04	1,105,000.0 0	26,564,200. 00
111	300271	华宇软件	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	19.25	1,378,400.0 0	26,534,200. 00
112	300296	利亚德	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.82	3,386,000.0 0	26,478,520. 00
113	600166	福田汽车	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.45	7,655,600.0 0	26,411,820. 00
114	300244	迪安诊断	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	38.30	689,200.00	26,396,360. 00
115	002373	千方科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.70	1,579,200.0 0	26,372,640. 00
116	000975	银泰黄金	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.51	2,772,800.0 0	26,369,328. 00
117	002131	利欧股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.34	11,252,200. 00	26,330,148. 00
118	600536	中国软件	2021 年 7 月 1 日-	56.93	462,400.00	26,324,432. 00

			2021 年 7 月 21 日			
119	002152	广电运通	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.03	2,017,200.0 0	26,284,116. 00
120	601615	明阳智能	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.19	1,622,000.0 0	26,260,180. 00
121	600316	洪都航空	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	38.48	681,000.00	26,204,880. 00
122	600909	华安证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.57	4,696,400.0 0	26,158,948. 00
123	000960	锡业股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.03	1,628,100.0 0	26,098,443. 00
124	300383	光环新网	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.39	1,797,600.0 0	25,867,464. 00
125	600529	山东药玻	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	33.95	759,300.00	25,778,235. 00
126	002572	索 菲 亚	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	24.20	1,063,000.0 0	25,724,600. 00
127	000723	美锦能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.56	3,392,000.0 0	25,643,520. 00
128	300463	迈克生物	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	42.09	607,100.00	25,552,839. 00
129	601689	拓普集团	2021 年 7	37.43	682,300.00	25,538,489.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			00
130	002926	华西证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.63	2,624,600.0 0	25,274,898. 00
131	600642	申能股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.14	4,087,000.0 0	25,094,180. 00
132	601866	中远海发	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.75	6,606,200.0 0	24,773,250. 00
133	600038	中直股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	52.74	469,500.00	24,761,430. 00
134	300115	长盈精密	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.60	1,183,200.0 0	24,373,920. 00
135	688208	道通科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	86.99	280,000.00	24,357,200. 00
136	600271	航天信息	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.03	1,851,800.0 0	24,128,954. 00
137	002500	山西证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.71	3,579,200.0 0	24,016,432. 00
138	000623	吉林敖东	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	15.49	1,550,200.0 0	24,012,598. 00
139	600998	九州通	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	15.37	1,558,600.0 0	23,955,682. 00

140	002690	美亚光电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	55.76	428,900.00	23,915,464.00
141	601198	东兴证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.93	2,184,600.00	23,877,678.00
142	603156	养元饮品	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	28.58	833,700.00	23,827,146.00
143	603605	珀莱雅	2021 年 7 月 5 日- 2021 年 7 月 23 日	196.71	120,000.00	23,605,200.00
144	600895	张江高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.27	1,289,800.00	23,564,646.00
145	601699	潞安环能	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.81	1,994,600.00	23,556,226.00
146	002065	东华软件	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.93	2,968,000.00	23,536,240.00
147	300474	景嘉微	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	97.92	240,000.00	23,500,800.00
148	600415	小商品城	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.15	4,562,800.00	23,498,420.00
149	000012	南玻 A	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.24	2,281,800.00	23,365,632.00
150	600153	建发股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.10	2,861,400.00	23,177,340.00



			月 21 日			
151	600188	兖州煤业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	15.36	1,483,000.0 0	22,778,880. 00
152	600256	广汇能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.33	6,751,400.0 0	22,482,162. 00
153	300418	昆仑万维	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.38	1,365,400.0 0	22,365,252. 00
154	600390	五矿资本	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.98	3,738,800.0 0	22,358,024. 00
155	600667	太极实业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.10	2,453,600.0 0	22,327,760. 00
156	603260	合盛硅业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	76.91	290,000.00	22,303,900. 00
157	300024	机器人	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.67	2,075,600.0 0	22,146,652. 00
158	600535	天士力	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.81	1,494,000.0 0	22,126,140. 00
159	600008	首创环保	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.01	7,342,400.0 0	22,100,624. 00
160	600060	海信视像	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.90	1,302,800.0 0	22,017,320. 00
161	002670	国盛金控	2021 年 7 月 1 日-	11.39	1,932,000.0 0	22,005,480. 00

			2021 年 7 月 21 日			
162	603638	艾迪精密	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	42.87	511,600.00	21,932,292.00
163	600497	驰宏锌锗	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.31	5,086,600.00	21,923,246.00
164	002372	伟星新材	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.67	1,059,200.00	21,893,664.00
165	000027	深圳能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.17	2,381,000.00	21,833,770.00
166	000878	云南铜业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.83	1,700,600.00	21,818,698.00
167	600733	北汽蓝谷	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	13.48	1,615,000.00	21,770,200.00
168	300630	普利制药	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	52.40	415,400.00	21,766,960.00
169	600155	华创阳安	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.70	2,032,800.00	21,750,960.00
170	603858	步长制药	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	22.49	953,000.00	21,432,970.00
171	600707	彩虹股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.41	2,275,700.00	21,414,337.00
172	600765	中航重机	2021 年 7	22.65	940,800.00	21,309,120.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			00
173	002382	蓝帆医疗	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.85	1,020,500.0 0	21,277,425. 00
174	600372	中航电子	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.55	1,285,200.0 0	21,270,060. 00
175	002019	亿帆医药	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.25	1,231,000.0 0	21,234,750. 00
176	300251	光线传媒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.81	1,956,400.0 0	21,148,684. 00
177	600141	兴发集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.83	1,117,200.0 0	21,036,876. 00
178	002221	东华能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.95	1,919,800.0 0	21,021,810. 00
179	000718	苏宁环球	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.29	2,528,400.0 0	20,960,436. 00
180	600409	三友化工	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.11	2,058,800.0 0	20,814,468. 00
181	002174	游族网络	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.17	1,207,200.0 0	20,727,624. 00
182	600208	新湖中宝	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.04	6,806,700.0 0	20,692,368. 00

183	600498	烽火通信	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	18.63	1,107,000.0 0	20,623,410. 00
184	600170	上海建工	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.76	7,420,200.0 0	20,479,752. 00
185	002390	信邦制药	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.48	1,948,800.0 0	20,423,424. 00
186	600875	东方电气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.97	1,852,600.0 0	20,323,022. 00
187	000997	新大陆	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.59	1,222,600.0 0	20,282,934. 00
188	601717	郑煤机	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.63	1,735,000.0 0	20,178,050. 00
189	300058	蓝色光标	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.05	3,318,800.0 0	20,078,740. 00
190	002146	荣盛发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.64	3,534,200.0 0	19,932,888. 00
191	600801	华新水泥	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.57	1,134,000.0 0	19,924,380. 00
192	000738	航发控制	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.83	953,800.00	19,867,654. 00
193	600160	巨化股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	8.84	2,247,400.0 0	19,867,016. 00

			月 21 日			
194	000401	冀东水泥	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.35	1,608,000.0 0	19,858,800. 00
195	002958	青农商行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.28	4,626,200.0 0	19,800,136. 00
196	000686	东北证券	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.45	2,339,800.0 0	19,771,310. 00
197	002683	宏大爆破	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	27.77	707,000.00	19,633,390. 00
198	300315	掌趣科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.25	4,584,200.0 0	19,482,850. 00
199	002506	协鑫集成	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.48	5,579,700.0 0	19,417,356. 00
200	600511	国药股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	33.06	585,600.00	19,359,936. 00
201	002195	二三四五	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.03	9,525,800.0 0	19,337,374. 00
202	002557	洽洽食品	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	43.10	447,700.00	19,295,870. 00
203	002268	卫士通	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	19.48	986,600.00	19,218,968. 00
204	300017	网宿科技	2021 年 7 月 1 日-	5.85	3,272,200.0 0	19,142,370. 00

			2021 年 7 月 21 日			
205	000540	中天金融	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.73	7,008,600.0 0	19,133,478. 00
206	600325	华发股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.74	2,822,400.0 0	19,022,976. 00
207	688029	南微医学	2021 年 7 月 5 日- 2021 年 7 月 23 日	311.69	61,000.00	19,013,090. 00
208	600663	陆家嘴	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.32	1,426,800.0 0	19,004,976. 00
209	002408	齐翔腾达	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.42	1,528,000.0 0	18,977,760. 00
210	600258	首旅酒店	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	23.86	785,200.00	18,734,872. 00
211	601992	金隅集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.69	6,953,600.0 0	18,705,184. 00
212	601016	节能风电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.74	4,995,800.0 0	18,684,292. 00
213	600027	华电国际	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.44	5,418,000.0 0	18,637,920. 00
214	000961	中南建设	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.92	3,143,200.0 0	18,607,744. 00
215	603707	健友股份	2021 年 7	41.75	443,700.00	18,524,475.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			00
216	603077	和邦生物	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.08	8,833,800.0 0	18,374,304. 00
217	000158	常山北明	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.49	1,596,000.0 0	18,338,040. 00
218	002429	兆驰股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.07	3,016,400.0 0	18,309,548. 00
219	600282	南钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.56	5,115,600.0 0	18,211,536. 00
220	603866	桃李面包	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	31.20	583,500.00	18,205,200. 00
221	002191	劲嘉股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.64	1,709,800.0 0	18,192,272. 00
222	600500	中化国际	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.86	2,306,200.0 0	18,126,732. 00
223	600567	山鹰国际	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.45	5,245,900.0 0	18,098,355. 00
224	600528	中铁工业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.10	2,218,400.0 0	17,969,040. 00
225	600216	浙江医药	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.01	1,121,800.0 0	17,960,018. 00

