

**广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2019 年年度报告摘要**  
**2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年三月二十七日

## §1 重要提示

### 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 2020 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	3,369,038,319.00 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	2013-05-24

注：本基金扩位证券简称：中证 500ETF 基金

### 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

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	25,430,493.00	-157,834,436.65	19,491,767.42
本期利润	960,669,399.73	-902,370,831.95	30,098,534.49
加权平均基金份额本期利润	0.3236	-0.5196	0.0335
本期基金份额净值增长率	27.51%	-32.03%	0.78%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5073	0.1821	0.7391
期末基金资产净值	5,078,209,628.10	3,301,665,891.74	1,434,835,524.90
期末基金份额净值	1.5073	1.1821	1.7391

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

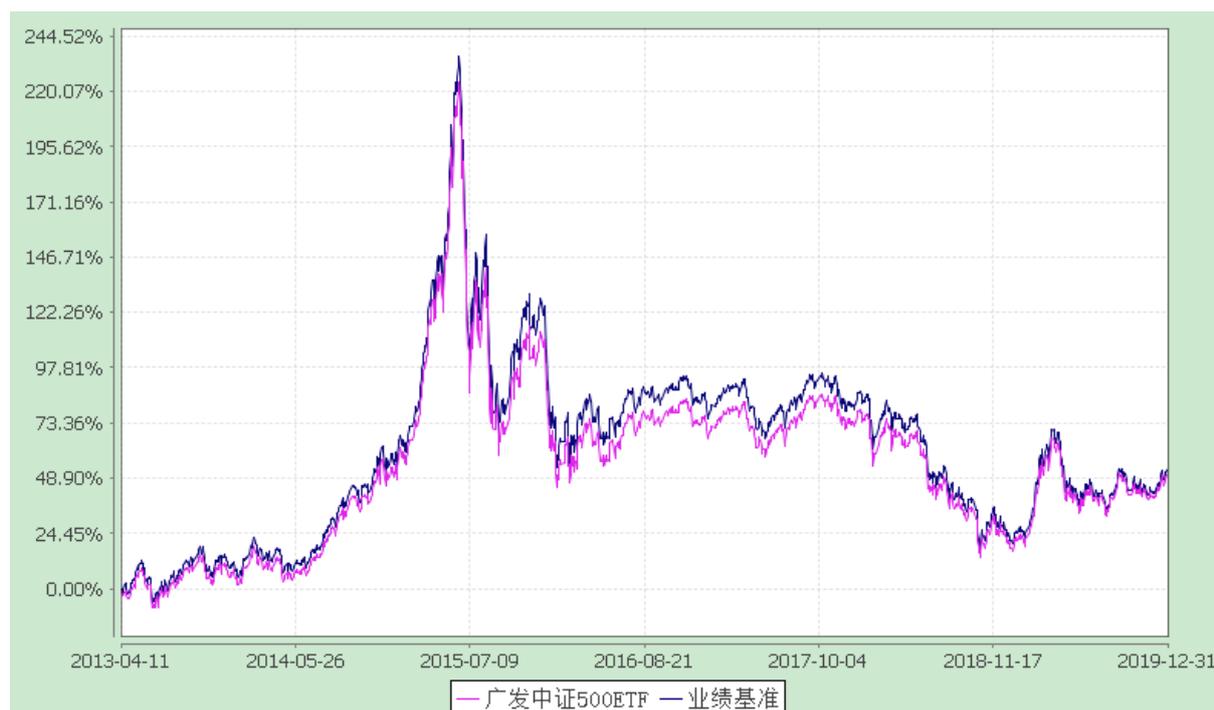
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	6.28%	0.90%	6.61%	0.92%	-0.33%	-0.02%
过去六个月	6.61%	1.05%	6.41%	1.08%	0.20%	-0.03%
过去一年	27.51%	1.44%	26.38%	1.47%	1.13%	-0.03%
过去三年	-12.66%	1.31%	-15.90%	1.33%	3.24%	-0.02%
过去五年	0.92%	1.80%	-1.03%	1.83%	1.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	50.73%	1.69%	53.25%	1.72%	-2.52%	-0.03%

注: 业绩比较基准: 中证 500 指数。

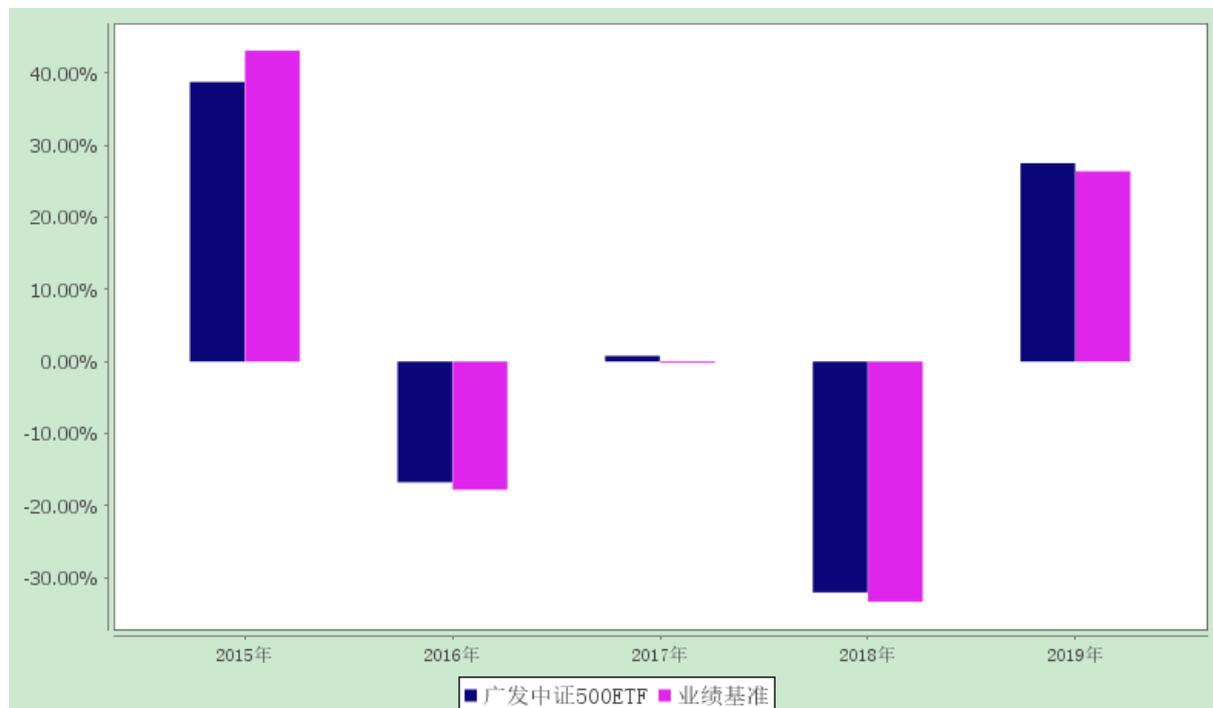
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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的历史走势对比图  
 (2013 年 4 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、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 12 月 31 日，公司管理 207 只开放式基金，管理公募基金规模为 5025.61 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）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2014-04-01	-	15 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。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)、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基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老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 2019 年 11 月 14 日)、广发中小板

	<p>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；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中</p>				<p>300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、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基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)。</p>
--	---	--	--	--	--

	证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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 公平交易制度和控制方法

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。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；对于不同投资组合的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的

第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 5 次，其中 4 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，1 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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。

2019 年 A 股市场整体大幅上涨，其中国证 A 指上涨 34.17%，沪深 300 上涨 36.07%，中证 500 上涨 26.38%，创业板指上涨 43.79%，上证综指上涨 22.30%；行业方面，电子、食品饮料、家电、

