

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十八日

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。本半年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 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
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遵规守信情况的说明.....	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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
9 开放式基金份额变动	56
10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	61
11 影响投资者决策的其他重要信息	61
12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 500ETF
场内简称	广发 500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,007,038,319.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 5 月 24 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	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证 500 指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邱春杨	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	陈四清

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-2,728,108.94
本期利润	655,773,818.13
加权平均基金份额本期利润	0.2388
本期加权平均净值利润率	16.87%
本期基金份额净值增长率	19.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	1,244,567,945.65
期末可供分配基金份额利润	0.4139
期末基金资产净值	4,251,606,264.65
期末基金份额净值	1.4139
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	41.39%

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，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

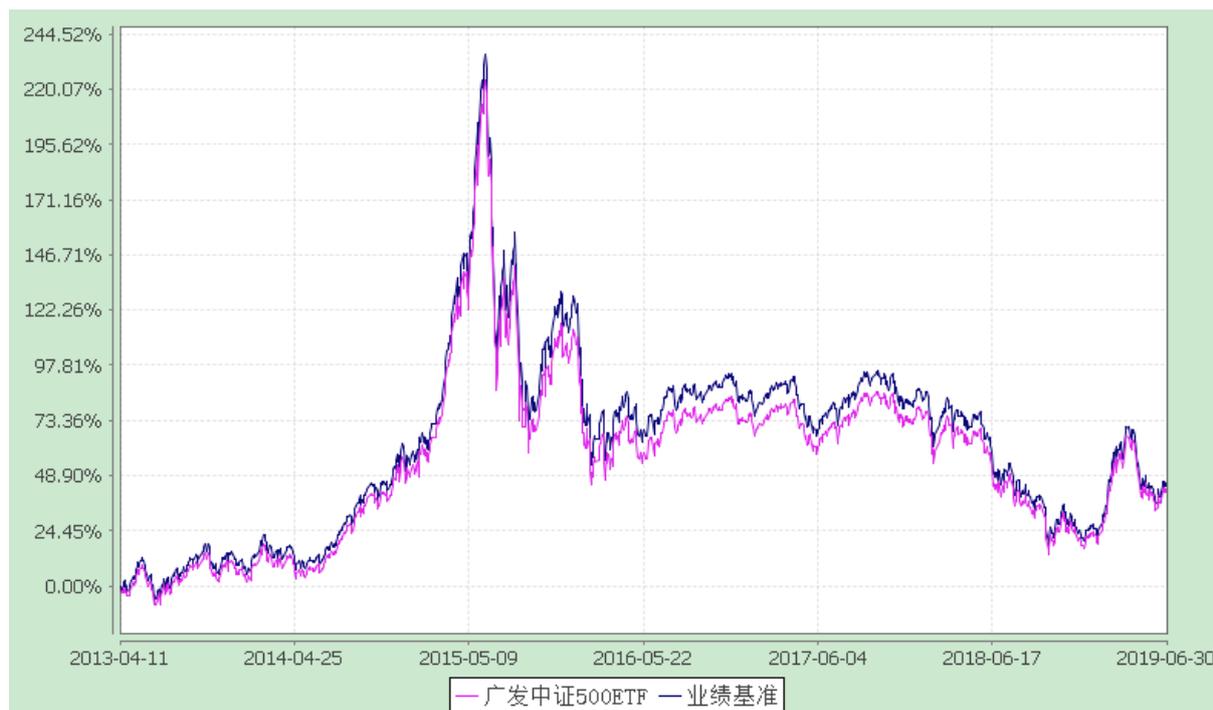
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.95%	1.36%	0.78%	1.39%	0.17%	-0.03%
过去三个月	-10.05%	1.78%	-10.76%	1.81%	0.71%	-0.03%
过去六个月	19.61%	1.76%	18.77%	1.79%	0.84%	-0.03%
过去一年	-3.40%	1.67%	-5.12%	1.69%	1.72%	-0.02%
过去三年	-15.88%	1.29%	-19.16%	1.31%	3.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	41.39%	1.73%	44.02%	1.76%	-2.63%	-0.03%

注：业绩比较基准：中证 500 指数。

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

广发中证 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
 （2013 年 4 月 11 日至 2019 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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、受托管理保险资金投资管理、保险保障基金委托资产管理投资管理、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和32个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国

际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证养老产业指数型发起	2014-04-01	-	15 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)。

	<p>式证券投资基金的基金经理；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯</p>				
--	--	--	--	--	--

	达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金 (QDII) 的基金经理；指数投资部总经理助理				
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关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，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口

下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，公司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 4 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本基金业绩基准是中证 500 指数，主要采用完全复制法来跟踪业绩基准。

(1) 投资策略

作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。

(2) 运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素。

受益于一季度中美贸易问题的短期反转以及 1 月份社融超预期表现，2019 年上半年 A 股市场先扬后抑且整体大幅上涨，其中沪深 300 上涨 27.07%，中证 500 上涨 18.77%，创业板指上涨 20.87%，上证综指上涨 19.45%。

总体上，上半年 A 股市场存在多空信号交错，例如 1 至 5 月固定资产投资累计增速 5.6%，前值 6.1%，结束了自去年 9 月起的连续改善，社融数据增速的剧烈变化以及企业中长期贷款增速的较大波动，促使整体市场上半年先涨后跌且处于宽幅震荡状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 19.61%，同期业绩比较基准收益率为 18.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来，中美贸易问题的长期性和国内经济下行压力依然是资本市场关注的两个重要因素。虽然外部环境和内部压力可能对出口构成压力，制造业投资短期也难以出现明显改善，但是减税降费和财政政策的积极有望在下半年支撑消费、制造业投资并明显提振基建投资，进而提振市场。

随着科创板开板、MSCI 和富时 A 股权重不断提升，外资和机构在 A 股中占比的不断增长，资本市场环境也在发生着变化，公司治理相对完善和行业中竞争力存在相对优势的公司或许会得到资本市场的更多关注，叠加美联储的降息预期，看好未来市场存在的阶段性机会和结构性行情。

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动高收益指数，中长期收益相对大部分指数存在一定优势，就短期表现而言，其往往被誉为“反弹急先锋”，值得投资者关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	65,544,250.35	15,696,271.37
结算备付金		9,442,891.33	10,515,268.85
存出保证金		492,855.48	1,738,378.65

交易性金融资产	6.4.7.2	4,172,279,661.28	3,276,737,947.46
其中：股票投资		4,169,999,505.48	3,274,819,523.16
基金投资		-	-
债券投资		2,280,155.80	1,918,424.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		97,954,026.85	-
应收利息	6.4.7.5	16,908.37	8,185.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,345,730,593.66	3,304,696,052.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		75,413,340.49	10,554.77
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,584,005.64	1,433,405.74
应付托管费		316,801.14	286,681.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,008,196.53	679,747.75
应交税费		12.43	12.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	15,801,972.78	619,758.16
负债合计		94,124,329.01	3,030,160.41
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,007,038,319.00	2,793,038,319.00
未分配利润	6.4.7.10	1,244,567,945.65	508,627,572.74
所有者权益合计		4,251,606,264.65	3,301,665,891.74
负债和所有者权益总计		4,345,730,593.66	3,304,696,052.15