226	000060	中金岭南	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.52	3,968,000.0 0	17,935,360. 00
227	600839	四川长虹	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.91	6,155,600.0 0	17,912,796. 00
228	600859	王府井	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	28.88	620,100.00	17,908,488. 00
229	688088	虹软科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	55.75	320,000.00	17,840,000. 00
230	002056	横店东磁	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.00	1,369,200.0 0	17,799,600. 00
231	600737	中粮糖业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.01	1,777,000.0 0	17,787,770. 00
232	000898	鞍钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.45	3,993,800.0 0	17,772,410. 00
233	002081	金螳螂	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.92	2,230,600.0 0	17,666,352. 00
234	603198	迎驾贡酒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	44.30	395,800.00	17,533,940. 00
235	601577	长沙银行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.94	1,959,800.0 0	17,520,612. 00
236	600598	北大荒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	14.96	1,170,300.0 0	17,507,688. 00



			月 21 日			
237	000671	阳光城	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.20	3,346,400.0 0	17,401,280. 00
238	000709	河钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.46	7,069,800.0 0	17,391,708. 00
239	002203	海亮股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.64	1,629,600.0 0	17,338,944. 00
240	600580	卧龙电驱	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.30	1,302,800.0 0	17,327,240. 00
241	600728	佳都科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.41	2,335,200.0 0	17,303,832. 00
242	300182	捷成股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.99	3,431,800.0 0	17,124,682. 00
243	600808	马钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.29	3,965,600.0 0	17,012,424. 00
244	000729	燕京啤酒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.24	2,349,000.0 0	17,006,760. 00
245	300212	易华录	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	26.91	631,600.00	16,996,356. 00
246	603712	七一二	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	36.10	467,000.00	16,858,700. 00
247	603883	老百姓	2021 年 7 月 1 日-	52.68	320,000.00	16,857,600. 00

			2021 年 7 月 21 日			
248	000930	中粮科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.01	1,861,000.0 0	16,767,610. 00
249	000999	华润三九	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	26.75	626,700.00	16,764,225. 00
250	002595	豪迈科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	26.70	625,100.00	16,690,170. 00
251	600820	隧道股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.29	3,146,200.0 0	16,643,398. 00
252	002281	光迅科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	24.60	676,400.00	16,639,440. 00
253	300166	东方国信	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.36	1,344,800.0 0	16,621,728. 00
254	002010	传化智联	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.71	2,152,900.0 0	16,598,859. 00
255	000488	晨鸣纸业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.14	2,037,400.0 0	16,584,436. 00
256	002745	木林森	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.40	1,234,800.0 0	16,546,320. 00
257	000581	威孚高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.83	792,600.00	16,509,858. 00
258	000629	攀钢钒钛	2021 年 7	2.29	7,160,600.0	16,397,774.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日		0	00
259	002004	华邦健康	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.21	2,633,800.0 0	16,355,898. 00
260	002387	维信诺	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.43	1,554,300.0 0	16,211,349. 00
261	688321	微芯生物	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	46.19	350,000.00	16,166,500. 00
262	002563	森马服饰	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.95	1,348,600.0 0	16,115,770. 00
263	600755	厦门国贸	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.21	1,948,800.0 0	15,999,648. 00
264	002124	天邦股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.01	2,281,200.0 0	15,991,212. 00
265	600970	中材国际	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.17	1,738,800.0 0	15,944,796. 00
266	603444	吉比特	2021 年 7 月 5 日- 2021 年 7 月 23 日	530.00	30,000.00	15,900,000. 00
267	002396	星网锐捷	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	21.35	744,500.00	15,895,075. 00
268	300002	神州泰岳	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.85	3,260,800.0 0	15,814,880. 00

269	600022	山东钢铁	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	1.72	9,116,400.0 0	15,680,208. 00
270	600803	新奥股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.51	949,200.00	15,671,292. 00
271	603000	人 民 网	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.19	908,400.00	15,615,396. 00
272	600398	海澜之家	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.24	2,155,000.0 0	15,602,200. 00
273	600037	歌华有线	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.61	1,621,200.0 0	15,579,732. 00
274	000598	兴蓉环境	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.21	2,982,000.0 0	15,536,220. 00
275	601106	中国一重	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.39	4,579,400.0 0	15,524,166. 00
276	600881	亚泰集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.85	5,404,400.0 0	15,402,540. 00
277	002048	宁波华翔	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	19.50	776,400.00	15,139,800. 00
278	600811	东方集团	2021 年 7 月 14 日- 2021 年 7 月 21 日	3.05	4,950,600.0 0	15,099,330. 00
279	603885	吉祥航空	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	15.26	982,800.00	14,997,528. 00

			月 21 日			
280	000883	湖北能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.59	3,257,600.0 0	14,952,384. 00
281	600039	四川路桥	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.27	2,382,600.0 0	14,938,902. 00
282	000778	新兴铸管	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.72	3,996,800.0 0	14,868,096. 00
283	600348	华阳股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.42	1,999,200.0 0	14,834,064. 00
284	600782	新钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.58	2,658,200.0 0	14,832,756. 00
285	000690	宝新能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.11	2,895,000.0 0	14,793,450. 00
286	600260	ST 凯 乐	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.88	1,663,200.0 0	14,769,216. 00
287	000887	中鼎股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.08	1,218,800.0 0	14,723,104. 00
288	600597	光明乳业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.41	1,020,200.0 0	14,701,082. 00
289	002002	鸿达兴业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.93	3,739,200.0 0	14,695,056. 00
290	002242	九阳股份	2021 年 7 月 1 日-	32.49	451,400.00	14,665,986. 00

			2021 年 7 月 21 日			
291	601118	海南橡胶	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.09	2,856,000.0 0	14,537,040. 00
292	600126	杭钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.13	2,810,200.0 0	14,416,326. 00
293	600967	内蒙一机	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.12	1,423,400.0 0	14,404,808. 00
294	002925	盈趣科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	38.91	370,000.00	14,396,700. 00
295	002085	万丰奥威	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.60	2,549,000.0 0	14,274,400. 00
296	600026	中远海能	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.16	2,314,600.0 0	14,257,936. 00
297	601880	辽港股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	1.71	8,318,200.0 0	14,224,122. 00
298	600718	东软集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.78	1,449,400.0 0	14,175,132. 00
299	002701	奥瑞金	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.14	2,755,200.0 0	14,161,728. 00
300	002183	怡亚通	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.73	2,470,400.0 0	14,155,392. 00
301	000528	柳工	2021 年 7	8.20	1,722,800.0	14,126,960.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日		0	00
302	601179	中国西电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.12	3,408,200.0 0	14,041,784. 00
303	600410	华胜天成	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.76	1,787,600.0 0	13,871,776. 00
304	600572	康恩贝	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.44	3,115,600.0 0	13,833,264. 00
305	002110	三钢闽光	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.74	2,038,200.0 0	13,737,468. 00
306	000877	天山股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.03	1,050,000.0 0	13,681,500. 00
307	603568	伟明环保	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	22.83	596,800.00	13,624,944. 00
308	600446	金证股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.44	940,800.00	13,585,152. 00
309	600167	联美控股	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.93	1,521,200.0 0	13,584,316. 00
310	000970	中科三环	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.55	1,419,600.0 0	13,557,180. 00
311	002249	大洋电机	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.25	2,565,600.0 0	13,469,400. 00

312	300072	三聚环保	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.74	2,339,800.0 0	13,430,452. 00
313	000402	金 融 街	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.75	1,987,000.0 0	13,412,250. 00
314	002266	浙富控股	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.99	2,680,400.0 0	13,375,196. 00
315	600064	南京高科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.29	1,437,200.0 0	13,351,588. 00
316	002128	露天煤业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.41	1,277,600.0 0	13,299,816. 00
317	601598	中国外运	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.05	2,629,200.0 0	13,277,460. 00
318	000990	诚志股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.73	1,041,600.0 0	13,259,568. 00
319	000089	深圳机场	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.77	1,706,000.0 0	13,255,620. 00
320	002368	太极股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	20.06	652,600.00	13,091,156. 00
321	600645	中源协和	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	22.95	566,200.00	12,994,290. 00
322	600517	国网英大	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	6.81	1,907,600.0 0	12,990,756. 00



			月 21 日			
323	600329	中新药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	28.09	456,300.00	12,817,467.00
324	600158	中体产业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.41	1,121,000.00	12,790,610.00
325	000400	许继电气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.66	1,008,000.00	12,761,280.00
326	300026	红日药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.25	2,998,800.00	12,744,900.00
327	002705	新宝股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	26.25	484,700.00	12,723,375.00
328	000519	中兵红箭	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.72	1,163,800.00	12,475,936.00
329	601718	际华集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.82	4,400,000.00	12,408,000.00
330	601975	招商南油	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.14	5,768,600.00	12,344,804.00
331	000959	首钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.62	2,174,800.00	12,222,376.00
332	600507	方大特钢	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.78	1,793,000.00	12,156,540.00
333	002233	塔牌集团	2021 年 7 月 1 日-	10.28	1,175,800.00	12,087,224.00

			2021 年 7 月 21 日			
334	600307	酒钢宏兴	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.32	5,196,600.0 0	12,056,112. 00
335	600376	首开股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.60	2,149,600.0 0	12,037,760. 00
336	000090	天健集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.53	2,176,400.0 0	12,035,492. 00
337	000685	中山公用	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.16	1,474,600.0 0	12,032,736. 00
338	601333	广深铁路	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.12	5,650,200.0 0	11,978,424. 00
339	601000	唐山港	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.41	4,932,400.0 0	11,887,084. 00
340	600195	中牧股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.96	992,200.00	11,866,712. 00
341	001914	招商积余	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.18	687,000.00	11,802,660. 00
342	600435	北方导航	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.94	1,483,000.0 0	11,775,020. 00
343	600120	浙江东方	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.28	2,745,200.0 0	11,749,456. 00
344	000559	万向钱潮	2021 年 7	5.31	2,204,600.0	11,706,426.