建筑材料、证券涨幅靠前。在经历了 2018 年整体市场低迷以及在市场逐渐对中美贸易战脱敏的趋势下，春季行情随着社融等指标超预期逐渐展开。而下半年信息技术等板块逐渐活跃，期间国庆和区块链均阶段性利好市场情绪。在 4 季度工业企业利润大幅反弹和中美贸易缓和等因素的作用下，12 月份市场延续上涨；11 月工业企业利润增速从 10 月的低点-9.9%反弹至 5.4%，巩固了工业去库存和制造业投资增速的底部过程；12 月份中美第一阶段协议的达成是中美关系缓和的重要一步，是方向性的变化；外部环境的转暖叠加中央经济工作会议“以稳为主”的定调，一定程度上为 A 股排除了“下行风险”，铸就了 12 月份 A 股的整体表现。

#### 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 27.51%，同期业绩比较基准收益率为 26.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，整体市场机遇大于风险。伴随着中美贸易摩擦的缓和、美伊局势的改善以及国内金融条件的放松、社融增速的触底反弹等，未来权益市场风险偏好可能进一步提升，尤其是经济转型相关的新经济领域。未来随着总需求的回升，盈利周期也将逐步回升，流动性边际可能更加宽松。整体上，未来权益市场值得关注。中证 500 指数属于高波动、高收益指数，中长期收益率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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 赵雅 马婧签字出具了安永华明（2020）审字第 60873695\_G189 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### §7 年度财务报表

#### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	53,955,800.55	15,696,271.37
结算备付金	3,565,822.00	10,515,268.85
存出保证金	9,300,821.89	1,738,378.65
交易性金融资产	5,000,389,413.67	3,276,737,947.46
其中：股票投资	4,999,343,213.67	3,274,819,523.16
基金投资	-	-
债券投资	1,046,200.00	1,918,424.30
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	43,194,570.00	-
应收利息	18,787.06	8,185.82
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>5,110,425,215.17</b>	<b>3,304,696,052.15</b>
负债和所有者权益	本期末 2019 年 12 月 31 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	-	-

卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	16,215,814.73	10,554.77
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,050,547.94	1,433,405.74
应付托管费	410,109.58	286,681.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,248,903.87	679,747.75
应交税费	238.36	12.84
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	12,289,972.59	619,758.16
<b>负债合计</b>	<b>32,215,587.07</b>	<b>3,030,160.41</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	3,369,038,319.00	2,793,038,319.00
未分配利润	1,709,171,309.10	508,627,572.74
<b>所有者权益合计</b>	<b>5,078,209,628.10</b>	<b>3,301,665,891.74</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>5,110,425,215.17</b>	<b>3,304,696,052.15</b>

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.5073 元，基金份额总额 3,369,038,319.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>993,140,955.76</b>	<b>-882,094,009.67</b>
1.利息收入	883,923.30	698,377.83

其中：存款利息收入	864,839.54	697,844.94
债券利息收入	5,874.39	532.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
证券出借利息收入	13,209.37	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	53,916,021.17	-150,088,583.76
其中：股票投资收益	933,542.27	-168,381,474.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	423,641.52	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	15,404.27	-6,383,020.58
股利收益	52,543,433.11	24,665,996.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	935,238,906.73	-744,536,395.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,102,104.56	11,832,591.56
<b>减：二、费用</b>	<b>32,471,556.03</b>	<b>20,276,822.28</b>
1. 管理人报酬	21,084,182.70	12,266,787.70
2. 托管费	4,216,836.46	2,453,357.50
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,650,090.60	4,382,242.40
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	322.67	3,345.20
7. 其他费用	1,520,123.60	1,171,089.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>960,669,399.73</b>	<b>-902,370,831.95</b>
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	960,669,399.73	-902,370,831.95
-------------------	----------------	-----------------

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	-	960,669,399.73	960,669,399.73
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）	576,000,000.00	239,874,336.63	815,874,336.63
其中：1.基金申购款	2,390,000,000.00	1,086,535,541.95	3,476,535,541.95
2.基金赎回款	-1,814,000,000.00	-846,661,205.32	-2,660,661,205.32
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）	3,369,038,319.00	1,709,171,309.10	5,078,209,628.10
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	825,038,319.00	609,797,205.90	1,434,835,524.90

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-902,370,831.95	-902,370,831.95
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)	1,968,000,000.00	801,201,198.79	2,769,201,198.79
其中：1.基金申购款	2,540,000,000.00	1,117,397,060.57	3,657,397,060.57
2.基金赎回款	-572,000,000.00	-316,195,861.78	-888,195,861.78
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)	2,793,038,319.00	508,627,572.74	3,301,665,891.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 425,038,319.00 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 2020 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人控股子公司的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理（英国）有限公司)	基金管理人全资子公司的全资子公司
广发纳正（上海）资产管理有限公司	基金管理人全资子公司的全资子公司
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
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

注：根据广发基金管理有限公司于 2019 年 11 月 14 日发布的公告，经股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1948 号文核准，广发基金管理有限公司原股东康美药业股份有限公司将其持有的公司 9.458% 股权转让给广发证券股份有限公司，康美药业股份有限公司不再持

有广发基金管理有限公司的股权。广发纳正（上海）资产管理有限公司于 2019 年 11 月 28 日经上海市市场监督管理局批准注销登记。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	519,089,158.75	9.36%	634,997,823.67	16.74%

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	93,200.00	2.75%	-	-

##### 7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	483,420.92	18.01%	416,243.35	33.33%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	591,433.84	19.22%	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12 月31日	2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,084,182.70	12,266,787.70
其中：支付销售机构的客户维护费	191,229.20	25,568.21

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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,216,836.46	2,453,357.50

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。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.8.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.5.2 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 2019 年 12 月 31 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(LOF)	2,708,307,821.00	80.39%	2,064,958,177.00	73.93%
广发证券股份有限公司	11,709,733.00	0.35%	-	-

#### 7.4.8.6 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018年12月31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	53,955,800.55	716,304.10	15,696,271.37	605,317.70

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。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

#### 7.4.9 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
601916	浙商银行	2019-1-18	2020-05-26	新股流通受限	4.94	4.66	294,195.00	1,453,323.30	1,370,948.70	-
601077	渝农商行	2019-1-0-16	2020-04-29	新股流通受限	7.36	6.26	147,778.00	1,087,646.08	925,090.28	-
688099	晶晨股份	2019-07-31	2020-02-10	新股流通受限	38.50	52.29	15,597.00	600,484.50	815,567.13	-
688199	久日新材	2019-1-0-28	2020-05-06	新股流通受限	66.68	59.66	4,494.00	299,659.92	268,112.04	-
688168	安博通	2019-08-30	2020-03-06	新股流通受限	56.88	97.93	2,252.00	128,093.76	220,538.36	-
688166	博瑞医药	2019-1-0-29	2020-05-08	新股流通受限	12.71	25.64	8,041.00	102,201.11	206,171.24	-
688181	八亿时空	2019-1-2-27	2020-01-06	新股流通受限	43.98	43.98	4,306.00	189,377.88	189,377.88	-
688369	致远互联	2019-1-0-23	2020-05-06	新股流通受限	49.39	52.08	2,970.00	146,688.30	154,677.60	-
688198	佰仁医疗	2019-1-1-29	2020-06-09	新股流通受限	23.68	37.58	3,213.00	76,083.84	120,744.54	-
688098	申联生物	2019-1-0-18	2020-04-28	新股流通受限	8.80	12.14	9,792.00	86,169.60	118,874.88	-
688108	赛诺医疗	2019-1-0-22	2020-04-30	新股流通受限	6.99	12.40	9,304.00	65,034.96	115,369.60	-
688081	兴图新科	2019-1-2-26	2020-01-06	新股流通受限	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-1-2-27	2020-01-06	新股流通受限	5.74	5.74	1,146.00	6,578.04	6,578.04	-

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110064	建工转债	2019-12-23	2020-01-16	新债流通受限	100.00	100.00	5,690.00	569,000.00	569,000.00	-
110065	淮矿转债	2019-12-24	2020-01-13	新债流通受限	100.00	100.00	3,840.00	384,000.00	384,000.00	-
128088	深南转债	2019-12-24	2020-01-16	新债流通受限	100.00	100.00	932.00	93,200.00	93,200.00	-