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4139 元，基金份额总额 3,007,038,319.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		670,801,225.86	-251,167,582.92
1.利息收入		353,052.69	257,198.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	350,835.79	257,192.38
债券利息收入		2,216.90	6.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,937,241.73	-10,413,693.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-19,911,788.17	-22,109,359.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	9,915.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-4,131,635.73	-691,740.58
股利收益	6.4.7.15	34,980,665.63	12,377,491.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	658,501,927.07	-250,918,138.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,009,004.37	9,907,050.72
减：二、费用		15,027,407.73	8,094,083.39
1. 管理人报酬		9,603,882.65	4,509,845.28
2. 托管费		1,920,776.49	901,969.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,804,280.09	2,189,556.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		261.91	3,343.30
7. 其他费用	6.4.7.19	698,206.59	489,368.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		655,773,818.13	-259,261,666.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		655,773,818.13	-259,261,666.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,793,038,319.00	508,627,572.74	3,301,665,891.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	655,773,818.13	655,773,818.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	214,000,000.00	80,166,554.78	294,166,554.78
其中：1.基金申购款	1,380,000,000.00	640,000,042.21	2,020,000,042.21
2.基金赎回款	-1,166,000,000.00	-559,833,487.43	-1,725,833,487.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,007,038,319.00	1,244,567,945.65	4,251,606,264.65
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	825,038,319.00	609,797,205.90	1,434,835,524.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-259,261,666.31	-259,261,666.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	688,000,000.00	350,942,749.84	1,038,942,749.84
其中：1.基金申购款	1,048,000,000.00	597,733,091.26	1,645,733,091.26
2.基金赎回款	-360,000,000.00	-246,790,341.42	-606,790,341.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,513,038,319.00	701,478,289.43	2,214,516,608.43

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]165 号《关于核准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 4 月 11 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为 2013 年 3 月 18 日至 2013 年 3 月 29 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 425,036,920.00 元，有效认购户数为 3,122 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,399.00 元，折合基金份额 1,399.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金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，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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	65,544,250.35
定期存款	-
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	-
合计	65,544,250.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,287,601,114.06	4,169,999,505.48	-117,601,608.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,919,000.00	2,280,155.80
	银行间市场	-	-
	合计	1,919,000.00	2,280,155.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,289,520,114.06	4,172,279,661.28	-117,240,452.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,267.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	199.62
应收结算备付金利息	3,614.82
应收债券利息	2,826.45
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	16,908.37

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,008,196.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,008,196.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	121,434.45
应付替代款	13,953,380.49
可退替代款	1,422,785.43
应付指数使用费	304,372.41
合计	15,801,972.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,793,038,319.00	2,793,038,319.00
本期申购	1,380,000,000.00	1,380,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,166,000,000.00	-1,166,000,000.00
本期末	3,007,038,319.00	3,007,038,319.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,525,019,607.65	-3,016,392,034.91	508,627,572.74
本期利润	-2,728,108.94	658,501,927.07	655,773,818.13
本期基金份额交易产生的变动数	272,365,675.56	-192,199,120.78	80,166,554.78
其中：基金申购款	1,751,441,503.16	-1,111,441,460.95	640,000,042.21
基金赎回款	-1,479,075,827.60	919,242,340.17	-559,833,487.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,794,657,174.27	-2,550,089,228.62	1,244,567,945.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	257,866.24
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,121.52
结算备付金利息收入	89,848.03
其他	-
合计	350,835.79

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-35,704,301.56
股票投资收益——赎回差价收入	15,792,513.39
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-19,911,788.17

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,340,651,776.60
减：卖出股票成本总额	1,376,356,078.16
买卖股票差价收入	-35,704,301.56

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,725,833,487.43
减：现金支付赎回款总额	926,254,268.43
减：赎回股票成本总额	783,786,705.61
赎回差价收入	15,792,513.39

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股指期货投资收益	-4,131,635.73
----------	---------------

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	34,980,665.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	34,980,665.63

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	658,182,093.75
——股票投资	657,820,362.25
——债券投资	361,731.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	326,800.00
——权证投资	-
——股指期货投资	326,800.00
3.其他	-6,966.68
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	658,501,927.07

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,009,004.37
合计	1,009,004.37

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代股票的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,802,075.43
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	2,204.66
合计	2,804,280.09

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	36,695.94
信息披露费	54,985.73
银行汇划费	539.23
上市费	29,752.78
指数使用费	576,232.91
合计	698,206.59

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，本基金无需要披露的或有事项。

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，本基金无需要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

本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	本基金的联接基金
广发期货有限公司	与基金管理人受同一控制

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,603,882.65	4,509,845.28
其中：支付销售机构的客户维护费	65,710.55	10,553.56

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,920,776.49	901,969.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1 % 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,671,237,821.00	88.83%	2,064,958,177.00	73.93%

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	65,544,250.35	257,866.24	58,215,484.02	220,192.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金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，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	2,280,155.80	1,918,424.30
未评级	-	-
合计	2,280,155.80	1,918,424.30

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业

市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	65,544,250.35	-	-	-	65,544,250.35
结算备付金	9,442,891.33	-	-	-	9,442,891.33
存出保证金	492,855.48	-	-	-	492,855.48
交易性金融资产	2,280,155.80	-	-	4,169,999,505.48	4,172,279,661.28
应收证券清算款	-	-	-	97,954,026.85	97,954,026.85
应收利息	-	-	-	16,908.37	16,908.37
资产总计	77,760,152.96	-	-	4,267,970,440.70	4,345,730,593.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	75,413,340.49	75,413,340.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,584,005.64	1,584,005.64
应付托管费	-	-	-	316,801.14	316,801.14
应付交易费用	-	-	-	1,008,196.53	1,008,196.53

应交税费	-	-	-	12.43	12.43
其他负债	-	-	-	15,801,972.78	15,801,972.78
负债总计	-	-	-	94,124,329.01	94,124,329.01
利率敏感度缺口	77,760,152.96	-	-	4,173,846,111.69	4,251,606,264.65
上年度末 2018 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	15,696,271.37	-	-	-	15,696,271.37
结算备付金	10,515,268.85	-	-	-	10,515,268.85
存出保证金	1,738,378.65	-	-	-	1,738,378.65
交易性金融资产	1,918,424.30	-	-	3,274,819,523.16	3,276,737,947.46
应收利息	-	-	-	8,185.82	8,185.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	29,868,343.17	-	-	3,274,827,708.98	3,304,696,052.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,554.77	10,554.77
应付管理人报酬	-	-	-	1,433,405.74	1,433,405.74
应交税金	-	-	-	12.84	12.84
应付托管费	-	-	-	286,681.15	286,681.15
应付交易费用	-	-	-	679,747.75	679,747.75
其他负债	-	-	-	619,758.16	619,758.16
负债总计	-	-	-	3,030,160.41	3,030,160.41
利率敏感度缺口	29,868,343.17	-	-	3,271,797,548.57	3,301,665,891.74

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末持有的债券占基金资产净值较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	4,169,999,505.48	98.08	3,274,819,523.16	99.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,280,155.80	0.05	1,918,424.30	0.06
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	4,172,279,661.28	98.13	3,276,737,947.46	99.24

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	249,038,861.81	156,829,129.86
	业绩比较基准下降 5%	-249,038,861.81	-156,829,129.86

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 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。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 4,172,222,684.74 元，属于第二层级的余额为人民币 56,976.54 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 3,250,705,659.62 元，属于第二层级的余额为人民币 26,032,287.84 元，属于第三层级的金额为人民币 0.00 元）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第三层级的余额；本报告期内转出第三层级的金额为人民币 0.00 元，除上述变动外，该层级金融资产无其他变动。

2、除公允价值外，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	4,169,999,505.48	95.96
	其中：股票	4,169,999,505.48	95.96
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	2,280,155.80	0.05
	其中：债券	2,280,155.80	0.05
	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	74,987,141.68	1.73
8	其他各项资产	98,463,790.70	2.27
9	合计	4,345,730,593.66	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	46,604,062.95	1.10
B	采矿业	146,214,980.25	3.44
C	制造业	2,339,139,664.72	55.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,237,504.60	3.13
E	建筑业	70,214,671.97	1.65
F	批发和零售业	202,842,692.19	4.77
G	交通运输、仓储和邮政业	146,140,277.88	3.44
H	住宿和餐饮业	15,786,075.44	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	405,187,873.07	9.53
J	金融业	179,934,274.63	4.23
K	房地产业	197,796,224.41	4.65
L	租赁和商务服务业	58,578,635.44	1.38
M	科学研究和技术服务业	5,922,056.65	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	35,759,645.46	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	12,686,173.72	0.30
Q	卫生和社会工作	27,692,407.23	0.65
R	文化、体育和娱乐业	89,597,722.33	2.11
S	综合	56,671,529.22	1.33
	合计	4,170,006,472.16	98.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

