

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	60
7.1 期末基金资产组合情况	60
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76

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	77
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	77
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	77
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	77
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
7.12 投资组合报告附注	77
§ 8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末上市基金前十名持有人	79
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	80
§ 9 开放式基金份额变动	80
§ 10 重大事件揭示	80
10.1 基金份额持有人大会决议	80
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	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
10.4 基金投资策略的改变	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
10.8 其他重大事件	84
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	85
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	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 12 备查文件目录	85
12.1 备查文件目录	85
12.2 存放地点	86
12.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 500ETF
场内简称	平安中证 500ETF
基金主代码	510590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 23 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	89,986,121.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387

注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-31,813,073.86
本期利润	-168,278,790.94
加权平均基金份额本期利润	-1.2292
本期加权平均净值利润率	-18.93%
本期基金份额净值增长率	-11.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	50,992,235.67
期末可供分配基金份额利润	0.5667
期末基金资产净值	590,289,804.92
期末基金份额净值	6.5598
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.38%

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

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

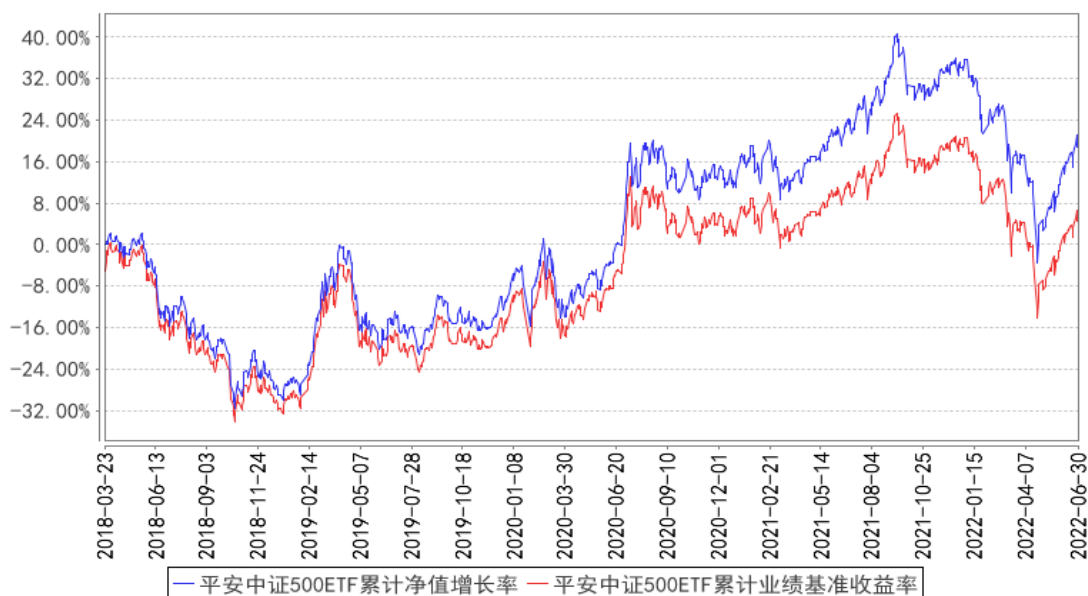
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.92%	1.10%	7.10%	1.10%	0.82%	0.00%
过去三个月	3.22%	1.75%	2.04%	1.75%	1.18%	0.00%
过去六个月	-11.28%	1.63%	-12.30%	1.63%	1.02%	0.00%
过去一年	-2.91%	1.32%	-5.20%	1.33%	2.29%	-0.01%
过去三年	42.34%	1.34%	30.37%	1.35%	11.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	20.38%	1.43%	5.78%	1.45%	14.60%	-0.02%

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

平安中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 03 月 23 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投

投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2022 年 6 月 30 日，平安基金共管理 169 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5504 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
成钧	ETF 指数投资中心投资执行总经理，平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 23 日	-	11 年	成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心投资执行总经理。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司

					<p>债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安上海金交易型开放式证券投资基金基金经理。</p>
王宁	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2020 年 11 月 18 日	-	5 年	<p>王宁宁女士，法国雷恩高等商学院硕士，曾任平安道远投资管理（上海）有限公司量化投资部助理产品经理，2018 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心指数研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安富时</p>

					中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。
王仁增	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2021 年 7 月 8 日	-	8 年	王仁增先生，南开大学国际经济研究所世界经济硕士，曾任财通基金产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理，2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心指数研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指

					数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安上海金交易型开放式证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、自 2022 年 7 月 18 日起，王宁宁不再担任平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易

易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

作为一只投资于中证 500 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。报告期内，本基金的日均偏离度为 0.02%，年化跟踪误差 0.48%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 6.5598 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.28%，业绩比较基准收益率为-12.30%。

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 2022 年下半年，疫情之后复工复产有望推动制造业投资明显回升，在稳增长政策支持下，基建投资仍有望保持高增长势头。消费方面，随着各地消费刺激政策出台，三季度消费有望迎来集中释放，四季度消费将有望恢复常态。从股债收益比来看，A 股市场估值整体不贵，且政策改革的加快推进，有利于市场整体风险偏好的提升，因此市场整体向下风险不大。综合考虑，我们对权益资产的前景仍保持谨慎乐观。作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、

假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本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。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,703,228.07	7,721,423.23
结算备付金		4,001,049.79	4,146,811.76
存出保证金		3,060,347.50	6,245,026.74

交易性金融资产	6.4.7.2	573,253,215.40	1,261,603,631.98
其中：股票投资		573,201,205.60	1,261,603,631.98
基金投资		-	-
债券投资		52,009.80	-
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	-	15,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		134,253.83	5,119,023.26
应收股利		156,556.18	3,400.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	106,845.25	31,291.05
资产总计		591,415,496.02	1,299,870,608.02
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		0.85	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		279,278.79	531,770.56
应付托管费		55,855.78	106,354.11
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	57,542.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	790,555.34	882,854.53
负债合计		1,125,691.10	1,578,521.54
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	539,297,569.25	1,052,308,591.67
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	50,992,235.67	245,983,494.81
净资产合计		590,289,804.92	1,298,292,086.48

负债和净资产总计		591,415,496.02	1,299,870,608.02
----------	--	----------------	------------------

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 6.5598 元，基金份额总额 89,986,121.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-165,274,306.81	120,699,409.83
1. 利息收入		817,763.18	2,327,947.74
其中：存款利息收入	6.4.7.13	91,158.20	212,688.87
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		50,889.50	102,941.88
证券出借利息收入		675,715.48	2,012,316.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-31,018,638.55	190,602,949.21
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-36,164,226.91	176,418,607.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	31,078.81	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-2,492,759.37	3,926,829.77
股利收益	6.4.7.19	7,607,268.92	10,257,511.74
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-136,465,717.08	-72,478,859.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,392,285.64	247,372.87
减：二、营业总支出		3,004,484.13	6,170,737.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,219,197.29	3,366,277.83

2. 托管费	6.4.10.2.2	443,839.48	673,255.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.28	14,136.59
8. 其他费用	6.4.7.23	341,447.08	2,117,067.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-168,278,790.94	114,528,672.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-168,278,790.94	114,528,672.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-168,278,790.94	114,528,672.62

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,052,308,591.67	-	245,983,494.81	1,298,292,086.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,052,308,591.67	-	245,983,494.81	1,298,292,086.48
三、本期增减变动额(减)	-513,011,022.42	-	-194,991,259.14	-708,002,281.56

少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-168,278,790.94	-168,278,790.94
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-513,011,022.42	-	-26,712,468.20	-539,723,490.62
其中:1.基金申购款	50,342,203.14	-	3,528,679.61	53,870,882.75
2.基金赎回款	-563,353,225.56	-	-30,241,147.81	-593,594,373.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	539,297,569.25	-	50,992,235.67	590,289,804.92
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,709,154,480.32	-	239,692,164.75	1,948,846,645.07
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,709,154,480.32	-	239,692,164.75	1,948,846,645.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-678,421,118.56	-	7,462,093.77	-670,959,024.79
(一)、综合收益总额	-	-	114,528,672.62	114,528,672.62
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-678,421,118.56	-	-107,066,578.85	-785,487,697.41
其中:1.基金申购款	127,054,131.71	-	18,078,080.15	145,132,211.86
2.基金赎回款	-805,475,250.27	-	-125,144,659.00	-930,619,909.27
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,030,733,361.76	-	247,154,258.52	1,277,887,620.28

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：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]112 号《关于准予平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,648,533,409.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,648,875,604.00 份,其中认购资金利息折合 342,195.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银

行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]41 号审核同意,本基金 441,986,121.00 份基金份额于 2018 年 5 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以在履行适程序后,参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人平安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“平安 500ETF 联接基金”)。平安 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、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》、《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计政策除了下述会计政策变更外，其余与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计政策的变更

6.4.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账

面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资

产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.1.4 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估

值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收股利,金额分别为 7,721,423.23 元、4,146,811.76 元、6,245,026.74 元、15,000,000.00 元、31,291.05 元、5,119,023.26 元和 3,400.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利,金额分别为 7,724,944.85 元、4,148,601.34 元、6,245,146.64 元、15,000,772.61 元、25,087.34 元、5,119,023.26 元和 3,400.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 1,261,603,631.98 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 1,261,603,631.98 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费

用和其他负债-其他应付款,金额分别为 531,770.56 元、106,354.11 元、458,578.90 元和 7,831.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 531,770.56 元、106,354.11 元、458,578.90 元和 7,831.20 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	10,703,228.07
等于：本金	10,699,586.71
加：应计利息	3,641.36
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	10,703,228.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	580,787,662.53	-	573,201,205.60	-7,586,456.93
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	9.80	52,009.80	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	9.80	52,009.80	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	580,839,662.53	9.80	573,253,215.40	-7,586,456.93

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 2022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	15,577,700.00	-	-	
其中：股指期 货投资	15,577,700.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	15,577,700.00	-	-	

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
IC2209	IC2209	13.00	16,546,400.00	968,700.00
合计				968,700.00

