

华夏中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 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
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	54
7.1 期末基金资产组合情况.....	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	70
§8 基金份额持有人信息.....	71
§9 开放式基金份额变动.....	72
§10 重大事件揭示.....	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§12 备查文件目录.....	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500（扩位证券简称：中证 500ETF 华夏）
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,549,608,794 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	2015 年 5 月 29 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最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为“中证 500 指数”。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王小飞
	联系电话	400-818-6666	021-6063 7103
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637228
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		张佑君	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-56,911,173.22
本期利润	-637,416,198.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1612
本期加权平均净值利润率	-5.65%
本期基金份额净值增长率	-8.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-8,520,122,817.45
期末可供分配基金份额利润	-1.8727
期末基金资产净值	12,265,078,028.02
期末基金份额净值	2.6959
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-40.99%

注：①所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。

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。

③期末可供分配利润为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

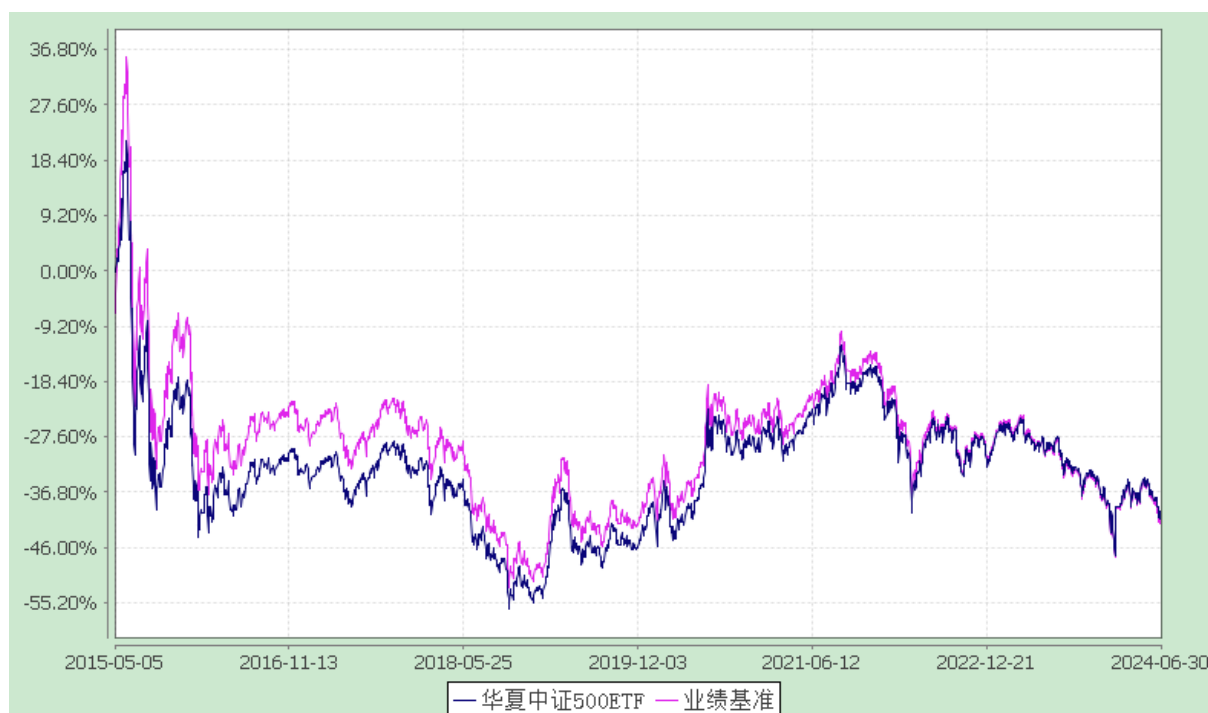
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.24%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.65%	0.00%

月						
过去三个月	-5.40%	1.14%	-6.50%	1.14%	1.10%	0.00%
过去六个月	-8.00%	1.60%	-8.96%	1.61%	0.96%	-0.01%
过去一年	-16.63%	1.27%	-17.60%	1.27%	0.97%	0.00%
过去三年	-23.99%	1.19%	-27.40%	1.20%	3.41%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-40.99%	1.57%	-41.92%	1.60%	0.93%	-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

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 5 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日)



§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司,在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人,国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司,香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》,截至 2024 年 6 月 30 日,华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先(基金排名不作为产品未来表现的保证),其中:

主动权益产品:在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10;在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/17;在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

固收与固收+产品:在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券(QDII)(A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排名第 2/24;在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/18;在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616;在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第 52/793;在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
荣膺	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2016-10-20	-	14 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理，华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交

					<p>易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏创业板低波价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金（LOF）基金经理（2016 年 10 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 1 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 2 月 25 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 29 日至 2022 年 8 月 22 日期间）等。</p>
--	--	--	--	--	---

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的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% 的交易共有 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

上半年国内宏观经济运行总体平稳，PMI 季节性冲高回落，PPI 同比降幅收窄，M1 降幅较大。金融市场波动幅度较大，债券市场利率几乎单边下行，权益市场宽幅震荡，商品市场冲高回落。权益市场风格和行业呈现分化，大盘风格强于小盘风格，低估值红利风格和人工智能算力方向继续强势。强势风格内部也呈现分化特征，银行、水电、核电在红利风格里强势，光模块、PCB 在人工智能方向强势。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括财通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、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、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.6959 元，本报告期份额净值增长率为-8.00%，同期业绩比较基准增长率-8.96%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.96%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济在财政发力支持下有望继续稳健运行，美联储降息将会给市场带来变化。降息后，国内货币政策空间打开，随着货币政策的落地，经济预期改善，风险偏好有望提升。存在概率出现风格的反转交易，即前期弱势的小盘风格、消费行业等有望走强。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

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及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，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。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作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合规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	57,869,041.45	39,831,735.96
结算备付金		47,343,991.47	31,960,645.46
存出保证金		14,222,442.08	7,027,626.10
交易性金融资产	6.4.7.2	12,168,395,665.94	6,361,588,536.23
其中：股票投资		12,166,202,502.52	6,361,205,024.46

基金投资		-	-
债券投资		2,193,163.42	383,511.77
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	-	-
应收清算款		13,102,745.17	120,682,072.88
应收股利		760,419.43	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	28,769.79	56,930.60
资产总计		12,301,723,075.33	6,561,147,547.23
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20,356,827.16	109,770,964.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,238,316.78	2,259,115.02
应付托管费		1,047,663.37	451,822.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,963.86	10,950.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	9,995,276.14	30,365,398.25
负债合计		36,645,047.31	142,858,251.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	20,785,200,845.47	10,007,033,305.70
未分配利润	6.4.7.8	-8,520,122,817.45	-3,588,744,009.56
净资产合计		12,265,078,028.02	6,418,289,296.14
负债和净资产总计		12,301,723,075.33	6,561,147,547.23

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.6959 元，基金份额总额 4,549,608,794.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-602,165,709.05	199,360,803.85
1.利息收入		2,479,351.61	3,153,350.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	594,511.58	364,837.52
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		1,884,840.03	2,788,513.20
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,864,005.07	10,102,368.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-193,449,839.39	-39,620,051.27
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	126,063.27	207,514.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	537,939.03	646,912.57
股利收益	6.4.7.16	168,921,832.02	48,867,992.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-580,505,025.76	185,684,036.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-276,029.83	421,047.61
减：二、营业总支出		35,250,489.93	12,816,557.59
1.管理人报酬		27,878,633.05	10,077,274.36
2.托管费		5,575,726.64	2,015,454.85
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		19,770.19	13,313.74
8.其他费用	6.4.7.21	1,776,360.05	710,514.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-637,416,198.98	186,544,246.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-637,416,198.98	186,544,246.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-637,416,198.98	186,544,246.26

注：根据《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》修订版调整，可比期 2023 年中期报告利润表中“证券出借利息收入”项目金额列示在“其他利息收入”。

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,007,033,305.70	-3,588,744,009.56	6,418,289,296.14
二、本期期初净资产	10,007,033,305.70	-3,588,744,009.56	6,418,289,296.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,778,167,539.77	-4,931,378,807.89	5,846,788,731.88
（一）、综合收益总额	-	-637,416,198.98	-637,416,198.98
（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）	10,778,167,539.77	-4,293,962,608.91	6,484,204,930.86
其中：1.基金申购款	21,746,387,543.48	-8,420,097,856.52	13,326,289,686.96
2.基金赎回款	-10,968,220,003.71	4,126,135,247.61	-6,842,084,756.10
（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	20,785,200,845.47	-8,520,122,817.45	12,265,078,028.02
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,099,993,254.37	-1,923,095,169.36	4,176,898,085.01
二、本期期初净资产	6,099,993,254.37	-1,923,095,169.36	4,176,898,085.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,100,111,371.45	-180,811,309.33	919,300,062.12

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	186,544,246.26	186,544,246.26
(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)	1,100,111,371.45	-367,355,555.59	732,755,815.86
其中: 1.基金申购款	3,420,944,328.51	-976,483,555.08	2,444,460,773.43
2.基金赎回款	-2,320,832,957.06	609,127,999.49	-1,711,704,957.57
(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	7,200,104,625.82	-2,103,906,478.69	5,096,198,147.13

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：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]113 号《关于准予华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 2,134,343,230 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有

限公司确定 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2015 年 5 月 22 日中证 500 指数收盘值的两千万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 2,134,473,505 份，本次基金份额折算比例为 0.21889230，折算后基金份额总额为 467,208,794 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置

试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得

的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10%的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/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，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	57,869,041.45
等于：本金	57,862,824.49
加：应计利息	6,216.96
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	57,869,041.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,056,588,159.35	-	12,166,202,502.52	-890,385,656.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所	2,193,000.00	163.42	2,193,163.42	-

	市场				
	银行间市场				
	合计	2,193,000.00	163.42	2,193,163.42	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		13,058,781,159.35	163.42	12,168,395,665.94	-890,385,656.83

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	94,338,120.00	-	-	-
其中：股指期货	94,338,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	94,338,120.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	中证 500 期货 IC2409 合约	92	89,703,680.00	-4,634,440.00
合计	-	-	-	-4,634,440.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-4,634,440.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，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/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为 0。

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。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	28,769.79
待摊费用	-
合计	28,769.79

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	2,292,296.70
其中：交易所市场	2,292,296.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,453.90
应付指数使用费	1,672,718.00
应退替代款	5,925,741.40
可退替代款	5,066.14
合计	9,995,276.14

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,190,408,794.00	10,007,033,305.70
本期申购	4,760,000,000.00	21,746,387,543.48
本期赎回（以“-”号填列）	-2,400,800,000.00	-10,968,220,003.71
本期末	4,549,608,794.00	20,785,200,845.47