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	000860	顺鑫农业	584,494	27,266,645.10	0.64
2	600872	中炬高新	605,233	25,922,129.39	0.61
3	002405	四维图新	1,556,020	25,051,922.00	0.59
4	002049	紫光国微	476,800	21,031,648.00	0.49
5	000066	中国长城	1,979,413	20,348,365.64	0.48
6	300253	卫宁健康	1,410,329	19,998,465.22	0.47
7	600201	生物股份	1,262,719	19,812,061.11	0.47
8	002195	二三四五	4,977,532	19,362,599.48	0.46
9	300450	先导智能	565,286	18,993,609.60	0.45
10	002157	正邦科技	1,138,900	18,974,074.00	0.45
11	000401	冀东水泥	1,059,000	18,648,990.00	0.44
12	002439	启明星辰	682,570	18,361,133.00	0.43
13	002129	中环股份	1,877,449	18,323,902.24	0.43
14	600426	华鲁恒升	1,227,171	18,235,761.06	0.43
15	002506	协鑫集成	2,716,203	18,144,236.04	0.43
16	002507	涪陵榨菜	590,600	18,013,300.00	0.42
17	002127	南极电商	1,587,036	17,838,284.64	0.42
18	600642	申能股份	2,961,270	17,797,232.70	0.42
19	002463	沪电股份	1,303,236	17,750,074.32	0.42
20	300383	光环新网	1,043,800	17,504,526.00	0.41
21	600183	生益科技	1,153,248	17,356,382.40	0.41
22	002465	海格通信	1,812,372	17,290,028.88	0.41
23	600895	张江高科	841,000	17,257,320.00	0.41
24	600536	中国软件	321,066	17,231,612.22	0.41

25	600298	安琪酵母	540,918	17,109,236.34	0.40
26	002340	格林美	3,599,840	16,955,246.40	0.40
27	000975	银泰资源	1,283,515	16,929,562.85	0.40
28	000750	国海证券	3,313,586	16,667,337.58	0.39
29	002223	鱼跃医疗	669,131	16,474,005.22	0.39
30	002268	卫士通	654,240	15,996,168.00	0.38
31	600763	通策医疗	176,777	15,660,674.43	0.37
32	002384	东山精密	1,068,084	15,561,983.88	0.37
33	002500	山西证券	1,884,800	15,266,880.00	0.36
34	603369	今世缘	538,156	15,009,170.84	0.35
35	600801	华新水泥	738,941	14,963,555.25	0.35
36	600161	天坛生物	581,407	14,680,526.75	0.35
37	600779	水井坊	287,516	14,611,563.12	0.34
38	000998	隆平高科	1,004,456	14,544,522.88	0.34
39	600879	航天电子	2,351,933	14,487,907.28	0.34
40	002385	大北农	2,720,300	14,390,387.00	0.34
41	600325	华发股份	1,834,448	14,327,038.88	0.34
42	000333	美的集团	276,005	14,313,619.30	0.34
43	002373	千方科技	830,945	14,209,159.50	0.33
44	002299	圣农发展	560,700	14,196,924.00	0.33
45	000723	美锦能源	1,356,300	14,173,335.00	0.33
46	600460	士兰微	852,104	14,144,926.40	0.33
47	002371	北方华创	202,635	14,032,473.75	0.33
48	600528	中铁工业	1,204,200	13,932,594.00	0.33
49	000686	东北证券	1,572,030	13,849,584.30	0.33
50	000778	新兴铸管	3,115,950	13,834,818.00	0.33
51	000009	中国宝安	2,407,944	13,749,360.24	0.32
52	000997	新大陆	809,298	13,669,043.22	0.32
53	601128	常熟银行	1,764,633	13,622,966.76	0.32
54	000988	华工科技	855,697	13,537,126.54	0.32
55	600584	长电科技	1,037,614	13,333,339.90	0.31
56	002092	中泰化学	1,672,641	13,314,222.36	0.31
57	002075	沙钢股份	1,690,000	13,249,600.00	0.31
58	601005	重庆钢铁	6,591,209	13,248,330.09	0.31
59	002926	华西证券	1,261,100	13,241,550.00	0.31
60	600848	上海临港	423,155	13,172,815.15	0.31
61	601168	西部矿业	2,063,880	13,167,554.40	0.31
62	600699	均胜电子	610,400	13,038,144.00	0.31
63	002821	凯莱英	132,600	13,005,408.00	0.31
64	000060	中金岭南	2,756,000	12,925,640.00	0.30
65	000999	华润三九	440,458	12,923,037.72	0.30
66	600820	隧道股份	2,045,000	12,903,950.00	0.30
67	000039	中集集团	1,200,004	12,816,042.72	0.30
68	600673	东阳光	1,631,390	12,806,411.50	0.30

69	002797	第一创业	2,018,900	12,799,826.00	0.30
70	600410	华胜天成	1,185,320	12,718,483.60	0.30
71	600392	盛和资源	1,145,563	12,669,926.78	0.30
72	600875	东方电气	1,192,516	12,664,519.92	0.30
73	000690	宝新能源	1,954,469	12,586,780.36	0.30
74	002353	杰瑞股份	544,618	12,580,675.80	0.30
75	000830	鲁西化工	1,156,279	12,580,315.52	0.30
76	600572	康恩贝	1,961,010	12,550,464.00	0.30
77	600376	首开股份	1,390,400	12,416,272.00	0.29
78	300168	万达信息	955,400	12,391,538.00	0.29
79	000960	锡业股份	1,109,060	12,388,200.20	0.29
80	002191	劲嘉股份	993,348	12,327,448.68	0.29
81	600497	驰宏锌锗	2,419,400	12,290,552.00	0.29
82	002372	伟星新材	700,740	12,192,876.00	0.29
83	000581	威孚高科	652,745	12,114,947.20	0.28
84	600745	闻泰科技	364,200	12,098,724.00	0.28
85	002916	深南电路	118,282	12,055,301.44	0.28
86	600718	东软集团	940,001	12,050,812.82	0.28
87	600811	东方集团	3,225,790	11,999,938.80	0.28
88	600166	福田汽车	5,041,700	11,948,829.00	0.28
89	002281	光迅科技	451,024	11,943,115.52	0.28
90	000547	航天发展	1,249,189	11,942,246.84	0.28
91	002078	太阳纸业	1,746,650	11,894,686.50	0.28
92	600755	厦门国贸	1,373,116	11,849,991.08	0.28
93	600022	山东钢铁	7,036,916	11,751,649.72	0.28
94	600839	四川长虹	3,982,371	11,747,994.45	0.28
95	600567	山鹰纸业	3,484,000	11,741,080.00	0.28
96	601866	中远海发	4,310,100	11,723,472.00	0.28
97	600804	鹏博士	1,557,800	11,714,656.00	0.28
98	600885	宏发股份	476,106	11,569,375.80	0.27
99	600881	亚泰集团	3,559,264	11,567,608.00	0.27
100	002572	索菲亚	621,434	11,533,815.04	0.27
101	600959	江苏有线	2,588,200	11,517,490.00	0.27
102	600549	厦门钨业	800,166	11,450,375.46	0.27
103	601872	招商轮船	2,624,650	11,443,474.00	0.27
104	600909	华安证券	1,721,100	11,255,994.00	0.26
105	002074	国轩高科	854,400	11,201,184.00	0.26
106	600315	上海家化	358,269	11,160,079.35	0.26
107	002221	东华能源	1,292,350	11,127,133.50	0.26
108	600808	马钢股份	3,237,174	11,038,763.34	0.26
109	002670	国盛金控	872,160	10,989,216.00	0.26
110	603077	和邦生物	5,749,289	10,923,649.10	0.26
111	600260	凯乐科技	546,674	10,922,546.52	0.26
112	002038	双鹭药业	460,766	10,855,646.96	0.26

