

# 中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中创 400ETF
场内简称	中创 400ETF
基金主代码	159918
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	36,561,264.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日

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的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	<p>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。</p> <p>在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。</p>
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	郭松	郭明

负责人	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65215588	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		经雷	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,701,947.50
本期利润	5,409,175.04
加权平均基金份额本期利润	0.1440
本期加权平均净值利润率	7.81%
本期基金份额净值增长率	6.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	33,852,802.11
期末可供分配基金份额利润	0.9259
期末基金资产净值	70,414,066.11
期末基金份额净值	1.9259
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	92.59%

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

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

于所列数字。

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

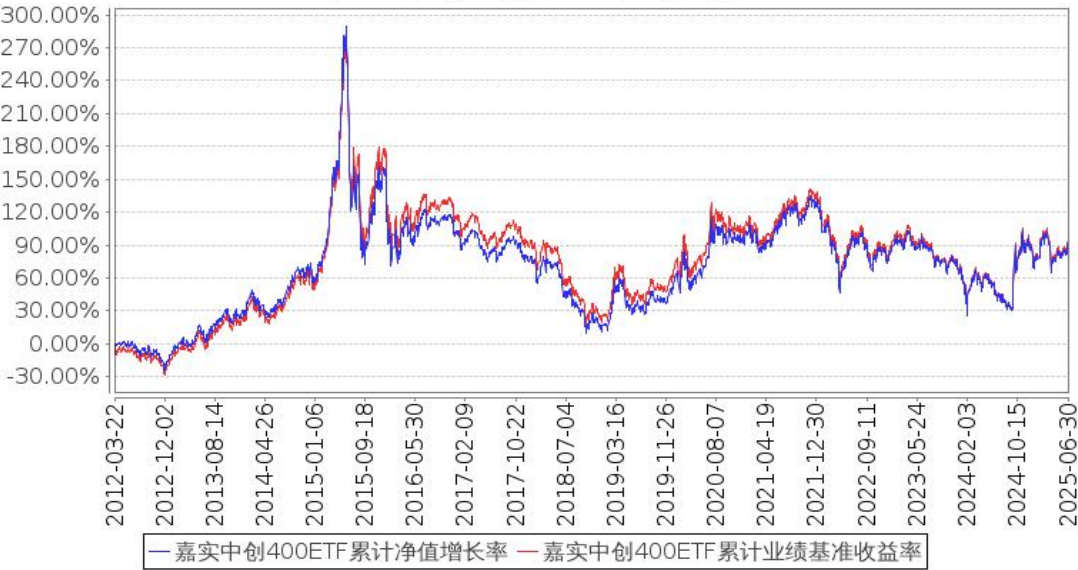
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	7.04%	1.00%	6.80%	1.01%	0.24%	-0.01%
过去三个月	2.43%	1.90%	1.83%	1.92%	0.60%	-0.02%
过去六个月	6.42%	1.75%	6.02%	1.77%	0.40%	-0.02%
过去一年	32.44%	2.10%	32.73%	2.13%	-0.29%	-0.03%
过去三年	-1.71%	1.65%	-3.38%	1.67%	1.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	92.59%	1.70%	94.17%	1.73%	-1.58%	-0.03%

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

嘉实中创400ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2012年03月22日至2025年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张超梁	本基金、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实中证信息安全主题 ETF、嘉实中证高端装备细分 50ETF、嘉实中证高端装备细分 50ETF 发起联接、嘉实中证 A500ETF、嘉实中证 A500ETF 联接、嘉实创业板 50ETF、嘉实创业板 50ETF 联接基金经	2024 年 2 月 1 日	-	11 年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任 SmartBeta 和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。



	理				
--	---	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 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
张超梁	公募基金	9	23,926,438,395.91	2024 年 1 月 25 日
	私募资产管理计划	1	573,392.22	2024 年 7 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	10	23,927,011,788.13	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中小创业企业 400 指数，由中创 500 指数剔除同期中创 100 指数成份股后余下的 400 只股票组成，反映中小板和创业板中正处于高成长阶段的企业的整体状况。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

回顾上半年，外部扰动不断，但宏观经济复苏进程仍在持续推进。一季度关税预期压制进出口贸易，但政策持续发力推动部分产业景气度修复，战略性新兴产业尤为突出。4、5 月超预期关税的落地造成了较大冲击，货币政策的进一步宽松和社融改善推动内需结构性改善，高新技术产品出口及高技术制造业增加值大幅提升。总体来看，上半年增量政策效果逐步显现，高新技术产品成为经济发展新动能。海外方面，美国经济的表现极大地影响了降息进程和市场对未来利率水平的预期。1、2 月虽然也有关税不确定性的影响，但美国经济数据总体表现较为积极，美联储对通胀表示关注，3 月并未继续降息。进入二季度，通胀仍未明显下降，同时劳动力市场较为坚挺，5 月平均周薪创历史新高，6 月非农就业超预期，美联储降息预期不断延后。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.02%，年化跟踪误差为 0.37%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00%的限制。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.9259 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.42%，业绩比较基准收益率为 6.02%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，积极的总量政策仍将持续，货币和社融同比增速在低基数的背景下有望保持稳健。随着货币和信贷的宽松推动经济增长、关税等国际贸易冲击逐渐消退，内外需有望相继企稳。

本基金作为一只投资于中小创业企业 400 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中小创业企业 400 指数的投资工具。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管