6.4.7.8 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	-161,117,355.57	-3,427,626,653.99	-3,588,744,009.56
本期期初	-161,117,355.57	-3,427,626,653.99	-3,588,744,009.56
本期利润	-56,911,173.22	-580,505,025.76	-637,416,198.98
本期基金份额交易产生的变动数	-432,541,219.61	-3,861,421,389.30	-4,293,962,608.91
其中：基金申购款	-806,573,857.03	-7,613,523,999.49	-8,420,097,856.52
基金赎回款	374,032,637.42	3,752,102,610.19	4,126,135,247.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-650,569,748.40	-7,869,553,069.05	-8,520,122,817.45

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	92,113.24
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	478,143.61
其他	24,254.73
合计	594,511.58

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-163,537,244.97
股票投资收益——赎回差价收入	-29,912,594.42
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	-193,449,839.39

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,917,332,932.39
减：卖出股票成本总额	6,073,712,888.53
减：交易费用	7,157,288.83
买卖股票差价收入	-163,537,244.97

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	6,842,084,756.10
减：现金支付赎回款总额	3,587,212,234.10
减：赎回股票成本总额	3,284,785,116.42
减：交易费用	-
赎回差价收入	-29,912,594.42

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	207.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	125,856.17
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	126,063.27

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	681,445.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	555,500.00
减：应计利息总额	61.63
减：交易费用	27.26

买卖债券差价收入	125,856.17
----------	------------

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	537,939.03

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	168,921,832.02
其中：证券出借权益补偿收入	7,953,813.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	168,921,832.02

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-576,229,625.76
——股票投资	-576,229,625.76
——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	-4,275,400.00
——权证投资	-
——期货投资	-4,275,400.00
4.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	-580,505,025.76

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-276,029.83
合计	-276,029.83

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	711.19
指数使用费	1,672,718.00
存托服务费	3,476.96
合计	1,776,360.05

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

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏中证 500ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	基金管理人第一大股东的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中信证券	10,622,775,643.72	69.13%	747,006,697.85	21.15%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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
中信证券	1,101,600.69	34.28%	456,935.66	19.93%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中信证券	322,202.42	21.15%	246,847.07	8.16%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手

费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,878,633.05	10,077,274.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	129,753.62	107,663.92
应支付基金管理人的净管理费	27,748,879.43	9,969,610.44

注：①支付基金管理人的基金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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用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，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,575,726.64	2,015,454.85

注：①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024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	期末证券出借业务余额
中信证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	期末证券出借业务余额
中信证券	305,567,696.00	224,610.56	-	-

注：2023 年股票注册制全面改革，自注册制实施之日起，本基金没有与关联方通过约定方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	757,934,088.56	0.41~5.60	1.22	331,401.72	7,864,593.00	1,190.23
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	464,635,087.00	1.00~15.10	1.41	5,001,935.55	410,470,370.56	4,916,174.40

注：上年度可比期间数据，按照最新 XBRL 模板要求调整披露信息。

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自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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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
中信中证资本	-	-	7,862,148.00	0.36%
华夏中证 500ETF 联接	651,587,723.00	14.32%	582,187,723.00	26.58%
中信证券	2,511,415.00	0.06%	30,395,026.00	1.39%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	57,869,041.45	92,113.24	14,011,226.46	29,560.96

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024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
中信证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2024 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688525	佰维存储	2024-06-04	6 个月	大宗转让流通受限	51.46	56.15	100,000	5,146,000.00	5,615,000.00	-
689009	九号公司	2024-06-12	6 个月	大宗转让流通受限	35.42	33.84	100,000	3,542,000.00	3,384,000.00	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024-06-14	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	21,930	2,193,000.00	2,193,163.42	期末估值单价为含息价格

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③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。

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设定限售期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。

6.4.12.2 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（股）	期末估值总额
1	300502	新易盛	2024年7月2日 -2024年7月9日	105.55	66,400.00	7,008,520.00
2	002028	思源电气	2024年7月2日 -2024年7月9日	66.90	57,500.00	3,846,750.00
3	688536	思瑞浦	2024年7月2日 -2024年7月12日	97.81	35,400.00	3,462,474.00
4	601058	赛轮轮胎	2024年7月2日 -2024年7月9日	14.00	234,100.00	3,277,400.00
5	601168	西部矿业	2024年7月2日 -2024年7月9日	17.95	178,700.00	3,207,665.00
6	600066	宇通客车	2024年7月2日 -2024年7月9日	25.80	124,300.00	3,206,940.00
7	688169	石头科技	2024年7月2日 -2024年7月9日	392.60	8,100.00	3,180,060.00
8	300394	天孚通信	2024年7月2日 -2024年7月9日	88.42	35,800.00	3,165,436.00
9	002340	格林美	2024年7月2日 -2024年7月9日	6.37	481,900.00	3,069,703.00
10	000933	神火股份	2024年7月2日 -2024年7月9日	20.23	147,600.00	2,985,948.00
11	601077	渝农商行	2024年7月2日 -2024年7月11日	5.02	580,900.00	2,916,118.00
12	000988	华工科技	2024年7月2日 -2024年7月9日	29.93	94,300.00	2,822,399.00
13	002384	东山精密	2024年7月2日 -2024年7月9日	20.70	128,000.00	2,649,600.00
14	000423	东阿阿胶	2024年7月2日 -2024年7月9日	62.60	42,000.00	2,629,200.00

15	002966	苏州银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.50	344,300.00	2,582,250.00
16	000630	铜陵有色	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.61	713,200.00	2,574,652.00
17	600988	赤峰黄金	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.34	155,700.00	2,544,138.00
18	601233	桐昆股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.96	158,100.00	2,523,276.00
19	002532	天山铝业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.11	305,600.00	2,478,416.00
20	002625	光启技术	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.35	141,200.00	2,449,820.00
21	600096	云天化	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.42	120,200.00	2,334,284.00
22	000400	许继电气	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	34.41	66,600.00	2,291,706.00
23	601555	东吴证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.90	375,900.00	2,217,810.00
24	002156	通富微电	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	22.39	99,000.00	2,216,610.00
25	002273	水晶光电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.98	130,300.00	2,212,494.00
26	002078	太阳纸业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.95	157,000.00	2,190,150.00
27	600885	宏发股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.68	77,900.00	2,156,272.00
28	601128	常熟银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.57	283,110.00	2,143,142.70
29	300207	欣旺达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.17	139,600.00	2,117,732.00
30	002223	鱼跃医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	37.60	55,800.00	2,098,080.00
31	600352	浙江龙盛	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.59	244,100.00	2,096,819.00
32	002138	顺络电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.46	75,200.00	2,064,992.00
33	600642	申能股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.83	229,500.00	2,026,485.00
34	601108	财通证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.61	304,800.00	2,014,728.00
35	002353	杰瑞股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	35.08	57,200.00	2,006,576.00
36	600765	中航重机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.40	96,400.00	1,966,560.00

37	002185	华天科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.15	240,400.00	1,959,260.00
38	600873	梅花生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.02	193,000.00	1,933,860.00
39	002517	恺英网络	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.55	201,800.00	1,927,190.00
40	301236	软通动力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	35.21	53,300.00	1,876,693.00
41	688120	华海清科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	189.58	9,800.00	1,857,884.00
42	603606	东方电缆	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	48.81	38,000.00	1,854,780.00
43	600177	雅戈尔	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.12	260,500.00	1,854,760.00
44	601577	长沙银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.18	226,200.00	1,850,316.00
45	688032	禾迈股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	114.78	16,092.00	1,847,039.76
46	600109	国金证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.55	244,300.00	1,844,465.00
47	600079	人福医药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.17	106,900.00	1,835,473.00
48	300003	乐普医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.84	123,300.00	1,829,772.00
49	688099	晶晨股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	59.32	30,800.00	1,827,056.00
50	600060	海信视像	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	24.74	73,200.00	1,810,968.00
51	300017	网宿科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.90	228,400.00	1,804,360.00
52	600497	驰宏锌锗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.34	334,400.00	1,785,696.00
53	300866	安克创新	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	71.21	24,890.00	1,772,416.90
54	300136	信维通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.58	90,300.00	1,768,074.00
55	002128	电投能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	21.10	83,700.00	1,766,070.00
56	000783	长江证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.83	363,200.00	1,754,256.00
57	603160	汇顶科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	68.75	25,500.00	1,753,125.00
58	002739	万达电影	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.09	142,800.00	1,726,452.00

59	689009	九号公司	2024年7月2日 -2024年7月9日	36.81	46,900.00	1,726,389.00
60	000932	华菱钢铁	2024年7月2日 -2024年7月9日	4.43	388,900.00	1,722,827.00
61	000683	远兴能源	2024年7月2日 -2024年7月9日	6.91	245,700.00	1,697,787.00
62	600348	华阳股份	2024年7月2日 -2024年7月9日	9.96	168,900.00	1,682,244.00
63	002409	雅克科技	2024年7月2日 -2024年7月9日	62.91	26,600.00	1,673,406.00
64	600536	中国软件	2024年7月2日 -2024年7月9日	29.92	55,900.00	1,672,528.00
65	000009	中国宝安	2024年7月2日 -2024年7月9日	8.60	193,400.00	1,663,240.00
66	002444	巨星科技	2024年7月2日 -2024年7月9日	24.70	67,300.00	1,662,310.00
67	000878	云南铜业	2024年7月2日 -2024年7月9日	12.46	131,400.00	1,637,244.00
68	002008	大族激光	2024年7月2日 -2024年7月9日	20.80	78,700.00	1,636,960.00
69	688122	西部超导	2024年7月2日 -2024年7月9日	38.32	42,300.00	1,620,936.00
70	002797	第一创业	2024年7月2日 -2024年7月9日	5.09	315,400.00	1,605,386.00
71	300474	景嘉微	2024年7月2日 -2024年7月9日	63.23	25,300.00	1,599,719.00
72	000039	中集集团	2024年7月2日 -2024年7月9日	9.26	172,600.00	1,598,276.00
73	601990	南京证券	2024年7月2日 -2024年7月9日	7.68	207,400.00	1,592,832.00
74	600298	安琪酵母	2024年7月2日 -2024年7月9日	27.93	56,800.00	1,586,424.00
75	000066	中国长城	2024年7月2日 -2024年7月9日	8.75	181,200.00	1,585,500.00
76	300012	华测检测	2024年7月2日 -2024年7月9日	10.06	157,500.00	1,584,450.00
77	300144	宋城演艺	2024年7月2日 -2024年7月9日	8.03	196,300.00	1,576,289.00
78	600529	山东药玻	2024年7月2日 -2024年7月9日	25.34	61,900.00	1,568,546.00
79	600985	淮北矿业	2024年7月2日 -2024年7月9日	16.74	93,000.00	1,556,820.00
80	002673	西部证券	2024年7月2日 -2024年7月9日	6.19	251,300.00	1,555,547.00