113	600094	大名城	1,720,043	10,819,070.47	0.25
114	000970	中科三环	952,300	10,808,605.00	0.25
115	600079	人福医药	1,026,878	10,782,219.00	0.25
116	300274	阳光电源	1,149,902	10,751,583.70	0.25
117	300315	掌趣科技	3,089,800	10,659,810.00	0.25
118	603000	人民网	597,397	10,651,588.51	0.25
119	002273	水晶光电	919,655	10,649,604.90	0.25
120	300027	华谊兄弟	2,158,900	10,600,199.00	0.25
121	600160	巨化股份	1,481,567	10,533,941.37	0.25
122	000513	丽珠集团	316,714	10,524,406.22	0.25
123	603444	吉比特	50,080	10,514,796.80	0.25
124	601333	广深铁路	3,246,200	10,485,226.00	0.25
125	000729	燕京啤酒	1,577,266	10,473,046.24	0.25
126	300088	长信科技	2,066,500	10,456,490.00	0.25
127	600521	华海药业	738,049	10,406,490.90	0.24
128	600037	歌华有线	1,008,232	10,334,378.00	0.24
129	000089	深圳机场	1,156,400	10,280,396.00	0.24
130	002387	维信诺	784,893	10,242,853.65	0.24
131	600643	爱建集团	1,066,853	10,220,451.74	0.24
132	002002	鸿达兴业	1,648,712	10,205,527.28	0.24
133	002110	三钢闽光	1,097,150	10,203,495.00	0.24
134	600967	内蒙一机	910,242	10,194,710.40	0.24
135	300001	特锐德	563,804	10,159,748.08	0.24
136	300166	东方国信	823,133	10,116,304.57	0.24
137	600466	蓝光发展	1,626,131	10,114,534.82	0.24
138	000878	云南铜业	949,700	10,095,311.00	0.24
139	600143	金发科技	2,059,781	10,092,926.90	0.24
140	600282	南钢股份	2,883,600	10,092,600.00	0.24
141	002174	游族网络	594,500	10,035,160.00	0.24
142	600064	南京高科	936,121	10,025,855.91	0.24
143	600266	北京城建	1,243,569	10,023,166.14	0.24
144	600435	北方导航	1,113,020	10,006,049.80	0.24
145	603939	益丰药房	142,452	9,970,215.48	0.23
146	600737	中粮糖业	1,148,439	9,968,450.52	0.23
147	600388	龙净环保	801,286	9,927,933.54	0.23
148	002217	合力泰	1,793,200	9,916,396.00	0.23
149	002589	瑞康医药	1,305,877	9,911,606.43	0.23
150	000563	陕国投 A	2,230,436	9,903,135.84	0.23
151	600021	上海电力	1,140,115	9,896,198.20	0.23
152	002690	美亚光电	303,200	9,884,320.00	0.23
153	002131	利欧股份	5,166,267	9,867,569.97	0.23
154	600171	上海贝岭	605,272	9,835,670.00	0.23
155	002019	亿帆医药	801,893	9,823,189.25	0.23
156	601098	中南传媒	773,600	9,778,304.00	0.23

157	600863	内蒙华电	3,113,528	9,776,477.92	0.23
158	000636	风华高科	800,199	9,682,407.90	0.23
159	300009	安科生物	608,068	9,668,281.20	0.23
160	002440	闰土股份	774,825	9,654,319.50	0.23
161	600258	首旅酒店	536,036	9,637,927.28	0.23
162	600026	中远海能	1,479,203	9,600,027.47	0.23
163	002155	湖南黄金	941,072	9,476,595.04	0.22
164	600486	扬农化工	172,900	9,457,630.00	0.22
165	601106	中国一重	2,992,100	9,395,194.00	0.22
166	601718	际华集团	2,391,600	9,351,156.00	0.22
167	002152	广电运通	1,355,701	9,286,551.85	0.22
168	000732	泰禾集团	562,680	9,284,220.00	0.22
169	000930	中粮生化	1,230,653	9,254,510.56	0.22
170	002085	万丰奥威	1,260,700	9,177,896.00	0.22
171	000983	西山煤电	1,513,800	9,173,628.00	0.22
172	000598	兴蓉环境	2,008,600	9,139,130.00	0.21
173	600373	中文传媒	726,899	9,129,851.44	0.21
174	600845	宝信软件	320,003	9,113,685.44	0.21
175	000559	万向钱潮	1,520,980	9,095,460.40	0.21
176	002250	联化科技	817,922	9,070,754.98	0.21
177	601699	潞安环能	1,141,894	9,066,638.36	0.21
178	300316	晶盛机电	714,400	9,065,736.00	0.21
179	600380	健康元	1,046,524	9,052,432.60	0.21
180	000681	视觉中国	466,744	9,045,498.72	0.21
181	601966	玲珑轮胎	526,771	8,955,107.00	0.21
182	002607	中公教育	649,420	8,916,536.60	0.21
183	000932	华菱钢铁	1,867,880	8,909,787.60	0.21
184	601100	恒立液压	283,907	8,909,001.66	0.21
185	002399	海普瑞	422,900	8,876,671.00	0.21
186	600649	城投控股	1,365,173	8,832,669.31	0.21
187	601000	唐山港	3,207,390	8,820,322.50	0.21
188	002583	海能达	1,033,046	8,667,255.94	0.20
189	300207	欣旺达	745,000	8,582,400.00	0.20
190	600039	四川路桥	2,352,901	8,564,559.64	0.20
191	600648	外高桥	407,271	8,544,545.58	0.20
192	002233	塔牌集团	730,831	8,536,106.08	0.20
193	600008	首创股份	2,423,700	8,531,424.00	0.20
194	300182	捷成股份	1,933,950	8,528,719.50	0.20
195	000685	中山公用	998,512	8,527,292.48	0.20
196	600827	百联股份	869,187	8,526,724.47	0.20
197	002368	太极股份	281,022	8,514,966.60	0.20
198	000738	航发控制	633,911	8,494,407.40	0.20
199	603517	绝味食品	218,120	8,487,049.20	0.20
200	600500	中化国际	1,135,407	8,481,490.29	0.20

201	000758	中色股份	1,543,291	8,472,667.59	0.20
202	601118	海南橡胶	1,644,000	8,466,600.00	0.20
203	600167	联美控股	799,250	8,456,065.00	0.20
204	002266	浙富控股	1,779,019	8,450,340.25	0.20
205	601231	环旭电子	700,289	8,438,482.45	0.20
206	000031	大悦城	1,311,218	8,418,019.56	0.20
207	600782	新钢股份	1,681,800	8,409,000.00	0.20
208	002004	华邦健康	1,727,100	8,393,706.00	0.20
209	000008	神州高铁	2,205,782	8,315,798.14	0.20
210	000027	深圳能源	1,337,820	8,294,484.00	0.20
211	300418	昆仑万维	643,500	8,281,845.00	0.19
212	000807	云铝股份	1,761,400	8,260,966.00	0.19
213	000877	天山股份	710,548	8,256,567.76	0.19
214	601179	中国西电	2,222,145	8,221,936.50	0.19
215	600598	北大荒	765,600	8,214,888.00	0.19
216	002414	高德红外	423,304	8,127,436.80	0.19
217	601608	中信重工	1,876,950	8,108,424.00	0.19
218	000883	湖北能源	1,863,700	8,088,458.00	0.19
219	000488	晨鸣纸业	1,501,656	8,048,876.16	0.19
220	000826	启迪环境	680,940	8,028,282.60	0.19
221	300058	蓝色光标	1,873,178	7,998,470.06	0.19
222	600729	重庆百货	263,624	7,971,989.76	0.19
223	002183	怡亚通	1,669,802	7,964,955.54	0.19
224	601678	滨化股份	1,170,871	7,915,087.96	0.19
225	600138	中青旅	623,593	7,913,395.17	0.19
226	600120	浙江东方	617,090	7,861,726.60	0.18
227	600056	中国医药	582,378	7,856,279.22	0.18
228	600748	上实发展	945,388	7,837,266.52	0.18
229	000887	中鼎股份	816,600	7,831,194.00	0.18
230	002603	以岭药业	670,297	7,762,039.26	0.18
231	600633	浙数文化	827,700	7,738,995.00	0.18
232	000528	柳工	1,161,260	7,733,991.60	0.18
233	000813	德展健康	1,010,670	7,701,305.40	0.18
234	600507	方大特钢	787,300	7,699,794.00	0.18
235	600155	华创阳安	573,000	7,695,390.00	0.18
236	000156	华数传媒	698,760	7,693,347.60	0.18
237	002408	齐翔腾达	992,437	7,691,386.75	0.18
238	603885	吉祥航空	585,250	7,666,775.00	0.18
239	600511	国药股份	332,774	7,643,818.78	0.18
240	600525	长园集团	1,209,383	7,643,300.56	0.18
241	600409	三友化工	1,346,514	7,621,269.24	0.18
242	600348	阳泉煤业	1,298,221	7,542,664.01	0.18
243	300133	华策影视	1,118,309	7,526,219.57	0.18
244	600216	浙江医药	733,899	7,515,125.76	0.18