理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	762,717.14	869,085.30

结算备付金		2,722.83	3,260.15
存出保证金		137.29	453.55
交易性金融资产	6.4.7.2	69,741,348.60	72,643,953.63
其中：股票投资		69,741,348.60	72,643,953.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		70,506,925.86	73,516,752.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		27,696.00	32,736.42
应付托管费		5,539.20	6,547.29
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	59,624.55	73,405.23
负债合计		92,859.75	112,688.94
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	36,561,264.00	40,561,264.00
未分配利润	6.4.7.12	33,852,802.11	32,842,799.69

净资产合计		70,414,066.11	73,404,063.69
负债和净资产总计		70,506,925.86	73,516,752.63

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9259 元，基金份额总额 36,561,264.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,676,781.64	-8,689,124.48
1. 利息收入		1,312.06	2,175.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,312.06	2,175.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		2,966,757.04	-4,707,600.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,418,042.79	-5,273,949.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,421.52	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	545,292.73	566,348.96
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,707,227.54	-3,997,588.90
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	1,485.00	13,890.00
减：二、营业总支出		267,606.60	302,790.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	171,437.60	144,135.11
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,287.55	28,827.00

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	61, 881. 45	129, 828. 34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 409, 175. 04	-8, 991, 914. 93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 409, 175. 04	-8, 991, 914. 93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5, 409, 175. 04	-8, 991, 914. 93

6.3 净资产变动表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40, 561, 264. 00	-	32, 842, 799. 69	73, 404, 063. 69
二、本期期初净资产	40, 561, 264. 00	-	32, 842, 799. 69	73, 404, 063. 69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4, 000, 000. 00	-	1, 010, 002. 42	-2, 989, 997. 58
（一）、综合收益总额	-	-	5, 409, 175. 04	5, 409, 175. 04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4, 000, 000. 00	-	-4, 399, 172. 62	-8, 399, 172. 62
其中：1. 基金申购款	4, 000, 000. 00	-	3, 293, 602. 23	7, 293, 602. 23
2. 基金赎回款	-8, 000, 000. 00	-	-7, 692, 774. 85	-15, 692, 774. 85
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	36,561,264.00	-	33,852,802.11	70,414,066.11
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,561,264.00	-	24,871,905.80	60,433,169.80
二、本期期初净资产	35,561,264.00	-	24,871,905.80	60,433,169.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-	-9,174,217.16	-10,174,217.16
（一）、综合收益总额	-	-	-8,991,914.93	-8,991,914.93
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-	-182,302.23	-1,182,302.23
其中：1. 基金申购款	17,000,000.00	-	8,278,443.82	25,278,443.82
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-	-8,460,746.05	-26,460,746.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	34,561,264.00	-	15,697,688.64	50,258,952.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷  
基金管理人负责人

梁凯  
主管会计工作负责人

李袁  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]13 号《关于核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 286,561,264.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税



[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 解禁后取得的股息红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

(4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税; 对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税; 自 2023 年 8 月 28 日起, 出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税;

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	762,717.14
等于：本金	762,653.59
加：应计利息	63.55
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	762,717.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		66,447,716.53	-	69,741,348.60	3,293,632.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		66,447,716.53	-	69,741,348.60	3,293,632.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,596.88
其中：交易所市场	2,596.88
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,027.67
合计	59,624.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,561,264.00	40,561,264.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	36,561,264.00	36,561,264.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,595,593.64	-2,752,793.95	32,842,799.69
本期期初	35,595,593.64	-2,752,793.95	32,842,799.69
本期利润	2,701,947.50	2,707,227.54	5,409,175.04
本期基金份额交易产生的变动数	-3,459,343.47	-939,829.15	-4,399,172.62
其中：基金申购款	3,610,575.04	-316,972.81	3,293,602.23
基金赎回款	-7,069,918.51	-622,856.34	-7,692,774.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,838,197.67	-985,395.56	33,852,802.11

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,289.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22.45
其他	0.57
合计	1,312.06

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,028,458.85
股票投资收益——赎回差价收入	1,389,583.94
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	2,418,042.79

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,807,871.33
减：卖出股票成本总额	6,771,524.07
减：交易费用	7,888.41
买卖股票差价收入	1,028,458.85

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	15,692,774.85
减：现金支付赎回款总额	66,930.85
减：赎回股票成本总额	14,236,260.06
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,389,583.94

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,420.41
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	3,421.52

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,422.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,000.00
减：应计利息总额	1.11
减：交易费用	0.58
买卖债券差价收入	3,420.41

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	545,292.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	545,292.73

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,707,227.54
股票投资	2,707,227.54
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,707,227.54

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,485.00
合计	1,485.00

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	96.00
指数使用费	4,757.78
合计	61,881.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人



嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金（“嘉实中创 400ETF 联接”）	本基金的联接基金
---	----------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	171,437.60	144,135.11
其中：应支付销售机构的客户维护 费	936.04	—
应支付基金管理人的净管理费	170,501.56	144,135.11

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,287.55	28,827.00

注：支付基金托管人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：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
嘉 实 中 创 400ETF联接	32,677,908.00	89.38	34,787,908.00	85.77

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国工商银行股份有限 公司_活期	762,717.14	1,289.04	1,065,821.64	2,098.35