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日		0	00
345	002505	鹏都农牧	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.24	5,177,900.0 0	11,598,496. 00
346	600804	鹏 博 士	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.84	2,378,800.0 0	11,513,392. 00
347	002839	张家港行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.44	2,105,400.0 0	11,453,376. 00
348	600673	东 阳 光	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.49	2,514,600.0 0	11,290,554. 00
349	603228	景旺电子	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	26.20	430,900.00	11,289,580. 00
350	300133	华策影视	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.92	1,895,400.0 0	11,220,768. 00
351	600373	中文传媒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.86	1,133,200.0 0	11,173,352. 00
352	601860	紫金银行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.63	3,053,000.0 0	11,082,390. 00
353	002440	闰土股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.85	1,244,400.0 0	11,012,940. 00
354	000758	中色股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.75	2,297,000.0 0	10,910,750. 00

355	000967	盈峰环境	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.87	1,586,800.0 0	10,901,316. 00
356	601991	大唐发电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.64	4,120,600.0 0	10,878,384. 00
357	002155	湖南黄金	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.75	1,398,200.0 0	10,836,050. 00
358	601608	中信重工	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.74	2,897,200.0 0	10,835,528. 00
359	002038	双鹭药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.53	1,028,600.0 0	10,831,158. 00
360	600582	天地科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.90	2,759,000.0 0	10,760,100. 00
361	600056	中国医药	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.15	879,800.00	10,689,570. 00
362	600388	龙净环保	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.52	1,251,600.0 0	10,663,632. 00
363	000563	陕国投 A	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.22	3,287,600.0 0	10,586,072. 00
364	600643	爱建集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.98	1,505,400.0 0	10,507,692. 00
365	601098	中南传媒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	8.82	1,179,500.0 0	10,403,190. 00

			月 21 日			
366	601958	金钼股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.48	1,605,200.0 0	10,401,696. 00
367	600901	江苏租赁	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.20	1,982,400.0 0	10,308,480. 00
368	600266	城建发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.74	2,165,100.0 0	10,262,574. 00
369	600062	华润双鹤	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.91	858,600.00	10,225,926. 00
370	300180	华峰超纤	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.95	2,058,000.0 0	10,187,100. 00
371	600959	江苏有线	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.05	3,334,000.0 0	10,168,700. 00
372	002416	爱 施 德	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.03	1,007,800.0 0	10,108,234. 00
373	600131	国网信通	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.24	759,300.00	10,053,132. 00
374	600649	城投控股	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.76	2,100,000.0 0	9,996,000.0 0
375	600094	大 名 城	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.77	2,642,200.0 0	9,961,094.0 0
376	000415	渤海租赁	2021 年 7 月 1 日-	2.42	4,114,600.0 0	9,957,332.0 0

			2021 年 7 月 21 日			
377	002399	海普瑞	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	15.93	623,600.00	9,933,948.00
378	600928	西安银行	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.66	2,119,400.00	9,876,404.00
379	002458	益生股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.97	987,400.00	9,844,378.00
380	600776	东方通信	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.40	793,000.00	9,833,200.00
381	000681	视觉中国	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.93	758,400.00	9,806,112.00
382	600259	广晟有色	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	33.81	290,000.00	9,804,900.00
383	300113	顺网科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.94	754,800.00	9,767,112.00
384	600006	东风汽车	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.30	1,331,800.00	9,722,140.00
385	601611	中国核建	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.22	1,319,600.00	9,527,512.00
386	600633	浙数文化	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.18	1,305,800.00	9,375,644.00
387	600764	中国海防	2021 年 7	28.30	330,000.00	9,339,000.00

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			0
388	002317	众生药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.61	1,083,600.0 0	9,329,796.0 0
389	000717	韶钢松山	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.59	2,012,200.0 0	9,235,998.0 0
390	601928	凤凰传媒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.14	1,276,000.0 0	9,110,640.0 0
391	002434	万里扬	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.11	1,121,000.0 0	9,091,310.0 0
392	000028	国药一致	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	37.84	240,000.00	9,081,600.0 0
393	300257	开山股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.37	629,000.00	9,038,730.0 0
394	600546	山煤国际	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.18	1,256,600.0 0	9,022,388.0 0
395	600863	内蒙华电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.33	3,867,000.0 0	9,010,110.0 0
396	600021	上海电力	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.91	1,303,600.0 0	9,007,876.0 0
397	000078	海王生物	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.26	2,740,000.0 0	8,932,400.0 0

398	000501	鄂武商 A	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.70	763,400.00	8,931,780.0 0
399	002375	亚厦股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.92	1,116,400.0 0	8,841,888.0 0
400	600729	重庆百货	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	27.45	320,000.00	8,784,000.0 0
401	600648	外 高 桥	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.78	594,100.00	8,780,798.0 0
402	601828	美 凯 龙	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.00	731,300.00	8,775,600.0 0
403	603355	莱克电气	2021 年 7 月 5 日	62.23	140,600.00	8,749,538.0 0
404	002294	信 立 泰	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	32.90	265,600.00	8,738,240.0 0
405	600968	海油发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.59	3,370,000.0 0	8,728,300.0 0
406	002244	滨江集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.19	2,071,800.0 0	8,680,842.0 0
407	600717	天 津 港	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.92	2,181,240.0 0	8,550,460.8 0
408	000869	张 裕 A	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	37.14	230,000.00	8,542,200.0 0
409	000062	深圳华强	2021 年 7	16.91	496,700.00	8,399,197.0



			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			0
410	002424	贵州百灵	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.36	1,133,100.0 0	8,339,616.0 0
411	600835	上海机电	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	16.25	512,000.00	8,320,000.0 0
412	600623	华谊集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.81	940,800.00	8,288,448.0 0
413	600339	中油工程	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.84	2,793,400.0 0	7,933,256.0 0
414	600566	济川药业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.90	440,700.00	7,888,530.0 0
415	600312	平高电气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.84	1,349,400.0 0	7,880,496.0 0
416	600787	中储股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.33	1,470,000.0 0	7,835,100.0 0
417	600377	宁沪高速	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.76	799,200.00	7,800,192.0 0
418	002583	海能达	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.04	1,532,600.0 0	7,724,304.0 0
419	000031	大悦城	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.60	2,142,000.0 0	7,711,200.0 0

420	601969	海南矿业	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	11.63	660,200.00	7,678,126.0 0
421	600823	世茂股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	4.04	1,867,200.0 0	7,543,488.0 0
422	000826	启迪环境	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.35	1,389,500.0 0	7,433,825.0 0
423	600466	蓝光发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.95	2,517,000.0 0	7,425,150.0 0
424	002468	申通快递	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.62	968,000.00	7,376,160.0 0
425	000156	华数传媒	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.71	924,800.00	7,130,208.0 0
426	601298	青 岛 港	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.18	1,139,800.0 0	7,043,964.0 0
427	603888	新 华 网	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	21.17	330,000.00	6,986,100.0 0
428	000937	冀中能源	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.93	1,769,400.0 0	6,953,742.0 0
429	600639	浦东金桥	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	13.65	499,500.00	6,818,175.0 0
430	000813	德展健康	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7	4.54	1,494,400.0 0	6,784,576.0 0

			月 21 日			
431	002302	西部建设	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	7.90	843,800.00	6,666,020.0 0
432	603708	家家悦	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	17.37	380,000.00	6,600,600.0 0
433	300010	豆神教育	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.67	1,163,000.0 0	6,594,210.0 0
434	601228	广州港	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.18	2,069,400.0 0	6,580,692.0 0
435	002635	安洁科技	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	14.63	445,900.00	6,523,517.0 0
436	600350	山东高速	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.15	1,034,000.0 0	6,359,100.0 0
437	601139	深圳燃气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.56	957,600.00	6,281,856.0 0
438	000061	农产品	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.52	1,125,600.0 0	6,213,312.0 0
439	603515	欧普照明	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	25.67	240,000.00	6,160,800.0 0
440	600871	石化油服	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	1.97	3,101,200.0 0	6,109,364.0 0
441	000046	泛海控股	2021 年 7 月 1 日-	2.30	2,599,400.0 0	5,978,620.0 0

			2021 年 7 月 21 日			
442	603377	东方时尚	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	10.69	556,440.00	5,948,343.60
443	600640	号百控股	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	12.19	466,200.00	5,682,978.00
444	002653	海思科	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	21.52	260,000.00	5,595,200.00
445	603379	三美股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	18.71	290,000.00	5,425,900.00
446	002419	天虹股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	6.56	800,400.00	5,250,624.00
447	001872	招商港口	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 16 日	16.92	310,000.00	5,245,200.00
448	601869	长飞光纤	2021 年 7 月 5 日- 2021 年 7 月 21 日	24.36	206,000.00	5,018,160.00
449	601003	柳钢股份	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.90	847,500.00	5,000,250.00
450	000537	广宇发展	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	5.23	940,000.00	4,916,200.00
451	600657	信达地产	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	3.48	1,367,400.00	4,758,552.00
452	601801	皖新传媒	2021 年 7	4.72	988,200.00	4,664,304.00