减：可抵销期货 暂收款				968,700.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-

其他应收款	31,229.01
待摊费用	75,616.24
合计	106,845.25

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	244,196.19
其中：交易所市场	244,196.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	367,042.94
应退退补款	137,681.33
可退替代款	28,800.00
现金差额	12,834.88
合计	790,555.34

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	175,586,121.00	1,052,308,591.67
本期申购	8,400,000.00	50,342,203.14
本期赎回（以“-”号填列）	-94,000,000.00	-563,353,225.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	89,986,121.00	539,297,569.25

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	274,815,280.81	-28,831,786.00	245,983,494.81
本期利润	-31,813,073.86	-136,465,717.08	-168,278,790.94
本期基金份额交易产生的变动数	-122,956,255.95	96,243,787.75	-26,712,468.20

其中：基金申购款	12,599,534.81	-9,070,855.20	3,528,679.61
基金赎回款	-135,555,790.76	105,314,642.95	-30,241,147.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	120,045,951.00	-69,053,715.33	50,992,235.67

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		54,691.10
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		34,653.03
其他		1,814.07
合计		91,158.20

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-30,561,926.16
股票投资收益——赎回差价收入		-5,602,300.75
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		-36,164,226.91

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		460,838,175.33
减：卖出股票成本总额		490,385,640.68
减：交易费用		1,014,460.81
买卖股票差价收入		-30,561,926.16

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
赎回基金份额对价总额		593,594,373.37
减：现金支付赎回款总额		296,126,692.37
减：赎回股票成本总额		303,069,981.75
减：交易费用		-

赎回差价收入	-5,602,300.75
--------	---------------

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	72.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	31,006.36
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	31,078.81

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	285,980.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	254,900.00
减：应计利息总额	65.01
减：交易费用	9.35
买卖债券差价收入	31,006.36

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-2,492,759.37

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,607,268.92
其中：证券出借权益补偿收入	419,925.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,607,268.92

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-136,855,217.08
股票投资	-136,855,217.08

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	389,500.00
权证投资	-
期货投资	389,500.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-136,465,717.08

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,392,285.64
合计	1,392,285.64

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	133,151.81
其他	99,199.33
合计	341,447.08

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“平安 500ETF 联接基金”）	本基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,219,197.29	3,366,277.83
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人平安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	443,839.48	673,255.60

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 ×0.1%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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				
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	65,700.00	8.21	-	-
上年度可比期间				
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				

关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生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。

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

注：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 2022年6月30日		上年度末 2021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 (%)
平安500ETF联接基金	60,762,431.00	67.5242	53,440,243.00	30.4353
平安人寿	22,668,019.00	25.1906	107,941,901.00	61.4752

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
平安银行-活期	10,703,228.07	54,691.10	8,653,454.64	107,259.79

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

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 2022年1月1日至2022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： 张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
平安证券股份有限公司	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券股份有限公司	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股锁定	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08	-

		日									
301181	标榜股份	2022年 2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
301201	诚达药业	2022年 1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301216	万凯新材	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80		-
301219	腾远钴业	2022年 3月10日	6个月	新股锁定	96.71	87.82	367	35,491.92	32,229.94		-
301235	华康医疗	2022年 1月21日	6个月	新股锁定	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74		-
301236	软通动力	2022年 3月8日	6个月	新股锁定	48.57	31.38	1,454	70,620.72	45,626.52		-
301237	和顺科技	2022年 3月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46		-
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48		-
301258	富士莱	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60		-
301263	泰恩康	2022年 3月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
688150	莱特光电	2022年 3月10日	6个月	新股锁定	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60		-
688176	亚虹医药	2021年 12月29日	6个月	新股锁定	22.98	12.53	37,990	873,010.20	476,014.70		-
688220	翱捷	2022年	6个月	新股锁	164.54	68.59	5,710	939,523.40	391,648.90		-

	科技	1月6日		定						
688322	奥比中光	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	520	52,000.00	52,009.80	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项停牌	9.60	2022年07月14日	9.99	133,903	1,400,615.34	1,285,468.80	-

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

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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(单位:股)	期末估值总额
1	000009	中国宝安	2022年7月6日-2022年7月13日	13.49	50,900	686,641.00
2	000012	南玻A	2022年7月6日	7.42	28,500	211,470.00
3	000021	深科技	2022年7月6日	11.64	19,400	225,816.00
4	000027	深圳能源	2022年7月6日-2022年7月13日	6.41	38,100	244,221.00
5	000031	大悦城	2022年7月6日	4.00	26,500	106,000.00
6	000039	中集集团	2022年7月6日	13.85	25,400	351,790.00
7	000050	深天马A	2022年7月6日	9.97	25,500	254,235.00
8	000060	中金岭南	2022年7月6日-2022年7月13日	4.46	51,600	230,136.00
9	000089	深圳机场	2022年7月6日	7.72	21,200	163,664.00
10	000156	华数传媒	2022年7月6日	7.97	19,200	153,024.00
11	000158	常山北明	2022年7月6日	6.00	23,100	138,600.00
12	000400	许继电气	2022年7月6日	19.20	14,500	278,400.00
13	000401	冀东水泥	2022年7月6日	10.52	22,100	232,492.00
14	000402	金融街	2022年7月6日	5.95	24,800	147,560.00
15	000415	渤海租赁	2022年7月6日	2.17	36,300	78,771.00
16	000488	晨鸣纸业	2022年7月6日	5.64	25,500	143,820.00
17	000519	中兵红箭	2022年7月6日	29.15	17,300	504,295.00
18	000528	柳工	2022年7月6日	6.51	20,200	131,502.00
19	000537	广宇发展	2022年7月6日	12.99	11,600	150,684.00
20	000540	中天金	2022年7月6日	1.93	86,900	167,717.00

		融				0
21	000547	航天发展	2022 年 7 月 6 日	11.94	26,600	317,604.00
22	000559	万向钱潮	2022 年 7 月 6 日	5.94	27,300	162,162.00
23	000563	陕国投 A	2022 年 7 月 6 日	3.12	29,000	90,480.00
24	000581	威孚高科	2022 年 7 月 6 日	19.25	10,400	200,200.00
25	000598	兴蓉环境	2022 年 7 月 6 日	5.11	37,200	190,092.00
26	000623	吉林敖东	2022 年 7 月 6 日	14.76	19,300	284,868.00
27	000629	攀钢钒钛	2022 年 7 月 6 日	3.80	89,100	338,580.00
28	000630	铜陵有色	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	3.26	145,100	473,026.00
29	000636	风华高科	2022 年 7 月 6 日	18.79	16,800	315,672.00
30	000656	金科股份	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	2.86	73,500	210,210.00
31	000671	阳光城	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	2.19	50,300	110,157.00
32	000685	中山公用	2022 年 7 月 6 日	7.68	18,800	144,384.00
33	000686	东北证券	2022 年 7 月 6 日	6.99	29,100	203,409.00
34	000690	宝新能源	2022 年 7 月 6 日	4.38	45,000	197,100.00
35	000709	河钢股份	2022 年 7 月 6 日	2.26	87,900	198,654.00
36	000717	韶钢松山	2022 年 7 月 6 日	3.50	25,600	89,600.00
37	000718	苏宁环球	2022 年 7 月 6 日	3.68	32,500	119,600.00
38	000728	国元证券	2022 年 7 月 6 日	6.22	54,400	338,368.00
39	000729	燕京啤酒	2022 年 7 月 6 日	9.66	29,200	282,072.00
40	000738	航发控制	2022 年 7 月 6 日	28.10	13,700	384,970.00
41	000739	普洛药业	2022 年 7 月 6 日	20.64	12,200	251,808.00
42	000778	新兴铸	2022 年 7 月 6 日	4.82	49,700	239,554.00

		管				0
43	000783	长江证 券	2022 年 7 月 6 日	5.93	79,800	473,214.0 0
44	000807	云铝股 份	2022 年 7 月 6 日	9.88	36,000	355,680.0 0
45	000825	太钢不 锈	2022 年 7 月 6 日	5.45	48,000	261,600.0 0
46	000830	鲁西化 工	2022 年 7 月 6 日	17.29	23,900	413,231.0 0
47	000831	五矿稀 土	2022 年 7 月 6 日	31.25	12,200	381,250.0 0
48	000878	云南铜 业	2022 年 7 月 6 日	11.39	24,500	279,055.0 0
49	000883	湖北能 源	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	5.11	38,800	198,268.0 0
50	000887	中鼎股 份	2022 年 7 月 6 日	18.24	16,400	299,136.0 0
51	000898	鞍钢股 份	2022 年 7 月 6 日	3.22	49,700	160,034.0 0
52	000930	中粮科 技	2022 年 7 月 6 日	9.04	23,200	209,728.0 0
53	000932	华菱钢 铁	2022 年 7 月 6 日	5.09	85,900	437,231.0 0
54	000937	冀中能 源	2022 年 7 月 6 日	7.46	22,000	164,120.0 0
55	000959	首钢股 份	2022 年 7 月 6 日	4.76	32,400	154,224.0 0
56	000960	锡业股 份	2022 年 7 月 6 日	16.77	20,800	348,816.0 0
57	000961	中南建 设	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	3.05	37,600	114,680.0 0
58	000967	盈峰环 境	2022 年 7 月 6 日	5.06	26,500	134,090.0 0
59	000970	中科三 环	2022 年 7 月 6 日	18.78	16,100	302,358.0 0
60	000975	银泰黄 金	2022 年 7 月 6 日	9.74	34,500	336,030.0 0
61	000983	山西焦 煤	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	13.39	40,600	543,634.0 0
62	000987	越秀金 控	2022 年 7 月 6 日	7.03	31,185	219,230.5 5
63	000988	华工科 技	2022 年 7 月 6 日	23.17	20,800	481,936.0 0
64	000990	诚志股	2022 年 7 月 6 日	10.95	13,300	145,635.0