注：截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

#### 7.4.9.2 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 12 月 31 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

#### 7.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
2019122700000242	002439	启明星辰	2019-12-27	2020-02-03	33.80	10,000.00	338,000.00

201912 270000 0547	600801	华新水泥	2019-12-27	2020-02- 03	26.43	10,000.00	264,300.00
201912 270000 0206	002268	卫士通	2019-12-27	2020-02- 03	25.79	10,000.00	257,900.00
201912 270000 0214	002384	东山精密	2019-12-27	2020-02- 03	23.15	10,000.00	231,500.00
201912 270000 0320	300285	国瓷材料	2019-12-27	2020-02- 03	22.85	10,000.00	228,500.00
201912 270000 0356	600584	长电科技	2019-12-27	2020-02- 03	21.98	10,000.00	219,800.00
201912 270000 0619	600150	中国船舶	2019-12-27	2020-02- 03	21.76	10,000.00	217,600.00
201912 270000 0263	002572	索菲亚	2019-12-27	2020-02- 03	20.95	10,000.00	209,500.00
201912 270000 0505	603858	步长制药	2019-12-27	2020-02- 03	20.62	10,000.00	206,200.00
201912 160000 0711	600307	酒钢宏兴	2019-12-16	2020-01- 13	2.06	100,000.00	206,000.00
201912 270000 0439	600446	金证股份	2019-12-27	2020-02- 03	20.58	10,000.00	205,800.00
201912 270000 0199	002223	鱼跃医疗	2019-12-27	2020-02- 03	20.32	10,000.00	203,200.00
201912 270000 0154	000988	华工科技	2019-12-27	2020-02- 03	20.29	10,000.00	202,900.00
201912 270000 0329	300383	光环新网	2019-12-27	2020-02- 03	20.07	10,000.00	200,700.00
201912 270000 0409	600426	华鲁恒升	2019-12-27	2020-02- 03	19.87	10,000.00	198,700.00
201912 270000	603000	人民网	2019-12-27	2020-02- 03	19.79	10,000.00	197,900.00

0554							
201912 270000 0059	000066	中国长城	2019-12-27	2020-02-03	15.56	12,600.00	196,056.00
201912 270000 0317	300207	欣旺达	2019-12-27	2020-02-03	19.52	10,000.00	195,200.00
201912 270000 0480	601231	环旭电子	2019-12-27	2020-02-03	19.23	10,000.00	192,300.00
201912 270000 0089	000581	威孚高科	2019-12-27	2020-02-03	19.05	10,000.00	190,500.00
201912 270000 0195	002212	南洋股份	2019-12-27	2020-02-03	19.01	10,000.00	190,100.00
201912 270000 0635	600201	生物股份	2019-12-27	2020-02-03	18.72	10,000.00	187,200.00
201912 270000 0504	601099	太平洋	2019-12-27	2020-02-03	3.79	48,700.00	184,573.00
201912 270000 0219	002373	千方科技	2019-12-27	2020-02-03	18.04	10,000.00	180,400.00
201912 270000 0403	600699	均胜电子	2019-12-27	2020-02-03	17.90	10,000.00	179,000.00
201912 270000 0339	601128	常熟银行	2019-12-27	2020-02-03	9.11	19,400.00	176,734.00
201912 270000 0577	600521	华海药业	2019-12-27	2020-02-03	17.26	10,000.00	172,600.00
201912 270000 0282	300001	特锐德	2019-12-27	2020-02-03	17.18	10,000.00	171,800.00
201912 270000 0204	002250	联化科技	2019-12-27	2020-02-03	17.13	10,000.00	171,300.00
201912 270000 0074	000401	冀东水泥	2019-12-27	2020-02-03	17.01	10,000.00	170,100.00
201912	300418	昆仑万维	2019-12-27	2020-02-	16.75	10,000.00	167,500.00

270000 0328				03			
201912 270000 0091	000623	吉林敖东	2019-12-27	2020-02-03	16.53	10,000.00	165,300.00
201912 270000 0055	000050	深天马 A	2019-12-27	2020-02-03	16.29	10,000.00	162,900.00
201912 270000 0152	002019	亿帆医药	2019-12-27	2020-02-03	16.25	10,000.00	162,500.00
201912 270000 0216	002273	水晶光电	2019-12-27	2020-02-03	16.16	10,000.00	161,600.00
201912 270000 0227	002387	维信诺	2019-12-27	2020-02-03	15.90	10,000.00	159,000.00
201912 270000 0148	000997	新大陆	2019-12-27	2020-02-03	15.88	10,000.00	158,800.00
201912 270000 0400	600171	上海贝岭	2019-12-27	2020-02-03	15.75	10,000.00	157,500.00
201912 270000 0323	300316	晶盛机电	2019-12-27	2020-02-03	15.72	10,000.00	157,200.00
201912 270000 0521	600460	士兰微	2019-12-27	2020-02-03	15.47	10,000.00	154,700.00
201912 270000 0305	300168	万达信息	2019-12-27	2020-02-03	15.43	10,000.00	154,300.00
201912 270000 0488	600895	张江高科	2019-12-27	2020-02-03	15.31	10,000.00	153,100.00
201912 270000 0394	600739	辽宁成大	2019-12-27	2020-02-03	15.23	10,000.00	152,300.00
201912 270000 0286	300009	安科生物	2019-12-27	2020-02-03	15.09	10,000.00	150,900.00
201912 270000 0364	603885	吉祥航空	2019-12-27	2020-02-03	15.00	10,000.00	150,000.00

201912 270000 0526	601233	桐昆股份	2019-12-27	2020-02- 03	14.99	10,000.00	149,900.00
201912 270000 0309	300253	卫宁健康	2019-12-27	2020-02- 03	14.98	10,000.00	149,800.00
201912 270000 0289	300012	华测检测	2019-12-27	2020-02- 03	14.91	10,000.00	149,100.00
201912 270000 0096	000636	风华高科	2019-12-27	2020-02- 03	14.89	10,000.00	148,900.00
201912 270000 0162	000998	隆平高科	2019-12-27	2020-02- 03	14.71	10,000.00	147,100.00
201912 270000 0165	002074	国轩高科	2019-12-27	2020-02- 03	14.55	10,000.00	145,500.00
201912 270000 0250	002465	海格通信	2019-12-27	2020-02- 03	10.83	13,300.00	144,039.00
201912 270000 0380	601872	招商轮船	2019-12-27	2020-02- 03	8.26	17,200.00	142,072.00
201912 270000 0464	600155	华创阳安	2019-12-27	2020-02- 03	14.03	10,000.00	140,300.00
201912 270000 0178	002127	南极电商	2019-12-27	2020-02- 03	10.91	12,700.00	138,557.00
201912 270000 0182	002129	中环股份	2019-12-27	2020-02- 03	11.81	11,700.00	138,177.00
201912 270000 0153	002028	思源电气	2019-12-27	2020-02- 03	13.77	10,000.00	137,700.00
201912 270000 0130	000878	云南铜业	2019-12-27	2020-02- 03	13.66	10,000.00	136,600.00
201912 270000 0387	600373	中文传媒	2019-12-27	2020-02- 03	13.61	10,000.00	136,100.00
201912 270000	000975	银泰黄金	2019-12-27	2020-02- 03	13.61	10,000.00	136,100.00

