

广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 3 月 14 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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47

8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
11 影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证红利 ETF
场内简称	红利 100ETF
基金主代码	159589
交易代码	159589
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 3 月 14 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,590,005.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024-03-26

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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
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、备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%。 具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证红利指数同期收益率
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	招商银行股份有限公司	
信息披露	姓名	项军	张姗
	联系电话	020-83936666	400-61-95555

负责人	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105828	400-61-95555
传真		020-34281105	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510308	518040
法定代表人		葛长伟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省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（2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日）
本期已实现收益	3,578,538.13
本期利润	3,223,432.98
加权平均基金份额本期利润	0.0255
本期加权平均净值利润率	2.52%
本期基金份额净值增长率	2.07%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	859,058.57
期末可供分配基金份额利润	0.0207
期末基金资产净值	42,449,063.57
期末基金份额净值	1.0207
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.07%

注：（1）本基金合同生效日为 2024 年 3 月 14 日，至披露时点不满半年。

（2）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。

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

（4）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）。

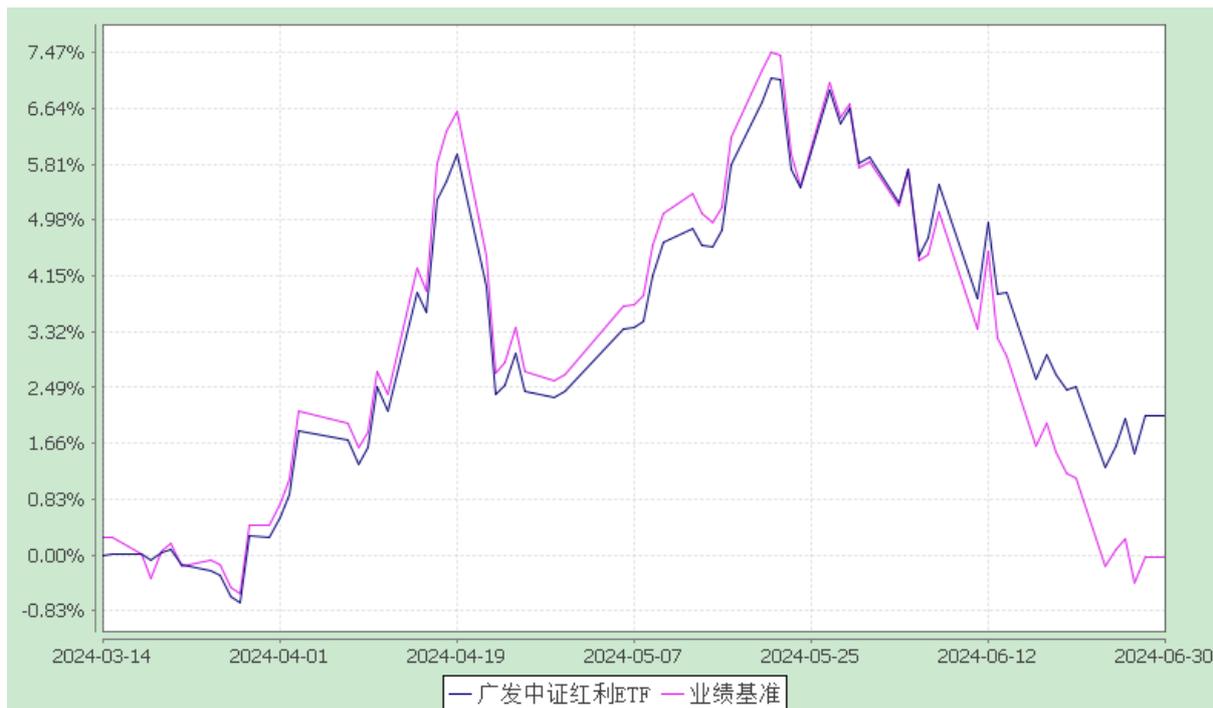
3.2 基金净值表现

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	-3.63%	0.75%	-5.55%	0.76%	1.92%	-0.01%
过去三个月	1.80%	0.75%	-0.48%	0.81%	2.28%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.07%	0.70%	-0.03%	0.75%	2.10%	-0.05%