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新发未上市	16.42	16.42	336	5,517.12	5,517.12	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	38	623.96	623.96	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	15	1,344.00	2,092.20	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	41	1,355.46	1,945.86	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	101	1,292.80	4,498.54	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	762,717.14	-	-	-	762,717.14
结算备付金	2,722.83	-	-	-	2,722.83
存出保证金	137.29	-	-	-	137.29
交易性金融资产	-	-	-	69,741,348.60	69,741,348.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	765,577.26	-	-	69,741,348.60	70,506,925.86
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	27,696.00	27,696.00
应付托管费	-	-	-	5,539.20	5,539.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	59,624.55	59,624.55
负债总计	-	-	-	92,859.75	92,859.75
利率敏感度缺口	765,577.26	-	-	69,648,488.85	70,414,066.11
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	869,085.30	-	-	-	869,085.30
结算备付金	3,260.15	-	-	-	3,260.15
存出保证金	453.55	-	-	-	453.55
交易性金融资产	-	-	-	72,643,953.63	72,643,953.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	872,799.00	-	-	72,643,953.63	73,516,752.63
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,736.42	32,736.42
应付托管费	-	-	-	6,547.29	6,547.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	73,405.23	73,405.23
负债总计	-	-	-	112,688.94	112,688.94
利率敏感度缺口	872,799.00	-	-	72,531,264.69	73,404,063.69

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）	
	市场利率上升 25 个基点	-	-	
	市场利率下降 25 个基点	-	-	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）	
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-	
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以



外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	69,741,348.60	99.04	72,643,953.63	98.96
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	69,741,348.60	99.04	72,643,953.63	98.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,487,282.10	3,610,843.33
	业绩比较基准下降 5%	-3,487,282.10	-3,610,843.33

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	69,726,670.92	72,643,953.63
第二层次	6,141.08	-
第三层次	8,536.60	-
合计	69,741,348.60	72,643,953.63

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。
--------------------------

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	69,741,348.60	98.91
	其中：股票	69,741,348.60	98.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	765,439.97	1.09
8	其他各项资产	137.29	0.00
9	合计	70,506,925.86	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	671,446.44	0.95
B	采矿业	717,894.00	1.02
C	制造业	46,989,548.06	66.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	355,104.36	0.50
E	建筑业	403,973.60	0.57
F	批发和零售业	1,308,614.65	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	329,325.08	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,938,442.58	15.53
J	金融业	3,547,932.61	5.04
K	房地产业	180,375.00	0.26
L	租赁和商务服务业	1,295,971.60	1.84
M	科学研究和技术服务业	918,762.80	1.30

N	水利、环境和公共设施管理业	287,238.00	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	246,330.00	0.35
Q	卫生和社会工作	428,622.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	1,107,090.14	1.57
S	综合	—	—
	合计	69,726,670.92	99.02

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	14,677.68	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	14,677.68	0.02

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	49,100	581,835.00	0.83
2	002966	苏州银行	65,960	579,128.80	0.82
3	002517	恺英网络	29,800	575,438.00	0.82
4	002261	拓维信息	17,800	550,910.00	0.78
5	300255	常山药业	11,200	522,032.00	0.74
6	300803	指南针	6,200	500,092.00	0.71
7	002195	岩山科技	88,600	498,818.00	0.71
8	002558	巨人网络	20,600	485,130.00	0.69
9	002797	第一创业	65,500	463,740.00	0.66
10	002465	海格通信	31,600	440,504.00	0.63
11	002185	华天科技	43,400	438,340.00	0.62
12	300779	惠城环保	2,300	410,527.00	0.58
13	002273	水晶光电	20,380	406,988.60	0.58
14	002281	光迅科技	8,212	405,015.84	0.58
15	300458	全志科技	10,119	401,623.11	0.57
16	300058	蓝色光标	60,060	393,993.60	0.56
17	300454	深信服	4,100	386,138.00	0.55
18	300002	神州泰岳	31,800	375,240.00	0.53
19	002472	双环传动	11,200	375,088.00	0.53
20	300017	网宿科技	34,700	371,984.00	0.53
21	300395	菲利华	7,200	367,920.00	0.52
22	002085	万丰奥威	22,500	357,525.00	0.51
23	002353	杰瑞股份	10,200	357,000.00	0.51
24	002851	麦格米特	7,000	350,980.00	0.50
25	300024	机器人	20,100	345,318.00	0.49
26	002738	中矿资源	10,700	344,112.00	0.49
27	300496	中科创达	6,000	343,320.00	0.49
28	002065	东华软件	35,600	341,760.00	0.49
29	300115	长盈精密	15,966	341,672.40	0.49
30	002131	利欧股份	97,454	341,089.00	0.48
31	002850	科达利	3,000	339,510.00	0.48
32	002008	大族激光	13,900	338,743.00	0.48
33	300383	光环新网	23,600	337,480.00	0.48
34	002436	兴森科技	25,228	334,018.72	0.47
35	300054	鼎龙股份	11,629	333,519.72	0.47
36	002138	顺络电子	11,694	328,835.28	0.47
37	002673	西部证券	41,500	327,020.00	0.46
38	300253	卫宁健康	30,700	325,420.00	0.46
39	002624	完美世界	21,300	323,121.00	0.46