0145							
201912 270000 0363	600260	凯乐科技	2019-12-27	2020-02-03	13.57	10,000.00	135,700.00
201912 270000 0160	002065	东华软件	2019-12-27	2020-02-03	10.32	13,100.00	135,192.00
201912 270000 0419	600079	人福医药	2019-12-27	2020-02-03	13.51	10,000.00	135,100.00
201912 270000 0548	600884	杉杉股份	2019-12-27	2020-02-03	13.51	10,000.00	135,100.00
201912 270000 0218	002340	格林美	2019-12-27	2020-02-03	4.87	27,500.00	133,925.00
201912 270000 0299	300088	长信科技	2019-12-27	2020-02-03	10.27	13,000.00	133,510.00
201912 270000 0540	600216	浙江医药	2019-12-27	2020-02-03	13.35	10,000.00	133,500.00
201912 270000 0222	002372	伟星新材	2019-12-27	2020-02-03	13.17	10,000.00	131,700.00
201912 270000 0342	600167	联美控股	2019-12-27	2020-02-03	13.16	10,000.00	131,600.00
201912 270000 0164	002038	双鹭药业	2019-12-27	2020-02-03	13.15	10,000.00	131,500.00
201912 270000 0231	002407	多氟多	2019-12-27	2020-02-03	13.11	10,000.00	131,100.00
201912 270000 0107	000738	航发控制	2019-12-27	2020-02-03	13.07	10,000.00	130,700.00
201912 270000 0569	600549	厦门钨业	2019-12-27	2020-02-03	13.04	10,000.00	130,400.00
201912 270000 0300	300166	东方国信	2019-12-27	2020-02-03	13.00	10,000.00	130,000.00
201912	300010	立思辰	2019-12-27	2020-02-	12.91	10,000.00	129,100.00

270000 0288				03			
201912 270000 0276	002670	国盛金控	2019-12-27	2020-02-03	12.71	10,000.00	127,100.00
201912 270000 0221	002317	众生药业	2019-12-27	2020-02-03	12.70	10,000.00	127,000.00
201912 270000 0433	600597	光明乳业	2019-12-27	2020-02-03	12.69	10,000.00	126,900.00
201912 270000 0471	600138	中青旅	2019-12-27	2020-02-03	12.60	10,000.00	126,000.00
201912 270000 0201	002233	塔牌集团	2019-12-27	2020-02-03	12.60	10,000.00	126,000.00
201912 270000 0285	002797	第一创业	2019-12-27	2020-02-03	8.28	15,000.00	124,200.00
201912 270000 0049	000021	深科技	2019-12-27	2020-02-03	12.18	10,000.00	121,800.00
201912 270000 0399	600580	卧龙电驱	2019-12-27	2020-02-03	12.02	10,000.00	120,200.00
201912 270000 0354	601098	中南传媒	2019-12-27	2020-02-03	11.94	10,000.00	119,400.00
201912 270000 0125	000877	天山股份	2019-12-27	2020-02-03	11.85	10,000.00	118,500.00
201912 270000 0308	300251	光线传媒	2019-12-27	2020-02-03	11.80	10,000.00	118,000.00
201912 270000 0315	300315	掌趣科技	2019-12-27	2020-02-03	6.17	19,000.00	117,230.00
201912 270000 0632	600528	中铁工业	2019-12-27	2020-02-03	11.50	10,000.00	115,000.00
201912 270000 0155	002030	达安基因	2019-12-27	2020-02-03	11.50	10,000.00	115,000.00

201912 270000 0197	002191	劲嘉股份	2019-12-27	2020-02- 03	11.41	10,000.00	114,100.00
201912 270000 0408	600718	东软集团	2019-12-27	2020-02- 03	11.35	10,000.00	113,500.00
201912 270000 0111	000750	国海证券	2019-12-27	2020-02- 03	5.34	21,200.00	113,208.00
201912 270000 0442	600273	嘉化能源	2019-12-27	2020-02- 03	11.25	10,000.00	112,500.00
201912 270000 0244	002440	闰土股份	2019-12-27	2020-02- 03	11.20	10,000.00	112,000.00
201912 270000 0037	000009	中国宝安	2019-12-27	2020-02- 03	6.19	18,000.00	111,420.00
201912 270000 0624	600673	东阳光	2019-12-27	2020-02- 03	10.24	10,800.00	110,592.00
201912 270000 0473	600862	中航高科	2019-12-27	2020-02- 03	11.02	10,000.00	110,200.00
201912 270000 0281	002926	华西证券	2019-12-27	2020-02- 03	11.01	10,000.00	110,100.00
201912 270000 0493	600060	海信视像	2019-12-27	2020-02- 03	10.85	10,000.00	108,500.00
201912 270000 0071	000400	许继电气	2019-12-27	2020-02- 03	10.77	10,000.00	107,700.00
201912 270000 0143	000970	中科三环	2019-12-27	2020-02- 03	10.75	10,000.00	107,500.00
201912 270000 0170	002078	太阳纸业	2019-12-27	2020-02- 03	9.84	10,900.00	107,256.00
201912 270000 0437	600967	内蒙一机	2019-12-27	2020-02- 03	10.63	10,000.00	106,300.00
201912 270000	002195	二三四五	2019-12-27	2020-02- 03	3.23	32,900.00	106,267.00

0192							
201912 270000 0312	300274	阳光电源	2019-12-27	2020-02-03	10.53	10,000.00	105,300.00
201912 270000 0123	000830	鲁西化工	2019-12-27	2020-02-03	10.51	10,000.00	105,100.00
201912 270000 0063	000156	华数传媒	2019-12-27	2020-02-03	10.44	10,000.00	104,400.00
201912 270000 0140	000960	锡业股份	2019-12-27	2020-02-03	10.44	10,000.00	104,400.00
201912 270000 0519	600642	申能股份	2019-12-27	2020-02-03	5.81	17,900.00	103,999.00
201912 270000 0420	600380	健康元	2019-12-27	2020-02-03	10.35	10,000.00	103,500.00
201912 270000 0397	600410	华胜天成	2019-12-27	2020-02-03	10.31	10,000.00	103,100.00
201912 270000 0194	002203	海亮股份	2019-12-27	2020-02-03	10.25	10,000.00	102,500.00
201912 270000 0522	600765	中航重机	2019-12-27	2020-02-03	10.23	10,000.00	102,300.00
201912 270000 0088	000547	航天发展	2019-12-27	2020-02-03	10.22	10,000.00	102,200.00
201912 270000 0251	002500	山西证券	2019-12-27	2020-02-03	8.29	12,200.00	101,138.00
201912 270000 0637	600507	方大特钢	2019-12-27	2020-02-03	10.06	10,000.00	100,600.00
201912 270000 0517	600158	中体产业	2019-12-27	2020-02-03	10.03	10,000.00	100,300.00
201912 270000 0313	300296	利亚德	2019-12-27	2020-02-03	7.67	12,900.00	98,943.00
201912	000039	中集集团	2019-12-27	2020-02-	9.82	10,000.00	98,200.00

270000 0053				03			
201912 270000 0060	000089	深圳机场	2019-12-27	2020-02-03	9.77	10,000.00	97,700.00
201912 270000 0497	600256	广汇能源	2019-12-27	2020-02-03	3.31	29,500.00	97,645.00
201912 270000 0595	600064	南京高科	2019-12-27	2020-02-03	9.75	10,000.00	97,500.00
201912 270000 0416	600388	龙净环保	2019-12-27	2020-02-03	9.75	10,000.00	97,500.00
201912 270000 0431	600598	北大荒	2019-12-27	2020-02-03	9.74	10,000.00	97,400.00
201912 270000 0150	000987	越秀金控	2019-12-27	2020-02-03	9.67	10,000.00	96,700.00
201912 270000 0500	600325	华发股份	2019-12-27	2020-02-03	7.83	12,300.00	96,309.00
201912 270000 0187	002152	广电运通	2019-12-27	2020-02-03	9.61	10,000.00	96,100.00
201912 270000 0525	600643	爱建集团	2019-12-27	2020-02-03	9.60	10,000.00	96,000.00
201912 270000 0636	600704	物产中大	2019-12-27	2020-02-03	5.25	18,200.00	95,550.00
201912 270000 0395	600909	华安证券	2019-12-27	2020-02-03	7.30	13,000.00	94,900.00
201912 270000 0388	600143	金发科技	2019-12-27	2020-02-03	7.28	13,000.00	94,640.00
201912 270000 0382	600728	佳都科技	2019-12-27	2020-02-03	9.38	10,000.00	93,800.00
201912 270000 0174	002110	三钢闽光	2019-12-27	2020-02-03	9.36	10,000.00	93,600.00