81	002465	海格通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.36	150,000.00	1,554,000.00
82	601179	中国西电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.04	192,100.00	1,544,484.00
83	600418	江淮汽车	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.84	96,300.00	1,525,392.00
84	603596	伯特利	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	38.90	38,640.00	1,503,096.00
85	601717	郑煤机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.80	100,600.00	1,488,880.00
86	000728	国元证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.06	245,500.00	1,487,730.00
87	300395	菲利华	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	30.75	48,300.00	1,485,225.00
88	600862	中航高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	18.78	77,900.00	1,462,962.00
89	000703	恒逸石化	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.09	206,200.00	1,461,958.00
90	601666	平煤股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.20	129,800.00	1,453,760.00
91	601198	东兴证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.96	181,900.00	1,447,924.00
92	002738	中矿资源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	26.80	53,900.00	1,444,520.00
93	601997	贵阳银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.27	274,100.00	1,444,507.00
94	600879	航天电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.77	185,400.00	1,440,558.00
95	600282	南钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.98	289,000.00	1,439,220.00
96	000960	锡业股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.49	92,200.00	1,428,178.00
97	002155	湖南黄金	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	18.10	78,800.00	1,426,280.00
98	600521	华海药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.05	83,300.00	1,420,265.00
99	603338	浙江鼎力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	60.42	23,500.00	1,419,870.00
100	600863	内蒙华电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.64	305,900.00	1,419,376.00
101	601162	天风证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.18	650,300.00	1,417,654.00
102	601696	中银证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.08	156,000.00	1,416,480.00

103	002595	豪迈科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	38.17	37,100.00	1,416,107.00
104	002472	双环传动	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	22.02	63,500.00	1,398,270.00
105	300037	新宙邦	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	28.56	48,800.00	1,393,728.00
106	300001	特锐德	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.12	69,100.00	1,390,292.00
107	603939	益丰药房	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	24.55	56,620.00	1,390,021.00
108	300724	捷佳伟创	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	54.01	25,700.00	1,388,057.00
109	600141	兴发集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.08	72,600.00	1,385,208.00
110	002294	信立泰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	26.63	52,000.00	1,384,760.00
111	002281	光迅科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	37.37	36,900.00	1,378,953.00
112	600549	厦门钨业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.25	79,400.00	1,369,650.00
113	600699	均胜电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.82	92,200.00	1,366,404.00
114	600546	山煤国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.62	92,700.00	1,355,274.00
115	000723	美锦能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.76	284,000.00	1,351,840.00
116	600839	四川长虹	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.49	300,200.00	1,347,898.00
117	600820	隧道股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.53	206,300.00	1,347,139.00
118	300699	光威复材	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	24.83	54,100.00	1,343,303.00
119	600369	西南证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.58	374,200.00	1,339,636.00
120	300285	国瓷材料	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.85	74,900.00	1,336,965.00
121	002262	恩华药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	23.74	56,300.00	1,336,562.00
122	002064	华峰化学	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.17	185,800.00	1,332,186.00
123	603589	口子窖	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	39.19	33,400.00	1,308,946.00
124	601000	唐山港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.70	277,700.00	1,305,190.00

125	300073	当升科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	34.31	37,800.00	1,296,918.00
126	300146	汤臣倍健	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.55	95,400.00	1,292,670.00
127	000513	丽珠集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	37.21	34,300.00	1,276,303.00
128	600486	扬农化工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	56.45	22,600.00	1,275,770.00
129	600704	物产中大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.34	292,300.00	1,268,582.00
130	601966	玲珑轮胎	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	18.37	68,800.00	1,263,856.00
131	000598	兴蓉环境	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.52	167,600.00	1,260,352.00
132	600170	上海建工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.15	583,800.00	1,255,170.00
133	600153	建发股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.93	140,500.00	1,254,665.00
134	600155	华创云信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.91	211,900.00	1,252,329.00
135	002756	永兴材料	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	35.78	34,900.00	1,248,722.00
136	000830	鲁西化工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.59	107,500.00	1,245,925.00
137	688180	君实生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	29.05	42,700.00	1,240,435.00
138	600499	科达制造	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.43	146,100.00	1,231,623.00
139	600118	中国卫星	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	22.23	55,400.00	1,231,542.00
140	300529	健帆生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.21	45,200.00	1,229,892.00
141	000738	航发控制	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	20.07	61,200.00	1,228,284.00
142	600583	海油工程	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.91	207,300.00	1,225,143.00
143	002558	巨人网络	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.44	129,500.00	1,222,480.00
144	300114	中航电测	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	45.25	27,000.00	1,221,750.00
145	002152	广电运通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.46	116,500.00	1,218,590.00
146	688188	柏楚电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	184.55	6,560.00	1,210,648.00

147	000591	太阳能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.71	256,600.00	1,208,586.00
148	002385	大北农	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.85	310,200.00	1,194,270.00
149	600673	东阳光	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.04	169,400.00	1,192,576.00
150	600970	中材国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.06	98,800.00	1,191,528.00
151	002439	启明星辰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.26	69,000.00	1,190,940.00
152	002025	航天电器	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	46.38	25,500.00	1,182,690.00
153	300058	蓝色光标	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.44	215,500.00	1,172,320.00
154	601216	君正集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.69	316,700.00	1,168,623.00
155	600637	东方明珠	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.08	192,100.00	1,167,968.00
156	300373	扬杰科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	38.90	30,000.00	1,167,000.00
157	000729	燕京啤酒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.83	132,000.00	1,165,560.00
158	000623	吉林敖东	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.40	86,900.00	1,164,460.00
159	605358	立昂微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	23.14	50,300.00	1,163,942.00
160	600143	金发科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.61	175,300.00	1,158,733.00
161	600998	九州通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.88	236,850.00	1,155,828.00
162	300251	光线传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.41	137,300.00	1,154,693.00
163	002372	伟星新材	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.42	74,300.00	1,145,706.00
164	300677	英科医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	26.81	42,700.00	1,144,787.00
165	000519	中兵红箭	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	14.67	77,900.00	1,142,793.00
166	600021	上海电力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.89	115,500.00	1,142,295.00
167	600516	方大炭素	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.31	264,100.00	1,138,271.00
168	300383	光环新网	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.45	134,700.00	1,138,215.00

169	600392	盛和资源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.62	131,200.00	1,130,944.00
170	000636	风华高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.06	86,500.00	1,129,690.00
171	300024	机器人	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.74	115,900.00	1,128,866.00
172	603816	顾家家居	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	32.29	34,500.00	1,114,005.00
173	600909	华安证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	4.21	264,300.00	1,112,703.00
174	603225	新凤鸣	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.59	71,300.00	1,111,567.00
175	600038	中直股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	41.11	27,000.00	1,109,970.00
176	002044	美年健康	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.78	293,500.00	1,109,430.00
177	000883	湖北能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.01	183,500.00	1,102,835.00
178	300604	长川科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.17	40,500.00	1,100,385.00
179	600867	通化东宝	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.37	130,700.00	1,093,959.00
180	000629	钒钛股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.50	436,300.00	1,090,750.00
181	601016	节能风电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.99	364,600.00	1,090,154.00
182	600566	济川药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	31.71	34,300.00	1,087,653.00
183	688005	容百科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	23.28	46,700.00	1,087,176.00
184	300088	长信科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.70	230,100.00	1,081,470.00
185	600511	国药股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	30.79	34,900.00	1,074,571.00
186	000997	新大陆	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.91	76,900.00	1,069,679.00
187	600582	天地科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.89	155,100.00	1,068,639.00
188	600535	天士力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.58	84,100.00	1,057,978.00
189	600498	烽火通信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.90	66,500.00	1,057,350.00
190	601665	齐鲁银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.91	214,700.00	1,054,177.00

191	600004	白云机场	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.48	110,800.00	1,050,384.00
192	002120	韵达股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.74	135,700.00	1,050,318.00
193	601991	大唐发电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.01	348,600.00	1,049,286.00
194	000750	国海证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.91	359,300.00	1,045,563.00
195	600129	太极集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	28.92	36,100.00	1,044,012.00
196	000709	河钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.94	537,100.00	1,041,974.00
197	600580	卧龙电驱	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.15	85,700.00	1,041,255.00
198	000060	中金岭南	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.24	245,400.00	1,040,496.00
199	300118	东方日升	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.10	85,400.00	1,033,340.00
200	002195	岩山科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.51	410,900.00	1,031,359.00
201	688200	华峰测控	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	91.75	11,200.00	1,027,600.00
202	603000	人民网	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.99	51,400.00	1,027,486.00
203	002430	杭氧股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	22.25	45,600.00	1,014,600.00
204	600166	福田汽车	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.25	450,800.00	1,014,300.00
205	002407	多氟多	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.23	82,800.00	1,012,644.00
206	002939	长城证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.70	151,000.00	1,011,700.00
207	600325	华发股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.50	154,800.00	1,006,200.00
208	603156	养元饮品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	21.27	47,200.00	1,003,944.00
209	601456	国联证券	2024 年 7 月 3 日 -2024 年 7 月 10 日	9.64	103,700.00	999,668.00
210	603228	景旺电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	31.80	31,300.00	995,340.00
211	603658	安图生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	46.07	21,600.00	995,112.00
212	601231	环旭电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.05	61,800.00	991,890.00

213	002850	科达利	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	76.38	12,900.00	985,302.00
214	300568	星源材质	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.20	119,900.00	983,180.00
215	600563	法拉电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	76.18	12,900.00	982,722.00
216	603568	伟明环保	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.58	47,700.00	981,666.00
217	300487	蓝晓科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	41.76	23,500.00	981,360.00
218	002508	老板电器	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	22.10	44,400.00	981,240.00
219	000958	电投产融	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.66	267,600.00	979,416.00
220	002958	青农商行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.68	365,100.00	978,468.00
221	000893	亚钾国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.16	60,500.00	977,680.00
222	300601	康泰生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.61	62,600.00	977,186.00
223	000027	深圳能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.30	133,600.00	975,280.00
224	600380	健康元	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.17	87,100.00	972,907.00
225	601636	旗滨集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.45	150,800.00	972,660.00
226	002926	华西证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.59	147,500.00	972,025.00
227	000998	隆平高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.83	98,700.00	970,221.00
228	688567	孚能科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.60	100,600.00	965,760.00
229	002624	完美世界	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.60	127,000.00	965,200.00
230	603893	瑞芯微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	59.17	16,300.00	964,471.00
231	002497	雅化集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	8.92	107,900.00	962,468.00
232	600737	中粮糖业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.59	100,000.00	959,000.00
233	601866	中远海发	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.58	371,500.00	958,470.00
234	603077	和邦生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.65	580,200.00	957,330.00