		份				0
65	000997	新大陆	2022年7月6日	13.21	17,100	225,891.00
66	000998	隆平高科	2022年7月6日	16.66	21,800	363,188.00
67	002002	鸿达兴业	2022年7月6日	3.71	35,800	132,818.00
68	002004	华邦健康	2022年7月6日	5.58	32,800	183,024.00
69	002010	传化智联	2022年7月6日	6.43	25,400	163,322.00
70	002019	亿帆医药	2022年7月6日	13.98	15,400	215,292.00
71	002028	思源电气	2022年7月6日	35.66	12,700	452,882.00
72	002030	达安基因	2022年7月6日	17.19	20,400	350,676.00
73	002048	宁波华翔	2022年7月6日	16.02	10,100	161,802.00
74	002056	横店东磁	2022年7月6日	26.62	16,900	449,878.00
75	002065	东华软件	2022年7月6日	6.32	32,100	202,872.00
76	002078	太阳纸业	2022年7月6日	12.31	33,400	411,154.00
77	002081	金螳螂	2022年7月6日	5.08	28,300	143,764.00
78	002092	中泰化学	2022年7月6日-2022年7月13日	7.76	40,400	313,504.00
79	002110	三钢闽光	2022年7月6日	6.09	25,400	154,686.00
80	002124	天邦食品	2022年7月6日	6.72	30,400	204,288.00
81	002127	南极电商	2022年7月6日-2022年7月13日	5.34	38,600	206,124.00
82	002128	电投能源	2022年7月6日	14.32	15,900	227,688.00
83	002131	利欧股份	2022年7月6日	1.94	139,800	271,212.00
84	002138	顺络电子	2022年7月6日	27.25	13,400	365,150.00
85	002146	荣盛发展	2022年7月6日-2022年7月13日	3.03	43,900	133,017.00
86	002152	广电运	2022年7月6日	9.27	25,700	238,239.00

		通				0
87	002153	石基信息	2022 年 7 月 6 日	15.87	13,100	207,897.00
88	002155	湖南黄金	2022 年 7 月 6 日	12.14	17,400	211,236.00
89	002156	通富微电	2022 年 7 月 6 日	15.40	19,200	295,680.00
90	002174	游族网络	2022 年 7 月 6 日	9.77	15,200	148,504.00
91	002180	纳思达	2022 年 7 月 6 日	50.62	14,700	744,114.00
92	002183	怡亚通	2022 年 7 月 6 日	7.21	37,600	271,096.00
93	002185	华天科技	2022 年 7 月 6 日	9.38	46,500	436,170.00
94	002191	劲嘉股份	2022 年 7 月 6 日	10.72	21,300	228,336.00
95	002195	二三四五	2022 年 7 月 6 日	2.25	118,700	267,075.00
96	002203	海亮股份	2022 年 7 月 6 日	11.55	24,500	282,975.00
97	002212	天融信	2022 年 7 月 6 日	10.15	24,600	249,690.00
98	002221	东华能源	2022 年 7 月 6 日	9.31	24,000	223,440.00
99	002223	鱼跃医疗	2022 年 7 月 6 日	25.66	12,500	320,750.00
100	002233	塔牌集团	2022 年 7 月 6 日	8.85	17,400	153,990.00
101	002240	盛新锂能	2022 年 7 月 6 日	60.36	12,500	754,500.00
102	002244	滨江集团	2022 年 7 月 6 日	8.65	25,800	223,170.00
103	002249	大洋电机	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 14 日	6.14	49,500	303,930.00
104	002250	联化科技	2022 年 7 月 6 日	16.37	15,300	250,461.00
105	002266	浙富控股	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	4.79	42,300	202,617.00
106	002268	卫士通	2022 年 7 月 6 日	42.91	12,300	527,793.00
107	002273	水晶光电	2022 年 7 月 6 日	12.11	28,700	347,557.00
108	002294	信立泰	2022 年 7 月 6 日	28.10	11,600	325,960.00

						0
109	002299	圣农发展	2022 年 7 月 6 日	19.18	15,500	297,290.00
110	002326	永太科技	2022 年 7 月 6 日	32.93	12,600	414,918.00
111	002353	杰瑞股份	2022 年 7 月 6 日	40.30	11,900	479,570.00
112	002372	伟星新材	2022 年 7 月 6 日	24.04	13,200	317,328.00
113	002373	千方科技	2022 年 7 月 6 日	11.12	22,900	254,648.00
114	002382	蓝帆医疗	2022 年 7 月 6 日	9.55	14,700	140,385.00
115	002384	东山精密	2022 年 7 月 6 日	22.93	28,400	651,212.00
116	002385	大北农	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	7.81	65,300	509,993.00
117	002387	维信诺	2022 年 7 月 6 日	6.72	20,100	135,072.00
118	002390	信邦制药	2022 年 7 月 6 日	6.91	25,900	178,969.00
119	002407	多氟多	2022 年 7 月 6 日	48.91	15,700	767,887.00
120	002408	齐翔腾达	2022 年 7 月 6 日	8.11	35,400	287,094.00
121	002416	爱施德	2022 年 7 月 6 日	9.30	15,300	142,290.00
122	002422	科伦药业	2022 年 7 月 6 日	18.70	20,700	387,090.00
123	002429	兆驰股份	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	3.84	43,200	165,888.00
124	002434	万里扬	2022 年 7 月 6 日	8.55	14,200	121,410.00
125	002439	启明星辰	2022 年 7 月 6 日	19.93	14,400	286,992.00
126	002444	巨星科技	2022 年 7 月 6 日	18.84	14,200	267,528.00
127	002465	海格通信	2022 年 7 月 6 日	9.09	38,200	347,238.00
128	002468	申通快递	2022 年 7 月 6 日	11.92	15,800	188,336.00
129	002497	雅化集团	2022 年 7 月 6 日	32.65	23,900	780,335.00
130	002500	山西证	2022 年 7 月 6 日	5.74	44,600	256,004.00

		券				0
131	002505	鹏都农牧	2022年7月6日-2022年7月13日	3.39	62,700	212,553.00
132	002506	协鑫集成	2022年7月6日-2022年7月13日	3.72	80,800	300,576.00
133	002507	涪陵榨菜	2022年7月6日	34.52	12,900	445,308.00
134	002511	中顺洁柔	2022年7月6日	12.52	16,300	204,076.00
135	002563	森马服饰	2022年7月6日	5.92	16,700	98,864.00
136	002572	索菲亚	2022年7月6日	27.50	13,300	365,750.00
137	002603	以岭药业	2022年7月6日	24.30	17,300	420,390.00
138	002624	完美世界	2022年7月6日	14.37	28,100	403,797.00
139	002625	光启技术	2022年7月6日	17.27	26,800	462,836.00
140	002673	西部证券	2022年7月6日	6.54	55,500	362,970.00
141	002683	广东宏大	2022年7月6日	27.83	10,900	303,347.00
142	002701	奥瑞金	2022年7月6日	5.20	37,300	193,960.00
143	002739	万达电影	2022年7月6日	13.65	23,100	315,315.00
144	002745	木林森	2022年7月6日	9.77	18,400	179,768.00
145	002797	第一创业	2022年7月6日-2022年7月13日	6.41	67,900	435,239.00
146	002926	华西证券	2022年7月6日	7.84	32,600	255,584.00
147	002939	长城证券	2022年7月6日	10.16	19,200	195,072.00
148	002958	青农商行	2022年7月6日	3.32	77,100	255,972.00
149	003035	南网能源	2022年7月6日	6.35	23,200	147,320.00
150	300001	特锐德	2022年7月6日	17.31	15,100	261,381.00
151	300009	安科生物	2022年7月6日	10.11	23,800	240,618.00
152	300012	华测检	2022年7月6日	23.21	34,900	810,029.00

		测				0
153	300017	网宿科技	2022年7月6日-2022年7月13日	5.36	48,300	258,888.00
154	300024	机器人	2022年7月6日	10.08	25,700	259,056.00
155	300026	红日药业	2022年7月6日	7.70	37,400	287,980.00
156	300037	新宙邦	2022年7月6日	52.56	10,800	567,648.00
157	300058	蓝色光标	2022年7月6日-2022年7月13日	6.53	49,700	324,541.00
158	300070	碧水源	2022年7月6日-2022年7月13日	5.21	42,900	223,509.00
159	300072	海新能科	2022年7月6日	5.06	33,800	171,028.00
160	300073	当升科技	2022年7月6日	90.34	7,400	668,516.00
161	300088	长信科技	2022年7月6日-2022年7月14日	7.42	60,300	447,426.00
162	300115	长盈精密	2022年7月6日	10.31	17,400	179,394.00
163	300136	信维通信	2022年7月6日	16.85	20,000	337,000.00
164	300144	宋城演艺	2022年7月6日	15.35	32,000	491,200.00
165	300146	汤臣倍健	2022年7月4日-2022年7月6日	21.65	20,800	450,320.00
166	300166	东方国信	2022年7月6日	9.22	18,700	172,414.00
167	300168	万达信息	2022年7月6日	9.44	24,600	232,224.00
168	300182	捷成股份	2022年7月6日	5.50	42,800	235,400.00
169	300212	易华录	2022年7月6日	17.40	8,200	142,680.00
170	300244	迪安诊断	2022年7月6日	31.10	10,300	320,330.00
171	300251	光线传媒	2022年7月6日	9.47	24,400	231,068.00
172	300253	卫宁健康	2022年7月6日	8.78	35,600	312,568.00
173	300257	开山股份	2022年7月6日	14.96	8,500	127,160.00
174	300285	国瓷材	2022年7月6日	35.92	16,700	599,864.00