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

广发中证红利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
 （2024 年 3 月 14 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：（1）本基金合同生效日期为 2024 年 3 月 14 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、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、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、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

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；广发中证 500 交易型	2024-03-14	-	20 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

	<p>开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发中证 500 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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；广发纳斯达克生物科技指数型发</p>				<p>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)、广发中小企业 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)、广发中小企业 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)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、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联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发纳斯达克生物</p>
--	--	--	--	--	--

	<p>起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；指数投资部总经理助理</p>			<p>科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、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基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中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基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 8 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发沪深 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 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金经理(自 2023 年 3 月 8 日至 2024 年 3 月 30 日)。</p>
--	--	--	--	---

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办

法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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% 的交易共有 14 次，其中 13 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，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资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

2024 年上半年，A 股市场总体呈现先抑后扬的趋势，2 月以来伴随流动性积极化解，叠加稳市场、稳预期的多项政策密集出台，投资者情绪逐步改善。上半年，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 指数下跌 8.96%，创业板指数下跌 10.99%，北证 50 下跌 34.52%，深证 100 下跌 4.16%。

2024 年上半年，大盘相对占优，表现较优的大盘股包括股息率较高行业、供给端出清行业和制造业出海热潮的相关行业。上半年，行业表现较好的有银行、公用事业、家用电器，与高股息、全球经济呈现修复态势和国内出口增速超预期存在一定关系，表现较弱的行业主要是与内需增速相关性较强以及部分估值水平较高的行业，包括计算机、社会服务、商贸零售、医药生物等行业。

本基金的标的指数是中证红利指数，主要采用完全复制法来跟踪标的指数。中证红利指数近些年股息率为 6% 上下，股息率较高，受到市场资产配置资金的追捧。在经历了长期的供给端出清后，越来越多的传统行业供需格局走向平衡，继而带来了 ROE 和分红的双重改善，中证红利指数越来越受到市场的关注。

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。

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。本基金跟踪误差来源主要是申购赎回和成份股调整等因素。

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 2.07%，同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着物价因素边际改善和复苏深化，下半年 A 股企业盈利增速可能好于上半年，同时，A 股企业资产负债表仍相对健康，在稳增长政策支持下，预计内需逐步提升，并且在海外经济景气度较高的背景下，外需有望增速上扬，未来需求侧边际修复有望带动 ROE 周期性改善，并且当前 A 股估值处于历史中低水平，基本面好转有望带动投资者风险偏好回升。同时，下半年美国降息周期或有望开启，在全球资金再配置过程中，部分资金可能会流向包括中国在内的新兴市场，鉴于 A 股市场整体处于估值相对较低位置，届时 A 股有望相对受益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2024 年 5 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日出现了基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	1,013,824.90
结算备付金		88,266.16
存出保证金		154,280.16
交易性金融资产	6.4.7.2	41,769,317.23
其中：股票投资		41,769,317.23
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	78,767.36

资产总计		43,104,455.81
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		447,993.71
应付赎回款		-
应付管理人报酬		17,415.18
应付托管费		3,483.03
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	186,500.32
负债合计		655,392.24
净资产：		
实收基金	6.4.7.8	41,590,005.00
未分配利润	6.4.7.9	859,058.57
净资产合计		42,449,063.57
负债和净资产总计		43,104,455.81

注：(1)报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0207 元，基金份额总额 41,590,005.00 份。

(2) 本会计期间为 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年3月14日（基金合同生效日）至 2024 年6月30日
一、营业总收入		3,546,297.81
1.利息收入		60,088.93
其中：存款利息收入	6.4.7.10	60,088.93
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,237,043.86
其中：股票投资收益	6.4.7.11	2,005,503.50
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	1,231,540.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-355,105.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	604,270.17
减：二、营业总支出		322,864.83
1. 管理人报酬		176,897.01
2. 托管费		35,379.42
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.21	110,588.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,223,432.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,223,432.98
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,223,432.98