235	000021	深科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	15.12	63,000.00	952,560.00
236	002065	东华软件	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.52	210,300.00	950,556.00
237	300253	卫宁健康	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.90	161,100.00	950,490.00
238	002299	圣农发展	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.64	69,600.00	949,344.00
239	002653	海思科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	30.70	30,900.00	948,630.00
240	002500	山西证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	4.70	201,700.00	947,990.00
241	002056	横店东磁	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.47	75,900.00	946,473.00
242	002414	高德红外	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.89	160,100.00	942,989.00
243	600131	国网信通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.87	55,800.00	941,346.00
244	601958	金钼股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.41	90,300.00	940,023.00
245	300390	天华新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.18	54,700.00	939,746.00
246	600655	豫园股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.15	182,400.00	939,360.00
247	300009	安科生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.54	109,900.00	938,546.00
248	002373	千方科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.07	103,200.00	936,024.00
249	300212	易华录	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.83	55,200.00	929,016.00
250	688002	睿创微纳	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.97	33,100.00	925,807.00
251	688114	华大智造	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	47.41	19,500.00	924,495.00
252	002507	涪陵榨菜	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.25	75,300.00	922,425.00
253	002670	国盛金控	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.47	108,600.00	919,842.00
254	002936	郑州银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.73	531,500.00	919,495.00
255	601611	中国核建	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.09	113,100.00	914,979.00
256	600707	彩虹股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.81	134,200.00	913,902.00

257	002368	太极股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	22.55	40,300.00	908,765.00
258	603885	吉祥航空	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.99	82,500.00	906,675.00
259	002203	海亮股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.98	111,900.00	892,962.00
260	600755	厦门国贸	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.17	123,900.00	888,363.00
261	002831	裕同科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	25.59	34,600.00	885,414.00
262	600859	王府井	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.74	74,200.00	871,108.00
263	688390	固德威	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	56.12	15,520.00	870,982.40
264	600995	南网储能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.66	89,500.00	864,570.00
265	688052	纳芯微	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	102.78	8,400.00	863,352.00
266	600801	华新水泥	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.75	62,700.00	862,125.00
267	600416	湘电股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.94	86,600.00	860,804.00
268	600884	杉杉股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.12	105,600.00	857,472.00
269	300070	碧水源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.19	203,800.00	853,922.00
270	300296	利亚德	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.50	189,700.00	853,650.00
271	600390	五矿资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.05	210,500.00	852,525.00
272	002506	协鑫集成	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.94	438,900.00	851,466.00
273	688516	奥特维	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	41.81	20,300.00	848,743.00
274	002019	亿帆医药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.36	68,600.00	847,896.00
275	002572	索菲亚	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.33	55,300.00	847,749.00
276	002244	滨江集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.26	116,500.00	845,790.00
277	600435	北方导航	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	8.62	98,000.00	844,760.00
278	601933	永辉超市	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.48	340,300.00	843,944.00

279	603927	中科软	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	18.09	46,500.00	841,185.00
280	002683	广东宏大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.13	41,700.00	839,421.00
281	000887	中鼎股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	12.24	68,400.00	837,216.00
282	600739	辽宁成大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.37	100,000.00	837,000.00
283	000050	深天马 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.28	114,900.00	836,472.00
284	600399	抚顺特钢	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.63	147,800.00	832,114.00
285	601598	中国外运	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.63	147,600.00	830,988.00
286	601098	中南传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.42	66,800.00	829,656.00
287	600895	张江高科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	18.48	44,700.00	826,056.00
288	600598	北大荒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.49	66,100.00	825,589.00
289	300748	金力永磁	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	12.96	63,700.00	825,552.00
290	601106	中国一重	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.31	356,000.00	822,360.00
291	002568	百润股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.83	48,800.00	821,304.00
292	600848	上海临港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.11	89,400.00	814,434.00
293	300676	华大基因	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	35.01	23,100.00	808,731.00
294	002240	盛新锂能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.42	60,200.00	807,884.00
295	002080	中材科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.90	62,600.00	807,540.00
296	001286	陕西能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.53	69,700.00	803,641.00
297	600398	海澜之家	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	9.24	86,300.00	797,412.00
298	002557	洽洽食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	28.19	28,200.00	794,958.00
299	603379	三美股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	39.14	20,200.00	790,628.00
300	000563	陕国投 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.75	287,300.00	790,075.00

301	300595	欧普康视	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.68	50,100.00	785,568.00
302	600968	海油发展	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.12	190,300.00	784,036.00
303	603712	七一二	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	18.19	43,100.00	783,989.00
304	000778	新兴铸管	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.48	224,800.00	782,304.00
305	601928	凤凰传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.96	71,300.00	781,448.00
306	603858	步长制药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.15	51,500.00	780,225.00
307	688425	铁建重工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.68	210,700.00	775,376.00
308	688385	复旦微电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	31.38	24,700.00	775,086.00
309	688234	天岳先进	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	46.92	16,500.00	774,180.00
310	600258	首旅酒店	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	12.35	62,600.00	773,110.00
311	688538	和辉光电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.98	389,700.00	771,606.00
312	600271	航天信息	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	7.36	104,100.00	766,176.00
313	300558	贝达药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	32.55	23,400.00	761,670.00
314	600528	中铁工业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.32	103,700.00	759,084.00
315	600062	华润双鹤	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.58	38,700.00	757,746.00
316	688029	南微医学	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	61.56	12,200.00	751,032.00
317	600977	中国电影	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.76	69,600.00	748,896.00
318	000739	普洛药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.57	55,000.00	746,350.00
319	600959	江苏有线	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.64	281,300.00	742,632.00
320	000155	川能动力	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.77	68,900.00	742,053.00
321	688220	翱捷科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	37.46	19,600.00	734,216.00
322	600378	昊华科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	28.90	25,400.00	734,060.00

323	601118	海南橡胶	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.55	160,200.00	728,910.00
324	600008	首创环保	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.68	271,100.00	726,548.00
325	000825	太钢不锈	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.38	214,600.00	725,348.00
326	603688	石英股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	29.61	24,450.00	723,964.50
327	002429	兆驰股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.81	147,800.00	710,918.00
328	603737	三棵树	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	36.27	19,600.00	710,892.00
329	688778	厦钨新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	31.24	22,600.00	706,024.00
330	603882	金域医学	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.19	25,800.00	701,502.00
331	600901	江苏金租	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.05	138,500.00	699,425.00
332	000987	越秀资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.96	140,800.00	698,368.00
333	600906	财达证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.73	121,800.00	697,914.00
334	600517	国网英大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.33	160,800.00	696,264.00
335	603456	九洲药业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.72	50,200.00	688,744.00
336	002266	浙富控股	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.79	246,100.00	686,619.00
337	688301	奕瑞科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	115.23	5,880.00	677,552.40
338	688521	芯原股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	26.75	25,100.00	671,425.00
339	600316	洪都航空	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.63	40,000.00	665,200.00
340	000937	冀中能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.70	99,200.00	664,640.00
341	603650	彤程新材	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	29.55	22,300.00	658,965.00
342	603529	爱玛科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	27.33	23,900.00	653,187.00
343	002531	天顺风能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.94	72,600.00	649,044.00
344	688772	珠海冠宇	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.90	43,400.00	646,660.00

345	002423	中粮资本	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.49	86,300.00	646,387.00
346	603883	老百姓	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.36	35,100.00	644,436.00
347	600208	新湖中宝	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.58	398,900.00	630,262.00
348	003035	南网能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	4.40	142,000.00	624,800.00
349	688063	派能科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	39.71	15,680.00	622,652.80
350	601298	青岛港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.56	65,100.00	622,356.00
351	002607	中公教育	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.53	404,800.00	619,344.00
352	601608	中信重工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.81	162,500.00	619,125.00
353	600663	陆家嘴	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.82	69,400.00	612,108.00
354	603233	大参林	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.30	42,400.00	606,320.00
355	300776	帝尔激光	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	45.96	13,000.00	597,480.00
356	300438	鹏辉能源	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	18.34	32,500.00	596,050.00
357	600500	中化国际	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.49	168,500.00	588,065.00
358	300357	我武生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.22	29,000.00	586,380.00
359	600377	宁沪高速	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	12.60	46,000.00	579,600.00
360	603826	坤彩科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	28.97	19,880.00	575,923.60
361	600967	内蒙一机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.20	79,500.00	572,400.00
362	688520	神州细胞	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	39.35	14,500.00	570,575.00
363	300888	稳健医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	25.30	22,300.00	564,190.00
364	600373	中文传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.84	37,700.00	559,468.00
365	600350	山东高速	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	8.85	63,100.00	558,435.00
366	688281	华秦科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	83.32	6,700.00	558,244.00

367	600315	上海家化	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.78	31,300.00	556,514.00
368	688349	三一重能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	24.84	22,300.00	553,932.00
369	600827	百联股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.38	74,800.00	552,024.00
370	000559	万向钱潮	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.46	123,700.00	551,702.00
371	688006	杭可科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.45	31,500.00	549,675.00
372	000156	华数传媒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.28	86,500.00	543,220.00
373	603517	绝味食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	15.40	35,100.00	540,540.00
374	002690	美亚光电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.50	32,500.00	536,250.00
375	603707	健友股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.88	45,100.00	535,788.00
376	601992	金隅集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.37	390,800.00	535,396.00
377	002867	周大生	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.06	40,900.00	534,154.00
378	603444	吉比特	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	178.01	3,000.00	534,030.00
379	300682	朗新集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.51	61,300.00	521,663.00
380	600126	杭钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.11	126,400.00	519,504.00
381	600764	中国海防	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.63	26,400.00	518,232.00
382	688107	安路科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	25.42	20,100.00	510,942.00
383	003022	联泓新科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.71	37,100.00	508,641.00
384	000967	盈峰环境	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.23	119,300.00	504,639.00
385	000831	中国稀土	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 2 日	25.35	19,600.00	496,860.00
386	600329	达仁堂	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	32.39	15,300.00	495,567.00
387	000537	中绿电	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.53	52,000.00	495,560.00
388	002432	九安医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	40.54	12,200.00	494,588.00

389	603218	日月股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.27	47,900.00	491,933.00
390	600481	双良节能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.67	105,200.00	491,284.00
391	600339	中油工程	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.12	156,600.00	488,592.00
392	003031	中瓷电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	46.24	10,500.00	485,520.00
393	688276	百克生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	28.37	16,900.00	479,453.00
394	000898	鞍钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.12	224,400.00	475,728.00
395	600056	中国医药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	10.12	46,400.00	469,568.00
396	603127	昭衍新药	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.27	35,100.00	465,777.00
397	603786	科博达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	64.15	7,200.00	461,880.00
398	603185	弘元绿能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.09	26,800.00	458,012.00
399	600808	马钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.02	225,700.00	455,914.00
400	002153	石基信息	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.73	76,600.00	438,918.00
401	601156	东航物流	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.35	21,500.00	437,525.00
402	002563	森马服饰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.81	75,200.00	436,912.00
403	601228	广州港	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.05	141,300.00	430,965.00
404	688297	中无人机	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	33.03	12,900.00	426,087.00
405	000539	粤电力 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.08	83,500.00	424,180.00
406	688387	信科移动	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.04	82,900.00	417,816.00
407	688779	长远锂科	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.63	90,200.00	417,626.00
408	001872	招商港口	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.25	21,500.00	413,875.00
409	601568	北元集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.71	111,500.00	413,665.00
410	600928	西安银行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	3.27	124,700.00	407,769.00