245	300113	顺网科技	479,100	7,512,288.00	0.18
246	600823	世茂股份	1,614,051	7,440,775.11	0.18
247	600418	江淮汽车	1,437,693	7,418,495.88	0.17
248	603883	老百姓	126,500	7,397,720.00	0.17
249	600515	海航基础	1,490,292	7,376,945.40	0.17
250	002407	多氟多	620,800	7,350,272.00	0.17
251	600060	海信电器	850,968	7,335,344.16	0.17
252	600970	中材国际	1,139,855	7,329,267.65	0.17
253	300010	立思辰	779,857	7,322,857.23	0.17
254	002244	滨江集团	1,752,336	7,272,194.40	0.17
255	603228	景旺电子	180,579	7,224,965.79	0.17
256	600158	中体产业	705,333	7,215,556.59	0.17
257	600777	新潮能源	3,464,880	7,206,950.40	0.17
258	600277	亿利洁能	1,479,711	7,206,192.57	0.17
259	601598	中国外运	1,503,560	7,202,052.40	0.17
260	600062	华润双鹤	566,019	7,137,499.59	0.17
261	600597	光明乳业	663,696	7,134,732.00	0.17
262	002242	九阳股份	342,591	7,129,318.71	0.17
263	002701	奥瑞金	1,515,858	7,079,056.86	0.17
264	601958	金钼股份	1,054,300	7,063,810.00	0.17
265	600478	科力远	1,262,237	7,055,904.83	0.17
266	002212	南洋股份	513,599	7,036,306.30	0.17
267	600664	哈药股份	1,695,849	7,020,814.86	0.17
268	002056	横店东磁	923,100	7,015,560.00	0.17
269	300026	红日药业	2,023,743	6,981,913.35	0.16
270	300002	神州泰岳	1,753,058	6,977,170.84	0.16
271	002640	跨境通	837,191	6,973,801.03	0.16
272	600717	天津港	1,083,240	6,954,400.80	0.16
273	601880	大连港	3,261,506	6,947,007.78	0.16
274	000028	国药一致	165,823	6,936,376.09	0.16
275	002491	通鼎互联	854,400	6,912,096.00	0.16
276	600307	酒钢宏兴	3,398,937	6,899,842.11	0.16
277	300244	迪安诊断	404,360	6,866,032.80	0.16
278	600580	卧龙电驱	815,228	6,856,067.48	0.16
279	000090	天健集团	1,386,330	6,848,470.20	0.16
280	600557	康缘药业	457,709	6,801,555.74	0.16
281	600312	平高电气	880,840	6,773,659.60	0.16
282	300324	旋极信息	1,163,988	6,739,490.52	0.16
283	002030	达安基因	627,283	6,730,746.59	0.16
284	300134	大富科技	432,318	6,713,898.54	0.16
285	002176	江特电机	1,376,400	6,703,068.00	0.16
286	002128	露天煤业	774,024	6,695,307.60	0.16
287	601928	凤凰传媒	825,807	6,664,262.49	0.16
288	002426	胜利精密	2,603,200	6,664,192.00	0.16

289	000021	深科技	819,598	6,663,331.74	0.16
290	600316	洪都航空	463,666	6,635,060.46	0.16
291	002470	金正大	1,816,400	6,611,696.00	0.16
292	601200	上海环境	482,234	6,563,204.74	0.15
293	002064	华峰氨纶	1,305,544	6,553,830.88	0.15
294	600259	广晟有色	162,504	6,548,911.20	0.15
295	600073	上海梅林	708,593	6,519,055.60	0.15
296	600884	杉杉股份	609,644	6,492,708.60	0.15
297	600759	洲际油气	1,675,270	6,466,542.20	0.15
298	002051	中工国际	562,749	6,454,731.03	0.15
299	300115	长盈精密	612,881	6,429,121.69	0.15
300	000712	锦龙股份	499,400	6,412,296.00	0.15
301	600125	铁龙物流	993,471	6,407,887.95	0.15
302	000078	海王生物	1,839,885	6,402,799.80	0.15
303	000727	华东科技	3,049,400	6,373,246.00	0.15
304	000301	东方盛虹	1,158,385	6,359,533.65	0.15
305	600017	日照港	2,014,719	6,346,364.85	0.15
306	601717	郑煤机	1,109,714	6,336,466.94	0.15
307	002812	恩捷股份	135,500	6,334,625.00	0.15
308	002665	首航节能	1,861,429	6,310,244.31	0.15
309	300197	铁汉生态	1,754,620	6,299,085.80	0.15
310	002358	森源电气	619,436	6,287,275.40	0.15
311	600267	海正药业	621,994	6,219,940.00	0.15
312	600859	王府井	409,378	6,218,451.82	0.15
313	002317	众生药业	728,867	6,202,658.17	0.15
314	603659	璞泰来	131,800	6,197,236.00	0.15
315	600751	海航科技	1,943,500	6,180,330.00	0.15
316	600582	天地科技	1,789,332	6,173,195.40	0.15
317	600754	锦江股份	249,519	6,148,148.16	0.14
318	002285	世联行	1,362,536	6,145,037.36	0.14
319	600575	皖江物流	2,091,506	6,128,112.58	0.14
320	603816	顾家家居	191,742	6,120,404.64	0.14
321	002419	天虹股份	466,000	6,085,960.00	0.14
322	000400	许继电气	671,637	6,085,031.22	0.14
323	600291	西水股份	604,620	6,082,477.20	0.14
324	002505	大康农业	3,075,818	6,059,361.46	0.14
325	600563	法拉电子	146,904	6,048,037.68	0.14
326	000519	中兵红箭	780,782	6,035,444.86	0.14
327	002444	巨星科技	603,010	6,018,039.80	0.14
328	002302	西部建设	539,994	6,015,533.16	0.14
329	002280	联络互动	1,643,050	6,013,563.00	0.14
330	000926	福星股份	867,950	6,006,214.00	0.14
331	600499	科达洁能	1,368,003	5,991,853.14	0.14
332	000717	韶钢松山	1,339,600	5,934,428.00	0.14