		料				0
175	300296	利亚德	2022 年 7 月 6 日	7.30	42,800	312,440.00
176	300308	中际旭创	2022 年 7 月 6 日	31.05	10,000	310,500.00
177	300357	我武生物	2022 年 7 月 6 日	52.03	6,500	338,195.00
178	300363	博腾股份	2022 年 7 月 6 日	77.99	6,800	530,332.00
179	300383	光环新网	2022 年 7 月 6 日	10.42	26,100	271,962.00
180	300418	昆仑万维	2022 年 7 月 6 日	16.00	19,900	318,400.00
181	300463	迈克生物	2022 年 7 月 6 日	20.49	8,900	182,361.00
182	300474	景嘉微	2022 年 7 月 6 日	68.39	4,700	321,433.00
183	300482	万孚生物	2022 年 7 月 6 日	40.71	5,500	223,905.00
184	300558	贝达药业	2022 年 7 月 6 日	60.80	5,200	316,160.00
185	300618	寒锐钴业	2022 年 7 月 6 日	57.92	4,500	260,640.00
186	300630	普利制药	2022 年 7 月 6 日	35.15	5,400	189,810.00
187	300676	华大基因	2022 年 7 月 6 日	71.70	5,100	365,670.00
188	300677	英科医疗	2022 年 7 月 6 日	25.36	9,600	243,456.00
189	300699	光威复材	2022 年 7 月 6 日	58.87	6,400	376,768.00
190	300869	康泰医学	2022 年 7 月 6 日	28.26	3,200	90,432.00
191	300888	稳健医疗	2022 年 7 月 6 日	66.50	2,600	172,900.00
192	600008	首创环保	2022 年 7 月 6 日	2.90	91,600	265,640.00
193	600021	上海电力	2022 年 7 月 6 日	10.25	21,700	222,425.00
194	600022	山东钢铁	2022 年 7 月 6 日	1.74	113,700	197,838.00
195	600026	中远海能	2022 年 7 月 6 日	10.33	28,800	297,504.00
196	600027	华电国	2022 年 7 月 6 日	3.93	67,700	266,061.00

		际				0
197	600037	歌华有线	2022 年 7 月 6 日	9.39	20,300	190,617.00
198	600039	四川路桥	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	10.53	38,000	400,140.00
199	600056	中国医药	2022 年 7 月 6 日	14.82	15,540	230,302.80
200	600060	海信视像	2022 年 7 月 6 日	12.50	16,300	203,750.00
201	600064	南京高科	2022 年 7 月 6 日	11.00	17,900	196,900.00
202	600066	宇通客车	2022 年 7 月 6 日	8.65	27,600	238,740.00
203	600079	人福医药	2022 年 7 月 6 日	16.00	20,300	324,800.00
204	600096	云天化	2022 年 7 月 6 日	31.48	26,700	840,516.00
205	600109	国金证券	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 14 日	9.00	58,200	523,800.00
206	600118	中国卫星	2022 年 7 月 6 日	20.08	12,300	246,984.00
207	600120	浙江东方	2022 年 7 月 6 日	4.01	35,900	143,959.00
208	600126	杭钢股份	2022 年 7 月 6 日	5.12	28,700	146,944.00
209	600141	兴发集团	2022 年 7 月 6 日	43.99	16,100	708,239.00
210	600143	金发科技	2022 年 7 月 6 日	9.52	37,300	355,096.00
211	600153	建发股份	2022 年 7 月 6 日	13.07	30,900	403,863.00
212	600155	华创阳安	2022 年 7 月 6 日	8.48	25,300	214,544.00
213	600157	永泰能源	2022 年 7 月 6 日	1.59	460,900	732,831.00
214	600160	巨化股份	2022 年 7 月 6 日	13.15	28,000	368,200.00
215	600166	福田汽车	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	2.83	90,600	256,398.00
216	600167	联美控股	2022 年 7 月 6 日	7.49	19,000	142,310.00
217	600170	上海建工	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	3.03	105,400	319,362.00
218	600171	上海贝	2022 年 7 月 6 日	25.03	11,800	295,354.00

		岭				0
219	600177	雅戈尔	2022 年 7 月 6 日	6.63	57,600	381,888.00
220	600195	中牧股份	2022 年 7 月 6 日	12.26	12,600	154,476.00
221	600201	生物股份	2022 年 7 月 6 日	9.16	23,300	213,428.00
222	600208	新湖中宝	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	2.76	84,600	233,496.00
223	600216	浙江医药	2022 年 7 月 6 日	13.65	14,000	191,100.00
224	600233	圆通速递	2022 年 7 月 6 日	20.39	28,500	581,115.00
225	600236	桂冠电力	2022 年 7 月 6 日	6.09	49,000	298,410.00
226	600256	广汇能源	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	10.54	90,500	953,870.00
227	600258	首旅酒店	2022 年 7 月 6 日	24.80	11,600	287,680.00
228	600271	航天信息	2022 年 7 月 6 日	10.94	23,100	252,714.00
229	600282	南钢股份	2022 年 7 月 6 日	3.15	64,000	201,600.00
230	600297	广汇汽车	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	2.61	61,000	159,210.00
231	600298	安琪酵母	2022 年 7 月 6 日	48.75	10,400	507,000.00
232	600307	酒钢宏兴	2022 年 7 月 6 日	1.94	66,300	128,622.00
233	600325	华发股份	2022 年 7 月 6 日	7.57	35,200	266,464.00
234	600339	中油工程	2022 年 7 月 6 日	2.89	35,200	101,728.00
235	600348	华阳股份	2022 年 7 月 6 日	15.46	24,900	384,954.00
236	600350	山东高速	2022 年 7 月 6 日	5.25	13,400	70,350.00
237	600369	西南证券	2022 年 7 月 6 日	3.97	68,900	273,533.00
238	600372	中航电子	2022 年 7 月 6 日	19.39	16,000	310,240.00
239	600373	中文传媒	2022 年 7 月 6 日	9.99	14,000	139,860.00
240	600376	首开股份	2022 年 7 月 6 日	4.91	26,900	132,079.00

		份				0
241	600377	宁沪高速	2022年7月6日	8.57	10,700	91,699.00
242	600380	健康元	2022年7月6日	12.35	23,800	293,930.00
243	600390	五矿资本	2022年7月6日	4.89	46,600	227,874.00
244	600392	盛和资源	2022年7月6日	22.60	29,100	657,660.00
245	600398	海澜之家	2022年7月6日	4.75	35,400	168,150.00
246	600409	三友化工	2022年7月6日	8.19	25,700	210,483.00
247	600415	小商品城	2022年7月6日	5.57	57,000	317,490.00
248	600418	江淮汽车	2022年7月6日	17.16	36,300	622,908.00
249	600435	北方导航	2022年7月6日	8.62	18,500	159,470.00
250	600446	金证股份	2022年7月6日	10.38	13,600	141,168.00
251	600497	驰宏锌锗	2022年7月13日	5.19	10,000	51,900.00
252	600516	方大炭素	2022年7月13日	7.60	12,400	94,240.00
253	600522	中天科技	2022年7月13日	23.10	14,800	341,880.00
254	600567	山鹰国际	2022年7月13日	2.77	17,600	48,752.00
255	600820	隧道股份	2022年7月13日	6.12	11,900	72,828.00
256	600839	四川长虹	2022年7月14日	2.88	20,100	57,888.00
257	600863	内蒙华电	2022年7月14日	3.65	17,800	64,970.00
258	601016	节能风电	2022年7月13日	4.80	10,000	48,000.00
259	601058	赛轮轮胎	2022年7月13日	11.27	13,300	149,891.00
260	601077	渝农商行	2022年7月11日	3.70	16,200	59,940.00
261	601106	中国一重	2022年7月13日	3.07	14,900	45,743.00
262	601108	财通证	2022年7月14日	7.87	17,700	139,299.00

		券				0
263	601168	西部矿业	2022 年 7 月 13 日	11.83	10,400	123,032.00
264	601179	中国西电	2022 年 7 月 13 日	4.68	11,100	51,948.00
265	601333	广深铁路	2022 年 7 月 13 日	2.18	18,400	40,112.00
266	601555	东吴证券	2022 年 7 月 15 日	6.93	13,100	90,783.00
267	601866	中远海发	2022 年 7 月 13 日	3.00	21,600	64,800.00
268	601872	招商轮船	2022 年 7 月 13 日	5.76	17,700	101,952.00
269	603077	和邦生物	2022 年 7 月 13 日	4.26	33,700	143,562.00
270	688002	睿创微纳	2022 年 7 月 8 日	39.72	5,500	218,460.00
271	688006	杭可科技	2022 年 7 月 8 日	70.06	2,500	175,150.00
272	688029	南微医学	2022 年 7 月 8 日	87.20	1,600	139,520.00
273	002670	国盛金控	2022 年 07 月 14 日	9.60	15,000	144,000.00
合计	-	-	-	-	8,456,925	75,134,197.35

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用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。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.01%（上年末：无）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,703,228.07	-	-	-	10,703,228.07
结算备付金	4,001,049.79	-	-	-	4,001,049.79
存出保证金	247,459.50	-	-	2,812,888.00	3,060,347.50
交易性金融资产	52,009.80	-	-	573,201,205.60	573,253,215.40
应收股利	-	-	-	156,556.18	156,556.18
应收清算款	-	-	-	134,253.83	134,253.83
其他资产	-	-	-	106,845.25	106,845.25
资产总计	15,003,747.16	-	-	576,411,748.86	591,415,496.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	279,278.79	279,278.79
应付托管费	-	-	-	55,855.78	55,855.78
应付清算款	-	-	-	0.85	0.85
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	790,555.34	790,555.34
负债总计	-	-	-	1,125,691.10	1,125,691.10
利率敏感度缺口	15,003,747.16	-	-	575,286,057.76	590,289,804.92
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,721,423.23	-	-	-	7,721,423.23
结算备付金	4,146,811.76	-	-	-	4,146,811.76
存出保证金	266,357.94	-	-	5,978,668.80	6,245,026.74
交易性金融资产	-	-	-	1,261,603,631.98	1,261,603,631.98
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收利息	-	-	-	31,291.05	31,291.05
应收股利	-	-	-	3,400.00	3,400.00
应收证券清算款	-	-	-	5,119,023.26	5,119,023.26
资产总计	27,134,592.93	-	-	1,272,736,015.09	1,299,870,608.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	531,770.56	531,770.56
应付托管费	-	-	-	106,354.11	106,354.11
应付交易费用	-	-	-	458,578.90	458,578.90
应交税费	-	-	-	57,542.34	57,542.34
其他负债	-	-	-	424,275.63	424,275.63
负债总计	-	-	-	1,578,521.54	1,578,521.54
利率敏感度缺口	27,134,592.93	-	-	1,271,157,493.55	1,298,292,086.48