6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	510,590,005.00	-	510,590,005.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-469,000,000.00	859,058.57	-468,140,941.43
（一）、综合收益总额	-	3,223,432.98	3,223,432.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-469,000,000.00	-2,364,374.41	-471,364,374.41
其中：1. 基金申购款	5,000,000.00	114,803.69	5,114,803.69
2. 基金赎回款	-474,000,000.00	-2,479,178.10	-476,479,178.10
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	41,590,005.00	859,058.57	42,449,063.57

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：葛长伟，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

广发中证红利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[2024]82 号《关于准予广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2024 年 3 月 4 日向社会公开发行募集并于 2024 年 3 月 14 日正式成立。本基金

的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2024 年 3 月 4 日至 2024 年 3 月 8 日，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 510,590,005.00 元，有效认购户数为 4,185 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 22,005.00 元，按照基金合同的有关约定，折合基金份额 22,005.00 份计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价

值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已经开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入（若有）、转出（若有）及红利再投资（若有）等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已

确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(9) 黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金管理人在基金满足基金合同约定的收益分配条件后，方可进行收益分配。本基金收益分配比例的确定原则为，使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，且本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，

收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,013,824.90
等于：本金	1,013,710.61
加：应计利息	114.29
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,013,824.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	42,124,422.38	-	41,769,317.23	-355,105.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	42,124,422.38	-	41,769,317.23	-355,105.15

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	78,767.36
合计	78,767.36

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	125,026.00
其中：交易所市场	125,026.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	61,474.32
合计	186,500.32

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	510,590,005.00	510,590,005.00
本期申购	5,000,000.00	5,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-474,000,000.00	-474,000,000.00
本期末	41,590,005.00	41,590,005.00

注：本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额情况，详见于附注 6.4.1“基金基本情况”之说明。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	3,578,538.13	-355,105.15	3,223,432.98
本期基金份额交易产生的变动数	-726,248.68	-1,638,125.73	-2,364,374.41
其中：基金申购款	168,679.42	-53,875.73	114,803.69
基金赎回款	-894,928.10	-1,584,250.00	-2,479,178.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,852,289.45	-1,993,230.88	859,058.57

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,625.29
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,891.34
其他	572.30
合计	60,088.93

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,084,283.35
股票投资收益——赎回差价收入	-78,779.85
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,005,503.50

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	389,021,364.20
减：卖出股票成本总额	386,007,033.19
减：交易费用	930,047.66
买卖股票差价收入	2,084,283.35

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	476,479,178.10
减：现金支付赎回款总额	391,432,040.10
减：赎回股票成本总额	85,125,917.85
减：交易费用	-
赎回差价收入	-78,779.85

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,231,540.36
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,231,540.36

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-355,105.15
——股票投资	-355,105.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-355,105.15

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	602,113.17
其他	2,157.00
合计	604,270.17

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）被替代成分证券的实际买入成本（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成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日
审计费用	18,972.54
信息披露费	37,201.70
证券出借违约金	-
其他	51,932.72
银行汇划费	2,481.44
合计	110,588.40

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

本基金的基金管理人已发布本基金分红公告，向截至 2024 年 7 月 12 日交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利人民币 0.020 元。实际分配金额为人民币 79,179.23 元；向截至 2024 年 8 月 13 日交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利人民币 0.020 元。实际分配金额为人民币 75,179.31 元。

除上述情况外，截至本财务报表批准报出日，本基金无其他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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
招商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	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	26,353,583.82	2.92%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限 公司	24,931.64	3.68%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

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；

4、自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	176,897.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,524.57
应支付基金管理人的净管理费	172,372.44

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,379.42

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	1,946,469.00	4.68%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024年3月14日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,013,824.90	50,625.29