333	600901	江苏租赁	973,319	5,927,512.71	0.14
334	002424	贵州百灵	597,730	5,905,572.40	0.14
335	600565	迪马股份	1,582,357	5,902,191.61	0.14
336	002831	裕同科技	307,860	5,901,676.20	0.14
337	000718	苏宁环球	1,700,160	5,882,553.60	0.14
338	600645	中源协和	336,731	5,828,813.61	0.14
339	601611	中国核建	749,200	5,828,776.00	0.14
340	002573	清新环境	724,048	5,828,586.40	0.14
341	002249	大洋电机	1,334,468	5,791,591.12	0.14
342	600993	马应龙	327,734	5,784,505.10	0.14
343	000006	深振业 A	1,060,119	5,777,648.55	0.14
344	002028	思源电气	577,771	5,754,599.16	0.14
345	000158	常山北明	1,057,980	5,734,251.60	0.13
346	002839	张家港行	1,018,500	5,734,155.00	0.13
347	600835	上海机电	345,029	5,727,481.40	0.13
348	000012	南玻 A	1,373,006	5,711,704.96	0.13
349	603501	韦尔股份	103,600	5,688,676.00	0.13
350	000543	皖能电力	1,207,440	5,687,042.40	0.13
351	603866	桃李面包	136,140	5,670,231.00	0.13
352	002807	江阴银行	1,211,248	5,668,640.64	0.13
353	600770	综艺股份	846,031	5,651,487.08	0.13
354	002390	信邦制药	1,071,775	5,648,254.25	0.13
355	601326	秦港股份	1,555,800	5,647,554.00	0.13
356	600908	无锡银行	1,000,109	5,640,614.76	0.13
357	600787	中储股份	979,347	5,611,658.31	0.13
358	600151	航天机电	1,083,745	5,581,286.75	0.13
359	600611	大众交通	1,181,104	5,492,133.60	0.13
360	300055	万邦达	770,000	5,490,100.00	0.13
361	002366	台海核电	585,374	5,479,100.64	0.13
362	000980	众泰汽车	1,299,700	5,471,737.00	0.13
363	000848	承德露露	654,773	5,454,259.09	0.13
364	600765	中航重机	590,539	5,450,674.97	0.13
365	002672	东江环保	478,410	5,425,169.40	0.13
366	000600	建投能源	807,268	5,408,695.60	0.13
367	600141	兴发集团	524,569	5,392,569.32	0.13
368	300308	中际旭创	158,356	5,382,520.44	0.13
369	600458	时代新材	517,776	5,379,692.64	0.13
370	000959	首钢股份	1,523,300	5,362,016.00	0.13
371	002093	国脉科技	575,202	5,343,626.58	0.13
372	002332	仙琚制药	787,923	5,326,359.48	0.13
373	603515	欧普照明	163,731	5,280,324.75	0.12
374	600862	中航高科	584,400	5,253,756.00	0.12
375	002431	棕榈股份	1,324,448	5,231,569.60	0.12
376	600317	营口港	1,889,317	5,214,514.92	0.12

377	600169	太原重工	1,947,479	5,199,768.93	0.12
378	000564	供销大集	1,990,400	5,194,944.00	0.12
379	603233	大参林	115,070	5,178,150.00	0.12
380	300347	泰格医药	67,000	5,165,700.00	0.12
381	300376	易事特	1,047,800	5,165,654.00	0.12
382	002635	安洁科技	380,945	5,138,948.05	0.12
383	600338	西藏珠峰	293,806	5,135,728.88	0.12
384	300287	飞利信	1,287,100	5,109,787.00	0.12
385	002544	杰赛科技	391,787	5,093,231.00	0.12
386	002048	宁波华翔	470,260	5,088,213.20	0.12
387	600393	粤泰股份	1,093,729	5,085,839.85	0.12
388	002254	泰和新材	479,665	5,074,855.70	0.12
389	002745	木林森	432,100	5,064,212.00	0.12
390	601311	骆驼股份	463,698	5,031,123.30	0.12
391	300159	新研股份	1,008,086	5,020,268.28	0.12
392	300297	蓝盾股份	819,900	4,943,997.00	0.12
393	603712	七一二	232,500	4,935,975.00	0.12
394	601019	山东出版	623,374	4,849,849.72	0.11
395	600978	宜华生活	1,285,515	4,833,536.40	0.11
396	601689	拓普集团	314,188	4,813,360.16	0.11
397	601016	节能风电	1,789,402	4,759,809.32	0.11
398	300266	兴源环境	1,045,271	4,745,530.34	0.11
399	300199	翰宇药业	515,539	4,727,492.63	0.11
400	603766	隆鑫通用	1,114,768	4,670,877.92	0.11
401	600694	大商股份	167,062	4,662,700.42	0.11
402	603198	迎驾贡酒	260,300	4,661,973.00	0.11
403	600623	华谊集团	610,200	4,661,928.00	0.11
404	000501	鄂武商 A	433,433	4,659,404.75	0.11
405	600750	江中药业	357,244	4,647,744.44	0.11
406	000990	诚志股份	283,100	4,645,671.00	0.11
407	600006	东风汽车	866,827	4,620,187.91	0.11
408	000062	深圳华强	347,266	4,615,165.14	0.11
409	002410	广联达	140,013	4,605,027.57	0.11
410	000937	冀中能源	1,192,960	4,604,825.60	0.11
411	600195	中牧股份	331,700	4,594,045.00	0.11
412	600640	号百控股	341,678	4,571,651.64	0.11
413	603888	新华网	228,100	4,552,876.00	0.11
414	002503	搜于特	1,649,886	4,537,186.50	0.11
415	002709	天赐材料	187,389	4,534,813.80	0.11
416	000426	兴业矿业	836,282	4,490,834.34	0.11
417	002375	亚厦股份	754,500	4,459,095.00	0.10
418	600639	浦东金桥	275,745	4,458,796.65	0.10
419	600757	长江传媒	653,046	4,447,243.26	0.10
420	600329	中新药业	309,159	4,417,882.11	0.10

421	002815	崇达技术	282,242	4,400,152.78	0.10
422	600545	卓郎智能	614,731	4,370,737.41	0.10
423	600869	智慧能源	965,410	4,363,653.20	0.10
424	300257	开山股份	392,200	4,345,576.00	0.10
425	600416	湘电股份	720,053	4,334,719.06	0.10
426	603806	福斯特	116,997	4,297,299.81	0.10
427	000537	广宇发展	616,600	4,266,872.00	0.10
428	603568	伟明环保	194,533	4,186,350.16	0.10
429	000869	张裕 A	130,100	4,178,812.00	0.10
430	000061	农产品	762,218	4,131,221.56	0.10
431	601001	大同煤业	900,728	4,116,326.96	0.10
432	002434	万里扬	602,516	4,091,083.64	0.10
433	002489	浙江永强	1,221,877	4,081,069.18	0.10
434	002707	众信旅游	671,300	4,074,791.00	0.10
435	600098	广州发展	660,131	4,066,406.96	0.10
436	603056	德邦股份	283,069	3,985,611.52	0.09
437	300459	金科文化	696,000	3,960,240.00	0.09
438	601127	小康股份	302,112	3,957,667.20	0.09
439	000829	天音控股	675,396	3,930,804.72	0.09
440	600058	五矿发展	463,811	3,919,202.95	0.09
441	000536	华映科技	1,548,517	3,902,262.84	0.09
442	002437	誉衡药业	986,127	3,895,201.65	0.09
443	002118	紫鑫药业	577,478	3,892,201.72	0.09
444	002509	天广中茂	1,885,900	3,884,954.00	0.09
445	600874	创业环保	465,616	3,859,956.64	0.09
446	002517	恺英网络	1,209,294	3,857,647.86	0.09
447	601801	皖新传媒	635,950	3,822,059.50	0.09
448	000541	佛山照明	727,727	3,813,289.48	0.09
449	002920	德赛西威	170,231	3,813,174.40	0.09
450	600657	信达地产	923,420	3,804,490.40	0.09
451	002382	蓝帆医疗	274,800	3,797,736.00	0.09
452	603377	东方时尚	246,704	3,769,637.12	0.09
453	002512	达华智能	833,100	3,765,612.00	0.09
454	600971	恒源煤电	642,865	3,760,760.25	0.09
455	002681	奋达科技	875,950	3,714,028.00	0.09
456	000766	通化金马	542,957	3,692,107.60	0.09
457	002251	步步高	460,221	3,667,961.37	0.09
458	600996	贵广网络	339,747	3,662,472.66	0.09
459	600350	山东高速	732,400	3,515,520.00	0.08
460	000552	靖远煤电	1,276,676	3,459,791.96	0.08
461	600428	中远海特	928,183	3,434,277.10	0.08
462	600707	彩虹股份	681,000	3,411,810.00	0.08
463	002482	广田集团	696,255	3,383,799.30	0.08
464	002344	海宁皮城	722,882	3,368,630.12	0.08