411	002608	江苏国信	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.75	52,300.00	405,325.00
412	000401	冀东水泥	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.06	99,500.00	403,970.00
413	000959	首钢股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.72	145,700.00	396,304.00
414	002518	科士达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	17.70	21,700.00	384,090.00
415	600871	石化油服	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	1.74	220,700.00	384,018.00
416	603056	德邦股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	13.10	28,500.00	373,350.00
417	603305	旭升集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	10.56	34,600.00	365,376.00
418	600299	安迪苏	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	9.70	37,600.00	364,720.00
419	601139	深圳燃气	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.68	53,300.00	356,044.00
420	300861	美畅股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.35	18,100.00	350,235.00
421	688248	南网科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	29.63	11,500.00	340,745.00
422	603317	天味食品	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	11.41	29,600.00	337,736.00
423	600095	湘财股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.96	54,200.00	323,032.00
424	688819	天能股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	23.86	12,900.00	307,794.00
425	688153	唯捷创芯	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 5 日	37.00	8,300.00	307,100.00
426	301029	怡合达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.66	15,500.00	304,730.00
427	002487	大金重工	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	22.88	13,100.00	299,728.00
428	000031	大悦城	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.34	119,800.00	280,332.00
429	600956	新天绿能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	8.17	32,500.00	265,525.00
430	601828	美凯龙	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.55	101,400.00	258,570.00
431	601158	重庆水务	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.80	53,600.00	257,280.00
432	002945	华林证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.98	25,000.00	249,500.00

433	688295	中复神鹰	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	20.30	12,200.00	247,660.00
434	688331	荣昌生物	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 5 日	43.20	5,300.00	228,960.00
435	688375	国博电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	70.64	3,000.00	211,920.00
436	688348	昱能科技	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	59.00	3,100.00	182,900.00
437	600032	浙江新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.28	16,500.00	120,120.00
438	603868	飞科电器	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	38.40	3,100.00	119,040.00
439	002408	齐翔腾达	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	5.60	12,500.00	70,000.00
440	002791	坚朗五金	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	25.87	2,600.00	67,262.00
441	002268	电科网安	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	14.23	3,900.00	55,497.00
合计	-	-	-	-	52,459,572.00	488,867,540.06

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

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

持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	12,166,202,502.52	99.19	6,361,205,024.46	99.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,193,163.42	0.02	383,511.77	0.01
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	12,168,395,665.94	99.21	6,361,588,536.23	99.12

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-603,238,108.30	-323,122,311.17
	+5%	603,238,108.30	323,122,311.17

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	12,157,157,891.41
第二层次	2,238,774.53
第三层次	8,999,000.00
合计	12,168,395,665.94

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,166,202,502.52	98.90
	其中：股票	12,166,202,502.52	98.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,193,163.42	0.02

	其中：债券	2,193,163.42	0.02
	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	105,213,032.92	0.86
8	其他各项资产	28,114,376.47	0.23
9	合计	12,301,723,075.33	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 488,867,540.06 元, 占本基金期末资产净值的 3.99%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	76,296,234.71	0.62
B	采矿业	568,768,586.61	4.64
C	制造业	7,701,006,825.66	62.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	481,246,435.50	3.92
E	建筑业	123,836,439.70	1.01
F	批发和零售业	258,451,312.98	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	244,813,701.69	2.00
H	住宿和餐饮业	38,518,602.70	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	865,770,117.55	7.06
J	金融业	1,130,629,807.03	9.22
K	房地产业	137,576,500.22	1.12
L	租赁和商务服务业	92,894,576.54	0.76
M	科学研究和技术服务业	97,514,655.80	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	55,191,600.59	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,542,948.00	0.11
Q	卫生和社会工作	75,444,560.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	182,943,582.52	1.49
S	综合	21,756,014.72	0.18
	合计	12,166,202,502.52	99.19

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	1,456,200	153,701,910.00	1.25
2	002028	思源电气	1,262,876	84,486,404.40	0.69
3	601058	赛轮轮胎	5,393,781	75,512,934.00	0.62
4	688169	石头科技	191,110	75,029,786.00	0.61
5	600066	宇通客车	2,723,700	70,271,460.00	0.57
6	002340	格林美	10,529,600	67,073,552.00	0.55
7	000933	神火股份	3,229,100	65,324,693.00	0.53
8	601077	渝农商行	12,696,000	63,733,920.00	0.52
9	000988	华工科技	2,062,076	61,717,934.68	0.50
10	601168	西部矿业	3,419,831	61,385,966.45	0.50
11	300394	天孚通信	681,700	60,275,914.00	0.49
12	002384	东山精密	2,804,500	58,053,150.00	0.47
13	000423	东阿阿胶	924,800	57,892,480.00	0.47
14	000630	铜陵有色	15,738,667	56,816,587.87	0.46
15	600418	江淮汽车	3,583,214	56,758,109.76	0.46
16	600988	赤峰黄金	3,411,321	55,740,985.14	0.45
17	601233	桐昆股份	3,460,130	55,223,674.80	0.45
18	002625	光启技术	3,093,000	53,663,550.00	0.44
19	600096	云天化	2,633,100	51,134,802.00	0.42
20	601567	三星医疗	1,447,300	50,655,500.00	0.41
21	000400	许继电气	1,463,100	50,345,271.00	0.41
22	688777	中控技术	1,295,400	48,836,580.00	0.40
23	002156	通富微电	2,171,987	48,630,788.93	0.40
24	002128	电投能源	2,297,749	48,482,503.90	0.40
25	002273	水晶光电	2,851,051	48,410,845.98	0.39
26	601555	东吴证券	8,150,370	48,087,183.00	0.39
27	002078	太阳纸业	3,437,572	47,954,129.40	0.39
28	600885	宏发股份	1,710,119	47,336,093.92	0.39
29	601128	常熟银行	6,181,370	46,792,970.90	0.38
30	002532	天山铝业	5,723,800	46,420,018.00	0.38
31	002223	鱼跃医疗	1,232,919	46,357,754.40	0.38
32	300207	欣旺达	3,055,300	46,348,901.00	0.38
33	600352	浙江龙盛	5,336,892	45,843,902.28	0.37
34	600398	海澜之家	4,923,777	45,495,699.48	0.37
35	002138	顺络电子	1,653,190	45,396,597.40	0.37
36	002966	苏州银行	6,014,670	45,110,025.00	0.37
37	600157	永泰能源	38,222,300	45,102,314.00	0.37
38	688617	惠泰医疗	97,112	44,292,783.20	0.36
39	002353	杰瑞股份	1,259,099	44,169,192.92	0.36
40	601108	财通证券	6,664,760	44,054,063.60	0.36
41	600765	中航重机	2,126,577	43,382,170.80	0.35

42	002185	华天科技	5,257,017	42,844,688.55	0.35
43	002517	恺英网络	4,413,400	42,147,970.00	0.34
44	600879	航天电子	5,412,034	42,051,504.18	0.34
45	603606	东方电缆	846,800	41,332,308.00	0.34
46	301236	软通动力	1,172,147	41,271,295.87	0.34
47	600873	梅花生物	4,093,761	41,019,485.22	0.33
48	688099	晶晨股份	687,380	40,775,381.60	0.33
49	600177	雅戈尔	5,695,505	40,551,995.60	0.33
50	601577	长沙银行	4,947,384	40,469,601.12	0.33
51	600109	国金证券	5,329,000	40,233,950.00	0.33
52	600079	人福医药	2,342,400	40,219,008.00	0.33
53	002738	中矿资源	1,496,780	40,113,704.00	0.33
54	300003	乐普医疗	2,699,300	40,057,612.00	0.33
55	600060	海信视像	1,606,060	39,733,924.40	0.32
56	300017	网宿科技	5,004,300	39,533,970.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	7,308,400	39,026,856.00	0.32
58	300136	信维通信	1,984,500	38,856,510.00	0.32
59	603160	汇顶科技	563,400	38,733,750.00	0.32
60	603979	金诚信	760,900	38,448,277.00	0.31
61	002202	金风科技	5,660,997	38,041,899.84	0.31
62	002739	万达电影	3,128,400	37,822,356.00	0.31
63	000932	华菱钢铁	8,500,020	37,655,088.60	0.31
64	688120	华海清科	197,863	37,510,867.54	0.31
65	689009	九号公司	1,026,070	37,472,636.70	0.31
66	000683	远兴能源	5,355,100	37,003,741.00	0.30
67	600985	淮北矿业	2,208,852	36,976,182.48	0.30
68	600536	中国软件	1,233,456	36,905,003.52	0.30
69	002465	海格通信	3,561,300	36,895,068.00	0.30
70	600348	华阳股份	3,698,760	36,839,649.60	0.30
71	002409	雅克科技	585,400	36,827,514.00	0.30
72	002444	巨星科技	1,479,868	36,552,739.60	0.30
73	002281	光迅科技	977,415	36,525,998.55	0.30
74	000009	中国宝安	4,231,132	36,387,735.20	0.30
75	002008	大族激光	1,725,700	35,894,560.00	0.29
76	000878	云南铜业	2,875,300	35,826,238.00	0.29
77	688122	西部超导	932,920	35,749,494.40	0.29
78	002436	兴森科技	3,463,800	35,746,416.00	0.29
79	300474	景嘉微	564,206	35,674,745.38	0.29
80	600642	申能股份	4,013,630	35,440,352.90	0.29
81	601615	明阳智能	3,726,400	35,177,216.00	0.29
82	002797	第一创业	6,892,300	35,081,807.00	0.29
83	000039	中集集团	3,777,290	34,977,705.40	0.29
84	300054	鼎龙股份	1,539,400	34,913,592.00	0.28

85	601990	南京证券	4,534,600	34,825,728.00	0.28
86	600298	安琪酵母	1,246,348	34,810,499.64	0.28
87	000066	中国长城	3,968,100	34,720,875.00	0.28
88	300012	华测检测	3,450,000	34,707,000.00	0.28
89	600529	山东药玻	1,359,900	34,459,866.00	0.28
90	601666	平煤股份	3,047,100	34,127,520.00	0.28
91	002673	西部证券	5,498,555	34,036,055.45	0.28
92	600839	四川长虹	7,572,389	34,000,026.61	0.28
93	603596	伯特利	871,170	33,888,513.00	0.28
94	601179	中国西电	4,204,557	33,804,638.28	0.28
95	688525	佰维存储	535,736	33,567,464.40	0.27
96	000831	中国稀土	1,305,400	33,091,890.00	0.27
97	000783	长江证券	6,802,600	32,856,558.00	0.27
98	300395	菲利华	1,065,912	32,776,794.00	0.27
99	601717	郑煤机	2,213,600	32,761,280.00	0.27
100	002432	九安医疗	805,700	32,663,078.00	0.27
101	603816	顾家家居	1,011,400	32,658,106.00	0.27
102	300002	神州泰岳	4,020,498	32,646,443.76	0.27
103	000728	国元证券	5,368,763	32,534,703.78	0.27
104	000738	航发控制	1,618,067	32,474,604.69	0.26
105	600862	中航高科	1,713,602	32,181,445.56	0.26
106	000703	恒逸石化	4,510,027	31,976,091.43	0.26
107	688180	君实生物	1,099,969	31,954,099.45	0.26
108	601198	东兴证券	3,976,198	31,650,536.08	0.26
109	601997	贵阳银行	5,997,400	31,606,298.00	0.26
110	688188	柏楚电子	170,518	31,469,096.90	0.26
111	000960	锡业股份	2,025,192	31,370,224.08	0.26
112	603338	浙江鼎力	519,170	31,368,251.40	0.26
113	002595	豪迈科技	820,955	31,335,852.35	0.26
114	603345	安井食品	421,300	31,306,803.00	0.26
115	002155	湖南黄金	1,725,000	31,222,500.00	0.25
116	600863	内蒙华电	6,690,940	31,045,961.60	0.25
117	601696	中银证券	3,417,200	31,028,176.00	0.25
118	601162	天风证券	14,214,600	30,987,828.00	0.25
119	300037	新宙邦	1,082,020	30,902,491.20	0.25
120	300866	安克创新	433,821	30,892,393.41	0.25
121	600038	中直股份	751,097	30,877,597.67	0.25
122	300724	捷佳伟创	571,000	30,839,710.00	0.25
123	600521	华海药业	1,804,000	30,758,200.00	0.25
124	000921	海信家电	951,350	30,671,524.00	0.25
125	002472	双环传动	1,387,600	30,554,952.00	0.25
126	603939	益丰药房	1,242,828	30,511,427.40	0.25
127	300001	特锐德	1,515,902	30,499,948.24	0.25