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

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金持有债券资产占基金净资产的比例为 0.01%(上年末：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末：同)。

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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	573,201,205.60	97.11	1,261,603,631.98	97.17
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	573,201,205.60	97.11	1,261,603,631.98	97.17

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

资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
	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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	29,651,449.81	38,585,202.73
	沪深 300 指数下降 5%	-29,651,449.81	-38,585,202.73

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注:无

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	570,062,977.22	1,256,588,532.19
第二层次	1,845,103.39	3,300,831.64
第三层次	1,345,134.79	1,714,268.15
合计	573,253,215.40	1,261,603,631.98

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	573,201,205.60	96.92
	其中：股票	573,201,205.60	96.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,009.80	0.01
	其中：债券	52,009.80	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,704,277.86	2.49
8	其他各项资产	3,458,002.76	0.58
9	合计	591,415,496.02	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务融出证券公允价值为 75,134,197.35 元，占基金资产净值比例 12.73%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,201,732.16	0.88
B	采矿业	25,338,862.35	4.29
C	制造业	339,365,624.95	57.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,509,599.58	2.97
E	建筑业	7,364,566.20	1.25
F	批发和零售业	22,030,146.46	3.73
G	交通运输、仓储和邮政业	15,229,756.12	2.58
H	住宿和餐饮业	1,202,403.20	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,214,727.17	7.15
J	金融业	50,714,901.20	8.59
K	房地产业	13,436,943.00	2.28
L	租赁和商务服务业	6,893,179.89	1.17
M	科学研究和技术服务业	7,104,360.00	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	4,119,067.23	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,321,750.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	7,626,860.92	1.29
S	综合	4,183,419.22	0.71
	合计	570,857,899.65	96.71

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,760,095.24	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,934.84	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	83,854.94	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,778.92	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	37,342.74	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	262,065.13	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,343,305.95	0.40

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	236,400	5,460,840.00	0.93
2	601615	明阳智能	145,700	4,924,660.00	0.83
3	600256	广汇能源	397,120	4,185,644.80	0.71
4	300769	德方纳米	9,100	3,718,988.00	0.63
5	600096	云天化	111,500	3,510,020.00	0.59
6	300012	华测检测	145,500	3,377,055.00	0.57
7	002407	多氟多	66,500	3,252,515.00	0.55
8	002497	雅化集团	99,600	3,251,940.00	0.55
9	002240	盛新锂能	52,500	3,168,900.00	0.54
10	300390	天华超净	35,600	3,111,440.00	0.53
11	002180	纳思达	61,200	3,097,944.00	0.52
12	600157	永泰能源	1,915,600	3,045,804.00	0.52
13	600885	宏发股份	72,352	3,027,931.20	0.51
14	000009	中国宝安	223,678	3,017,416.22	0.51
15	600141	兴发集团	67,460	2,967,565.40	0.50
16	300073	当升科技	30,800	2,782,472.00	0.47
17	600392	盛和资源	121,310	2,741,606.00	0.46

18	002384	东山精密	118,400	2,714,912.00	0.46
19	603613	国联股份	30,325	2,686,795.00	0.46
20	002756	永兴材料	17,500	2,663,675.00	0.45
21	600418	江淮汽车	150,400	2,580,864.00	0.44
22	300285	国瓷材料	69,496	2,496,296.32	0.42
23	600765	中航重机	76,460	2,460,482.80	0.42
24	600399	抚顺特钢	137,300	2,457,670.00	0.42
25	600233	圆通速递	119,200	2,430,488.00	0.41
26	601555	东吴证券	344,640	2,388,355.20	0.40
27	601058	赛轮轮胎	211,500	2,383,605.00	0.40
28	600487	亨通光电	163,700	2,380,198.00	0.40
29	600563	法拉电子	11,590	2,377,804.40	0.40
30	000983	山西焦煤	177,230	2,373,109.70	0.40
31	300037	新宙邦	45,120	2,371,507.20	0.40
32	600499	科达制造	114,500	2,363,280.00	0.40
33	600732	爱旭股份	70,600	2,331,212.00	0.39
34	603077	和邦生物	530,100	2,258,226.00	0.38
35	688180	君实生物	29,800	2,245,132.00	0.38
36	002385	大北农	286,300	2,236,003.00	0.38
37	603456	九洲药业	43,000	2,223,100.00	0.38
38	300363	博腾股份	28,400	2,214,916.00	0.38
39	688122	西部超导	23,949	2,208,097.80	0.37
40	002268	卫士通	51,400	2,205,574.00	0.37
41	601108	财通证券	279,800	2,202,026.00	0.37
42	688099	晶晨股份	21,500	2,171,500.00	0.37
43	600486	扬农化工	16,013	2,134,212.64	0.36
44	603345	安井食品	12,600	2,115,162.00	0.36
45	000519	中兵红箭	72,400	2,110,460.00	0.36
46	300144	宋城演艺	137,200	2,106,020.00	0.36
47	600298	安琪酵母	42,900	2,091,375.00	0.35
48	000630	铜陵有色	635,600	2,072,056.00	0.35
49	600862	中航高科	72,500	2,037,250.00	0.35
50	002353	杰瑞股份	49,884	2,010,325.20	0.34
51	603605	珀莱雅	12,120	2,001,981.60	0.34
52	000988	华工科技	86,400	2,001,888.00	0.34
53	601077	渝农商行	535,300	1,980,610.00	0.34
54	000783	长江证券	333,200	1,975,876.00	0.33
55	601168	西部矿业	164,000	1,940,120.00	0.33
56	002625	光启技术	112,000	1,934,240.00	0.33
57	300146	汤臣倍健	88,300	1,911,695.00	0.32
58	601696	中银证券	143,200	1,904,560.00	0.32
59	601162	天风证券	594,800	1,891,464.00	0.32

60	002028	思源电气	52,900	1,886,414.00	0.32
61	300724	捷佳伟创	21,000	1,876,350.00	0.32
62	002056	横店东磁	70,400	1,874,048.00	0.32
63	002797	第一创业	291,900	1,871,079.00	0.32
64	688777	中控技术	25,710	1,870,659.60	0.32
65	002507	涪陵榨菜	53,900	1,860,628.00	0.32
66	603517	绝味食品	32,100	1,856,022.00	0.31
67	600988	赤峰黄金	116,200	1,853,390.00	0.31
68	000932	华菱钢铁	359,520	1,829,956.80	0.31
69	603589	口子窖	31,200	1,828,632.00	0.31
70	002185	华天科技	194,400	1,823,472.00	0.31
71	601128	常熟银行	237,600	1,815,264.00	0.31
72	601636	旗滨集团	141,100	1,799,025.00	0.30
73	603026	石大胜华	12,200	1,773,270.00	0.30
74	600521	华海药业	77,500	1,759,250.00	0.30
75	605117	德业股份	6,280	1,757,709.20	0.30
76	002603	以岭药业	72,320	1,757,376.00	0.30
77	600039	四川路桥	166,400	1,752,192.00	0.30
78	002326	永太科技	53,200	1,751,876.00	0.30
79	601607	上海医药	96,300	1,741,104.00	0.29
80	600109	国金证券	193,100	1,737,900.00	0.29
81	002078	太阳纸业	141,100	1,736,941.00	0.29
82	000830	鲁西化工	99,700	1,723,813.00	0.29
83	688390	固德威	5,420	1,696,514.20	0.29
84	002624	完美世界	117,550	1,689,193.50	0.29
85	600153	建发股份	127,600	1,667,732.00	0.28
86	600546	山煤国际	84,900	1,652,154.00	0.28
87	603939	益丰药房	31,200	1,648,296.00	0.28
88	603267	鸿远电子	12,000	1,611,960.00	0.27
89	600348	华阳股份	104,000	1,607,840.00	0.27
90	601872	招商轮船	278,900	1,606,464.00	0.27
91	002422	科伦药业	85,700	1,602,590.00	0.27
92	600705	中航产融	461,900	1,598,174.00	0.27
93	600549	厦门钨业	73,900	1,597,718.00	0.27
94	000738	航发控制	56,800	1,596,080.00	0.27
95	601990	南京证券	191,300	1,595,442.00	0.27
96	600497	驰宏锌锗	307,400	1,595,406.00	0.27
97	000831	五矿稀土	51,000	1,593,750.00	0.27
98	600177	雅戈尔	239,500	1,587,885.00	0.27
99	600875	东方电气	96,500	1,587,425.00	0.27
100	300699	光威复材	26,935	1,585,663.45	0.27
101	000970	中科三环	84,065	1,578,740.70	0.27

102	300088	长信科技	212,200	1,574,524.00	0.27
103	603127	昭衍新药	13,800	1,570,440.00	0.27
104	300676	华大基因	21,500	1,541,550.00	0.26
105	600160	巨化股份	116,730	1,534,999.50	0.26
106	000999	华润三九	34,100	1,534,500.00	0.26
107	000998	隆平高科	91,700	1,527,722.00	0.26
108	002572	索菲亚	55,200	1,518,000.00	0.26
109	002138	顺络电子	55,703	1,517,906.75	0.26
110	002673	西部证券	231,500	1,514,010.00	0.26
111	600859	王府井	58,100	1,509,438.00	0.26
112	601699	潞安环能	103,100	1,507,322.00	0.26
113	002557	洽洽食品	26,400	1,502,952.00	0.25
114	600516	方大炭素	196,940	1,496,744.00	0.25
115	600143	金发科技	155,800	1,483,216.00	0.25
116	002508	老板电器	41,000	1,477,230.00	0.25
117	601997	贵阳银行	253,300	1,471,673.00	0.25
118	000807	云铝股份	148,800	1,470,144.00	0.25
119	000039	中集集团	106,120	1,469,762.00	0.25
120	600482	中国动力	93,400	1,467,314.00	0.25
121	002465	海格通信	160,400	1,458,036.00	0.25
122	603444	吉比特	3,747	1,453,836.00	0.25
123	002030	达安基因	84,108	1,445,816.52	0.24
124	000960	锡业股份	86,200	1,445,574.00	0.24
125	002273	水晶光电	118,809	1,438,776.99	0.24
126	000728	国元证券	228,100	1,418,782.00	0.24
127	300357	我武生物	27,215	1,415,996.45	0.24
128	300136	信维通信	83,700	1,410,345.00	0.24
129	000629	攀钢钒钛	370,400	1,407,520.00	0.24
130	600170	上海建工	461,200	1,397,436.00	0.24
131	000975	银泰黄金	143,432	1,397,027.68	0.24
132	300058	蓝色光标	213,766	1,395,891.98	0.24
133	600704	物产中大	271,250	1,391,512.50	0.24
134	600536	中国软件	34,260	1,390,613.40	0.24
135	002409	雅克科技	24,800	1,376,648.00	0.23
136	002092	中泰化学	177,300	1,375,848.00	0.23
137	689009	九号公司	30,871	1,373,759.50	0.23
138	601577	长沙银行	173,000	1,371,890.00	0.23
139	600739	辽宁成大	93,600	1,364,688.00	0.23
140	002294	信立泰	48,200	1,354,420.00	0.23
141	603198	迎驾贡酒	20,700	1,348,398.00	0.23
142	600079	人福医药	83,800	1,340,800.00	0.23
143	002223	鱼跃医疗	52,198	1,339,400.68	0.23