			月 1 日- 2021 年 7 月 21 日			0
453	603868	飞科电器	2021 年 7 月 5 日	42.06	88,100.00	3,705,486.0 0
454	603719	良品铺子	2021 年 7 月 5 日	45.00	81,400.00	3,663,000.0 0
455	000732	泰禾集团	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	2.16	1,662,400.0 0	3,590,784.0 0
456	600917	重庆燃气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	8.17	430,500.00	3,517,185.0 0
457	600903	贵州燃气	2021 年 7 月 1 日- 2021 年 7 月 21 日	9.20	370,000.00	3,404,000.0 0
合计	-	-	-	-	979,722,98 0.00	9,386,539,0 19.40

## 6.4.10 金融工具风险及管理

### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。

#### 6.4.10.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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。

##### 6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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。

#### 6.4.10.4 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。

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,345,324,985.14	-	-	-	1,345,324,985.14
结算备付金	113,552,501.39	-	-	-	113,552,501.39
存出保证金	15,111,857.99	-	-	268,759,657.60	283,871,515.59
交易性金融	197,940,000.	-	9,526,000.00	37,271,894.5	37,479,360.5

资产	00			48.68	48.68
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,971,933.03	7,971,933.03
应收股利	-	-	-	11,856,219.22	11,856,219.22
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,494,708.28	15,494,708.28
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,671,929,344.52	-	9,526,000.00	37,575,977,066.81	39,257,432,411.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	15,870,308.24	15,870,308.24
应付托管费	-	-	-	3,174,061.66	3,174,061.66
应付证券清算款	-	-	-	3,291,980.16	3,291,980.16
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,666,395.43	2,666,395.43
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,141,830.79	4,141,830.79
其他负债	-	-	-	51,764,360.66	51,764,360.66
负债总计	-	-	-	80,908,936.94	80,908,936.94
利率敏感度缺口	1,671,929,344.52	-	9,526,000.00	37,495,068,129.87	39,176,523,474.39
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	96,110,222.33	-	-	-	96,110,222.33
结算备付金	1,552,092,852.47	-	-	-	1,552,092,852.47
存出保证金	14,025,933.83	-	-	262,675,224.00	276,701,157.83
交易性金融	-	-	2,353,100.00	36,377,951.1	36,380,304.2



资产				37.48	37.48
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,614,996.25	3,614,996.25
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	33,234,346.6 7	33,234,346.6 7
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,662,229,00 8.63	-	2,353,100.00	36,677,475,7 04.40	38,342,057,8 13.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	16,013,751.3 3	16,013,751.3 3
应付托管费	-	-	-	3,202,750.30	3,202,750.30
应付证券清 算款	-	-	-	3,336,764.49	3,336,764.49
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	2,516,409.51	2,516,409.51
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	609,835.37	609,835.37
其他负债	-	-	-	79,333,044.7 9	79,333,044.7 9
负债总计	-	-	-	105,012,555. 79	105,012,555. 79
利率敏感度 缺口	1,662,229,00 8.63	-	2,353,100.00	36,572,463,1 48.61	38,237,045,2 57.24

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

#### 6.4.10.4.1.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）

1.市场利率平行上升 25 个基点	-226,736.84	-33,342.39
2.市场利率平行下降 25 个基点	229,323.17	33,909.07

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	37,271,894,548.68	95.14	36,377,951,137.48	95.14
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	37,271,894,548.68	95.14	36,377,951,137.48	95.14

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，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。

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
1.组合自身基准上升 5%	1,948,321,424.41	1,904,879,128.72
2.组合自身基准下降 5%	-1,948,321,424.41	-1,904,879,128.72

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	37,271,894,548.68	94.94
	其中：股票	37,271,894,548.68	94.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	207,466,000.00	0.53
	其中：债券	207,466,000.00	0.53
	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	1,458,877,486.53	3.72
8	其他资产	319,194,376.12	0.81
9	合计	39,257,432,411.33	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 9,386,539,019.40 元，占基金资产净值的比例为 23.96%。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	367,172,407.32	0.94
B	采矿业	1,301,718,297.83	3.32

C	制造业	23,578,006,055.78	60.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	901,477,265.80	2.30
E	建筑业	692,410,697.59	1.77
F	批发和零售业	1,275,748,252.31	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	721,653,959.36	1.84
H	住宿和餐饮业	197,166,592.07	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,091,945,708.47	7.89
J	金融业	2,176,421,092.61	5.56
K	房地产业	1,216,891,282.17	3.11
L	租赁和商务服务业	490,216,540.96	1.25
M	科学研究和技术服务业	96,723,056.35	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	319,114,092.75	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,346,906.55	0.06
Q	卫生和社会工作	102,143,189.20	0.26
R	文化、体育和娱乐业	375,579,261.72	0.96
S	综合	329,814,051.84	0.84
	合计	37,257,548,710.68	95.10

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,913,658.52	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	28,336.72	0.00
F	批发和零售业	286,119.06	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,255.03	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
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	47,382.18	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,345,493.00	0.04

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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 报告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

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	002709	天赐材料	3,448,376	367,527,914.08	0.94
2	000799	酒鬼酒	1,384,330	353,834,748.00	0.90
3	603486	科沃斯	1,386,931	316,331,222.48	0.81
4	600089	特变电工	22,704,105	291,747,749.25	0.74
5	000009	中国宝安	15,761,050	287,954,383.50	0.74
6	002074	国轩高科	6,269,916	273,117,540.96	0.70
7	600460	士兰微	4,811,973	271,154,678.55	0.69
8	002340	格林美	28,993,958	271,093,507.30	0.69
9	300285	国瓷材料	4,879,431	237,872,261.25	0.61
10	601233	桐昆股份	9,749,061	234,854,879.49	0.60
11	300207	欣旺达	6,688,758	217,785,960.48	0.56
12	002185	华天科技	13,401,269	206,245,529.91	0.53
13	600885	宏发股份	3,162,939	198,316,275.30	0.51
14	300316	晶盛机电	3,900,507	196,975,603.50	0.50
15	601636	旗滨集团	9,756,033	181,071,972.48	0.46
16	600733	北汽蓝谷	14,059,371	176,555,321.08	0.45
17	300037	新宙邦	1,744,059	174,580,305.90	0.45
18	300146	汤臣倍健	5,161,267	169,805,684.30	0.43
19	300253	卫宁健康	10,306,632	167,688,902.64	0.43
20	002648	卫星石化	4,167,681	163,331,418.39	0.42
21	600884	杉杉股份	6,952,007	162,120,803.24	0.41
22	002625	光启技术	7,778,632	161,873,331.92	0.41
23	002223	鱼跃医疗	4,236,239	161,527,793.07	0.41
24	603737	三棵树	899,144	158,249,344.00	0.40
25	600219	南山铝业	43,813,144	157,727,318.40	0.40
26	002353	杰瑞股份	3,506,349	156,733,800.30	0.40
27	601127	小康股份	2,345,797	156,394,285.99	0.40
28	002138	顺络电子	3,959,104	153,494,462.08	0.39
29	600779	水井坊	1,193,067	150,744,015.45	0.38

30	603589	口子窖	2,203,659	149,165,677.71	0.38
31	000547	航天发展	7,878,445	148,666,257.15	0.38
32	002797	第一创业	20,390,403	145,587,477.42	0.37
33	600704	物产中大	18,350,538	144,418,734.06	0.37
34	300699	光威复材	1,899,866	144,294,822.70	0.37
35	000988	华工科技	6,099,595	143,462,474.40	0.37
36	688099	晶晨股份	1,274,486	142,997,329.20	0.37
37	002444	巨星科技	4,155,064	141,604,581.12	0.36
38	002212	天融信	7,158,373	141,521,034.21	0.36
39	603444	吉比特	267,013	141,516,890.00	0.36
40	601099	太平洋	41,744,002	141,512,166.78	0.36
41	603893	瑞芯微	1,004,131	140,036,109.26	0.36
42	600739	辽宁成大	6,703,634	139,502,623.54	0.36
43	601168	西部矿业	11,543,873	137,718,404.89	0.35
44	688002	睿创微纳	1,375,046	137,270,842.18	0.35
45	002422	科伦药业	6,867,273	137,002,096.35	0.35
46	002385	大北农	20,103,629	136,704,677.20	0.35
47	000807	云铝股份	11,359,617	135,179,442.30	0.35
48	300308	中际旭创	3,457,553	133,184,941.56	0.34
49	000636	风华高科	4,353,632	131,566,759.04	0.34
50	002439	启明星辰	4,523,542	131,227,953.42	0.33
51	600563	法拉电子	824,776	130,611,527.36	0.33
52	000830	鲁西化工	6,973,098	130,606,125.54	0.33
53	601117	中国化学	14,819,445	129,818,338.20	0.33
54	600862	中航高科	4,212,913	129,673,462.14	0.33
55	600392	盛和资源	7,465,451	129,600,229.36	0.33
56	002078	太阳纸业	9,538,305	127,336,371.75	0.33
57	600699	均胜电子	4,984,387	127,201,556.24	0.32
58	002030	达安基因	5,986,348	127,150,031.52	0.32
59	600486	扬农化工	1,133,572	126,699,342.44	0.32
60	600754	锦江酒店	2,211,435	125,941,223.25	0.32
61	002180	纳思达	3,896,705	125,473,901.00	0.32
62	002250	联化科技	4,497,085	125,468,671.50	0.32
63	600068	葛洲坝	16,704,403	125,115,978.47	0.32
64	600315	上海家化	2,078,509	125,001,531.26	0.32
65	300088	长信科技	14,977,138	123,711,159.88	0.32
66	603605	珀莱雅	625,257	122,994,304.47	0.31
67	000630	铜陵有色	45,191,796	122,921,685.12	0.31
68	002507	涪陵榨菜	3,253,287	122,518,788.42	0.31
69	600201	生物股份	6,877,614	120,014,364.30	0.31
70	002013	中航机电	11,865,826	119,488,867.82	0.31
71	000039	中集集团	6,551,584	119,107,797.12	0.30