465	603328	依顿电子	324,002	3,327,500.54	0.08
466	002818	富森美	258,914	3,321,866.62	0.08
467	600053	九鼎投资	142,054	3,309,858.20	0.08
468	601003	柳钢股份	564,000	3,265,560.00	0.08
469	600335	国机汽车	468,528	3,242,213.76	0.08
470	601139	深圳燃气	544,500	3,098,205.00	0.07
471	601777	力帆股份	722,130	3,097,937.70	0.07
472	601869	长飞光纤	82,200	3,082,500.00	0.07
473	000587	金洲慈航	1,192,608	3,076,928.64	0.07
474	300146	汤臣倍健	149,717	2,904,509.80	0.07
475	600939	重庆建工	589,911	2,884,664.79	0.07
476	603556	海兴电力	208,708	2,884,344.56	0.07
477	600903	贵州燃气	218,560	2,847,836.80	0.07
478	000656	金科股份	469,827	2,833,056.81	0.07
479	000987	越秀金控	307,100	2,770,042.00	0.07
480	600600	青岛啤酒	55,234	2,757,833.62	0.06
481	000025	特力 A	135,110	2,731,924.20	0.06
482	002416	爱施德	420,662	2,629,137.50	0.06
483	600126	杭钢股份	547,209	2,495,273.04	0.06
484	601969	海南矿业	423,616	2,490,862.08	0.06
485	002699	美盛文化	410,520	2,463,120.00	0.06
486	601990	南京证券	248,000	2,457,680.00	0.06
487	000596	古井贡酒	20,542	2,434,432.42	0.06
488	603868	飞科电器	61,275	2,398,916.25	0.06
489	601138	工业富联	198,315	2,389,695.75	0.06
490	300413	芒果超媒	58,000	2,380,900.00	0.06
491	600256	广汇能源	643,473	2,290,763.88	0.05
492	603225	新凤鸣	182,332	2,277,326.68	0.05
493	600179	ST 安通	761,534	2,231,294.62	0.05
494	600280	中央商场	616,994	2,215,008.46	0.05
495	601811	新华文轩	170,213	2,078,300.73	0.05
496	600985	淮北矿业	181,100	2,053,674.00	0.05
497	603355	莱克电气	93,061	2,002,672.72	0.05
498	603899	晨光文具	44,684	1,964,755.48	0.05
499	002013	中航机电	279,530	1,923,166.40	0.05
500	000761	本钢板材	436,450	1,876,735.00	0.04
501	603486	科沃斯	60,240	1,822,260.00	0.04
502	000661	长春高新	4,933	1,667,354.00	0.04
503	600655	豫园股份	186,764	1,529,597.16	0.04
504	600917	重庆燃气	201,800	1,404,528.00	0.03
505	603025	大豪科技	124,816	1,278,115.84	0.03
506	000667	美好置业	451,165	1,186,563.95	0.03
507	000612	焦作万方	212,517	1,134,840.78	0.03
508	002563	森马服饰	102,200	1,130,332.00	0.03

509	603569	长久物流	91,377	1,059,059.43	0.02
510	603877	太平鸟	67,714	1,050,921.28	0.02
511	603589	口子窖	15,742	1,014,099.64	0.02
512	600366	宁波韵升	106,808	980,497.44	0.02
513	600503	华丽家族	251,393	955,293.40	0.02
514	600004	白云机场	51,710	941,122.00	0.02
515	603658	安图生物	13,676	934,891.36	0.02
516	002400	省广集团	304,685	907,961.30	0.02
517	000969	安泰科技	107,362	906,135.28	0.02
518	603650	彤程新材	36,700	801,528.00	0.02
519	002041	登海种业	68,463	748,985.22	0.02
520	600086	东方金钰	155,955	686,202.00	0.02
521	002276	万马股份	122,321	666,649.45	0.02
522	002663	普邦股份	212,692	644,456.76	0.02
523	603169	兰石重装	88,286	640,956.36	0.02
524	600760	中航沈飞	22,020	639,240.60	0.02
525	601233	桐昆股份	39,616	614,444.16	0.01
526	002277	友阿股份	174,064	588,336.32	0.01
527	002179	中航光电	17,185	575,010.10	0.01
528	000049	德赛电池	21,770	566,673.10	0.01
529	600773	西藏城投	80,192	539,692.16	0.01
530	600635	大众公用	83,058	533,232.36	0.01
531	600594	益佰制药	100,414	527,173.50	0.01
532	002308	威创股份	97,393	485,017.14	0.01
533	600422	昆药集团	41,713	480,950.89	0.01
534	600122	宏图高科	149,811	480,893.31	0.01
535	600517	置信电气	65,519	479,599.08	0.01
536	000977	浪潮信息	19,271	459,806.06	0.01
537	002588	史丹利	102,585	457,529.10	0.01
538	000703	恒逸石化	33,180	453,238.80	0.01
539	300291	华录百纳	71,176	441,291.20	0.01
540	600743	华远地产	149,631	375,573.81	0.01
541	300202	聚龙股份	47,746	371,941.34	0.01
542	600184	光电股份	32,263	370,056.61	0.01
543	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
544	002345	潮宏基	79,682	362,553.10	0.01
545	002354	天神娱乐	100,116	349,404.84	0.01
546	300156	神雾环保	106,876	328,109.32	0.01
547	601020	华钰矿业	25,700	301,204.00	0.01
548	002841	视源股份	3,616	280,276.16	0.01
549	600618	氯碱化工	35,461	278,723.46	0.01
550	002600	领益智造	44,700	265,071.00	0.01
551	600936	广西广电	50,600	245,410.00	0.01
552	600108	亚盛集团	67,142	233,654.16	0.01

553	600578	京能电力	57,529	186,393.96	0.00
554	000825	太钢不锈	41,900	170,533.00	0.00
555	002180	纳思达	7,519	169,929.40	0.00
556	600300	维维股份	50,707	169,868.45	0.00
557	600395	盘江股份	28,700	169,617.00	0.00
558	600187	国中水务	57,109	168,471.55	0.00
559	002948	青岛银行	20,912	134,464.16	0.00
560	603188	亚邦股份	17,095	134,195.75	0.00
561	000566	海南海药	20,866	133,751.06	0.00
562	600481	双良节能	35,708	132,119.60	0.00
563	000553	安道麦 A	12,300	131,856.00	0.00
564	002958	青农商行	17,700	129,918.00	0.00
565	000592	平潭发展	36,944	129,304.00	0.00
566	600880	博瑞传播	33,100	125,449.00	0.00
567	600438	通威股份	8,800	123,728.00	0.00
568	601860	紫金银行	15,970	120,413.80	0.00
569	001696	宗申动力	19,123	119,136.29	0.00
570	002073	软控股份	19,307	112,752.88	0.00
571	600651	飞乐音响	30,276	112,021.20	0.00
572	600516	方大炭素	9,095	111,777.55	0.00
573	600176	中国巨石	11,566	110,223.98	0.00
574	300770	新媒股份	1,271	109,941.50	0.00
575	600292	远达环保	16,786	108,605.42	0.00
576	600776	东方通信	4,678	107,500.44	0.00
577	002657	中科金财	6,144	106,905.60	0.00
578	002022	科华生物	10,436	104,464.36	0.00
579	600059	古越龙山	11,081	98,177.66	0.00
580	002261	拓维信息	15,987	97,680.57	0.00
581	601068	中铝国际	13,770	95,013.00	0.00
582	300759	康龙化成	2,728	93,243.04	0.00
583	002428	云南锗业	11,960	91,254.80	0.00
584	600284	浦东建设	11,562	89,027.40	0.00
585	002106	莱宝高科	12,519	88,133.76	0.00
586	600894	广日股份	10,974	85,926.42	0.00
587	002032	苏泊尔	1,108	84,019.64	0.00
588	000762	西藏矿业	10,606	82,726.80	0.00
589	002422	科伦药业	2,723	80,954.79	0.00
590	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
591	600346	恒力石化	6,580	80,012.80	0.00
592	603379	三美股份	2,052	76,621.68	0.00
593	002479	富春环保	11,158	73,754.38	0.00
594	300762	上海瀚讯	1,233	71,514.00	0.00
595	603068	博通集成	1,231	71,373.38	0.00
596	300273	和佳股份	13,564	70,397.16	0.00