144	300474	景嘉微	19,550	1,337,024.50	0.23
145	000636	风华高科	70,914	1,332,474.06	0.23
146	300418	昆仑万维	82,910	1,326,560.00	0.22
147	002372	伟星新材	55,140	1,325,565.60	0.22
148	000547	航天发展	111,000	1,325,340.00	0.22
149	300244	迪安诊断	42,500	1,321,750.00	0.22
150	002739	万达电影	96,700	1,319,955.00	0.22
151	002506	协鑫集成	354,800	1,319,856.00	0.22
152	600415	小商品城	236,400	1,316,748.00	0.22
153	300296	利亚德	179,000	1,306,700.00	0.22
154	600699	均胜电子	82,880	1,302,044.80	0.22
155	300558	贝达药业	21,400	1,301,120.00	0.22
156	600372	中航电子	66,800	1,295,252.00	0.22
157	300253	卫宁健康	146,900	1,289,782.00	0.22
158	300308	中际旭创	41,400	1,285,470.00	0.22
159	002670	国盛金控	133,903	1,285,468.80	0.22
160	002683	广东宏大	45,600	1,269,048.00	0.21
161	600637	东方明珠	177,400	1,268,410.00	0.21
162	600315	上海家化	29,526	1,262,236.50	0.21
163	000887	中鼎股份	69,000	1,258,560.00	0.21
164	600867	通化东宝	121,700	1,258,378.00	0.21
165	600236	桂冠电力	205,800	1,253,322.00	0.21
166	601198	东兴证券	139,800	1,244,220.00	0.21
167	600171	上海贝岭	49,500	1,238,985.00	0.21
168	601016	节能风电	258,000	1,238,400.00	0.21
169	600985	淮北矿业	84,952	1,236,901.12	0.21
170	300832	新产业	27,300	1,231,503.00	0.21
171	600026	中远海能	119,100	1,230,303.00	0.21
172	002299	圣农发展	64,000	1,227,520.00	0.21
173	002156	通富微电	79,704	1,227,441.60	0.21
174	600879	航天电子	188,600	1,224,014.00	0.21
175	002065	东华软件	192,900	1,219,128.00	0.21
176	600380	健康元	97,972	1,209,954.20	0.20
177	300026	红日药业	156,400	1,204,280.00	0.20
178	688185	康希诺	6,049	1,204,234.92	0.20
179	600258	首旅酒店	48,484	1,202,403.20	0.20
180	002936	郑州银行	444,863	1,196,681.47	0.20
181	600642	申能股份	210,501	1,195,645.68	0.20
182	000750	国海证券	329,340	1,195,504.20	0.20
183	000623	吉林敖东	80,300	1,185,228.00	0.20
184	002203	海亮股份	102,307	1,181,645.85	0.20
185	002408	齐翔腾达	145,540	1,180,329.40	0.20

186	000513	丽珠集团	32,586	1,179,939.06	0.20
187	000729	燕京啤酒	121,900	1,177,554.00	0.20
188	600038	中直股份	25,900	1,170,680.00	0.20
189	000878	云南铜业	102,400	1,166,336.00	0.20
190	600673	东阳光	129,700	1,166,003.00	0.20
191	000400	许继电气	60,597	1,163,462.40	0.20
192	600529	山东药玻	41,300	1,154,335.00	0.20
193	600820	隧道股份	187,700	1,148,724.00	0.19
194	601717	郑煤机	79,676	1,148,131.16	0.19
195	002439	启明星辰	57,500	1,145,975.00	0.19
196	600369	西南证券	287,000	1,139,390.00	0.19
197	600580	卧龙电驱	78,800	1,136,296.00	0.19
198	002183	怡亚通	157,411	1,134,933.31	0.19
199	600801	华新水泥	58,080	1,133,140.80	0.19
200	688256	寒武纪	17,497	1,132,055.90	0.19
201	300383	光环新网	108,400	1,129,528.00	0.19
202	603568	伟明环保	33,815	1,128,406.55	0.19
203	600166	福田汽车	397,200	1,124,076.00	0.19
204	002131	利欧股份	579,100	1,123,454.00	0.19
205	300017	网宿科技	209,500	1,122,920.00	0.19
206	002958	青农商行	338,000	1,122,160.00	0.19
207	600316	洪都航空	37,100	1,121,904.00	0.19
208	601005	重庆钢铁	587,200	1,121,552.00	0.19
209	600909	华安证券	243,570	1,108,243.50	0.19
210	600848	上海临港	81,600	1,106,496.00	0.19
211	002195	二三四五	491,308	1,105,443.00	0.19
212	002444	巨星科技	58,600	1,104,024.00	0.19
213	600027	华电国际	280,900	1,103,937.00	0.19
214	600008	首创环保	380,050	1,102,145.00	0.19
215	600325	华发股份	144,700	1,095,379.00	0.19
216	300001	特锐德	63,175	1,093,559.25	0.19
217	300618	寒锐钴业	18,800	1,088,896.00	0.18
218	002373	千方科技	97,237	1,081,275.44	0.18
219	002926	华西证券	137,000	1,074,080.00	0.18
220	000825	太钢不锈	196,900	1,073,105.00	0.18
221	300024	机器人	106,100	1,069,488.00	0.18
222	002500	山西证券	186,070	1,068,041.80	0.18
223	688521	芯原股份	21,600	1,067,040.00	0.18
224	603218	日月股份	41,800	1,061,720.00	0.18
225	002430	杭氧股份	33,900	1,059,714.00	0.18
226	600271	航天信息	96,500	1,055,710.00	0.18
227	000027	深圳能源	164,480	1,054,316.80	0.18

228	000739	普洛药业	51,081	1,054,311.84	0.18
229	000050	深天马 A	105,400	1,050,838.00	0.18
230	002212	天融信	102,500	1,040,375.00	0.18
231	002250	联化科技	63,100	1,032,947.00	0.17
232	600118	中国卫星	51,300	1,030,104.00	0.17
233	603233	大参林	32,800	1,026,640.00	0.17
234	600863	内蒙华电	280,700	1,024,555.00	0.17
235	600208	新湖中宝	369,900	1,020,924.00	0.17
236	688009	中国通号	225,000	1,019,250.00	0.17
237	601866	中远海发	339,246	1,017,738.00	0.17
238	000060	中金岭南	227,600	1,015,096.00	0.17
239	300677	英科医疗	40,000	1,014,400.00	0.17
240	600066	宇通客车	116,400	1,006,860.00	0.17
241	002985	北摩高科	17,165	1,005,525.70	0.17
242	002249	大洋电机	163,400	1,003,276.00	0.17
243	000778	新兴铸管	206,800	996,776.00	0.17
244	300009	安科生物	98,228	993,085.08	0.17
245	603156	养元饮品	43,700	992,864.00	0.17
246	601992	金隅集团	356,900	988,613.00	0.17
247	002152	广电运通	106,400	986,328.00	0.17
248	300182	捷成股份	178,800	983,400.00	0.17
249	603658	安图生物	20,100	982,689.00	0.17
250	603858	步长制药	49,600	977,616.00	0.17
251	000401	冀东水泥	92,900	977,308.00	0.17
252	002966	苏州银行	159,880	975,268.00	0.17
253	300168	万达信息	102,700	969,488.00	0.16
254	600056	中国医药	65,340	968,338.80	0.16
255	600998	九州通	81,200	967,092.00	0.16
256	300070	碧水源	185,300	965,413.00	0.16
257	000997	新大陆	72,700	960,367.00	0.16
258	600970	中材国际	99,000	959,310.00	0.16
259	002831	裕同科技	32,260	953,283.00	0.16
260	002191	劲嘉股份	88,800	951,936.00	0.16
261	002128	电投能源	66,400	950,848.00	0.16
262	300482	万孚生物	23,300	948,543.00	0.16
263	000021	深科技	81,200	945,168.00	0.16
264	600390	五矿资本	193,000	943,770.00	0.16
265	300251	光线传媒	99,400	941,318.00	0.16
266	600528	中铁工业	116,333	936,480.65	0.16
267	600021	上海电力	91,100	933,775.00	0.16
268	600667	太极实业	126,400	932,832.00	0.16
269	002221	东华能源	100,000	931,000.00	0.16