72	002075	沙钢股份	10,849,103	118,363,713.73	0.30
73	300223	北京君正	1,143,248	115,376,588.16	0.29
74	002127	南极电商	11,771,300	115,005,601.00	0.29
75	002028	思源电气	3,720,353	114,549,668.87	0.29
76	000513	丽珠集团	2,259,605	113,025,442.10	0.29
77	601997	贵阳银行	15,656,320	112,099,251.20	0.29
78	300001	特锐德	3,719,500	111,994,145.00	0.29
79	600177	雅戈尔	16,828,482	110,899,696.38	0.28
80	002511	中顺洁柔	4,024,989	110,888,446.95	0.28
81	002273	水晶光电	7,429,336	109,136,945.84	0.28
82	601005	重庆钢铁	40,669,166	108,586,673.22	0.28
83	002299	圣农发展	4,539,105	108,393,827.40	0.28
84	002092	中泰化学	10,511,914	107,957,356.78	0.28
85	000021	深科技	5,638,770	107,926,057.80	0.28
86	600549	厦门钨业	5,173,822	107,770,712.26	0.28
87	002465	海格通信	11,282,566	106,733,074.36	0.27
88	002080	中材科技	4,070,446	106,523,571.82	0.27
89	300357	我武生物	1,653,878	106,046,657.36	0.27
90	000739	普洛药业	3,599,760	105,832,944.00	0.27
91	002603	以岭药业	3,629,076	105,823,856.16	0.27
92	000050	深天马 A	7,441,185	105,516,003.30	0.27
93	300168	万达信息	7,210,731	105,276,672.60	0.27
94	600988	赤峰黄金	6,987,467	104,742,130.33	0.27
95	000983	山西焦煤	12,584,610	104,578,109.10	0.27
96	300482	万孚生物	1,611,404	104,241,724.76	0.27
97	300009	安科生物	6,995,918	104,239,178.20	0.27
98	601128	常熟银行	16,770,165	103,975,023.00	0.27
99	600867	通化东宝	8,705,960	103,949,162.40	0.27
100	600171	上海贝岭	3,410,809	103,790,917.87	0.26
101	600516	方大炭素	13,944,353	103,745,986.32	0.26
102	000825	太钢不锈	13,839,948	103,661,210.52	0.26
103	300618	寒锐钴业	1,308,773	103,183,663.32	0.26
104	600536	中国软件	1,801,222	102,543,568.46	0.26
105	000998	隆平高科	6,384,349	102,404,957.96	0.26
106	300244	迪安诊断	2,666,924	102,143,189.20	0.26
107	600066	宇通客车	8,155,698	101,864,668.02	0.26
108	600316	洪都航空	2,639,206	101,556,646.88	0.26
109	600637	东方明珠	12,368,003	101,293,944.57	0.26
110	600418	江淮汽车	8,103,499	100,726,492.57	0.26
111	300463	迈克生物	2,378,364	100,105,340.76	0.26
112	600879	航天电子	13,284,776	99,901,515.52	0.26
113	300070	碧水源	13,546,207	99,022,773.17	0.25

114	601689	拓普集团	2,644,607	98,987,640.01	0.25
115	000750	国海证券	23,303,266	98,805,847.84	0.25
116	600827	百联股份	4,878,210	98,295,931.50	0.25
117	002156	通富微电	4,082,073	98,133,034.92	0.25
118	600380	健康元	7,146,302	98,118,726.46	0.25
119	600369	西南证券	20,143,695	98,099,794.65	0.25
120	000932	华菱钢铁	14,861,716	98,087,325.60	0.25
121	600529	山东药玻	2,879,725	97,766,663.75	0.25
122	600487	亨通光电	8,554,813	97,524,868.20	0.25
123	000975	银泰黄金	10,239,880	97,381,258.80	0.25
124	000723	美锦能源	12,836,415	97,043,297.40	0.25
125	600166	福田汽车	28,128,336	97,042,759.20	0.25
126	600909	华安证券	17,344,503	96,608,881.71	0.25
127	300271	华宇软件	5,014,020	96,519,885.00	0.25
128	002131	利欧股份	41,244,602	96,512,368.68	0.25
129	300296	利亚德	12,323,468	96,369,519.76	0.25
130	000960	锡业股份	5,997,493	96,139,812.79	0.25
131	002373	千方科技	5,749,016	96,008,567.20	0.25
132	002152	广电运通	7,366,373	95,983,840.19	0.25
133	688208	道通科技	1,154,597	95,950,393.03	0.24
134	601615	明阳智能	5,923,846	95,907,066.74	0.24
135	002572	索菲亚	3,916,658	94,783,123.60	0.24
136	300383	光环新网	6,516,355	93,770,348.45	0.24
137	600038	中直股份	1,774,891	93,607,751.34	0.24
138	002294	信立泰	2,955,925	92,850,921.78	0.24
139	603290	斯达半导	288,900	92,448,000.00	0.24
140	600642	申能股份	15,033,713	92,306,997.82	0.24
141	601866	中远海发	24,603,147	92,261,801.25	0.24
142	002926	华西证券	9,560,276	92,065,457.88	0.24
143	002690	美亚光电	1,631,350	90,964,076.00	0.23
144	300474	景嘉微	925,766	90,651,006.72	0.23
145	300115	长盈精密	4,396,129	90,560,257.40	0.23
146	601198	东兴证券	8,284,831	90,553,202.83	0.23
147	002065	东华软件	11,276,428	89,422,074.04	0.23
148	002500	山西证券	13,156,747	88,281,772.37	0.23
149	600271	航天信息	6,745,902	87,899,103.06	0.22
150	000623	吉林敖东	5,667,698	87,792,642.02	0.22
151	603156	养元饮品	3,064,660	87,587,982.80	0.22
152	603638	艾迪精密	2,041,667	87,526,264.29	0.22
153	600998	九州通	5,672,602	87,187,892.74	0.22
154	601699	潞安环能	7,345,787	86,753,744.47	0.22
155	600895	张江高科	4,726,246	86,348,514.42	0.22



156	000012	南玻A	8,384,929	85,861,672.96	0.22
157	600153	建发股份	10,591,529	85,791,384.90	0.22
158	600415	小商品城	16,608,810	85,535,371.50	0.22
159	600188	兖州煤业	5,415,150	83,176,704.00	0.21
160	300630	普利制药	1,583,517	82,976,290.80	0.21
161	600256	广汇能源	24,849,407	82,748,525.31	0.21
162	300024	机器人	7,749,506	82,687,229.02	0.21
163	300418	昆仑万维	5,027,454	82,349,696.52	0.21
164	600667	太极实业	9,031,223	82,184,129.30	0.21
165	600535	天士力	5,511,672	81,627,862.32	0.21
166	600008	首创环保	27,094,313	81,553,882.13	0.21
167	600390	五矿资本	13,617,400	81,432,052.00	0.21
168	600060	海信视像	4,799,370	81,109,353.00	0.21
169	600707	彩虹股份	8,613,707	81,054,982.87	0.21
170	002670	国盛金控	7,086,352	80,713,549.28	0.21
171	000027	深圳能源	8,735,089	80,100,766.13	0.20
172	000878	云南铜业	6,242,368	80,089,581.44	0.20
173	600155	华创阳安	7,463,473	79,859,161.10	0.20
174	600497	驰宏锌锗	18,519,436	79,818,769.16	0.20
175	002372	伟星新材	3,855,831	79,700,026.77	0.20
176	600765	中航重机	3,502,748	79,337,242.20	0.20
177	002019	亿帆医药	4,583,376	79,063,236.00	0.20
178	002557	洽洽食品	1,831,604	78,942,132.40	0.20
179	603260	合盛硅业	1,022,000	78,602,020.00	0.20
180	600208	新湖中宝	25,801,000	78,435,040.00	0.20
181	603858	步长制药	3,482,857	78,329,453.93	0.20
182	600372	中航电子	4,696,789	77,731,857.95	0.20
183	002382	蓝帆医疗	3,722,195	77,607,765.75	0.20
184	002221	东华能源	7,044,032	77,132,150.40	0.20
185	300251	光线传媒	7,113,008	76,891,616.48	0.20
186	000718	苏宁环球	9,258,100	76,749,649.00	0.20
187	688029	南微医学	246,075	76,699,116.75	0.20
188	600409	三友化工	7,583,300	76,667,163.00	0.20
189	002174	游族网络	4,458,951	76,560,188.67	0.20
190	600141	兴发集团	4,059,218	76,435,074.94	0.20
191	600511	国药股份	2,302,730	76,128,253.80	0.19
192	600498	烽火通信	4,079,706	76,004,922.78	0.19
193	002683	宏大爆破	2,730,612	75,829,095.24	0.19
194	600170	上海建工	27,238,454	75,178,133.04	0.19
195	002390	信邦制药	7,132,766	74,751,387.68	0.19
196	002966	苏州银行	10,169,000	74,742,150.00	0.19
197	601717	郑煤机	6,388,443	74,297,592.09	0.19