128	002984	森麒麟	1,264,240	30,455,541.60	0.25
129	002294	信立泰	1,142,771	30,431,991.73	0.25
130	600141	兴发集团	1,583,672	30,216,461.76	0.25
131	600549	厦门钨业	1,744,490	30,092,452.50	0.25
132	600699	均胜电子	2,022,375	29,971,597.50	0.24
133	002407	多氟多	2,447,929	29,938,171.67	0.24
134	600546	山煤国际	2,032,900	29,720,998.00	0.24
135	002850	科达利	388,000	29,635,440.00	0.24
136	300699	光威复材	1,192,942	29,620,749.86	0.24
137	600820	隧道股份	4,512,200	29,464,666.00	0.24
138	002262	恩华药业	1,239,158	29,417,610.92	0.24
139	600895	张江高科	1,587,843	29,343,338.64	0.24
140	301358	湖南裕能	932,100	29,323,866.00	0.24
141	600369	西南证券	8,175,100	29,266,858.00	0.24
142	002195	岩山科技	11,648,968	29,238,909.68	0.24
143	600872	中炬高新	1,287,900	29,222,451.00	0.24
144	300285	国瓷材料	1,635,505	29,193,764.25	0.24
145	002064	华峰化学	4,071,000	29,189,070.00	0.24
146	000021	深科技	1,920,700	29,040,984.00	0.24
147	603589	口子窖	739,100	28,965,329.00	0.24
148	600021	上海电力	2,887,290	28,555,298.10	0.23
149	601000	唐山港	6,075,052	28,552,744.40	0.23
150	603087	甘李药业	616,100	28,537,752.00	0.23
151	300073	当升科技	831,710	28,535,970.10	0.23
152	300146	汤臣倍健	2,092,731	28,356,505.05	0.23
153	600486	扬农化工	500,119	28,231,717.55	0.23
154	000513	丽珠集团	756,643	28,154,686.03	0.23
155	601966	玲珑轮胎	1,511,000	27,757,070.00	0.23
156	300058	蓝色光标	5,099,871	27,743,298.24	0.23
157	002756	永兴材料	775,130	27,734,151.40	0.23
158	600704	物产中大	6,389,555	27,730,668.70	0.23
159	600153	建发股份	3,080,353	27,507,552.29	0.22
160	603179	新泉股份	699,900	27,464,076.00	0.22
161	600155	华创云信	4,637,600	27,408,216.00	0.22
162	300114	中航电测	605,500	27,398,875.00	0.22
163	000830	鲁西化工	2,357,200	27,319,948.00	0.22
164	688065	凯赛生物	599,528	27,212,575.92	0.22
165	300529	健帆生物	993,790	27,041,025.90	0.22
166	600118	中国卫星	1,211,984	26,942,404.32	0.22
167	600583	海油工程	4,532,300	26,785,893.00	0.22
168	002558	巨人网络	2,832,300	26,736,912.00	0.22
169	002152	广电运通	2,546,500	26,636,390.00	0.22
170	601156	东航物流	1,301,800	26,491,630.00	0.22

171	000591	太阳能	5,610,400	26,424,984.00	0.22
172	000623	吉林敖东	1,962,357	26,295,583.80	0.21
173	600970	中材国际	2,166,945	26,133,356.70	0.21
174	002025	航天电器	562,014	26,066,209.32	0.21
175	300373	扬杰科技	668,000	25,985,200.00	0.21
176	002385	大北农	6,744,829	25,967,591.65	0.21
177	300144	宋城演艺	3,223,974	25,888,511.22	0.21
178	002439	启明星辰	1,499,300	25,877,918.00	0.21
179	600380	健康元	2,296,063	25,647,023.71	0.21
180	601216	君正集团	6,921,100	25,538,859.00	0.21
181	000729	燕京啤酒	2,889,152	25,511,212.16	0.21
182	605358	立昂微	1,101,240	25,482,693.60	0.21
183	600143	金发科技	3,833,120	25,336,923.20	0.21
184	000723	美锦能源	5,322,700	25,336,052.00	0.21
185	300251	光线传媒	3,006,700	25,286,347.00	0.21
186	600998	九州通	5,170,423	25,231,664.24	0.21
187	600282	南钢股份	5,056,000	25,178,880.00	0.21
188	600637	东方明珠	4,135,072	25,141,237.76	0.20
189	000519	中兵红箭	1,712,995	25,129,636.65	0.20
190	300677	英科医疗	930,380	24,943,487.80	0.20
191	300383	光环新网	2,948,000	24,910,600.00	0.20
192	600516	方大炭素	5,779,074	24,907,808.94	0.20
193	000636	风华高科	1,898,681	24,796,773.86	0.20
194	600763	通策医疗	458,600	24,787,330.00	0.20
195	600392	盛和资源	2,874,757	24,780,405.34	0.20
196	300024	机器人	2,543,400	24,772,716.00	0.20
197	000818	航锦科技	1,114,000	24,597,120.00	0.20
198	002958	青农商行	9,113,500	24,424,180.00	0.20
199	601665	齐鲁银行	4,956,695	24,337,372.45	0.20
200	600909	华安证券	5,779,973	24,333,686.33	0.20
201	002044	美年健康	6,421,000	24,271,380.00	0.20
202	600008	首创环保	9,031,470	24,204,339.60	0.20
203	688213	思特威	497,990	24,152,515.00	0.20
204	000883	湖北能源	4,010,500	24,103,105.00	0.20
205	600566	济川药业	757,125	24,008,433.75	0.20
206	600511	国药股份	774,854	23,857,754.66	0.19
207	000629	钒钛股份	9,528,607	23,821,517.50	0.19
208	601016	节能风电	7,966,134	23,818,740.66	0.19
209	600867	通化东宝	2,844,019	23,804,439.03	0.19
210	300088	长信科技	5,033,250	23,656,275.00	0.19
211	601456	国联证券	2,450,167	23,619,609.88	0.19
212	000997	新大陆	1,692,750	23,546,152.50	0.19
213	600170	上海建工	10,931,800	23,503,370.00	0.19

214	600582	天地科技	3,394,000	23,384,660.00	0.19
215	600499	科达制造	2,752,600	23,204,418.00	0.19
216	600498	烽火通信	1,459,000	23,198,100.00	0.19
217	600129	太极集团	801,600	23,182,272.00	0.19
218	600535	天士力	1,837,300	23,113,234.00	0.19
219	601933	永辉超市	9,303,700	23,073,176.00	0.19
220	000598	兴蓉环境	3,060,856	23,017,637.12	0.19
221	600004	白云机场	2,427,300	23,010,804.00	0.19
222	002120	韵达股份	2,971,600	23,000,184.00	0.19
223	601991	大唐发电	7,625,152	22,951,707.52	0.19
224	000750	国海证券	7,857,543	22,865,450.13	0.19
225	600580	卧龙电驱	1,881,300	22,857,795.00	0.19
226	002261	拓维信息	2,056,400	22,764,348.00	0.19
227	000060	中金岭南	5,364,800	22,746,752.00	0.19
228	603000	人民网	1,133,454	22,657,745.46	0.18
229	300118	东方日升	1,870,900	22,637,890.00	0.18
230	300568	星源材质	2,757,847	22,614,345.40	0.18
231	300567	精测电子	399,700	22,587,047.00	0.18
232	002430	杭氧股份	1,009,000	22,450,250.00	0.18
233	002429	兆驰股份	4,640,200	22,319,362.00	0.18
234	603486	科沃斯	473,000	22,316,140.00	0.18
235	002939	长城证券	3,308,800	22,168,960.00	0.18
236	603658	安图生物	481,016	22,160,407.12	0.18
237	600166	福田汽车	9,846,500	22,154,625.00	0.18
238	603156	养元饮品	1,038,081	22,079,982.87	0.18
239	600325	华发股份	3,385,476	22,005,594.00	0.18
240	603228	景旺电子	690,323	21,952,271.40	0.18
241	600816	建元信托	8,074,400	21,881,624.00	0.18
242	300765	新诺威	864,700	21,816,381.00	0.18
243	601231	环旭电子	1,359,000	21,811,950.00	0.18
244	600673	东阳光	3,090,343	21,756,014.72	0.18
245	300487	蓝晓科技	517,850	21,625,416.00	0.18
246	603568	伟明环保	1,048,654	21,581,299.32	0.18
247	603927	中科软	1,192,452	21,571,456.68	0.18
248	000893	亚钾国际	1,334,300	21,562,288.00	0.18
249	600754	锦江酒店	937,500	21,543,750.00	0.18
250	002508	老板电器	973,300	21,509,930.00	0.18
251	300601	康泰生物	1,374,900	21,462,189.00	0.17
252	603290	斯达半导	248,340	21,384,557.40	0.17
253	000027	深圳能源	2,927,380	21,369,874.00	0.17
254	601636	旗滨集团	3,301,250	21,293,062.50	0.17
255	002926	华西证券	3,229,500	21,282,405.00	0.17
256	688052	纳芯微	207,013	21,276,796.14	0.17