270	600827	百联股份	70,300	928,663.00	0.16
271	600062	华润双鹤	36,120	926,839.20	0.16
272	603885	吉祥航空	51,320	923,246.80	0.16
273	002244	滨江集团	106,700	922,955.00	0.16
274	000987	越秀金控	131,085	921,527.55	0.16
275	002505	鹏都农牧	271,700	921,063.00	0.16
276	000656	金科股份	320,200	915,772.00	0.16
277	600297	广汇汽车	350,200	914,022.00	0.15
278	688002	睿创微纳	23,000	913,560.00	0.15
279	603707	健友股份	32,270	910,014.00	0.15
280	600839	四川长虹	315,900	909,792.00	0.15
281	600598	北大荒	61,400	906,264.00	0.15
282	000012	南玻 A	120,902	897,092.84	0.15
283	002127	南极电商	167,600	894,984.00	0.15
284	002396	星网锐捷	39,500	894,280.00	0.15
285	000930	中粮科技	98,800	893,152.00	0.15
286	600201	生物股份	97,430	892,458.80	0.15
287	002019	亿帆医药	63,500	887,730.00	0.15
288	600259	广晟有色	17,457	884,197.05	0.15
289	002155	湖南黄金	72,800	883,792.00	0.15
290	600498	烽火通信	61,000	883,280.00	0.15
291	600155	华创阳安	104,100	882,768.00	0.15
292	600409	三友化工	106,500	872,235.00	0.15
293	002266	浙富控股	182,000	871,780.00	0.15
294	600511	国药股份	32,500	870,350.00	0.15
295	600718	东软集团	75,379	867,612.29	0.15
296	600755	厦门国贸	115,100	863,250.00	0.15
297	000883	湖北能源	168,300	860,013.00	0.15
298	603712	七一二	27,255	858,532.50	0.15
299	002511	中顺洁柔	68,357	855,829.64	0.14
300	600060	海信视像	68,400	855,000.00	0.14
301	000686	东北证券	121,700	850,683.00	0.14
302	688188	柏楚电子	3,840	844,953.60	0.14
303	002153	石基信息	53,120	843,014.40	0.14
304	002124	天邦食品	125,278	841,868.16	0.14
305	600282	南钢股份	267,000	841,050.00	0.14
306	600959	江苏有线	257,301	838,801.26	0.14
307	600895	张江高科	67,200	836,640.00	0.14
308	600566	济川药业	30,800	836,528.00	0.14
309	600782	新钢股份	165,600	834,624.00	0.14
310	601880	辽港股份	488,400	830,280.00	0.14
311	000581	威孚高科	43,099	829,655.75	0.14

312	601179	中国西电	176,955	828,149.40	0.14
313	600064	南京高科	75,200	827,200.00	0.14
314	000709	河钢股份	363,800	822,188.00	0.14
315	002939	长城证券	80,600	818,896.00	0.14
316	600022	山东钢铁	470,600	818,844.00	0.14
317	600535	天士力	77,600	815,576.00	0.14
318	601778	晶科科技	150,700	813,780.00	0.14
319	300376	易事特	99,800	810,376.00	0.14
320	000690	宝新能源	184,900	809,862.00	0.14
321	002701	奥瑞金	155,600	809,120.00	0.14
322	600500	中化国际	121,420	807,443.00	0.14
323	300630	普利制药	22,844	802,966.60	0.14
324	002002	鸿达兴业	215,400	799,134.00	0.14
325	600216	浙江医药	58,400	797,160.00	0.14
326	000598	兴蓉环境	155,100	792,561.00	0.13
327	002532	天山铝业	120,400	786,212.00	0.13
328	002468	申通快递	65,900	785,528.00	0.13
329	600728	佳都科技	121,400	784,244.00	0.13
330	600808	马钢股份	206,666	783,264.14	0.13
331	600037	歌华有线	83,400	783,126.00	0.13
332	600663	陆家嘴	74,900	775,964.00	0.13
333	002595	豪迈科技	34,700	775,198.00	0.13
334	603866	桃李面包	46,478	769,210.90	0.13
335	002004	华邦健康	137,700	768,366.00	0.13
336	300115	长盈精密	74,440	767,476.40	0.13
337	600567	山鹰国际	276,700	766,459.00	0.13
338	688208	道通科技	23,200	763,744.00	0.13
339	603225	新凤鸣	66,120	763,024.80	0.13
340	300463	迈克生物	37,200	762,228.00	0.13
341	600517	国网英大	146,100	758,259.00	0.13
342	600597	光明乳业	59,700	754,011.00	0.13
343	002745	木林森	77,100	753,267.00	0.13
344	688289	圣湘生物	25,397	752,005.17	0.13
345	002429	兆驰股份	195,500	750,720.00	0.13
346	601456	国联证券	60,900	747,243.00	0.13
347	000785	居然之家	167,800	746,710.00	0.13
348	688006	杭可科技	10,600	742,636.00	0.13
349	002390	信邦制药	107,300	741,443.00	0.13
350	300888	稳健医疗	11,000	731,500.00	0.12
351	300166	东方国信	79,000	728,380.00	0.12
352	601958	金钼股份	82,300	727,532.00	0.12
353	603927	中科软	31,027	723,549.64	0.12

354	601860	紫金银行	252,000	723,240.00	0.12
355	601106	中国一重	235,400	722,678.00	0.12
356	600572	康恩贝	162,700	720,761.00	0.12
357	300072	海新能科	141,300	714,978.00	0.12
358	601718	际华集团	229,744	712,206.40	0.12
359	600398	海澜之家	149,400	709,650.00	0.12
360	600737	中粮糖业	93,357	702,044.64	0.12
361	601118	海南橡胶	146,100	698,358.00	0.12
362	000540	中天金融	358,700	692,291.00	0.12
363	000937	冀中能源	92,600	690,796.00	0.12
364	600967	内蒙一机	75,700	690,384.00	0.12
365	600507	方大特钢	98,639	689,486.61	0.12
366	000089	深圳机场	88,600	683,992.00	0.12
367	000559	万向钱潮	114,800	681,912.00	0.12
368	603883	老百姓	20,082	680,378.16	0.12
369	002368	太极股份	35,196	676,115.16	0.11
370	600582	天地科技	140,100	669,678.00	0.11
371	002048	宁波华翔	41,700	668,034.00	0.11
372	600435	北方导航	77,200	665,464.00	0.11
373	600871	石化油服	352,000	665,280.00	0.11
374	002690	美亚光电	30,590	663,191.20	0.11
375	001914	招商积余	36,700	659,499.00	0.11
376	601000	唐山港	254,220	655,887.60	0.11
377	000898	鞍钢股份	203,500	655,270.00	0.11
378	002233	塔牌集团	74,000	654,900.00	0.11
379	600195	中牧股份	52,947	649,130.22	0.11
380	000959	首钢股份	135,800	646,408.00	0.11
381	601568	北元集团	101,120	641,100.80	0.11
382	002010	传化智联	99,700	641,071.00	0.11
383	000156	华数传媒	80,200	639,194.00	0.11
384	000537	广宇发展	49,200	639,108.00	0.11
385	600556	天下秀	77,500	637,825.00	0.11
386	002110	三钢闽光	104,700	637,623.00	0.11
387	601333	广深铁路	291,800	636,124.00	0.11
388	002705	新宝股份	28,600	628,914.00	0.11
389	600764	中国海防	24,900	628,476.00	0.11
390	600811	东方集团	221,100	625,713.00	0.11
391	600329	达仁堂	25,400	624,332.00	0.11
392	688321	微芯生物	24,735	623,074.65	0.11
393	002281	光迅科技	35,300	620,574.00	0.11
394	003035	南网能源	96,900	615,315.00	0.10
395	002174	游族网络	62,585	611,455.45	0.10

396	000990	诚志股份	55,301	605,545.95	0.10
397	000402	金融街	101,400	603,330.00	0.10
398	600126	杭钢股份	117,327	600,714.24	0.10
399	603638	艾迪精密	29,260	599,830.00	0.10
400	300212	易华录	34,412	598,768.80	0.10
401	600120	浙江东方	148,588	595,837.88	0.10
402	601200	上海环境	58,448	593,831.68	0.10
403	000488	晨鸣纸业	104,950	591,918.00	0.10
404	000158	常山北明	98,600	591,600.00	0.10
405	002081	金螳螂	116,200	590,296.00	0.10
406	002416	爱施德	63,380	589,434.00	0.10
407	600446	金证股份	56,700	588,546.00	0.10
408	600707	彩虹股份	125,600	587,808.00	0.10
409	600373	中文传媒	58,800	587,412.00	0.10
410	600095	湘财股份	76,300	586,747.00	0.10
411	002925	盈趣科技	27,250	586,420.00	0.10
412	601611	中国核建	69,580	583,776.20	0.10
413	001965	招商公路	76,100	580,643.00	0.10
414	000685	中山公用	75,500	579,840.00	0.10
415	002867	周大生	37,250	578,492.50	0.10
416	002146	荣盛发展	190,700	577,821.00	0.10
417	601098	中南传媒	61,193	577,661.92	0.10
418	600167	联美控股	76,890	575,906.10	0.10
419	688029	南微医学	6,560	572,032.00	0.10
420	002399	海普瑞	32,520	571,701.60	0.10
421	002382	蓝帆医疗	59,800	571,090.00	0.10
422	603317	天味食品	19,922	567,179.34	0.10
423	601608	中信重工	148,500	562,815.00	0.10
424	688088	虹软科技	17,747	560,627.73	0.09
425	000967	盈峰环境	110,600	559,636.00	0.09
426	002387	维信诺	82,500	554,400.00	0.09
427	600376	首开股份	112,400	551,884.00	0.09
428	600131	国网信通	40,700	547,415.00	0.09
429	000563	陕国投 A	175,240	546,748.80	0.09
430	601187	厦门银行	91,700	546,532.00	0.09
431	600623	华谊集团	65,400	542,820.00	0.09
432	600307	酒钢宏兴	279,100	541,454.00	0.09
433	000528	柳工	83,170	541,436.70	0.09
434	002948	青岛银行	149,400	540,828.00	0.09
435	603000	人民网	48,100	538,720.00	0.09
436	601991	大唐发电	221,000	537,030.00	0.09
437	601598	中国外运	136,600	530,008.00	0.09