40	300857	协创数据	3,740	321,864.40	0.46
41	300085	银之杰	7,300	321,638.00	0.46
42	002157	正邦科技	117,800	321,594.00	0.46
43	300604	长川科技	7,100	318,861.00	0.45
44	002405	四维图新	37,300	318,542.00	0.45
45	002155	湖南黄金	17,840	318,444.00	0.45
46	300346	南大光电	9,944	314,628.16	0.45
47	002126	银轮股份	12,934	314,037.52	0.45
48	002402	和而泰	13,500	312,795.00	0.44
49	002410	广联达	23,200	311,112.00	0.44
50	002821	凯莱英	3,500	308,875.00	0.44
51	300136	信维通信	13,700	306,880.00	0.44
52	300073	当升科技	6,900	302,703.00	0.43
53	300142	沃森生物	27,400	301,400.00	0.43
54	002444	巨星科技	11,800	301,018.00	0.43
55	002837	英维克	9,967	296,119.57	0.42
56	002152	广电运通	21,800	292,992.00	0.42
57	300627	华测导航	8,344	292,040.00	0.41
58	300001	特锐德	12,174	291,810.78	0.41
59	300773	拉卡拉	8,700	291,015.00	0.41
60	300459	汤姆猫	51,523	288,528.80	0.41
61	300037	新宙邦	8,180	287,936.00	0.41
62	300699	光威复材	9,040	286,296.80	0.41
63	300003	乐普医疗	20,700	285,246.00	0.41
64	300674	宇信科技	9,320	282,302.80	0.40
65	300012	华测检测	23,700	277,053.00	0.39
66	002389	航天彩虹	10,782	276,019.20	0.39
67	300315	掌趣科技	44,500	270,115.00	0.38
68	300170	汉得信息	15,600	268,476.00	0.38
69	300364	中文在线	9,900	262,350.00	0.37
70	002958	青农商行	72,400	261,364.00	0.37
71	300568	星源材质	20,537	260,409.16	0.37
72	300570	太辰光	2,700	260,226.00	0.37
73	300666	江丰电子	3,500	259,350.00	0.37
74	002409	雅克科技	4,700	257,043.00	0.37
75	002335	科华数据	6,000	256,080.00	0.36
76	300077	国民技术	10,000	256,000.00	0.36
77	300558	贝达药业	4,400	254,980.00	0.36
78	300757	罗博特科	1,700	254,949.00	0.36
79	300373	扬杰科技	4,900	254,310.00	0.36
80	002044	美年健康	49,300	253,402.00	0.36
81	300972	万辰集团	1,400	252,336.00	0.36
82	002683	广东宏大	7,400	251,156.00	0.36

83	002739	万达电影	21,800	249,174.00	0.35
84	002318	久立特材	10,600	247,934.00	0.35
85	002139	拓邦股份	17,900	247,199.00	0.35
86	002607	中公教育	80,500	246,330.00	0.35
87	300724	捷佳伟创	4,500	244,350.00	0.35
88	300748	金力永磁	10,240	244,121.60	0.35
89	002025	航天电器	4,704	241,832.64	0.34
90	300100	双林股份	5,000	235,400.00	0.33
91	002583	海能达	19,090	234,997.90	0.33
92	300130	新国都	6,600	234,498.00	0.33
93	002385	大北农	58,000	234,320.00	0.33
94	300144	宋城演艺	27,100	231,705.00	0.33
95	300672	国科微	2,700	229,284.00	0.33
96	300285	国瓷材料	13,200	229,020.00	0.33
97	002080	中材科技	11,700	228,150.00	0.32
98	300296	利亚德	37,400	228,140.00	0.32
99	300432	富临精工	17,260	225,588.20	0.32
100	002568	百润股份	8,800	225,368.00	0.32
101	002222	福晶科技	6,580	225,036.00	0.32
102	300682	朗新集团	9,550	224,425.00	0.32
103	300623	捷捷微电	7,450	222,010.00	0.32
104	002841	视源股份	6,400	221,440.00	0.31
105	300638	广和通	7,726	221,195.38	0.31
106	002487	大金重工	6,700	220,430.00	0.31
107	002926	华西证券	24,600	219,924.00	0.31
108	300763	锦浪科技	3,800	218,082.00	0.31
109	002407	多氟多	17,780	216,738.20	0.31
110	300777	中简科技	5,900	213,875.00	0.30
111	300487	蓝晓科技	4,225	212,517.50	0.30
112	300088	长信科技	35,600	212,176.00	0.30
113	301358	湖南裕能	6,800	212,092.00	0.30
114	002245	蔚蓝锂芯	16,400	210,412.00	0.30
115	300676	华大基因	4,200	209,034.00	0.30
116	002312	川发龙蟒	18,200	208,936.00	0.30
117	300679	电连技术	4,600	208,748.00	0.30
118	002432	九安医疗	5,700	207,651.00	0.29
119	300068	南都电源	12,975	206,562.00	0.29
120	300762	上海瀚讯	9,112	206,204.56	0.29
121	300182	捷成股份	37,414	206,151.14	0.29
122	002151	北斗星通	7,177	205,908.13	0.29
123	300083	创世纪	24,800	203,856.00	0.29
124	300199	翰宇药业	12,300	203,565.00	0.29
125	002015	协鑫能科	14,500	201,985.00	0.29