201912 270000 0533	600879	航天电子	2019-12-27	2020-02- 03	5.98	15,600.00	93,288.00
201912 270000 0103	000686	东北证券	2019-12-27	2020-02- 03	9.30	10,000.00	93,000.00
201912 270000 0518	600875	东方电气	2019-12-27	2020-02- 03	9.19	10,000.00	91,900.00
201912 270000 0122	000826	启迪环境	2019-12-27	2020-02- 03	9.18	10,000.00	91,800.00
201912 270000 0435	600633	浙数文化	2019-12-27	2020-02- 03	9.15	10,000.00	91,500.00
201912 270000 0185	002131	利欧股份	2019-12-27	2020-02- 03	2.97	30,700.00	91,179.00
201912 270000 0612	600392	盛和资源	2019-12-27	2020-02- 03	9.07	10,000.00	90,700.00
201912 270000 0226	002385	大北农	2019-12-27	2020-02- 03	4.98	18,200.00	90,636.00
201912 270000 0131	000887	中鼎股份	2019-12-27	2020-02- 03	9.05	10,000.00	90,500.00
201912 270000 0166	002013	中航机电	2019-12-27	2020-02- 03	6.94	13,000.00	90,220.00
201912 270000 0622	600037	歌华有线	2019-12-27	2020-02- 03	9.01	10,000.00	90,100.00
201912 270000 0455	600291	西水股份	2019-12-27	2020-02- 03	8.99	10,000.00	89,900.00
201912 270000 0578	600827	百联股份	2019-12-27	2020-02- 03	8.98	10,000.00	89,800.00
201912 270000 0310	300180	华峰超纤	2019-12-27	2020-02- 03	8.84	10,000.00	88,400.00
201912 270000	601168	西部矿业	2019-12-27	2020-02- 03	6.62	13,200.00	87,384.00

0361							
201912 270000 0507	600120	浙江东方	2019-12-27	2020-02-03	8.73	10,000.00	87,300.00
201912 270000 0181	002128	露天煤业	2019-12-27	2020-02-03	8.66	10,000.00	86,600.00
201912 270000 0475	600567	山鹰纸业	2019-12-27	2020-02-03	3.77	22,700.00	85,579.00
201912 270000 0396	600737	中粮糖业	2019-12-27	2020-02-03	8.46	10,000.00	84,600.00
201912 270000 0266	002583	海能达	2019-12-27	2020-02-03	8.41	10,000.00	84,100.00
201912 270000 0631	600435	北方导航	2019-12-27	2020-02-03	8.32	10,000.00	83,200.00
201912 270000 0350	600572	康恩贝	2019-12-27	2020-02-03	6.15	13,500.00	83,025.00
201912 270000 0114	000778	新兴铸管	2019-12-27	2020-02-03	4.17	19,900.00	82,983.00
201912 270000 0171	002092	中泰化学	2019-12-27	2020-02-03	6.79	12,200.00	82,838.00
201912 270000 0102	000685	中山公用	2019-12-27	2020-02-03	8.24	10,000.00	82,400.00
201912 270000 0413	600820	隧道股份	2019-12-27	2020-02-03	6.04	13,600.00	82,144.00
201912 270000 0158	002056	横店东磁	2019-12-27	2020-02-03	8.20	10,000.00	82,000.00
201912 270000 0072	000402	金融街	2019-12-27	2020-02-03	8.12	10,000.00	81,200.00
201912 270000 0512	600466	蓝光发展	2019-12-27	2020-02-03	7.37	11,000.00	81,070.00
201912	600266	城建发展	2019-12-27	2020-02-	8.10	10,000.00	81,000.00

270000 0336				03			
201912 270000 0527	600021	上海电力	2019-12-27	2020-02-03	8.05	10,000.00	80,500.00
201912 270000 0293	300058	蓝色光标	2019-12-27	2020-02-03	5.65	14,200.00	80,230.00
201912 270000 0573	601958	金钼股份	2019-12-27	2020-02-03	8.01	10,000.00	80,100.00
201912 270000 0366	600073	上海梅林	2019-12-27	2020-02-03	7.97	10,000.00	79,700.00
201912 270000 0450	600376	首开股份	2019-12-27	2020-02-03	7.97	10,000.00	79,700.00
201912 270000 0168	002075	沙钢股份	2019-12-27	2020-02-03	6.23	12,700.00	79,121.00
201912 270000 0190	002155	湖南黄金	2019-12-27	2020-02-03	7.89	10,000.00	78,900.00
201912 270000 0124	000848	承德露露	2019-12-27	2020-02-03	7.87	10,000.00	78,700.00
201912 270000 0410	600497	驰宏锌锗	2019-12-27	2020-02-03	4.38	17,900.00	78,402.00
201912 270000 0335	601139	深圳燃气	2019-12-27	2020-02-03	7.83	10,000.00	78,300.00
201912 270000 0545	601005	重庆钢铁	2019-12-27	2020-02-03	1.85	42,300.00	78,255.00
201912 270000 0080	000537	广宇发展	2019-12-27	2020-02-03	7.77	10,000.00	77,700.00
201912 270000 0207	002221	东华能源	2019-12-27	2020-02-03	7.76	10,000.00	77,600.00
201912 270000 0268	002640	跨境通	2019-12-27	2020-02-03	7.72	10,000.00	77,200.00

201912 270000 0478	600839	四川长虹	2019-12-27	2020-02- 03	2.91	26,500.00	77,115.00
201912 270000 0267	002589	瑞康医药	2019-12-27	2020-02- 03	7.69	10,000.00	76,900.00
201912 270000 0076	000519	中兵红箭	2019-12-27	2020-02- 03	7.62	10,000.00	76,200.00
201912 270000 0349	601928	凤凰传媒	2019-12-27	2020-02- 03	7.61	10,000.00	76,100.00
201912 270000 0457	600415	小商品城	2019-12-27	2020-02- 03	3.87	19,500.00	75,465.00
201912 270000 0559	600881	亚泰集团	2019-12-27	2020-02- 03	3.19	23,500.00	74,965.00
201912 270000 0048	000060	中金岭南	2019-12-27	2020-02- 03	4.30	17,400.00	74,820.00
201912 270000 0523	601333	广深铁路	2019-12-27	2020-02- 03	3.06	24,400.00	74,664.00
201912 270000 0386	601866	中远海发	2019-12-27	2020-02- 03	2.59	28,600.00	74,074.00
201912 270000 0296	300133	华策影视	2019-12-27	2020-02- 03	7.40	10,000.00	74,000.00
201912 270000 0198	002217	合力泰	2019-12-27	2020-02- 03	5.55	13,300.00	73,815.00
201912 270000 0340	600755	厦门国贸	2019-12-27	2020-02- 03	7.34	10,000.00	73,400.00
201912 270000 0422	600160	巨化股份	2019-12-27	2020-02- 03	7.28	10,000.00	72,800.00
201912 270000 0381	601699	潞安环能	2019-12-27	2020-02- 03	7.26	10,000.00	72,600.00
201912 270000	600811	东方集团	2019-12-27	2020-02- 03	3.36	21,600.00	72,576.00

0351							
201912 270000 0052	000031	大悦城	2019-12-27	2020-02-03	7.18	10,000.00	71,800.00
201912 270000 0392	600959	江苏有线	2019-12-27	2020-02-03	3.98	18,000.00	71,640.00
201912 270000 0233	002408	齐翔腾达	2019-12-27	2020-02-03	7.15	10,000.00	71,500.00
201912 270000 0374	601611	中国核建	2019-12-27	2020-02-03	7.13	10,000.00	71,300.00
201912 270000 0104	000690	宝新能源	2019-12-27	2020-02-03	5.65	12,500.00	70,625.00
201912 270000 0173	002085	万丰奥威	2019-12-27	2020-02-03	7.00	10,000.00	70,000.00
201912 270000 0223	002358	森源电气	2019-12-27	2020-02-03	6.99	10,000.00	69,900.00
201912 270000 0556	600970	中材国际	2019-12-27	2020-02-03	6.97	10,000.00	69,700.00
201912 270000 0077	000528	柳工	2019-12-27	2020-02-03	6.94	10,000.00	69,400.00
201912 270000 0520	600166	福田汽车	2019-12-27	2020-02-03	2.09	33,000.00	68,970.00
201912 270000 0147	000983	西山煤电	2019-12-27	2020-02-03	6.13	11,200.00	68,656.00
201912 270000 0423	600094	大名城	2019-12-27	2020-02-03	5.85	11,700.00	68,445.00
201912 270000 0067	000158	常山北明	2019-12-27	2020-02-03	6.82	10,000.00	68,200.00
201912 270000 0482	600022	山东钢铁	2019-12-27	2020-02-03	1.43	47,200.00	67,496.00
201912	000825	太钢不锈	2019-12-27	2020-02-	4.09	16,300.00	66,667.00