257	000998	隆平高科	2,160,329	21,236,034.07	0.17
258	002624	完美世界	2,784,200	21,159,920.00	0.17
259	600563	法拉电子	277,638	21,150,462.84	0.17
260	603298	杭叉集团	1,074,300	21,099,252.00	0.17
261	002497	雅化集团	2,362,700	21,075,284.00	0.17
262	002653	海思科	685,580	21,047,306.00	0.17
263	600737	中粮糖业	2,192,753	21,028,501.27	0.17
264	300604	长川科技	772,400	20,986,108.00	0.17
265	601866	中远海发	8,118,138	20,944,796.04	0.17
266	603077	和邦生物	12,674,964	20,913,690.60	0.17
267	300253	卫宁健康	3,544,000	20,909,600.00	0.17
268	002299	圣农发展	1,530,000	20,869,200.00	0.17
269	002065	东华软件	4,601,700	20,799,684.00	0.17
270	002056	横店东磁	1,667,600	20,794,972.00	0.17
271	600131	国网信通	1,231,944	20,782,895.28	0.17
272	002500	山西证券	4,416,160	20,755,952.00	0.17
273	688385	复旦微电	659,120	20,683,185.60	0.17
274	688772	珠海冠宇	1,387,371	20,671,827.90	0.17
275	601958	金铂股份	1,985,300	20,666,973.00	0.17
276	300390	天华新能	1,201,811	20,647,112.98	0.17
277	002414	高德红外	3,503,600	20,636,204.00	0.17
278	600373	中文传媒	1,389,987	20,627,407.08	0.17
279	688002	睿创微纳	736,629	20,603,513.13	0.17
280	600655	豫园股份	3,995,400	20,576,310.00	0.17
281	300009	安科生物	2,405,378	20,541,928.12	0.17
282	300763	锦浪科技	493,100	20,532,684.00	0.17
283	688114	华大智造	431,205	20,443,429.05	0.17
284	603893	瑞芯微	343,600	20,330,812.00	0.17
285	002507	涪陵榨菜	1,656,122	20,287,494.50	0.17
286	002368	太极股份	895,090	20,184,279.50	0.16
287	002372	伟星新材	1,305,563	20,131,781.46	0.16
288	600707	彩虹股份	2,942,400	20,037,744.00	0.16
289	601611	中国核建	2,476,300	20,033,267.00	0.16
290	603885	吉祥航空	1,815,330	19,950,476.70	0.16
291	000887	中鼎股份	1,619,700	19,825,128.00	0.16
292	688390	固德威	351,491	19,725,674.92	0.16
293	002203	海亮股份	2,459,200	19,624,416.00	0.16
294	603379	三美股份	500,789	19,600,881.46	0.16
295	002831	裕同科技	764,358	19,559,921.22	0.16
296	603225	新凤鸣	1,250,080	19,488,747.20	0.16
297	600755	厦门国贸	2,711,753	19,443,269.01	0.16
298	688521	芯原股份	718,612	19,222,871.00	0.16
299	600859	王府井	1,629,117	19,125,833.58	0.16

300	600995	南网储能	1,966,600	18,997,356.00	0.15
301	600801	华新水泥	1,378,867	18,959,421.25	0.15
302	601880	辽港股份	15,397,090	18,938,420.70	0.15
303	600329	达仁堂	584,400	18,928,716.00	0.15
304	600416	湘电股份	1,903,200	18,917,808.00	0.15
305	002683	广东宏大	935,063	18,822,818.19	0.15
306	600884	杉杉股份	2,314,800	18,796,176.00	0.15
307	300070	碧水源	4,458,400	18,680,696.00	0.15
308	300296	利亚德	4,149,700	18,673,650.00	0.15
309	600390	五矿资本	4,610,700	18,673,335.00	0.15
310	002019	亿帆医药	1,508,700	18,647,532.00	0.15
311	002506	协鑫集成	9,595,500	18,615,270.00	0.15
312	600435	北方导航	2,154,475	18,571,574.50	0.15
313	002244	滨江集团	2,552,394	18,530,380.44	0.15
314	600739	辽宁成大	2,195,574	18,376,954.38	0.15
315	600483	福能股份	1,575,400	18,369,164.00	0.15
316	000050	深天马 A	2,520,300	18,347,784.00	0.15
317	601098	中南传媒	1,473,475	18,300,559.50	0.15
318	300803	指南针	502,400	18,292,384.00	0.15
319	300748	金力永磁	1,408,660	18,256,233.60	0.15
320	600598	北大荒	1,458,551	18,217,301.99	0.15
321	600399	抚顺特钢	3,235,000	18,213,050.00	0.15
322	601598	中国外运	3,233,200	18,202,916.00	0.15
323	002572	索菲亚	1,184,532	18,158,875.56	0.15
324	002568	百润股份	1,076,160	18,111,772.80	0.15
325	600901	江苏金租	3,583,098	18,094,644.90	0.15
326	002487	大金重工	787,100	18,008,848.00	0.15
327	000155	川能动力	1,669,500	17,980,515.00	0.15
328	300676	华大基因	511,660	17,913,216.60	0.15
329	600848	上海临港	1,964,000	17,892,040.00	0.15
330	002240	盛新锂能	1,322,300	17,745,266.00	0.14
331	002080	中材科技	1,375,500	17,743,950.00	0.14
332	001286	陕西能源	1,538,100	17,734,293.00	0.14
333	002373	千方科技	1,944,757	17,638,945.99	0.14
334	002557	洽洽食品	623,539	17,577,564.41	0.14
335	002936	郑州银行	10,150,445	17,560,269.85	0.14
336	300595	欧普康视	1,103,700	17,306,016.00	0.14
337	000563	陕国投 A	6,292,200	17,303,550.00	0.14
338	603712	七一二	950,205	17,284,228.95	0.14
339	002268	电科网安	1,213,522	17,268,418.06	0.14
340	688017	绿的谐波	209,987	17,239,932.70	0.14
341	603883	老百姓	936,557	17,195,186.52	0.14
342	600968	海油发展	4,169,100	17,176,692.00	0.14

343	603858	步长制药	1,133,758	17,176,433.70	0.14
344	601928	凤凰传媒	1,565,681	17,159,863.76	0.14
345	000778	新兴铸管	4,908,800	17,082,624.00	0.14
346	688301	奕瑞科技	148,075	17,062,682.25	0.14
347	600258	首旅酒店	1,374,482	16,974,852.70	0.14
348	601212	白银有色	6,072,900	16,882,662.00	0.14
349	688538	和辉光电	8,524,302	16,878,117.96	0.14
350	600271	航天信息	2,279,200	16,774,912.00	0.14
351	300558	贝达药业	514,900	16,759,995.00	0.14
352	688234	天岳先进	356,644	16,733,736.48	0.14
353	600062	华润双鹤	853,388	16,709,337.04	0.14
354	600528	中铁工业	2,277,225	16,669,287.00	0.14
355	600977	中国电影	1,531,600	16,480,016.00	0.13
356	002531	天顺风能	1,841,600	16,463,904.00	0.13
357	000709	河钢股份	8,478,900	16,449,066.00	0.13
358	603688	石英股份	555,350	16,443,913.50	0.13
359	601155	新城控股	1,853,400	16,439,658.00	0.13
360	002408	齐翔腾达	2,913,958	16,318,164.80	0.13
361	000739	普洛药业	1,198,514	16,263,834.98	0.13
362	688220	翱捷科技	433,968	16,256,441.28	0.13
363	600959	江苏有线	6,151,716	16,240,530.24	0.13
364	688005	容百科技	696,161	16,206,628.08	0.13
365	600378	昊华科技	560,600	16,201,340.00	0.13
366	688536	思瑞浦	165,081	16,146,572.61	0.13
367	601118	海南橡胶	3,510,703	15,973,698.65	0.13
368	603444	吉比特	89,713	15,969,811.13	0.13
369	688331	荣昌生物	368,038	15,899,241.60	0.13
370	000825	太钢不锈	4,690,800	15,854,904.00	0.13
371	603737	三棵树	432,608	15,690,692.16	0.13
372	603882	金域医学	576,600	15,677,754.00	0.13
373	600056	中国医药	1,533,917	15,523,240.04	0.13
374	688200	华峰测控	168,525	15,462,168.75	0.13
375	000987	越秀资本	3,086,658	15,309,823.68	0.12
376	601399	国机重装	5,916,500	15,264,570.00	0.12
377	600906	财达证券	2,661,600	15,250,968.00	0.12
378	600517	国网英大	3,518,422	15,234,767.26	0.12
379	600612	老凤祥	260,900	15,181,771.00	0.12
380	603456	九洲药业	1,106,505	15,181,248.60	0.12
381	601019	山东出版	1,283,278	15,168,345.96	0.12
382	300212	易华录	890,380	14,985,095.40	0.12
383	002266	浙富控股	5,351,113	14,929,605.27	0.12
384	600316	洪都航空	882,857	14,681,911.91	0.12
385	000937	冀中能源	2,173,600	14,563,120.00	0.12

386	603650	彤程新材	492,100	14,541,555.00	0.12
387	600871	石化油服	8,346,400	14,522,736.00	0.12
388	603529	爱玛科技	530,200	14,490,366.00	0.12
389	688567	孚能科技	1,503,879	14,437,238.40	0.12
390	600925	苏能股份	2,824,700	14,264,735.00	0.12
391	688063	派能科技	357,121	14,181,274.91	0.12
392	002423	中粮资本	1,889,000	14,148,610.00	0.12
393	000032	深桑达 A	933,800	13,988,324.00	0.11
394	601965	中国汽研	823,600	13,910,604.00	0.11
395	001227	兰州银行	5,839,700	13,898,486.00	0.11
396	603728	鸣志电器	345,100	13,883,373.00	0.11
397	688297	中无人机	420,169	13,878,182.07	0.11
398	600098	广州发展	2,157,200	13,806,080.00	0.11
399	600208	新湖中宝	8,712,200	13,765,276.00	0.11
400	601298	青岛港	1,437,900	13,746,324.00	0.11
401	688516	奥特维	326,210	13,638,840.10	0.11
402	601608	中信重工	3,558,194	13,556,719.14	0.11
403	002607	中公教育	8,851,600	13,542,948.00	0.11
404	002670	国盛金控	1,587,186	13,443,465.42	0.11
405	600663	陆家嘴	1,522,662	13,429,878.84	0.11
406	603233	大参林	934,548	13,364,036.40	0.11
407	600578	京能电力	4,118,700	13,344,588.00	0.11
408	600022	山东钢铁	10,936,360	13,342,359.20	0.11
409	688561	奇安信	563,505	13,309,988.10	0.11
410	300438	鹏辉能源	723,309	13,265,487.06	0.11
411	300357	我武生物	643,928	13,020,224.16	0.11
412	601106	中国一重	5,624,000	12,991,440.00	0.11
413	300776	帝尔激光	280,757	12,903,591.72	0.11
414	003031	中瓷电子	278,220	12,864,892.80	0.10
415	600500	中化国际	3,679,387	12,841,060.63	0.10
416	600377	宁沪高速	1,017,300	12,817,980.00	0.10
417	002865	钧达股份	328,700	12,615,506.00	0.10
418	600967	内蒙一机	1,745,215	12,565,548.00	0.10
419	000785	居然之家	5,157,500	12,532,725.00	0.10
420	688349	三一重能	500,269	12,426,681.96	0.10
421	600315	上海家化	693,648	12,333,061.44	0.10
422	600350	山东高速	1,388,600	12,289,110.00	0.10
423	300888	稳健医疗	482,660	12,211,298.00	0.10
424	600827	百联股份	1,644,837	12,138,897.06	0.10
425	000958	电投产融	3,311,400	12,119,724.00	0.10
426	000537	中绿电	1,270,700	12,109,771.00	0.10
427	601568	北元集团	3,257,940	12,086,957.40	0.10
428	000559	万向钱潮	2,709,689	12,085,212.94	0.10