注：本基金的银行存款由基金托管人招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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2024 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证券。

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 2024 年 6 月 30 日止，本基金未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 2024 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 2024 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。本基金本报告期末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

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，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，本基金所持大部分投资品种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。

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。本基金管理人通过久期、凸性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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,013,824.90	-	-	-	1,013,824.90
结算备付金	88,266.16	-	-	-	88,266.16
存出保证金	154,280.16	-	-	-	154,280.16
交易性金融资产	-	-	-	41,769,317.23	41,769,317.23

其他资产	-	-	-	78,767.36	78,767.36
资产总计	1,256,371.22	-	-	41,848,084.59	43,104,455.81
负债					
应付清算款	-	-	-	447,993.71	447,993.71
应付管理人报酬	-	-	-	17,415.18	17,415.18
应付托管费	-	-	-	3,483.03	3,483.03
其他负债	-	-	-	186,500.32	186,500.32
负债总计	-	-	-	655,392.24	655,392.24
利率敏感度缺口	1,256,371.22	-	-	41,192,692.35	42,449,063.57

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

本基金本报告期末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），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

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

6.4.13.4.3 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，以及标准差、跟踪误差、beta 值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 2024 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	41,769,317.23	98.40
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-

其他	-	-
合计	41,769,317.23	98.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2024 年 6 月 30 日
	上升 5%	2,046,724.50
	下降 5%	-2,046,724.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	41,769,317.23
第二层次	-
第三层次	-
合计	41,769,317.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金

融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	41,769,317.23	96.90
	其中：普通股	41,769,317.23	96.90
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,102,091.06	2.56
8	其他各项资产	233,047.52	0.54
9	合计	43,104,455.81	100.00

注：上表中的权益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	-	-
B	采矿业	8,011,244.36	18.87

C	制造业	12,551,712.22	29.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,592,418.40	3.75
E	建筑业	1,103,027.73	2.60
F	批发和零售业	565,069.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	3,637,378.30	8.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	9,472,336.22	22.31
K	房地产业	1,283,800.00	3.02
L	租赁和商务服务业	1,415,933.00	3.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,136,398.00	5.03
S	综合	-	-
	合计	41,769,317.23	98.40

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	21,300	945,081.00	2.23
2	601225	陕西煤业	32,800	845,256.00	1.99
3	600398	海澜之家	91,300	843,612.00	1.99
4	601000	唐山港	179,000	841,300.00	1.98
5	601006	大秦铁路	104,700	749,652.00	1.77
6	601328	交通银行	90,900	679,023.00	1.60
7	000983	山西焦煤	64,880	668,912.80	1.58