270000 0121				03			
201912 270000 0513	600623	华谊集团	2019-12-27	2020-02-03	6.65	10,000.00	66,500.00
201912 270000 0253	002491	通鼎互联	2019-12-27	2020-02-03	6.61	10,000.00	66,100.00
201912 270000 0472	600808	马钢股份	2019-12-27	2020-02-03	3.07	21,500.00	66,005.00
201912 270000 0135	000930	中粮科技	2019-12-27	2020-02-03	6.60	10,000.00	66,000.00
201912 270000 0115	000729	燕京啤酒	2019-12-27	2020-02-03	6.52	10,100.00	65,852.00
201912 270000 0414	600282	南钢股份	2019-12-27	2020-02-03	3.45	19,000.00	65,550.00
201912 270000 0116	000766	通化金马	2019-12-27	2020-02-03	6.54	10,000.00	65,400.00
201912 270000 0516	600098	广州发展	2019-12-27	2020-02-03	6.54	10,000.00	65,400.00
201912 270000 0298	300027	华谊兄弟	2019-12-27	2020-02-03	4.63	14,000.00	64,820.00
201912 270000 0495	601717	郑煤机	2019-12-27	2020-02-03	6.47	10,000.00	64,700.00
201912 270000 0398	600312	平高电气	2019-12-27	2020-02-03	6.46	10,000.00	64,600.00
201912 270000 0265	002573	清新环境	2019-12-27	2020-02-03	6.45	10,000.00	64,500.00
201912 270000 0428	600026	中远海能	2019-12-27	2020-02-03	6.38	10,000.00	63,800.00
201912 270000 0292	300072	三聚环保	2019-12-27	2020-02-03	6.32	10,000.00	63,200.00

201912 270000 0367	600901	江苏租赁	2019-12-27	2020-02- 03	6.32	10,000.00	63,200.00
201912 270000 0496	600409	三友化工	2019-12-27	2020-02- 03	6.32	10,000.00	63,200.00
201912 270000 0086	000563	陕国投 A	2019-12-27	2020-02- 03	4.43	14,200.00	62,906.00
201912 270000 0109	000813	德展健康	2019-12-27	2020-02- 03	6.29	10,000.00	62,900.00
201912 270000 0628	600717	天津港	2019-12-27	2020-02- 03	6.28	10,000.00	62,800.00
201912 270000 0167	002064	华峰氨纶	2019-12-27	2020-02- 03	6.25	10,000.00	62,500.00
201912 270000 0359	600804	鹏博士	2019-12-27	2020-02- 03	6.12	10,200.00	62,424.00
201912 270000 0180	002118	紫鑫药业	2019-12-27	2020-02- 03	6.24	10,000.00	62,400.00
201912 270000 0050	000027	深圳能源	2019-12-27	2020-02- 03	6.21	10,000.00	62,100.00
201912 270000 0538	600777	新潮能源	2019-12-27	2020-02- 03	2.10	29,400.00	61,740.00
201912 270000 0141	000967	盈峰环境	2019-12-27	2020-02- 03	6.17	10,000.00	61,700.00
201912 270000 0546	600757	长江传媒	2019-12-27	2020-02- 03	6.16	10,000.00	61,600.00
201912 270000 0118	000732	泰禾集团	2019-12-27	2020-02- 03	6.15	10,000.00	61,500.00
201912 270000 0426	600545	卓郎智能	2019-12-27	2020-02- 03	6.07	10,000.00	60,700.00
201912 270000	600125	铁龙物流	2019-12-27	2020-02- 03	5.98	10,000.00	59,800.00

0511							
201912 270000 0095	000598	兴蓉环境	2019-12-27	2020-02-03	4.63	12,900.00	59,727.00
201912 270000 0280	002839	张家港行	2019-12-27	2020-02-03	5.94	10,000.00	59,400.00
201912 270000 0429	600748	上实发展	2019-12-27	2020-02-03	5.94	10,000.00	59,400.00
201912 270000 0600	601118	海南橡胶	2019-12-27	2020-02-03	4.92	12,000.00	59,040.00
201912 270000 0544	600782	新钢股份	2019-12-27	2020-02-03	5.13	11,500.00	58,995.00
201912 270000 0213	002375	亚厦股份	2019-12-27	2020-02-03	5.80	10,000.00	58,000.00
201912 270000 0137	000932	华菱钢铁	2019-12-27	2020-02-03	4.78	12,100.00	57,838.00
201912 270000 0348	600863	内蒙华电	2019-12-27	2020-02-03	2.75	21,000.00	57,750.00
201912 270000 0567	601106	中国一重	2019-12-27	2020-02-03	2.91	19,700.00	57,327.00
201912 270000 0406	600649	城投控股	2019-12-27	2020-02-03	5.72	10,000.00	57,200.00
201912 270000 0316	300297	蓝盾股份	2019-12-27	2020-02-03	5.64	10,000.00	56,400.00
201912 270000 0355	603077	和邦生物	2019-12-27	2020-02-03	1.48	38,100.00	56,388.00
201912 270000 0163	002004	华邦健康	2019-12-27	2020-02-03	4.94	11,400.00	56,316.00
201912 270000 0332	300324	旋极信息	2019-12-27	2020-02-03	5.60	10,000.00	56,000.00
201912	000061	农产品	2019-12-27	2020-02-	5.59	10,000.00	55,900.00

270000 0057				03			
201912 270000 0275	002681	奋达科技	2019-12-27	2020-02-03	5.58	10,000.00	55,800.00
201912 270000 0462	601000	唐山港	2019-12-27	2020-02-03	2.60	21,400.00	55,640.00
201912 270000 0531	601801	皖新传媒	2019-12-27	2020-02-03	5.48	10,000.00	54,800.00
201912 270000 0508	600008	首创股份	2019-12-27	2020-02-03	3.29	16,400.00	53,956.00
201912 270000 0491	600770	综艺股份	2019-12-27	2020-02-03	5.39	10,000.00	53,900.00
201912 270000 0452	601179	中国西电	2019-12-27	2020-02-03	3.64	14,800.00	53,872.00
201912 270000 0085	000559	万向钱潮	2019-12-27	2020-02-03	5.37	10,000.00	53,700.00
201912 270000 0034	000006	深振业 A	2019-12-27	2020-02-03	5.36	10,000.00	53,600.00
201912 270000 0290	300026	红日药业	2019-12-27	2020-02-03	3.51	15,200.00	53,352.00
201912 270000 0064	000090	天健集团	2019-12-27	2020-02-03	5.30	10,000.00	53,000.00
201912 270000 0440	600500	中化国际	2019-12-27	2020-02-03	5.30	10,000.00	53,000.00
201912 270000 0228	002390	信邦制药	2019-12-27	2020-02-03	5.25	10,000.00	52,500.00
201912 270000 0598	600039	四川路桥	2019-12-27	2020-02-03	3.36	15,600.00	52,416.00
201912 270000 0373	600787	中储股份	2019-12-27	2020-02-03	5.21	10,000.00	52,100.00