597	300761	立华股份	1,291	69,184.69	0.00
598	300043	星辉娱乐	14,309	68,969.38	0.00
599	300755	华致酒行	1,901	66,934.21	0.00
600	002271	东方雨虹	2,910	65,940.60	0.00
601	300039	上海凯宝	14,812	65,913.40	0.00
602	002955	鸿合科技	1,108	65,194.72	0.00
603	300773	拉卡拉	1,250	64,725.00	0.00
604	603697	有友食品	3,383	64,006.36	0.00
605	002311	海大集团	2,071	63,993.90	0.00
606	300775	三角防务	2,164	63,621.60	0.00
607	300771	智莱科技	1,126	62,887.10	0.00
608	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.00
609	002342	巨力索具	16,419	58,615.83	0.00
610	002946	新乳业	3,823	57,880.22	0.00
611	000662	天夏智慧	12,292	57,157.80	0.00
612	002001	新和成	2,929	56,500.41	0.00
613	600628	新世界	7,702	55,916.52	0.00
614	300765	新诺威	1,412	51,778.04	0.00
615	000786	北新建材	2,767	50,165.71	0.00
616	603967	中创物流	2,518	50,057.84	0.00
617	000669	金鸿控股	10,719	49,628.97	0.00
618	600566	济川药业	1,615	48,627.65	0.00
619	603317	天味食品	1,156	48,494.20	0.00
620	300766	每日互动	1,193	48,304.57	0.00
621	002947	恒铭达	1,064	43,336.72	0.00
622	300768	迪普科技	1,128	42,446.64	0.00
623	603681	永冠新材	1,767	40,641.00	0.00
624	002951	金时科技	1,675	40,250.25	0.00
625	002011	盾安环境	8,923	40,064.27	0.00
626	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
627	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
628	300032	金龙机电	11,400	38,760.00	0.00
629	300116	坚瑞沃能	22,500	38,475.00	0.00
630	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
631	000050	深天马 A	2,720	36,556.80	0.00
632	002050	三花智控	3,335	35,184.25	0.00
633	603001	奥康国际	3,430	34,780.20	0.00
634	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
635	603629	利通电子	1,051	33,621.49	0.00
636	600587	新华医疗	2,042	32,569.90	0.00
637	603956	威派格	1,835	32,222.60	0.00
638	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
639	002952	亚世光电	771	27,694.32	0.00
640	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.00

641	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
642	002953	日丰股份	1,072	26,499.84	0.00
643	002123	梦网集团	1,800	25,452.00	0.00
644	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
645	002063	远光软件	2,236	19,475.56	0.00
646	601002	晋亿实业	2,709	19,125.54	0.00
647	000777	中核科技	1,248	17,160.00	0.00
648	600826	兰生股份	1,303	14,567.54	0.00
649	000652	泰达股份	3,274	12,834.08	0.00
650	000680	山推股份	3,075	12,730.50	0.00
651	603528	多伦科技	1,600	12,000.00	0.00
652	000099	中信海直	1,547	11,014.64	0.00
653	002269	美邦服饰	3,896	10,246.48	0.00
654	002168	惠程科技	1,146	10,142.10	0.00
655	300147	香雪制药	1,476	9,697.32	0.00
656	002392	北京利尔	2,244	7,854.00	0.00
657	002325	洪涛股份	2,305	7,191.60	0.00
658	002551	尚荣医疗	1,231	6,253.48	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	002405	四维图新	24,629,136.11	0.75
2	002157	正邦科技	20,669,674.08	0.63
3	002075	沙钢股份	14,065,866.20	0.43
4	000333	美的集团	13,756,497.78	0.42
5	600763	通策医疗	13,528,589.05	0.41
6	002926	华西证券	13,298,130.20	0.40
7	002797	第一创业	12,696,015.75	0.38
8	002821	凯莱英	12,052,567.09	0.37
9	300347	泰格医药	11,401,641.99	0.35
10	600497	驰宏锌锗	11,362,154.00	0.34
11	000860	顺鑫农业	11,255,105.80	0.34
12	002572	索菲亚	11,251,669.52	0.34
13	600549	厦门钨业	11,245,033.83	0.34
14	600745	闻泰科技	11,216,071.00	0.34
15	002387	维信诺	10,515,875.73	0.32
16	002217	合力泰	10,356,728.85	0.31

17	002507	涪陵榨菜	10,355,615.55	0.31
18	002195	二三四五	10,264,846.14	0.31
19	300450	先导智能	10,081,279.57	0.31
20	300009	安科生物	9,912,086.77	0.30

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（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，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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	300347	泰格医药	28,648,656.10	0.87
2	002410	广联达	25,497,598.22	0.77
3	000656	金科股份	23,023,351.81	0.70
4	300146	汤臣倍健	22,009,711.70	0.67
5	000418	小天鹅 A	18,529,365.35	0.56
6	000596	古井贡酒	16,380,701.65	0.50
7	300413	芒果超媒	14,125,169.18	0.43
8	002013	中航机电	13,448,513.50	0.41
9	600600	青岛啤酒	13,127,593.57	0.40
10	600256	广汇能源	11,507,622.00	0.35
11	000860	顺鑫农业	10,008,392.64	0.30
12	600270	外运发展	9,833,919.95	0.30
13	000667	美好置业	9,345,750.00	0.28
14	603899	晨光文具	9,114,869.00	0.28
15	002129	中环股份	9,022,101.98	0.27
16	002268	卫士通	8,851,977.53	0.27
17	000750	国海证券	8,480,484.56	0.26
18	300383	光环新网	8,353,272.33	0.25
19	002465	海格通信	8,170,637.24	0.25
20	000066	中国长城	8,038,248.64	0.24

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,729,882,508.93
卖出股票收入（成交）总额	1,340,651,776.60

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）	2,280,155.80	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,280,155.80	0.05

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	113020	桐昆转债	19,190	2,280,155.80	0.05

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					-4,131,635.73
股指期货投资本期公允价值变动					326,800.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 基金，主要投资标的指数成份股及备选成份股，同时可以部分投资股指期货。

本基金投资股指期货，可以更好地进行流动性管理。本基金尽量选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本和跟踪误差，力争实现更好地跟踪标的指数的效果。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	492,855.48
2	应收证券清算款	97,954,026.85

3	应收股利	-
4	应收利息	16,908.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,463,790.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113020	桐昆转债	2,280,155.80	0.05

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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		广发中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金(LOF)	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
8,004	375,691.9 4	2,856,7 33,222. 00	95.00%	150,305 ,097.00	5.00%	2,671,237, 821.00	88.83%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中国人民人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	109,865,400.00	3.65%
2	中国人民财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品-008C-CT001 沪	41,252,100.00	1.37%
3	国信证券股份有限公司	9,049,000.00	0.30%
4	信泰人寿保险股份有限公司-传统产品	6,907,400.00	0.23%
5	方正证券股份有限公司	5,998,800.00	0.20%
6	刘俊	3,932,100.00	0.13%
7	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托 R2008ZX005	3,224,900.00	0.11%
8	珠海横琴知本金融投资管理有限公司-知本天泓一号私募证券投资基金	3,001,300.00	0.10%
9	孙建刚	2,180,000.00	0.07%
10	华泰证券股份有限公司	1,930,400.00	0.06%
11	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	2,671,237,821.00	88.83%

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	0.00	0.0000%

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（2013 年 4 月 11 日）基金份额总额	425,038,319.00
本报告期期初基金份额总额	2,793,038,319.00
本报告期基金总申购份额	1,380,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,166,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,007,038,319.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	
方正证券	5	1,036,180,896.04	34.30%	757,757.76	62.27%	减少 2 个
万联证券	4	1,985,193,463.71	65.70%	459,185.22	37.73%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	新增 1 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-

证券						
安信证券	5	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
海通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

(4) 具有较强的研究和行业分析能力,能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;

(5) 能积极为公司投资业务的开展,提供良好的信息交流和客户服务;

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程:

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
2	关于增加兴业证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-03
3	关于增加国盛证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-25
4	关于增加万联证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-26

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
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1	20190101-20190630	2,064,958,177.00	1,779,445,744.00	1,173,166,100.00	2,671,237,821.00	88.83%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净							

值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发中证 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

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：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.网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇一九年八月二十八日