198	600875	东方电气	6,771,521	74,283,585.37	0.19
199	000997	新大陆	4,475,683	74,251,580.97	0.19
200	300058	蓝色光标	12,183,866	73,712,389.30	0.19
201	002506	协鑫集成	21,163,078	73,647,511.44	0.19
202	002146	荣盛发展	12,968,700	73,143,468.00	0.19
203	600160	巨化股份	8,246,578	72,899,749.52	0.19
204	000738	航发控制	3,493,662	72,772,979.46	0.19
205	000686	东北证券	8,590,380	72,588,711.00	0.19
206	600801	华新水泥	4,124,976	72,475,828.32	0.18
207	000401	冀东水泥	5,833,282	72,041,032.70	0.18
208	002408	齐翔腾达	5,784,694	71,845,899.48	0.18
209	002958	青农商行	16,785,300	71,841,084.00	0.18
210	603866	桃李面包	2,296,469	71,649,832.80	0.18
211	300315	掌趣科技	16,815,200	71,464,600.00	0.18
212	600258	首旅酒店	2,985,137	71,225,368.82	0.18
213	002195	二三四五	34,803,626	70,651,360.78	0.18
214	688088	虹软科技	1,266,807	70,624,490.25	0.18
215	603707	健友股份	1,684,100	70,311,175.00	0.18
216	300017	网宿科技	11,985,698	70,116,333.30	0.18
217	000540	中天金融	25,608,214	69,910,424.22	0.18
218	600663	陆家嘴	5,246,915	69,888,907.80	0.18
219	002268	卫士通	3,584,356	69,823,254.88	0.18
220	600325	华发股份	10,264,006	69,179,400.44	0.18
221	603225	新凤鸣	3,399,557	69,011,007.10	0.18
222	600732	爱旭股份	4,927,263	68,587,500.96	0.18
223	601992	金隅集团	25,484,689	68,553,813.41	0.17
224	600859	王府井	2,369,746	68,438,264.48	0.17
225	000060	中金岭南	15,076,017	68,143,596.84	0.17
226	603712	七一二	1,884,346	68,024,890.60	0.17
227	002831	裕同科技	2,289,176	67,965,635.44	0.17
228	601016	节能风电	18,161,819	67,925,203.06	0.17
229	600282	南钢股份	19,057,679	67,845,337.24	0.17
230	600027	华电国际	19,620,300	67,493,832.00	0.17
231	603927	中科软	1,571,384	67,490,942.80	0.17
232	000961	中南建设	11,387,829	67,415,947.68	0.17
233	000158	常山北明	5,851,805	67,237,239.45	0.17
234	002429	兆驰股份	11,040,720	67,017,170.40	0.17
235	603077	和邦生物	32,148,523	66,868,927.84	0.17
236	002081	金螳螂	8,414,626	66,643,837.92	0.17
237	600567	山鹰国际	19,295,246	66,568,598.70	0.17
238	600598	北大荒	4,432,984	66,317,440.64	0.17
239	600500	中化国际	8,434,478	66,294,997.08	0.17

240	002191	劲嘉股份	6,221,059	66,192,067.76	0.17
241	603883	老百姓	1,247,864	65,737,475.52	0.17
242	600528	中铁工业	8,113,507	65,719,406.70	0.17
243	600737	中粮糖业	6,558,674	65,652,326.74	0.17
244	603198	迎驾贡酒	1,481,111	65,613,217.30	0.17
245	600839	四川长虹	22,543,806	65,602,475.46	0.17
246	600216	浙江医药	4,093,948	65,544,107.48	0.17
247	002056	横店东磁	5,031,094	65,404,222.00	0.17
248	688321	微芯生物	1,414,578	65,339,357.82	0.17
249	000898	鞍钢股份	14,660,048	65,237,213.60	0.17
250	002595	豪迈科技	2,441,121	65,177,930.70	0.17
251	600728	佳都科技	8,754,317	64,869,488.97	0.17
252	300212	易华录	2,409,591	64,842,093.81	0.17
253	601577	长沙银行	7,208,595	64,444,839.30	0.16
254	000999	华润三九	2,392,579	64,001,488.25	0.16
255	000709	河钢股份	25,985,500	63,924,330.00	0.16
256	600580	卧龙电驱	4,793,316	63,751,102.80	0.16
257	002203	海亮股份	5,959,880	63,413,123.20	0.16
258	000671	阳光城	12,179,091	63,331,273.20	0.16
259	002281	光迅科技	2,563,478	63,061,558.80	0.16
260	300182	捷成股份	12,610,848	62,928,131.52	0.16
261	000581	威孚高科	3,016,586	62,835,486.38	0.16
262	600808	马钢股份	14,608,649	62,671,104.21	0.16
263	000729	燕京啤酒	8,628,004	62,466,748.96	0.16
264	000488	晨鸣纸业	7,576,200	61,670,268.00	0.16
265	000930	中粮科技	6,819,323	61,442,100.23	0.16
266	600820	隧道股份	11,577,330	61,244,075.70	0.16
267	300166	东方国信	4,929,230	60,925,282.80	0.16
268	002745	木林森	4,519,164	60,556,797.60	0.15
269	002010	传化智联	7,841,729	60,459,730.59	0.15
270	002004	华邦健康	9,686,315	60,152,016.15	0.15
271	002396	星网锐捷	2,817,056	60,144,145.60	0.15
272	002124	天邦股份	8,563,566	60,030,597.66	0.15
273	000629	攀钢钒钛	26,102,837	59,775,496.73	0.15
274	002387	维信诺	5,728,310	59,746,273.30	0.15
275	002563	森马服饰	4,922,075	58,818,796.25	0.15
276	600970	中材国际	6,400,935	58,696,573.95	0.15
277	600755	厦门国贸	7,122,915	58,479,132.15	0.15
278	002242	九阳股份	1,795,182	58,325,463.18	0.15
279	300002	神州泰岳	11,977,208	58,089,458.80	0.15
280	603000	人民网	3,365,972	57,861,058.68	0.15
281	600022	山东钢铁	33,359,015	57,377,505.80	0.15

282	002048	宁波华翔	2,936,250	57,256,875.00	0.15
283	600037	歌华有线	5,952,926	57,207,618.86	0.15
284	000598	兴蓉环境	10,951,540	57,057,523.40	0.15
285	600803	新奥股份	3,449,882	56,957,551.82	0.15
286	600398	海澜之家	7,832,172	56,704,925.28	0.14
287	600881	亚泰集团	19,879,532	56,656,666.20	0.14
288	601106	中国一重	16,710,900	56,649,951.00	0.14
289	600039	四川路桥	9,015,267	56,525,724.09	0.14
290	600811	东方集团	18,153,579	55,368,415.95	0.14
291	000883	湖北能源	12,049,489	55,307,154.51	0.14
292	002925	盈趣科技	1,419,742	55,242,161.22	0.14
293	603885	吉祥航空	3,605,425	55,018,785.50	0.14
294	601456	国联证券	3,548,609	54,648,578.60	0.14
295	600348	华阳股份	7,358,115	54,597,213.30	0.14
296	000778	新兴铸管	14,637,101	54,450,015.72	0.14
297	600782	新钢股份	9,755,813	54,437,436.54	0.14
298	000690	宝新能源	10,633,512	54,337,246.32	0.14
299	600260	凯乐科技	6,094,941	54,123,076.08	0.14
300	600597	光明乳业	3,750,997	54,051,866.77	0.14
301	002002	鸿达兴业	13,738,378	53,991,825.54	0.14
302	000887	中鼎股份	4,461,729	53,897,686.32	0.14
303	601880	辽港股份	31,451,268	53,781,668.28	0.14
304	600718	东软集团	5,417,234	52,980,548.52	0.14
305	002085	万丰奥威	9,449,477	52,917,071.20	0.14
306	601118	海南橡胶	10,357,195	52,718,122.55	0.13
307	600967	内蒙一机	5,177,134	52,392,596.08	0.13
308	002867	周大生	2,646,300	52,317,351.00	0.13
309	600126	杭钢股份	10,195,830	52,304,607.90	0.13
310	603568	伟明环保	2,289,587	52,271,271.21	0.13
311	600026	中远海能	8,481,405	52,245,454.80	0.13
312	002701	奥瑞金	10,139,507	52,117,065.98	0.13
313	000528	柳工	6,326,936	51,880,875.20	0.13
314	601179	中国西电	12,549,563	51,704,199.56	0.13
315	002183	怡亚通	9,019,419	51,681,270.87	0.13
316	600645	中源协和	2,236,305	51,323,199.75	0.13
317	002705	新宝股份	1,948,070	51,136,837.50	0.13
318	600410	华胜天成	6,582,960	51,083,769.60	0.13
319	600908	无锡银行	8,806,806	51,079,474.80	0.13
320	000970	中科三环	5,340,851	51,005,127.05	0.13
321	600572	康恩贝	11,446,738	50,823,516.72	0.13
322	000877	天山股份	3,897,690	50,786,900.70	0.13
323	002249	大洋电机	9,669,258	50,763,604.50	0.13