126	300567	精测电子	3,300	200,013.00	0.28
127	002056	横店东磁	14,100	199,515.00	0.28
128	002497	雅化集团	17,378	198,109.20	0.28
129	300229	拓尔思	10,700	197,308.00	0.28
130	002617	露笑科技	25,800	194,274.00	0.28
131	002506	协鑫集成	72,500	193,575.00	0.27
132	002807	江阴银行	40,582	192,764.50	0.27
133	002500	山西证券	32,680	190,851.20	0.27
134	002756	永兴材料	6,000	190,500.00	0.27
135	002262	恩华药业	9,153	190,199.34	0.27
136	300475	香农芯创	5,300	188,839.00	0.27
137	002171	楚江新材	19,400	188,762.00	0.27
138	002203	海亮股份	18,200	187,824.00	0.27
139	300146	汤臣倍健	16,700	187,708.00	0.27
140	002400	省广集团	24,500	187,180.00	0.27
141	300390	天华新能	9,800	186,886.00	0.27
142	002176	江特电机	25,700	186,582.00	0.26
143	002603	以岭药业	13,200	186,120.00	0.26
144	002439	启明星辰	11,600	185,484.00	0.26
145	002423	中粮资本	15,100	184,673.00	0.26
146	002428	云南锗业	9,200	183,080.00	0.26
147	002249	大洋电机	27,788	182,845.04	0.26
148	002036	联创电子	16,876	182,429.56	0.26
149	002484	江海股份	8,900	182,361.00	0.26
150	002984	森麒麟	9,720	182,250.00	0.26
151	300751	迈为股份	2,600	180,856.00	0.26
152	300607	拓斯达	5,300	180,677.00	0.26
153	002244	滨江集团	18,500	180,375.00	0.26
154	002611	东方精工	14,800	178,488.00	0.25
155	002145	中核钛白	42,995	178,429.25	0.25
156	002747	埃斯顿	8,800	178,112.00	0.25
157	002701	奥瑞金	29,800	177,310.00	0.25
158	301078	孩子王	13,500	176,445.00	0.25
159	301536	星宸科技	2,900	174,870.00	0.25
160	300775	三角防务	6,500	174,590.00	0.25
161	300212	易华录	8,017	174,449.92	0.25
162	002268	电科网安	9,491	173,590.39	0.25
163	300181	佐力药业	10,000	173,300.00	0.25
164	300677	英科医疗	7,300	172,864.00	0.25
165	002317	众生药业	11,400	171,114.00	0.24
166	002936	郑州银行	82,946	170,868.76	0.24
167	002396	星网锐捷	7,593	170,462.85	0.24
168	002507	涪陵榨菜	13,010	166,397.90	0.24



169	300438	鹏辉能源	6,000	165,660.00	0.24
170	300035	中科电气	9,800	165,424.00	0.23
171	002075	沙钢股份	28,200	164,124.00	0.23
172	002373	千方科技	17,600	163,680.00	0.23
173	002948	青岛银行	32,620	162,447.60	0.23
174	300113	顺网科技	8,200	162,032.00	0.23
175	300101	振芯科技	7,100	160,673.00	0.23
176	300070	碧水源	35,700	160,650.00	0.23
177	300735	光弘科技	6,400	160,640.00	0.23
178	002429	兆驰股份	36,500	159,870.00	0.23
179	300601	康泰生物	10,500	159,495.00	0.23
180	002773	康弘药业	5,500	159,335.00	0.23
181	002544	普天科技	6,784	159,084.80	0.23
182	300009	安科生物	18,988	158,929.56	0.23
183	002019	亿帆医药	12,200	158,478.00	0.23
184	002221	东华能源	16,400	158,424.00	0.22
185	300133	华策影视	21,000	157,710.00	0.22
186	300529	健帆生物	7,300	157,461.00	0.22
187	300398	飞凯材料	7,860	156,964.20	0.22
188	301050	雷电微力	2,940	156,702.00	0.22
189	300045	华力创通	8,200	156,538.00	0.22
190	002240	盛新锂能	12,100	155,848.00	0.22
191	002368	太极股份	6,651	155,766.42	0.22
192	300573	兴齐眼药	3,002	155,473.58	0.22
193	002698	博实股份	10,000	155,400.00	0.22
194	300166	东方国信	14,256	155,390.40	0.22
195	002430	杭氧股份	8,000	155,360.00	0.22
196	300624	万兴科技	2,477	153,697.85	0.22
197	301498	乖宝宠物	1,400	153,118.00	0.22
198	002839	张家港行	33,880	152,460.00	0.22
199	002831	裕同科技	6,440	150,824.80	0.21
200	002675	东诚药业	10,400	149,656.00	0.21
201	002270	华明装备	8,900	148,986.00	0.21
202	300456	赛微电子	8,650	148,693.50	0.21
203	002508	老板电器	7,800	148,278.00	0.21
204	002120	韵达股份	22,100	148,070.00	0.21
205	003021	兆威机电	1,360	147,084.00	0.21
206	003031	中瓷电子	2,760	146,859.60	0.21
207	002212	天融信	19,000	146,300.00	0.21
208	300655	晶瑞电材	14,579	145,935.79	0.21
209	300718	长盛轴承	2,100	145,929.00	0.21
210	002048	宁波华翔	7,900	145,439.00	0.21
211	002292	奥飞娱乐	14,900	144,828.00	0.21