429	688425	铁建重工	3,280,734	12,073,101.12	0.10
430	002608	江苏国信	1,549,600	12,009,400.00	0.10
431	688029	南微医学	194,883	11,996,997.48	0.10
432	002690	美亚光电	724,377	11,952,220.50	0.10
433	000156	华数传媒	1,898,905	11,925,123.40	0.10
434	603707	健友股份	994,719	11,817,261.72	0.10
435	688032	禾迈股份	102,627	11,779,527.06	0.10
436	603517	绝味食品	763,900	11,764,060.00	0.10
437	002867	周大生	899,400	11,746,164.00	0.10
438	601992	金隅集团	8,548,112	11,710,913.44	0.10
439	603826	坤彩科技	403,420	11,687,077.40	0.10
440	600126	杭钢股份	2,769,707	11,383,495.77	0.09
441	300682	朗新集团	1,336,380	11,372,593.80	0.09
442	003022	联泓新科	822,300	11,273,733.00	0.09
443	688475	萤石网络	326,798	11,147,079.78	0.09
444	000967	盈峰环境	2,608,089	11,032,216.47	0.09
445	688778	厦钨新能	349,224	10,909,757.76	0.09
446	688520	神州细胞	277,209	10,908,174.15	0.09
447	603218	日月股份	1,057,000	10,855,390.00	0.09
448	600032	浙江新能	1,479,600	10,771,488.00	0.09
449	603786	科博达	167,658	10,755,260.70	0.09
450	600481	双良节能	2,301,000	10,745,670.00	0.09
451	600361	创新新材	2,665,300	10,741,159.00	0.09
452	600339	中油工程	3,433,800	10,713,456.00	0.09
453	301267	华夏眼科	516,800	10,708,096.00	0.09
454	600095	湘财股份	1,758,400	10,480,064.00	0.09
455	688248	南网科技	351,510	10,415,241.30	0.08
456	000898	鞍钢股份	4,904,013	10,396,507.56	0.08
457	603127	昭衍新药	777,570	10,318,353.90	0.08
458	003035	南网能源	2,329,600	10,250,240.00	0.08
459	688281	华秦科技	121,191	10,097,634.12	0.08
460	600808	马钢股份	4,934,000	9,966,680.00	0.08
461	002563	森马服饰	1,657,100	9,627,751.00	0.08
462	002153	石基信息	1,678,629	9,618,544.17	0.08
463	603185	弘元绿能	556,888	9,517,215.92	0.08
464	601228	广州港	3,094,400	9,437,920.00	0.08
465	000539	粤电力 A	1,825,100	9,271,508.00	0.08
466	688779	长远锂科	1,978,443	9,160,191.09	0.07
467	001872	招商港口	475,757	9,158,322.25	0.07
468	600928	西安银行	2,733,900	8,939,853.00	0.07
469	001203	大中矿业	928,085	8,918,896.85	0.07
470	000401	冀东水泥	2,180,204	8,851,628.24	0.07
471	688006	杭可科技	501,025	8,742,886.25	0.07

472	000959	首钢股份	3,195,100	8,690,672.00	0.07
473	600764	中国海防	437,400	8,586,162.00	0.07
474	002518	科士达	481,500	8,522,550.00	0.07
475	603056	德邦股份	631,456	8,272,073.60	0.07
476	603305	旭升集团	766,600	8,095,296.00	0.07
477	688172	燕东微	497,606	8,051,265.08	0.07
478	600299	安迪苏	825,600	8,008,320.00	0.07
479	601139	深圳燃气	1,179,400	7,878,392.00	0.06
480	300861	美畅股份	394,140	7,626,609.00	0.06
481	603317	天味食品	655,040	7,474,006.40	0.06
482	688276	百克生物	257,490	7,304,991.30	0.06
483	688387	信科移动	1,402,656	7,069,386.24	0.06
484	688375	国博电子	99,598	7,035,602.72	0.06
485	301029	怡合达	355,920	6,997,387.20	0.06
486	002791	坚朗五金	264,573	6,844,503.51	0.06
487	688819	天能股份	282,382	6,737,634.52	0.05
488	600927	永安期货	596,700	6,653,205.00	0.05
489	688153	唯捷创芯	173,594	6,422,978.00	0.05
490	688107	安路科技	249,518	6,342,747.56	0.05
491	601858	中国科传	324,800	6,210,176.00	0.05
492	000031	大悦城	2,636,895	6,170,334.30	0.05
493	601158	重庆水务	1,180,800	5,667,840.00	0.05
494	601828	美凯龙	2,222,640	5,667,732.00	0.05
495	002945	华林证券	553,600	5,524,928.00	0.05
496	688348	昱能科技	92,956	5,484,404.00	0.04
497	600956	新天绿能	630,600	5,152,002.00	0.04
498	301165	锐捷网络	141,500	4,222,360.00	0.03
499	688295	中复神鹰	205,416	4,169,944.80	0.03
500	603868	飞科电器	99,380	3,816,192.00	0.03
501	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
502	603350	安乃达	1,051	21,608.56	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	300502	新易盛	119,551,447.90	1.86
2	002422	科伦药业	79,474,662.80	1.24
3	002463	沪电股份	78,959,089.09	1.23
4	002028	思源电气	77,752,700.21	1.21
5	300394	天孚通信	76,363,265.19	1.19
6	000988	华工科技	74,717,712.10	1.16

7	000423	东阿阿胶	73,882,881.12	1.15
8	000933	神火股份	69,644,773.55	1.09
9	300418	昆仑万维	66,734,842.84	1.04
10	000975	银泰黄金	65,327,184.48	1.02
11	002340	格林美	64,327,839.80	1.00
12	002185	华天科技	62,646,638.98	0.98
13	002966	苏州银行	60,693,247.84	0.95
14	000630	铜陵有色	60,478,858.00	0.94
15	002625	光启技术	58,180,907.62	0.91
16	688777	中控技术	55,927,444.01	0.87
17	000009	中国宝安	55,898,543.66	0.87
18	688169	石头科技	54,990,642.71	0.86
19	002850	科达利	54,878,660.75	0.86
20	002517	恺英网络	54,790,651.13	0.85

注：“买入金额”按买入成交金额（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	002463	沪电股份	139,120,054.58	2.17
2	002422	科伦药业	127,152,442.79	1.98
3	000975	银泰黄金	104,779,820.50	1.63
4	300418	昆仑万维	93,657,388.04	1.46
5	300502	新易盛	77,100,149.38	1.20
6	600160	巨化股份	64,519,435.60	1.01
7	600161	天坛生物	52,967,331.28	0.83
8	300394	天孚通信	51,155,669.96	0.80
9	002600	领益智造	48,897,017.33	0.76
10	600415	小商品城	48,315,283.00	0.75
11	000423	东阿阿胶	47,281,139.49	0.74
12	688072	拓荆科技	46,601,721.29	0.73
13	000988	华工科技	44,196,156.41	0.69
14	002966	苏州银行	43,932,756.50	0.68
15	600482	中国动力	43,922,179.00	0.68
16	002032	苏泊尔	42,478,800.86	0.66
17	300866	安克创新	41,859,151.09	0.65
18	000933	神火股份	40,464,325.03	0.63
19	002028	思源电气	40,179,999.70	0.63
20	002185	华天科技	39,816,210.28	0.62

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,449,426,743.72
卖出股票收入（成交）总额	5,917,332,932.39

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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,193,163.42	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,193,163.42	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113685	升 24 转债	21,930	2,193,163.42	0.02
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	14,222,442.08
2	应收清算款	13,102,745.17
3	应收股利	760,419.43
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	28,769.79
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,114,376.47

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300502	新易盛	7,008,520.00	0.06	转融通出借证券受限

2	002028	思源电气	3,846,750.00	0.03	转融通出借证券受限
3	601058	赛轮轮胎	3,277,400.00	0.03	转融通出借证券受限
4	601168	西部矿业	3,207,665.00	0.03	转融通出借证券受限
5	600066	宇通客车	3,206,940.00	0.03	转融通出借证券受限
6	688169	石头科技	3,180,060.00	0.03	转融通出借证券受限
7	002340	格林美	3,069,703.00	0.03	转融通出借证券受限
8	000933	神火股份	2,985,948.00	0.02	转融通出借证券受限
9	601077	渝农商行	2,916,118.00	0.02	转融通出借证券受限
10	000988	华工科技	2,822,399.00	0.02	转融通出借证券受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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		华夏中证 500ETF 联接	
		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
20,357	223,491.12	3,618,176,807.00	79.53%	279,844,264.00	6.15%	651,587,723.00	14.32%

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	2,050,885,600.00	45.08%
2	中国人寿保险股份有限公司	430,414,821.00	9.46%

	司		
3	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	249,200,000.00	5.48%
4	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	151,241,662.00	3.32%
5	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	112,884,580.00	2.48%
6	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	105,549,600.00	2.32%
7	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	54,090,275.00	1.19%
8	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	31,446,500.00	0.69%
9	中国人寿保险股份有限公司	28,845,700.00	0.63%
10	中国国际金融股份有限公司	25,301,612.00	0.56%
11	中国建设银行股份有限公司—华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	651,587,723.00	14.32%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

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的情况

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（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	2,134,473,505
本报告期期初基金份额总额	2,190,408,794

本报告期基金总申购份额	4,760,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	2,400,800,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,549,608,794

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内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，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	
中信证券	18	10,622,775,643.72	69.13%	1,101,600.69	34.28%	-

中信建投证券	5	1,597,738,890.21	10.40%	712,738.95	22.18%	-
东方证券	1	1,216,974,827.17	7.92%	542,667.71	16.89%	-
方正证券	1	1,028,986,218.15	6.70%	458,896.09	14.28%	-
华泰证券	2	839,063,087.15	5.46%	370,028.04	11.52%	-
光大证券	5	61,175,398.60	0.40%	27,277.78	0.85%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东兴证券、广发证券、国盛证券、国泰君安证券、国投证券、海通证券、华西证券、申万宏源证券、万联证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中泰证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，广发证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	270,556.00	39.70%	-	-	-	-	-	-

东方证券	410,889.06	60.30%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-18 至 2024-01-24, 2024-01-26 至 2024-01-30	236,527,700.00	278,002,800.00	84,115,679.00	430,414,821.00	9.46%
	2	2024-02-19 至 2024-06-30	-	2,050,885,600.00	-	2,050,885,600.00	45.08%
华夏中证 500ETF 联接	1	2024-01-01 至 2024-02-18	582,187,723.00	97,000,000.00	27,600,000.00	651,587,723.00	14.32%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日