201912 270000 0066	000301	东方盛虹	2019-12-27	2020-02- 03	5.18	10,000.00	51,800.00
201912 270000 0307	300182	捷成股份	2019-12-27	2020-02- 03	3.49	14,800.00	51,652.00
201912 270000 0353	601718	际华集团	2019-12-27	2020-02- 03	3.26	15,800.00	51,508.00
201912 270000 0514	601228	广州港	2019-12-27	2020-02- 03	3.83	13,400.00	51,322.00
201912 270000 0031	000008	神州高铁	2019-12-27	2020-02- 03	3.63	14,100.00	51,183.00
201912 270000 0417	601678	滨化股份	2019-12-27	2020-02- 03	5.11	10,000.00	51,100.00
201912 270000 0068	000488	晨鸣纸业	2019-12-27	2020-02- 03	5.09	10,000.00	50,900.00
201912 270000 0046	000012	南玻 A	2019-12-27	2020-02- 03	5.01	10,100.00	50,601.00
201912 270000 0390	600418	江淮汽车	2019-12-27	2020-02- 03	5.02	10,000.00	50,200.00
201912 270000 0272	002665	首航高科	2019-12-27	2020-02- 03	3.36	14,700.00	49,392.00
201912 270000 0202	002244	滨江集团	2019-12-27	2020-02- 03	4.92	10,000.00	49,200.00
201912 270000 0486	600350	山东高速	2019-12-27	2020-02- 03	4.91	10,000.00	49,100.00
201912 270000 0438	600869	智慧能源	2019-12-27	2020-02- 03	4.90	10,000.00	49,000.00
201912 270000 0094	000600	建投能源	2019-12-27	2020-02- 03	4.89	10,000.00	48,900.00
201912 270000	600126	杭钢股份	2019-12-27	2020-02- 03	4.89	10,000.00	48,900.00

0615							
201912 270000 0418	601598	中国外运	2019-12-27	2020-02-03	4.26	11,400.00	48,564.00
201912 270000 0456	600823	世茂股份	2019-12-27	2020-02-03	4.50	10,600.00	47,700.00
201912 270000 0105	000717	韶钢松山	2019-12-27	2020-02-03	4.74	10,000.00	47,400.00
201912 270000 0205	002266	浙富控股	2019-12-27	2020-02-03	4.12	11,400.00	46,968.00
201912 270000 0629	601608	中信重工	2019-12-27	2020-02-03	3.72	12,500.00	46,500.00
201912 270000 0087	000543	皖能电力	2019-12-27	2020-02-03	4.64	10,000.00	46,400.00
201912 270000 0484	600515	海航基础	2019-12-27	2020-02-03	4.46	10,400.00	46,384.00
201912 270000 0156	002002	鸿达兴业	2019-12-27	2020-02-03	4.16	11,100.00	46,176.00
201912 270000 0448	600307	酒钢宏兴	2019-12-27	2020-02-03	2.06	22,400.00	46,144.00
201912 270000 0509	600006	东风汽车	2019-12-27	2020-02-03	4.58	10,000.00	45,800.00
201912 270000 0283	300002	神州泰岳	2019-12-27	2020-02-03	3.26	14,000.00	45,640.00
201912 270000 0634	600277	亿利洁能	2019-12-27	2020-02-03	4.56	10,000.00	45,600.00
201912 270000 0441	601880	大连港	2019-12-27	2020-02-03	2.03	22,300.00	45,269.00
201912 270000 0277	002701	奥瑞金	2019-12-27	2020-02-03	4.41	10,200.00	44,982.00
201912	002183	怡亚通	2019-12-27	2020-02-	4.21	10,600.00	44,626.00

270000 0196				03			
201912 270000 0061	000078	海王生物	2019-12-27	2020-02-03	3.73	11,900.00	44,387.00
201912 270000 0549	601001	大同煤业	2019-12-27	2020-02-03	4.40	10,000.00	44,000.00
201912 270000 0347	600478	科力远	2019-12-27	2020-02-03	4.40	10,000.00	44,000.00
201912 270000 0108	000758	中色股份	2019-12-27	2020-02-03	4.38	10,000.00	43,800.00
201912 270000 0524	600499	科达洁能	2019-12-27	2020-02-03	4.33	10,000.00	43,300.00
201912 270000 0106	000718	苏宁环球	2019-12-27	2020-02-03	3.82	11,100.00	42,402.00
201912 270000 0225	002280	联络互动	2019-12-27	2020-02-03	3.87	10,900.00	42,183.00
201912 270000 0421	600707	彩虹股份	2019-12-27	2020-02-03	4.20	10,000.00	42,000.00
201912 270000 0477	600664	哈药股份	2019-12-27	2020-02-03	3.79	10,900.00	41,311.00
201912 270000 0592	600339	中油工程	2019-12-27	2020-02-03	3.39	12,100.00	41,019.00
201912 270000 0120	000727	华东科技	2019-12-27	2020-02-03	2.09	19,600.00	40,964.00
201912 270000 0360	601975	招商南油	2019-12-27	2020-02-03	2.81	14,500.00	40,745.00
201912 270000 0138	000959	首钢股份	2019-12-27	2020-02-03	3.53	11,500.00	40,595.00
201912 270000 0391	600657	信达地产	2019-12-27	2020-02-03	3.99	10,000.00	39,900.00

201912 270000 0113	000761	本钢板材	2019-12-27	2020-02- 03	3.94	10,000.00	39,400.00
201912 270000 0208	002249	大洋电机	2019-12-27	2020-02- 03	3.86	10,000.00	38,600.00
201912 270000 0503	600017	日照港	2019-12-27	2020-02- 03	2.91	13,200.00	38,412.00
201912 270000 0341	600582	天地科技	2019-12-27	2020-02- 03	3.19	11,900.00	37,961.00
201912 270000 0436	600565	迪马股份	2019-12-27	2020-02- 03	3.58	10,600.00	37,948.00
201912 270000 0346	600751	海航科技	2019-12-27	2020-02- 03	2.93	12,900.00	37,797.00
201912 270000 0189	002176	江特电机	2019-12-27	2020-02- 03	3.76	10,000.00	37,600.00
201912 270000 0212	002285	世联行	2019-12-27	2020-02- 03	3.75	10,000.00	37,500.00
201912 270000 0485	600428	中远海特	2019-12-27	2020-02- 03	3.74	10,000.00	37,400.00
201912 270000 0561	603766	隆鑫通用	2019-12-27	2020-02- 03	3.73	10,000.00	37,300.00
201912 270000 0144	000937	冀中能源	2019-12-27	2020-02- 03	3.66	10,000.00	36,600.00
201912 270000 0368	600317	营口港	2019-12-27	2020-02- 03	2.55	14,000.00	35,700.00
201912 270000 0259	002505	大康农业	2019-12-27	2020-02- 03	1.75	19,800.00	34,650.00
201912 270000 0483	601326	秦港股份	2019-12-27	2020-02- 03	3.19	10,300.00	32,857.00
201912 270000	600759	洲际油气	2019-12-27	2020-02- 03	2.77	11,300.00	31,301.00

0557							
201912 270000 0306	300197	铁汉生态	2019-12-27	2020-02-03	3.06	10,200.00	31,212.00
201912 270000 0249	002470	金正大	2019-12-27	2020-02-03	2.66	11,700.00	31,122.00
201912 270000 0241	002437	誉衡药业	2019-12-27	2020-02-03	3.03	10,000.00	30,300.00
201912 270000 0149	000980	众泰汽车	2019-12-27	2020-02-03	2.93	10,000.00	29,300.00
201912 270000 0352	600575	淮河能源	2019-12-27	2020-02-03	2.57	11,200.00	28,784.00
201912 270000 0611	601016	节能风电	2019-12-27	2020-02-03	2.41	11,900.00	28,679.00
201912 270000 0079	000536	华映科技	2019-12-27	2020-02-03	2.70	10,100.00	27,270.00
201912 270000 0256	002503	搜于特	2019-12-27	2020-02-03	2.39	10,900.00	26,051.00
合计	-	-	-	-	-	4,154,200.00	31,039,854.00