212	300118	东方日升	15,048	144,159.84	0.20
213	300910	瑞丰新材	2,480	143,220.00	0.20
214	300185	通裕重工	50,000	143,000.00	0.20
215	002670	国盛金控	9,475	142,598.75	0.20
216	300236	上海新阳	3,650	141,620.00	0.20
217	300957	贝泰妮	3,200	141,504.00	0.20
218	300168	万达信息	18,300	140,361.00	0.20
219	002183	怡亚通	30,400	140,144.00	0.20
220	002063	远光软件	23,550	140,122.50	0.20
221	002299	圣农发展	9,800	140,042.00	0.20
222	002847	盐津铺子	1,710	137,484.00	0.20
223	300618	寒锐钴业	3,840	137,164.80	0.19
224	300457	赢合科技	5,950	136,850.00	0.19
225	300525	博思软件	9,320	135,699.20	0.19
226	300723	一品红	2,700	135,324.00	0.19
227	002572	索菲亚	9,600	134,496.00	0.19
228	300850	新强联	3,750	134,325.00	0.19
229	300294	博雅生物	5,150	133,848.50	0.19
230	301171	易点天下	5,000	133,650.00	0.19
231	300034	钢研高纳	8,000	133,040.00	0.19
232	300595	欧普康视	8,700	132,849.00	0.19
233	002416	爱施德	11,000	132,220.00	0.19
234	002003	伟星股份	12,100	132,011.00	0.19
235	002597	金禾实业	5,600	131,880.00	0.19
236	301301	川宁生物	10,900	131,236.00	0.19
237	002182	宝武镁业	10,720	131,212.80	0.19
238	300026	红日药业	35,500	130,995.00	0.19
239	002706	良信股份	14,480	129,016.80	0.18
240	300888	稳健医疗	3,120	128,232.00	0.18
241	301029	怡合达	5,588	127,741.68	0.18
242	300079	数码视讯	21,800	127,530.00	0.18
243	002906	华阳集团	3,900	126,789.00	0.18
244	002539	云图控股	13,500	126,630.00	0.18
245	002266	浙富控股	41,100	126,588.00	0.18
246	300049	福瑞股份	3,900	126,477.00	0.18
247	002239	奥特佳	43,300	125,570.00	0.18
248	002332	仙琚制药	13,600	124,712.00	0.18
249	002745	木林森	15,800	124,504.00	0.18
250	300747	锐科激光	5,212	123,420.16	0.18
251	300776	帝尔激光	2,308	122,808.68	0.17
252	002265	建设工业	4,000	122,200.00	0.17
253	300811	铂科新材	2,600	120,666.00	0.17
254	300576	容大感光	3,240	120,366.00	0.17

255	300188	国投智能	8,720	120,336.00	0.17
256	002127	南极电商	30,300	120,291.00	0.17
257	300660	江苏雷利	2,700	119,448.00	0.17
258	300769	德方纳米	3,600	118,872.00	0.17
259	300327	中颖电子	4,888	118,387.36	0.17
260	300244	迪安诊断	7,900	117,710.00	0.17
261	300298	三诺生物	5,200	117,468.00	0.17
262	002153	石基信息	13,560	117,429.60	0.17
263	002011	盾安环境	10,000	116,000.00	0.16
264	002091	江苏国泰	15,945	115,920.15	0.16
265	300633	开立医疗	3,900	115,908.00	0.16
266	300224	正海磁材	8,153	115,364.95	0.16
267	301155	海力风电	1,600	115,040.00	0.16
268	002324	普利特	10,800	114,804.00	0.16
269	300036	超图软件	7,500	114,450.00	0.16
270	300827	上能电气	3,745	114,409.75	0.16
271	002010	传化智联	20,300	113,274.00	0.16
272	002468	申通快递	10,500	112,245.00	0.16
273	300783	三只松鼠	4,100	111,151.00	0.16
274	002237	恒邦股份	9,400	110,920.00	0.16
275	002531	天顺风能	15,500	110,670.00	0.16
276	002557	洽洽食品	5,100	110,262.00	0.16
277	002372	伟星新材	10,548	109,277.28	0.16
278	301219	腾远钴业	2,040	108,364.80	0.15
279	300685	艾德生物	4,990	107,434.70	0.15
280	002192	融捷股份	3,500	107,240.00	0.15
281	002100	天康生物	17,200	106,468.00	0.15
282	002643	万润股份	9,250	106,467.50	0.15
283	002226	江南化工	18,300	106,140.00	0.15
284	301165	锐捷网络	1,720	105,711.20	0.15
285	002541	鸿路钢构	6,310	105,629.40	0.15
286	300602	飞荣达	4,961	105,222.81	0.15
287	300260	新莱应材	3,180	104,558.40	0.15
288	002004	华邦健康	25,000	104,250.00	0.15
289	002895	川恒股份	4,600	103,776.00	0.15
290	301297	富乐德	2,500	103,325.00	0.15
291	300482	万孚生物	4,836	103,248.60	0.15
292	300613	富瀚微	2,105	102,892.40	0.15
293	301291	明阳电气	2,500	102,875.00	0.15
294	002254	泰和新材	9,540	102,841.20	0.15
295	002626	金达威	5,000	102,300.00	0.15
296	002096	易普力	8,100	100,521.00	0.14
297	002605	姚记科技	3,600	100,440.00	0.14