8	601169	北京银行	109,000	636,560.00	1.50
9	600350	山东高速	71,900	636,315.00	1.50
10	600971	恒源煤电	52,300	624,462.00	1.47
11	000830	鲁西化工	53,000	614,270.00	1.45
12	000651	格力电器	15,600	611,832.00	1.44
13	600282	南钢股份	119,700	596,106.00	1.40
14	600039	四川路桥	74,657	589,043.73	1.39
15	601288	农业银行	133,900	583,804.00	1.38
16	600177	雅戈尔	80,700	574,584.00	1.35
17	601077	渝农商行	113,800	571,276.00	1.35
18	600755	厦门国贸	79,200	567,864.00	1.34
19	601988	中国银行	121,400	560,868.00	1.32
20	601398	工商银行	94,400	538,080.00	1.27
21	600012	皖通高速	38,490	537,705.30	1.27
22	601229	上海银行	73,647	534,677.22	1.26
23	601998	中信银行	79,800	534,660.00	1.26
24	601009	南京银行	50,200	521,578.00	1.23
25	601098	中南传媒	41,200	511,704.00	1.21
26	601857	中国石油	49,500	510,840.00	1.20
27	600985	淮北矿业	30,400	508,896.00	1.20
28	600546	山煤国际	34,805	508,849.10	1.20
29	601666	平煤股份	45,000	504,000.00	1.19
30	601939	建设银行	68,000	503,200.00	1.19
31	600295	鄂尔多斯	50,692	502,864.64	1.18
32	601019	山东出版	41,700	492,894.00	1.16
33	600015	华夏银行	76,600	490,240.00	1.15
34	601818	光大银行	154,600	490,082.00	1.15
35	601166	兴业银行	27,800	489,836.00	1.15
36	600028	中国石化	76,800	485,376.00	1.14
37	002128	电投能源	23,000	485,300.00	1.14
38	002048	宁波华翔	37,500	485,250.00	1.14
39	600188	兖矿能源	21,100	479,603.00	1.13
40	600373	中文传媒	32,100	476,364.00	1.12
41	600377	宁沪高速	37,400	471,240.00	1.11
42	600901	江苏金租	92,560	467,428.00	1.10
43	600019	宝钢股份	70,200	466,830.00	1.10
44	601928	凤凰传媒	42,300	463,608.00	1.09
45	000157	中联重科	57,414	440,939.52	1.04
46	601699	潞安环能	24,200	438,746.00	1.03
47	000581	威孚高科	26,700	434,676.00	1.02
48	600900	长江电力	15,000	433,800.00	1.02
49	600000	浦发银行	52,400	431,252.00	1.02
50	600064	南京高科	70,500	427,935.00	1.01
51	600057	厦门象屿	62,600	425,680.00	1.00

52	600585	海螺水泥	18,000	424,620.00	1.00
53	600153	建发股份	47,300	422,389.00	1.00
54	600997	开滦股份	60,500	415,030.00	0.98
55	603565	中谷物流	45,900	401,166.00	0.95
56	600919	江苏银行	53,900	400,477.00	0.94
57	002003	伟星股份	30,591	383,917.05	0.90
58	002601	龙佰集团	20,400	378,828.00	0.89
59	600325	华发股份	57,500	373,750.00	0.88
60	601997	贵阳银行	70,100	369,427.00	0.87
61	600273	嘉化能源	51,200	365,568.00	0.86
62	600348	华阳股份	36,476	363,300.96	0.86
63	600782	新钢股份	108,800	361,216.00	0.85
64	600801	华新水泥	26,200	360,250.00	0.85
65	601668	中国建筑	67,800	360,018.00	0.85
66	600873	梅花生物	34,500	345,690.00	0.81
67	600461	洪城环境	29,400	340,452.00	0.80
68	002416	爱施德	38,300	338,955.00	0.80
69	601601	中国太保	12,100	337,106.00	0.79
70	600016	民生银行	87,800	332,762.00	0.78
71	600123	兰花科创	36,950	330,702.50	0.78
72	002110	三钢闽光	109,200	322,140.00	0.76
73	600395	盘江股份	51,900	311,919.00	0.73
74	601216	君正集团	84,100	310,329.00	0.73
75	600642	申能股份	34,800	307,284.00	0.72
76	600741	华域汽车	16,600	271,908.00	0.64
77	600674	川投能源	14,400	270,000.00	0.64
78	000932	华菱钢铁	60,100	266,243.00	0.63
79	600048	保利发展	29,800	261,048.00	0.61
80	002030	达安基因	49,300	246,500.00	0.58
81	600808	马钢股份	121,800	246,036.00	0.58
82	605368	蓝天燃气	17,660	240,882.40	0.57
83	002737	葵花药业	9,800	229,124.00	0.54
84	600704	物产中大	52,100	226,114.00	0.53
85	601636	旗滨集团	34,400	221,880.00	0.52
86	000002	万科 A	31,900	221,067.00	0.52
87	002327	富安娜	21,600	217,080.00	0.51
88	600479	千金药业	18,900	192,213.00	0.45
89	600757	长江传媒	23,800	191,828.00	0.45
90	002233	塔牌集团	23,000	168,130.00	0.40
91	603878	武进不锈	24,500	160,230.00	0.38
92	603886	元祖股份	10,600	159,636.00	0.38
93	600389	江山股份	11,000	155,210.00	0.37
94	000090	天健集团	38,300	153,966.00	0.36
95	002443	金洲管道	26,800	143,112.00	0.34