324	600985	淮北矿业	4,156,872	50,755,407.12	0.13
325	000402	金融街	7,518,733	50,751,447.75	0.13
326	002110	三钢闽光	7,501,641	50,561,060.34	0.13
327	002266	浙富控股	10,105,619	50,427,038.81	0.13
328	603650	彤程新材	1,040,382	50,042,374.20	0.13
329	600064	南京高科	5,372,577	49,911,240.33	0.13
330	002368	太极股份	2,481,829	49,785,489.74	0.13
331	600167	联美控股	5,570,160	49,741,528.80	0.13
332	600446	金证股份	3,443,754	49,727,807.76	0.13
333	300072	三聚环保	8,621,945	49,489,964.30	0.13
334	601200	上海环境	4,082,004	48,861,587.88	0.12
335	002128	露天煤业	4,689,128	48,813,822.48	0.12
336	000089	深圳机场	6,279,800	48,794,046.00	0.12
337	601598	中国外运	9,634,179	48,652,603.95	0.12
338	600329	中新药业	1,728,856	48,563,565.04	0.12
339	000990	诚志股份	3,813,233	48,542,456.09	0.12
340	600517	国网英大	6,932,567	47,210,781.27	0.12
341	300026	红日药业	11,060,133	47,005,565.25	0.12
342	000400	许继电气	3,700,713	46,851,026.58	0.12
343	600158	中体产业	4,089,856	46,665,256.96	0.12
344	002233	塔牌集团	4,483,973	46,095,242.44	0.12
345	000519	中兵红箭	4,277,076	45,850,254.72	0.12
346	003035	南网能源	4,567,390	45,399,856.60	0.12
347	300376	易事特	5,634,800	45,303,792.00	0.12
348	601975	招商南油	21,167,043	45,297,472.02	0.12
349	000685	中山公用	5,533,688	45,154,894.08	0.12
350	601718	际华集团	15,990,685	45,093,731.70	0.12
351	600376	首开股份	8,004,693	44,826,280.80	0.11
352	001914	招商积余	2,600,657	44,679,287.26	0.11
353	000959	首钢股份	7,912,052	44,465,732.24	0.11
354	600120	浙江东方	10,384,283	44,444,731.24	0.11
355	601000	唐山港	18,425,746	44,406,047.86	0.11
356	600507	方大特钢	6,514,193	44,381,507.10	0.11
357	600307	酒钢宏兴	19,068,091	44,237,971.12	0.11
358	000090	天健集团	7,972,183	44,086,171.99	0.11
359	002985	北摩高科	451,264	43,998,240.00	0.11
360	601333	广深铁路	20,693,505	43,870,230.60	0.11
361	600195	中牧股份	3,624,415	43,348,003.40	0.11
362	600435	北方导航	5,431,975	43,129,881.50	0.11
363	600804	鹏博士	8,899,381	43,073,004.04	0.11
364	000559	万向钱潮	8,057,410	42,784,847.10	0.11
365	002839	张家港行	7,756,500	42,195,360.00	0.11

366	002505	鹏都农牧	18,808,057	42,130,047.68	0.11
367	603228	景旺电子	1,601,787	41,966,819.40	0.11
368	600373	中文传媒	4,248,679	41,891,974.94	0.11
369	600673	东阳光	9,322,866	41,859,668.34	0.11
370	002440	闰土股份	4,687,400	41,483,490.00	0.11
371	300133	华策影视	6,954,405	41,170,077.60	0.11
372	000967	盈峰环境	5,988,014	41,137,656.18	0.11
373	002155	湖南黄金	5,263,000	40,788,250.00	0.10
374	002038	双鹭药业	3,870,322	40,754,490.66	0.10
375	601860	紫金银行	11,178,492	40,577,925.96	0.10
376	600643	爱建集团	5,753,605	40,160,162.90	0.10
377	000758	中色股份	8,420,868	39,999,123.00	0.10
378	600266	城建发展	8,404,824	39,838,865.76	0.10
379	601608	中信重工	10,604,432	39,660,575.68	0.10
380	601991	大唐发电	14,960,000	39,494,400.00	0.10
381	600582	天地科技	10,117,497	39,458,238.30	0.10
382	600056	中国医药	3,246,155	39,440,783.25	0.10
383	002936	郑州银行	10,714,198	39,321,106.66	0.10
384	000563	陕国投 A	12,090,186	38,930,398.92	0.10
385	600388	龙净环保	4,563,809	38,883,652.68	0.10
386	601098	中南传媒	4,359,604	38,451,707.28	0.10
387	601958	金钼股份	5,909,479	38,293,423.92	0.10
388	600131	国网信通	2,886,773	38,220,874.52	0.10
389	300180	华峰超纤	7,714,128	38,184,933.60	0.10
390	300741	华宝股份	749,324	38,005,713.28	0.10
391	600095	湘财股份	3,243,900	37,986,069.00	0.10
392	002399	海普瑞	2,381,699	37,940,465.07	0.10
393	600062	华润双鹤	3,159,460	37,629,168.60	0.10
394	600901	江苏租赁	7,200,493	37,442,563.60	0.10
395	600928	西安银行	8,031,500	37,426,790.00	0.10
396	600959	江苏有线	12,258,669	37,388,940.45	0.10
397	002458	益生股份	3,745,041	37,338,058.77	0.10
398	002416	爱施德	3,693,317	37,043,969.51	0.09
399	600094	大名城	9,741,150	36,724,135.50	0.09
400	600649	城投控股	7,680,496	36,559,160.96	0.09
401	003022	联泓新科	1,188,671	36,492,199.70	0.09
402	600259	广晟有色	1,078,123	36,451,338.63	0.09
403	600776	东方通信	2,937,888	36,429,811.20	0.09
404	600764	中国海防	1,286,200	36,399,460.00	0.09
405	000415	渤海租赁	15,030,847	36,374,649.74	0.09
406	300113	顺网科技	2,801,740	36,254,515.60	0.09
407	000681	视觉中国	2,777,848	35,917,574.64	0.09

408	600006	东风汽车	4,830,562	35,263,102.60	0.09
409	000028	国药一致	930,659	35,216,136.56	0.09
410	002317	众生药业	4,080,585	35,133,836.85	0.09
411	601611	中国核建	4,861,517	35,100,152.74	0.09
412	000717	韶钢松山	7,576,600	34,776,594.00	0.09
413	600556	天下秀	3,291,787	34,761,270.72	0.09
414	600717	天津港	8,863,030	34,743,077.60	0.09
415	300257	开山股份	2,400,380	34,493,460.60	0.09
416	600863	内蒙华电	14,757,301	34,384,511.33	0.09
417	600633	浙数文化	4,769,624	34,245,900.32	0.09
418	600546	山煤国际	4,769,554	34,245,397.72	0.09
419	600729	重庆百货	1,246,977	34,229,518.65	0.09
420	002434	万里扬	4,205,645	34,107,780.95	0.09
421	600648	外高桥	2,280,413	33,704,504.14	0.09
422	002375	亚厦股份	4,253,532	33,687,973.44	0.09
423	000078	海王生物	10,333,028	33,685,671.28	0.09
424	000062	深圳华强	1,986,496	33,591,647.36	0.09
425	601928	凤凰传媒	4,657,948	33,257,748.72	0.08
426	600835	上海机电	2,041,254	33,170,377.50	0.08
427	600021	上海电力	4,787,535	33,081,866.85	0.08
428	601828	美凯龙	2,752,946	33,035,352.00	0.08
429	000501	鄂武商 A	2,795,627	32,708,835.90	0.08
430	600968	海油发展	12,369,660	32,037,419.40	0.08
431	002244	滨江集团	7,570,795	31,721,631.05	0.08
432	000869	张裕 A	830,930	30,860,740.20	0.08
433	002424	贵州百灵	4,175,301	30,730,215.36	0.08
434	600339	中油工程	10,707,034	30,407,976.56	0.08
435	603355	莱克电气	484,908	30,175,824.84	0.08
436	600623	华谊集团	3,407,459	30,019,713.79	0.08
437	605358	立昂微	258,877	29,921,003.66	0.08
438	600566	济川药业	1,671,347	29,917,111.30	0.08
439	002583	海能达	5,897,670	29,724,256.80	0.08
440	600787	中储股份	5,548,650	29,574,304.50	0.08
441	601969	海南矿业	2,508,400	29,172,692.00	0.07
442	600312	平高电气	4,982,017	29,094,979.28	0.07
443	600377	宁沪高速	2,975,083	29,036,810.08	0.07
444	000031	大悦城	8,033,992	28,922,371.20	0.07
445	600466	蓝光发展	9,595,550	28,306,872.50	0.07
446	600823	世茂股份	6,996,764	28,266,926.56	0.07
447	002468	申通快递	3,668,600	27,954,732.00	0.07
448	000156	华数传媒	3,605,818	27,800,856.78	0.07
449	601778	晶科科技	5,056,412	27,608,009.52	0.07

450	000826	启迪环境	5,120,330	27,393,765.50	0.07
451	600639	浦东金桥	2,002,595	27,335,421.75	0.07
452	603317	天味食品	922,935	27,161,977.05	0.07
453	002815	崇达技术	2,165,603	27,026,725.44	0.07
454	603888	新华网	1,273,356	26,956,946.52	0.07
455	002532	天山铝业	3,074,200	25,792,538.00	0.07
456	002302	西部建设	3,244,370	25,630,523.00	0.07
457	601298	青岛港	4,144,529	25,613,189.22	0.07
458	000937	冀中能源	6,435,684	25,292,238.12	0.06
459	000813	德展健康	5,569,727	25,286,560.58	0.06
460	603708	家家悦	1,438,106	24,979,901.22	0.06
461	000553	安道麦 A	2,676,584	24,811,933.68	0.06
462	600350	山东高速	4,031,927	24,796,351.05	0.06
463	002635	安洁科技	1,691,553	24,747,420.39	0.06
464	300010	豆神教育	4,297,982	24,369,557.94	0.06
465	601228	广州港	7,662,860	24,367,894.80	0.06
466	603515	欧普照明	924,206	23,724,368.02	0.06
467	603377	东方时尚	2,183,995	23,346,906.55	0.06
468	002948	青岛银行	4,680,570	23,262,432.90	0.06
469	601139	深圳燃气	3,514,047	23,052,148.32	0.06
470	000061	农产品	4,113,719	22,707,728.88	0.06
471	000046	泛海控股	9,836,549	22,624,062.70	0.06
472	600640	号百控股	1,840,267	22,432,854.73	0.06
473	002653	海思科	1,039,693	22,374,193.36	0.06
474	600871	石化油服	11,351,600	22,362,652.00	0.06
475	001872	招商港口	1,283,022	21,708,732.24	0.06
476	603786	科博达	272,948	20,607,574.00	0.05
477	601568	北元集团	2,402,300	20,563,688.00	0.05
478	002419	天虹股份	3,118,945	20,460,279.20	0.05
479	002901	大博医疗	276,419	20,148,180.91	0.05
480	603379	三美股份	1,066,738	19,958,667.98	0.05
481	601003	柳钢股份	3,339,871	19,705,238.90	0.05
482	603056	德邦股份	1,777,139	19,530,757.61	0.05
483	000537	广宇发展	3,550,505	18,569,141.15	0.05
484	600657	信达地产	5,193,262	18,072,551.76	0.05
485	601512	中新集团	1,780,825	17,737,017.00	0.05
486	601801	皖新传媒	3,658,808	17,269,573.76	0.04
487	601869	长飞光纤	691,600	16,847,376.00	0.04
488	603983	丸美股份	319,331	16,640,338.41	0.04
489	601187	厦门银行	1,705,400	16,167,192.00	0.04
490	002946	新乳业	990,900	15,012,135.00	0.04
491	000732	泰禾集团	6,296,782	13,601,049.12	0.03