298	300087	荃银高科	11,110	99,434.50	0.14
299	002815	崇达技术	8,731	98,922.23	0.14
300	300761	立华股份	5,200	97,708.00	0.14
301	300363	博腾股份	5,700	97,356.00	0.14
302	300357	我武生物	4,700	97,008.00	0.14
303	002865	钧达股份	2,478	96,642.00	0.14
304	003022	联泓新科	6,100	96,563.00	0.14
305	002761	浙江建投	10,800	95,796.00	0.14
306	300446	航天智造	5,500	95,260.00	0.14
307	301091	深城交	3,250	95,030.00	0.13
308	002408	齐翔腾达	21,199	94,971.52	0.13
309	002351	漫步者	7,200	94,464.00	0.13
310	300772	运达股份	7,320	94,281.60	0.13
311	300323	华灿光电	12,300	94,095.00	0.13
312	300641	正丹股份	4,100	93,439.00	0.13
313	002867	周大生	7,075	93,248.50	0.13
314	002233	塔牌集团	12,600	93,240.00	0.13
315	002458	益生股份	11,382	92,990.94	0.13
316	002608	江苏国信	12,500	91,625.00	0.13
317	002061	浙江交科	22,940	90,842.40	0.13
318	002518	科士达	4,000	90,360.00	0.13
319	301510	固高科技	3,000	90,150.00	0.13
320	002204	大连重工	15,100	90,147.00	0.13
321	301095	广立微	1,600	89,984.00	0.13
322	002832	比音勒芬	5,562	89,270.10	0.13
323	002690	美亚光电	5,260	88,736.20	0.13
324	300770	新媒股份	2,200	87,978.00	0.12
325	300855	图南股份	3,690	87,748.20	0.12
326	301589	诺瓦星云	600	87,198.00	0.12
327	301039	中集车辆	10,700	86,991.00	0.12
328	300463	迈克生物	7,300	86,870.00	0.12
329	300171	东富龙	6,500	86,385.00	0.12
330	301205	联特科技	900	86,274.00	0.12
331	002243	力合科创	10,500	85,680.00	0.12
332	002668	TCL 智家	8,500	83,045.00	0.12
333	300726	宏达电子	2,300	82,225.00	0.12
334	003035	南网能源	17,800	81,702.00	0.12
335	002081	金螳螂	23,500	80,605.00	0.11
336	002545	东方铁塔	9,000	80,010.00	0.11
337	002925	盈趣科技	4,430	79,651.40	0.11
338	300492	华图山鼎	1,160	78,740.80	0.11
339	301487	盟固利	3,500	76,405.00	0.11
340	002960	青鸟消防	7,688	75,111.76	0.11

341	300705	九典制药	4,800	74,736.00	0.11
342	002993	奥海科技	1,800	74,646.00	0.11
343	002967	广电计量	4,200	73,878.00	0.10
344	002635	安洁科技	5,450	73,793.00	0.10
345	301238	瑞泰新材	3,800	73,036.00	0.10
346	002511	中顺洁柔	10,840	72,844.80	0.10
347	002737	葵花药业	4,600	72,312.00	0.10
348	002755	奥赛康	4,500	71,910.00	0.10
349	002101	广东鸿图	5,700	71,307.00	0.10
350	002705	新宝股份	4,800	70,560.00	0.10
351	002461	珠江啤酒	6,200	69,998.00	0.10
352	002434	万里扬	9,500	69,635.00	0.10
353	301071	力量钻石	2,320	69,159.20	0.10
354	002320	海峡股份	10,552	69,010.08	0.10
355	300151	昌红科技	5,600	68,936.00	0.10
356	002051	中工国际	7,940	68,522.20	0.10
357	002060	广东建工	19,600	68,208.00	0.10
358	300428	立中集团	3,700	67,414.00	0.10
359	002859	洁美科技	3,380	67,295.80	0.10
360	300821	东岳硅材	8,500	66,810.00	0.09
361	300140	节能环保	10,800	66,636.00	0.09
362	300257	开山股份	6,600	66,462.00	0.09
363	002498	汉缆股份	19,500	65,910.00	0.09
364	002563	森马服饰	12,300	64,698.00	0.09
365	002158	汉钟精机	3,700	64,306.00	0.09
366	300820	英杰电气	1,400	64,190.00	0.09
367	301153	中科江南	2,380	62,356.00	0.09
368	301611	珂玛科技	1,100	60,511.00	0.09
369	002216	三全食品	5,460	60,442.20	0.09
370	002041	登海种业	6,100	59,719.00	0.08
371	300406	九强生物	4,200	59,430.00	0.08
372	300768	迪普科技	3,450	59,167.50	0.08
373	002946	新乳业	3,100	58,187.00	0.08
374	301267	华夏眼科	3,000	57,510.00	0.08
375	002399	海普瑞	4,700	55,977.00	0.08
376	300861	美畅股份	2,680	54,484.40	0.08
377	002791	坚朗五金	2,500	53,500.00	0.08
378	301217	铜冠铜箔	4,100	51,291.00	0.07
379	002913	奥士康	1,700	49,997.00	0.07
380	301522	上大股份	1,400	49,854.00	0.07
381	300080	易成新能	11,900	49,742.00	0.07
382	301363	美好医疗	2,800	49,392.00	0.07
383	002302	西部建设	8,400	48,720.00	0.07