#### 7.4.10 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 12 月 31 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 4,994,742,217.25 元，属于第二层级的余额为人民币 5,647,196.42 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 2019 年 12 月 31 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	4,999,343,213.67	97.83
	其中：股票	4,999,343,213.67	97.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,046,200.00	0.02
	其中：债券	1,046,200.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,521,622.55	1.13
8	其他各项资产	52,514,178.95	1.03

9	合计	5,110,425,215.17	100.00
---	----	------------------	--------

注：（1）上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 31,039,854.00 元，占基金资产净值比例 0.61%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	34,229,396.44	0.67
B	采矿业	158,766,732.41	3.13
C	制造业	2,850,321,052.18	56.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	143,302,722.14	2.82
E	建筑业	65,874,398.52	1.30
F	批发和零售业	221,333,470.59	4.36
G	交通运输、仓储和邮政业	172,322,447.96	3.39
H	住宿和餐饮业	22,594,500.45	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	516,446,542.84	10.17
J	金融业	289,024,895.95	5.69
K	房地产业	198,841,319.06	3.92
L	租赁和商务服务业	71,202,752.40	1.40
M	科学研究和技术服务业	20,748,419.83	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	35,934,875.46	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,897,971.10	0.10
Q	卫生和社会工作	43,960,372.32	0.87
R	文化、体育和娱乐业	97,149,569.65	1.91
S	综合	52,391,015.92	1.03
	合计	4,999,342,455.22	98.45

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600745	闻泰科技	439,077	40,614,622.50	0.80
2	000066	中国长城	2,203,813	34,291,330.28	0.68
3	002463	沪电股份	1,509,336	33,522,352.56	0.66
4	601099	太平洋	7,947,597	30,121,392.63	0.59
5	002384	东山精密	1,294,184	29,960,359.60	0.59
6	601128	常熟银行	3,173,651	28,911,960.61	0.57
7	600584	长电科技	1,294,414	28,451,219.72	0.56
8	002049	紫光国微	529,000	26,894,360.00	0.53
9	600426	华鲁恒升	1,312,671	26,082,772.77	0.51
10	002439	启明星辰	768,770	25,984,426.00	0.51

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	33,677,121.45	1.02
2	002157	正邦科技	29,131,883.08	0.88
3	601099	太平洋	28,927,024.76	0.88
4	002065	东华软件	24,662,095.59	0.75
5	002180	纳思达	22,266,512.98	0.67
6	300207	欣旺达	20,684,629.96	0.63
7	000050	深天马 A	20,654,740.15	0.63
8	000860	顺鑫农业	19,682,932.20	0.60
9	300285	国瓷材料	19,612,857.68	0.59
10	002797	第一创业	19,512,018.15	0.59
11	002926	华西证券	19,429,406.29	0.59
12	002075	沙钢股份	19,388,632.89	0.59
13	002821	凯莱英	19,284,219.20	0.58
14	000623	吉林敖东	19,155,317.77	0.58

15	002384	东山精密	18,742,232.66	0.57
16	600745	闻泰科技	18,338,518.48	0.56
17	300014	亿纬锂能	18,142,747.00	0.55
18	600150	中国船舶	17,608,726.86	0.53
19	300529	健帆生物	17,476,733.33	0.53
20	002013	中航机电	17,471,619.03	0.53

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

#### 8.4.2 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	000860	顺鑫农业	46,596,787.09	1.41
2	002405	四维图新	35,876,520.59	1.09
3	300450	先导智能	35,161,111.29	1.06
4	300347	泰格医药	34,936,743.74	1.06
5	002916	深南电路	30,909,669.35	0.94
6	002410	广联达	30,257,493.67	0.92
7	600183	生益科技	30,083,495.42	0.91
8	002506	协鑫集成	26,823,425.15	0.81
9	000656	金科股份	26,543,546.12	0.80
10	002157	正邦科技	24,955,664.31	0.76
11	002299	圣农发展	24,932,620.54	0.76
12	600872	中炬高新	24,600,580.19	0.75
13	300146	汤臣倍健	24,386,441.33	0.74
14	000723	美锦能源	21,168,690.79	0.64
15	000596	古井贡酒	18,790,240.39	0.57
16	000418	小天鹅 A	18,529,365.35	0.56
17	300413	芒果超媒	17,510,773.98	0.53
18	603369	今世缘	16,982,431.77	0.51
19	603501	韦尔股份	16,834,822.00	0.51
20	002607	中公教育	16,549,514.78	0.50

#### 8.4.3 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	3,194,660,803.43
卖出股票收入（成交）总额	2,420,982,001.36

### 8.5 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）	1,046,200.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,046,200.00	0.02

### 8.6 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	110064	建工转债	5,690	569,000.00	0.01
2	110065	淮矿转债	3,840	384,000.00	0.01
3	128088	深南转债	932	93,200.00	0.00

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2001	IC2001	66.00	69,521,760.00	781,640.00	买入的股指期货是现货股票指数的对应期货品种，相关性较高，用期货进行较小比例的现货股票替代，能够较好实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征保持前后一致。
公允价值变动总额合计					781,640.00
股指期货投资本期收益					15,404.27
股指期货投资本期公允价值变动					1,108,440.00

#### 8.10.2 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 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。

**8.12.2** 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。

#### 8.12.3 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	9,300,821.89
2	应收证券清算款	43,194,570.00
3	应收股利	-
4	应收利息	18,787.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,514,178.95

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002439	启明星辰	338,000.00	0.01	转融通出借流通受限
2	002384	东山精密	231,500.00	0.00	转融通出借流通受

					限
3	600584	长电科技	219,800.00	0.00	转融通出借流通受限
4	600426	华鲁恒升	198,700.00	0.00	转融通出借流通受限
5	000066	中国长城	196,056.00	0.00	转融通出借流通受限
6	601099	太平洋	184,573.00	0.00	转融通出借流通受限
7	601128	常熟银行	176,734.00	0.00	转融通出借流通受限

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
10,209	330,006.6 9	3,182,770,3 54.00	94.47%	186,267,965 .00	5.53%	2,708,307, 821.00	80.39%

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。

### 9.2 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	3.26%
2	华夏基金-华夏银行-华夏银行股份有限公司	55,854,100.00	1.66%
3	中信证券股份有限公司	42,473,200.00	1.26%

	融券专用证券账户		
4	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	1.22%
5	李志鹤	31,879,800.00	0.95%
6	中信建投证券股份有限公司融券专用证券账户	27,270,000.00	0.81%
7	华泰证券股份有限公司	24,592,600.00	0.73%
8	中信证券股份有限公司	20,721,900.00	0.62%
9	中国中投证券有限责任公司	20,063,900.00	0.60%
10	中国国际金融股份有限公司融券专用证券账户	13,429,200.00	0.40%
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)	2,708,307,821.00	80.39%

### 9.3 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%

### 9.4 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

## §10 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	2,390,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,814,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,369,038,319.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
长城证券	2	205,491,092.72	3.70%	191,375.25	7.13%	-
申万宏源	6	251,080,688.94	4.53%	233,832.45	8.71%	-
华泰证券	5	272,938,519.46	4.92%	254,182.51	9.47%	-
广发证券	7	519,089,158.75	9.36%	483,420.92	18.01%	减少 1 个
方正证券	5	1,052,782,863.34	18.98%	769,898.68	28.69%	减少 2 个
万联证券	4	3,246,643,155.06	58.52%	750,968.35	27.98%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-

国泰君安	3	-	-	-	-	减少 1 个
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
德邦证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
广州证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-

西南证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	5	-	-	-	-	新增 1 个
国联证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个

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。

### 11.7.2 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
长城证券	3,296,398.60	97.25%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	93,200.00	2.75%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-

国都证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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%	期初份 额	申购份 额	赎回份 额	持有份 额	份额占 比

		的时间区间					
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	20190101-20191231	2,064,95 8,177.00	2,829,44 0,844.00	2,186,09 1,200.00	2,708,30 7,821.00	80.39 %
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。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，本公司于本报告期内对本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件进行了信息披露相关条款的修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《根据<公开募集证券投资基金信息披露管理办法>修改旗下68只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》。

广发基金管理有限公司

二〇二〇年三月二十七日