492	600917	重庆燃气	1,652,763	13,503,073.71	0.03
493	600903	贵州燃气	1,397,460	12,856,632.00	0.03
494	603868	飞科电器	303,897	12,781,907.82	0.03
495	603719	良品铺子	280,900	12,640,500.00	0.03
496	002818	富森美	970,518	11,704,447.08	0.03
497	002423	中粮资本	1,075,474	9,733,039.70	0.02
498	603256	宏和科技	1,060,600	9,693,884.00	0.02
499	600956	新天绿能	816,400	9,560,044.00	0.02
500	601068	中铝国际	1,830,069	6,313,738.05	0.02

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 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

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	601865	福莱特	287,447	10,945,981.76	0.03
2	688538	和辉光电	313,555	1,059,815.90	0.00
3	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
4	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.00
5	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
6	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
7	300957	贝泰妮	923	233,940.18	0.00
8	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.00
9	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.00
10	300979	华利集团	946	83,329.40	0.00
11	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
12	300981	中红医疗	603	54,550.11	0.00
13	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
14	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
15	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
16	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
17	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
18	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
19	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.00
20	300937	药易购	334	18,057.04	0.00
21	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.00
22	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
23	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
24	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
25	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
26	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00

27	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
28	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
29	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
30	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
31	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
32	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
33	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
34	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
35	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
36	300948	冠中生态	380	10,503.04	0.00
37	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
38	300930	屹通新材	408	10,023.10	0.00
39	300993	玉马遮阳	483	9,730.25	0.00
40	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
41	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
42	300985	致远新能	345	8,763.45	0.00
43	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
44	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
45	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
46	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
47	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
48	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
49	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
50	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
51	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
52	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
53	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
54	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
55	300998	宁波方正	203	4,347.24	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	300274	阳光电源	477,130,763.96	1.25
2	000799	酒鬼酒	349,267,525.34	0.91
3	300012	华测检测	265,600,274.20	0.69
4	002340	格林美	261,154,480.86	0.68
5	002709	天赐材料	248,158,522.82	0.65
6	300285	国瓷材料	239,402,512.08	0.63

7	002074	国轩高科	225,979,269.71	0.59
8	002791	坚朗五金	197,449,905.66	0.52
9	300595	欧普康视	189,369,210.72	0.50
10	002385	大北农	186,497,287.15	0.49
11	002185	华天科技	178,051,372.26	0.47
12	300357	我武生物	173,358,924.85	0.45
13	300037	新宙邦	170,621,249.77	0.45
14	601636	旗滨集团	169,710,595.54	0.44
15	300253	卫宁健康	169,024,107.23	0.44
16	002625	光启技术	164,585,073.48	0.43
17	002078	太阳纸业	164,283,647.21	0.43
18	300496	中科创达	163,838,317.53	0.43
19	002797	第一创业	162,260,525.68	0.42
20	002507	涪陵榨菜	160,678,251.16	0.42

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	300274	阳光电源	1,133,380,970.89	2.96
2	300012	华测检测	615,114,959.71	1.61
3	300595	欧普康视	487,210,947.96	1.27
4	300496	中科创达	443,409,914.65	1.16
5	002791	坚朗五金	356,610,547.20	0.93
6	002568	百润股份	334,270,873.49	0.87
7	600426	华鲁恒升	308,875,857.28	0.81
8	002709	天赐材料	283,624,990.17	0.74
9	600132	重庆啤酒	259,143,975.01	0.68
10	603882	金域医学	254,562,767.98	0.67
11	300285	国瓷材料	249,765,901.61	0.65
12	002074	国轩高科	249,500,130.52	0.65
13	002340	格林美	228,437,243.82	0.60
14	002920	德赛西威	226,412,989.74	0.59
15	600143	金发科技	221,827,035.27	0.58
16	002064	华峰化学	219,176,504.20	0.57
17	603806	福斯特	206,061,766.81	0.54
18	300357	我武生物	198,232,310.14	0.52
19	000301	东方盛虹	190,673,507.12	0.50
20	002185	华天科技	189,755,375.75	0.50

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	25,688,431,115.60
卖出股票收入（成交）总额	26,251,331,222.71

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	197,940,000.00	0.51
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）	9,526,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	207,466,000.00	0.53

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	020407	21 贴债 10	2,000,000	197,940,000.00	0.51
2	113051	节能转债	95,260	9,526,000.00	0.02

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2107	IC2107	45	60,904,800.00	1,241,800.00	-
IC2108	IC2108	5	6,712,000.00	-31,000.00	-
IC2109	IC2109	92	122,672,800.00	3,703,320.00	-
IC2112	IC2112	1,326	1,729,422,240.00	58,707,560.00	-
公允价值变动总额合计（元）					63,621,680.00
股指期货投资本期收益（元）					197,040,662.39
股指期货投资本期公允价值变动（元）					37,915,157.74

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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（元）
1	存出保证金	283,871,515.59
2	应收证券清算款	15,494,708.28
3	应收股利	11,856,219.22
4	应收利息	7,971,933.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	319,194,376.12

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	271,154,678.55	0.69	重大事项停牌
2	002709	天赐材料	100,451,650.00	0.26	转融通融出
3	000799	酒鬼酒	89,460,000.0	0.23	转融通融出

			0		
4	600089	特变电工	78,509,645.0 0	0.20	转融通融出
5	000009	中国宝安	77,572,593.0 0	0.20	转融通融出
6	002340	格林美	73,620,965.0 0	0.19	转融通融出
7	002074	国轩高科	73,394,244.0 0	0.19	转融通融出
8	300285	国瓷材料	64,335,375.0 0	0.16	转融通融出
9	601233	桐昆股份	63,494,013.0 0	0.16	转融通融出

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601865	福莱特	10,945,981.76	0.03	非公开发行锁定期
2	688538	和辉光电	1,059,815.90	0.00	科创板新股锁定期
3	688276	百克生物	277,067.28	0.00	科创板新股锁定期
4	301015	百洋医药	17,939.46	0.00	新股锁定期

## § 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

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		南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
223,584	23,024.31	2,977,913,636.00	57.85%	1,121,082,881.00	21.78%	1,048,870,727.00	20.37%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	中央汇金投资有限责任公司	1,728,426,785.00	33.58%
2	华夏基金-中央汇金资产管理有限责任公司-华夏基金-汇金资管单一资产管理计划	143,100,000.00	2.78%
3	创金合信基金-华夏银行-创金合信华睿 2 号集合资产管理计划	89,054,505.00	1.73%
4	国泰君安-建行-香港上海汇丰银行有限公司	81,074,780.00	1.57%
5	中国人寿保险股份有限公司万能账户(国寿资产受托)	70,164,700.00	1.36%
6	中信建投证券股份有限公司融券专用证券账户	43,573,980.00	0.85%
7	易方达基金-中央汇金资产管理有限责任公司-易方达基金-汇金资管单一资产管理计划	40,000,000.00	0.78%
8	广发证券股份有限公司	34,040,408.00	0.66%
9	安信证券股份有限公司	31,872,300.00	0.62%
10	安信证券股份有限公司融券专用证券账户	30,514,103.00	0.59%
11	中国农业银行股份有限公司-南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)	1,048,870,727.00	20.37%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。其中：“中国农业银行股份有限公司-南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)”对应的基金全称为“中国农业银行股份有限公司-南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 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	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	5,419,867,244.00



本报告期基金总申购份额	4,890,400,000.00
减：报告期基金总赎回份额	5,162,400,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5,147,867,244.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	37,994,025,298.75	73.27%	3,799,901.98	73.28%	-
申万宏源	2	5,556,213,078.76	10.72%	555,648.83	10.71%	-
东北证券	2	5,552,721,990.98	10.71%	555,272.36	10.71%	-
平安证券	2	2,749,276,084.59	5.30%	274,937.02	5.30%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	1,976,374.58	12.66%	-	-	-	-

申万宏源	7,594,906.60	48.66%	-	-	-	-
东北证券	232.03	0.00%	-	-	-	-
平安证券	6,036,059.65	38.67%	2,150,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

## 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	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配福莱特（601865）非公开发行 A 股的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
2	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金修订基金合同有关条款的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	证券日报、基金管理	2021-04-13

	关联方承销证券的关联交易公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配信立泰（002294）非公开发行 A 股的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-24
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-25

## § 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					报告期末持有基金份额
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%	期初份额	申购份额	赎回份额	

		的时间区 间				
联接基 金	1	20210209- 20210225; 20210426- 20210426; 20210302- 20210303; 20210510- 20210512; 20210601- 20210624; 20210629- 20210630; 20210101- 20210207; 20210406- 20210412; 20210429- 20210506	1,222,329,927.00	83,740,800.00	257,200,000.00	1,048,870,727.00
机构	1	20210101- 20210630	1,728,426,785.00	-	-	1,728,426,785.00

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告》原文。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

## 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>