384	002053	云南能投	4,300	47,343.00	0.07
385	301200	大族数控	1,100	46,717.00	0.07
386	300856	科思股份	3,040	46,056.00	0.07
387	002901	大博医疗	1,200	43,488.00	0.06
388	301207	华兰疫苗	2,550	42,993.00	0.06
389	301015	百洋医药	2,100	42,126.00	0.06
390	002978	安宁股份	1,300	41,054.00	0.06
391	301327	华宝新能	780	40,060.80	0.06
392	301381	赛维时代	1,900	37,905.00	0.05
393	301371	敷尔佳	1,430	36,279.10	0.05
394	301090	华润材料	4,800	36,144.00	0.05
395	002534	西子洁能	3,200	35,968.00	0.05
396	301551	无线传媒	700	34,118.00	0.05
397	002911	佛燃能源	3,086	31,662.36	0.04
398	301606	绿联科技	600	30,858.00	0.04
399	003039	顺控发展	2,200	29,832.00	0.04
400	301262	海看股份	800	21,088.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001388	信通电子	374	6,141.08	0.01
2	301678	新恒汇	101	4,498.54	0.01
3	301590	优优绿能	15	2,092.20	0.00
4	301636	泽润新能	41	1,945.86	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	300779	惠城环保	396,660.00	0.54
2	002821	凯莱英	334,195.00	0.46
3	300972	万辰集团	273,149.00	0.37
4	300003	乐普医疗	272,784.00	0.37
5	300170	汉得信息	271,734.00	0.37
6	300144	宋城演艺	245,719.00	0.33
7	300570	太辰光	240,407.00	0.33
8	300077	国民技术	232,943.00	0.32
9	300100	双林股份	214,296.00	0.29
10	002603	以岭药业	194,615.00	0.27
11	300146	汤臣倍健	192,790.00	0.26
12	002400	省广集团	192,735.00	0.26
13	300607	拓斯达	187,388.00	0.26

14	002611	东方精工	178,579.00	0.24
15	300751	迈为股份	176,814.00	0.24
16	002428	云南锗业	175,010.00	0.24
17	300718	长盛轴承	145,280.00	0.20
18	301536	星宸科技	135,545.00	0.18
19	301171	易点天下	134,281.00	0.18
20	002966	苏州银行	110,938.00	0.15

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300476	胜宏科技	1,089,435.00	1.48
2	300339	润和软件	653,231.00	0.89
3	002595	豪迈科技	437,074.20	0.60
4	300251	光线传媒	414,323.00	0.56
5	302132	中航成飞	412,524.00	0.56
6	300474	景嘉微	316,971.50	0.43
7	301035	润丰股份	105,617.00	0.14
8	300841	康华生物	105,567.00	0.14
9	002727	一心堂	102,389.00	0.14
10	002099	海翔药业	102,158.28	0.14
11	300725	药石科技	101,472.30	0.14
12	002567	唐人神	101,034.00	0.14
13	002258	利尔化学	96,529.40	0.13
14	002155	湖南黄金	88,561.00	0.12
15	002038	双鹭药业	86,276.00	0.12
16	002985	北摩高科	82,158.66	0.11
17	300393	中来股份	72,227.00	0.10
18	002390	信邦制药	71,107.00	0.10
19	002726	龙大美食	68,635.00	0.09
20	002612	朗姿股份	63,825.00	0.09

#### 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	8,153,471.56
卖出股票收入（成交）总额	7,807,871.33

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	137.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	137.29
---	----	--------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001388	信通电子	5,517.12	0.01	新发未上市
1	001388	信通电子	623.96	0.00	新股锁定
2	301678	新恒汇	4,498.54	0.01	新股锁定
3	301590	优优绿能	2,092.20	0.00	新股锁定
4	301636	泽润新能	1,945.86	0.00	新股锁定

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

##### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
335	109,138.10	34,624,481.00	94.70	1,936,783.00	5.30

##### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	32,677,908.00	89.38

#### 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	中信证券股份有限公司	1,946,373.00	5.32

2	骆华星	215,355.00	0.59
3	陶文明	136,900.00	0.37
4	谭惠玲	100,009.00	0.27
5	刘亦男	64,700.00	0.18
6	林瑾葆	40,000.00	0.11
7	罗宏斌	35,000.00	0.10
8	陈宝琴	30,140.00	0.08
9	ZHANG XIA CHANG	30,000.00	0.08
10	胡梦姣	30,000.00	0.08
11	嘉实中创 400 交易型开 放式指数证券投资基金 联接基金	32,677,908.00	89.38

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 3 月 22 日） 基金份额总额	286,561,264.00
本报告期期初基金份额总额	40,561,264.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,561,264.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况  
2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任

公司副总经理、首席信息官。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券股份有限公司	2	15,901,480.83	99.91	2,956.07	100.00	-
中信证券股份有限公司	3	14,312.50	0.09	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

股份有限公司						
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份	3	-	-	-	-	-

有限公司						
------	--	--	--	--	--	--

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

3. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。国联证券股份有限公司更名为国联民生证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：东兴证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国都证券股份有限公司退租交易单元 1 个。华宝证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国信证券股份有限公司	14,422.10	100.00	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公 司						
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛高 华证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国联民 生证券	-	-	-	-	-	-

股份有 限公司						
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-



司						
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 19 日
2	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 8 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
联接基金	1	2025-01-01 至 2025-06-30	34,787,908.00	2,000,000.00	4,110,000.00	32,677,908.00	89.38
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内中创 400 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

- (1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- (2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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

或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日