438	600006	东风汽车	69,900	527,745.00	0.09
439	002423	中粮资本	77,900	522,709.00	0.09
440	600901	江苏租赁	100,900	517,617.00	0.09
441	603228	景旺电子	22,143	516,596.19	0.09
442	300257	开山股份	34,300	513,128.00	0.09
443	600717	天津港	127,135	509,811.35	0.09
444	600906	财达证券	56,300	506,137.00	0.09
445	603650	彤程新材	15,400	501,732.00	0.08
446	000718	苏宁环球	136,100	500,848.00	0.08
447	000961	中南建设	161,900	493,795.00	0.08
448	002242	九阳股份	26,600	488,376.00	0.08
449	002434	万里扬	56,800	485,640.00	0.08
450	000671	阳光城	220,500	482,895.00	0.08
451	000415	渤海租赁	219,700	476,749.00	0.08
452	601928	凤凰传媒	66,000	471,900.00	0.08
453	601969	海南矿业	54,700	469,873.00	0.08
454	600968	海油发展	182,000	469,560.00	0.08
455	600648	外高桥	33,400	454,240.00	0.08
456	000553	安道麦 A	37,500	454,125.00	0.08
457	000031	大悦城	110,600	442,400.00	0.07
458	600928	西安银行	120,200	441,134.00	0.07
459	600787	中储股份	76,973	437,976.37	0.07
460	002563	森马服饰	70,600	417,952.00	0.07
461	600339	中油工程	144,500	417,605.00	0.07
462	601228	广州港	109,500	401,865.00	0.07
463	600835	上海机电	29,200	400,916.00	0.07
464	002815	崇达技术	31,200	399,672.00	0.07
465	300869	康泰医学	13,800	389,988.00	0.07
466	688819	天能股份	11,065	382,627.70	0.06
467	600377	宁沪高速	44,500	381,365.00	0.06
468	000028	国药一致	12,800	381,312.00	0.06
469	603056	德邦股份	27,800	373,354.00	0.06
470	000717	韶钢松山	105,800	370,300.00	0.06
471	000062	深圳华强	28,270	359,029.00	0.06
472	002945	华林证券	23,500	358,375.00	0.06
473	603379	三美股份	15,720	349,770.00	0.06
474	000869	张裕 A	11,700	347,958.00	0.06
475	601139	深圳燃气	49,750	345,265.00	0.06
476	601298	青岛港	60,600	331,482.00	0.06
477	601869	长飞光纤	10,600	327,752.00	0.06
478	600299	安迪苏	33,300	319,014.00	0.05
479	603868	飞科电器	4,200	318,150.00	0.05

480	300741	华宝股份	10,800	300,456.00	0.05
481	601156	东航物流	15,000	297,000.00	0.05
482	001872	招商港口	19,000	296,400.00	0.05
483	002653	海思科	18,300	294,813.00	0.05
484	600823	世茂股份	97,900	291,742.00	0.05
485	600350	山东高速	55,200	289,800.00	0.05
486	601828	美凯龙	47,210	286,092.60	0.05
487	600927	永安期货	13,800	278,346.00	0.05
488	001227	兰州银行	53,100	261,252.00	0.04
489	603355	莱克电气	10,180	256,841.40	0.04
490	603786	科博达	3,900	240,123.00	0.04
491	603515	欧普照明	13,020	227,199.00	0.04
492	601665	齐鲁银行	45,100	220,088.00	0.04
493	001203	大中矿业	18,900	213,570.00	0.04
494	603719	良品铺子	7,000	200,410.00	0.03
495	002946	新乳业	14,900	193,551.00	0.03
496	601003	柳钢股份	46,900	189,945.00	0.03
497	002901	大博医疗	4,500	176,130.00	0.03
498	600956	新天绿能	12,200	150,304.00	0.03
499	603983	丸美股份	5,200	139,360.00	0.02
500	600917	重庆燃气	12,900	93,138.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688176	亚虹医药	37,990	476,014.70	0.08
2	688220	翱捷科技	5,710	391,648.90	0.07
3	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.04
4	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.04
5	601689	拓普集团	2,385	163,205.55	0.03
6	600903	贵州燃气	15,396	119,934.84	0.02
7	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.02
8	301177	迪阿股份	641	47,562.20	0.01
9	301236	软通动力	1,454	45,626.52	0.01
10	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.01
11	301219	腾远钴业	367	32,229.94	0.01
12	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.01
13	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
14	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
15	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
16	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
17	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00

18	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
19	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
20	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
21	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
22	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
23	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
24	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
25	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
26	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
27	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
28	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
29	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
30	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
31	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
32	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
33	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
34	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
35	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
36	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
37	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
38	688065	凯赛生物	11	1,229.80	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	300751	迈为股份	7,916,310.71	0.61
2	600096	云天化	4,194,748.00	0.32
3	300012	华测检测	4,178,556.04	0.32
4	300769	德方纳米	4,166,636.60	0.32
5	002497	雅化集团	4,105,811.00	0.32
6	002240	盛新锂能	3,898,931.00	0.30
7	300390	天华超净	3,491,149.00	0.27
8	688180	君实生物	3,467,148.12	0.27
9	002407	多氟多	3,319,548.48	0.26
10	688122	西部超导	3,199,564.73	0.25
11	002756	永兴材料	3,133,801.00	0.24
12	601058	赛轮轮胎	3,018,376.00	0.23
13	300073	当升科技	3,015,494.00	0.23
14	688777	中控技术	2,990,378.03	0.23
15	300763	锦浪科技	2,735,839.62	0.21
16	601108	财通证券	2,651,027.00	0.20

17	603345	安井食品	2,621,685.00	0.20
18	000783	长江证券	2,434,569.99	0.19
19	600499	科达制造	2,425,437.00	0.19
20	601162	天风证券	2,408,062.00	0.19

注：“买入金额”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。

7.4.2 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	300751	迈为股份	13,423,121.40	1.03
2	000733	振华科技	9,082,758.00	0.70
3	002340	格林美	7,522,580.00	0.58
4	300763	锦浪科技	7,021,531.00	0.54
5	000723	美锦能源	6,114,800.00	0.47
6	002013	中航机电	4,340,055.64	0.33
7	600188	兖矿能源	4,316,015.82	0.33
8	688536	思瑞浦	3,951,889.20	0.30
9	300223	北京君正	3,808,674.00	0.29
10	601117	中国化学	3,602,983.37	0.28
11	603290	斯达半导	3,544,517.60	0.27
12	000009	中国宝安	3,409,440.96	0.26
13	600884	杉杉股份	3,392,706.00	0.26
14	002180	纳思达	3,312,252.00	0.26
15	688005	容百科技	3,291,115.72	0.25
16	605358	立昂微	3,157,942.24	0.24
17	002080	中材科技	3,148,699.00	0.24
18	002384	东山精密	2,909,801.00	0.22
19	300285	国瓷材料	2,888,784.36	0.22
20	688099	晶晨股份	2,845,185.31	0.22

注：“卖出金额”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。

7.4.3 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	216,306,841.13
卖出股票收入（成交）总额	460,838,175.33

注：“买入股票成本”或“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）	52,009.80	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,009.80	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127064	杭氧转债	520	52,009.80	0.01

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

本基金本报告期有股指期货投资。投资政策是：本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，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，实现跟踪标的指数的投资目标。

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

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,060,347.50
2	应收清算款	134,253.83
3	应收股利	156,556.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	31,229.01
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	3,458,002.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600256	广汇能源	953,870.00	0.16	转融通流通受限
2	600096	云天化	840,516.00	0.14	转融通流通受限
3	300012	华测检测	810,029.00	0.14	转融通流通受限
4	002497	雅化集团	780,335.00	0.13	转融通流通受限
5	002407	多氟多	767,887.00	0.13	转融通流通受限
6	002240	盛新锂能	754,500.00	0.13	转融通流通受限
7	600522	中天科技	341,880.00	0.06	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688176	亚虹医药	476,014.70	0.08	新股锁定
2	688220	翱捷科技	391,648.90	0.07	新股锁定
3	688322	奥比中光	264,313.71	0.04	新股未上市
4	301175	中科环保	243,311.08	0.04	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
921	97,704.80	86,952,664.00	96.63	3,033,457.00	3.37

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
平安 500ETF 联接基金	60,762,431.00	67.52

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	中国平安人寿保险股份 有限公司一分红一个 险分红	22,430,219.00	24.93
2	方正证券股份有限公 司	1,278,452.00	1.42
3	招商证券股份有限公 司	649,800.00	0.72
4	大杨集团有限责任公 司	500,572.00	0.56
5	广发证券股份有限公 司	424,178.00	0.47
6	华泰证券股份有限公 司	377,543.00	0.42
7	中国平安人寿保险股 份有限公司一传统一	237,800.00	0.26

	银保账户		
8	黎旭晖	236,286.00	0.26
9	国亨信益（北京）资产管理有限公司	150,800.00	0.17
10	海通证券股份有限公司	130,100.00	0.14
11	平安银行股份有限公司—平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	60,762,431.00	67.52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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（2018年3月23日）基金份额总额	2,648,875,604.00
本报告期期初基金份额总额	175,586,121.00
本报告期基金总申购份额	8,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	94,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	89,986,121.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	375,394,851.57	56.14	267,798.69	55.91	-
东方财富证券	2	251,795,204.76	37.65	181,651.29	37.92	-
方正证券	2	41,508,892.71	6.21	29,531.19	6.17	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-

华创证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

3、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
中信证券	53,486.00	18.70	386,000,000.00	100.00	-	-
东方财富 证券	232,494.72	81.30	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下证券投资基金实施新会计准则等相关事宜的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 12 日
3	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 24 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华安证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 22 日
5	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 31 日
6	平安基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金产品风险评级相关事项的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 02 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东吴证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 07 日
8	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
9	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 22 日
10	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022/01/01—2022/03/21	85,273,882.00	0.00	85,273,882.00	0.00	0.00
	2	2022/03/23—2022/04/19; 2022/06/22—2022/06/30	22,430,219.00	0.00	0.00	22,430,219.00	24.93
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2022/01/01—2022/06/30	53,440,243.00	12,531,288.00	5,209,100.00	60,762,431.00	67.52
产品特有风险							
<p>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。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出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元,基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安中证 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、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日