96	002367	康力电梯	24,600	141,942.00	0.33
97	002932	明德生物	8,000	134,480.00	0.32
98	002088	鲁阳节能	10,400	125,736.00	0.30
99	000789	万年青	26,800	121,672.00	0.29
100	688606	奥泰生物	2,377	112,028.01	0.26

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601225	陕西煤业	10,345,379.00	24.37
2	601088	中国神华	9,827,258.00	23.15
3	601000	唐山港	9,357,562.00	22.04
4	601006	大秦铁路	8,788,096.00	20.70
5	600282	南钢股份	8,202,185.00	19.32
6	000651	格力电器	7,768,949.30	18.30
7	600971	恒源煤电	7,698,051.00	18.13
8	600028	中国石化	7,605,244.00	17.92
9	601169	北京银行	7,425,615.00	17.49
10	600398	海澜之家	7,395,046.00	17.42
11	600546	山煤国际	7,305,706.70	17.21
12	600350	山东高速	7,126,663.00	16.79
13	600755	厦门国贸	7,077,618.51	16.67
14	600177	雅戈尔	6,920,034.00	16.30
15	601998	中信银行	6,915,592.00	16.29
16	601699	潞安环能	6,896,096.00	16.25
17	601328	交通银行	6,890,119.00	16.23
18	601288	农业银行	6,798,646.00	16.02
19	000983	山西焦煤	6,719,299.40	15.83
20	600373	中文传媒	6,693,824.74	15.77
21	601098	中南传媒	6,599,289.43	15.55
22	600295	鄂尔多斯	6,571,686.16	15.48
23	601988	中国银行	6,479,258.00	15.26
24	000830	鲁西化工	6,458,760.00	15.22
25	601666	平煤股份	6,390,237.41	15.05
26	600012	皖通高速	6,361,990.90	14.99
27	600919	江苏银行	6,270,459.00	14.77
28	601077	渝农商行	6,240,580.00	14.70
29	600188	兖矿能源	6,168,782.00	14.53
30	601818	光大银行	6,143,570.00	14.47

31	600985	淮北矿业	6,126,200.00	14.43
32	601398	工商银行	5,996,239.00	14.13
33	002048	宁波华翔	5,979,235.00	14.09
34	601229	上海银行	5,911,691.95	13.93
35	600015	华夏银行	5,896,164.00	13.89
36	600153	建发股份	5,859,256.00	13.80
37	601166	兴业银行	5,833,531.00	13.74
38	601019	山东出版	5,813,706.00	13.70
39	601928	凤凰传媒	5,781,758.00	13.62
40	600019	宝钢股份	5,683,971.76	13.39
41	601939	建设银行	5,623,698.00	13.25
42	601857	中国石油	5,592,111.00	13.17
43	000157	中联重科	5,525,557.28	13.02
44	601009	南京银行	5,524,813.00	13.02
45	600997	开滦股份	5,487,335.00	12.93
46	600064	南京高科	5,462,089.00	12.87
47	600377	宁沪高速	5,343,989.00	12.59
48	002416	爱施德	5,303,609.80	12.49
49	002030	达安基因	5,266,398.00	12.41
50	600123	兰花科创	5,209,209.90	12.27
51	600901	江苏金租	5,160,352.00	12.16
52	600057	厦门象屿	5,098,589.16	12.01
53	600273	嘉化能源	5,076,118.00	11.96
54	600585	海螺水泥	4,974,238.00	11.72
55	600016	民生银行	4,927,136.00	11.61
56	600325	华发股份	4,916,885.00	11.58
57	600039	四川路桥	4,883,877.63	11.51
58	000581	威孚高科	4,851,284.00	11.43
59	002110	三钢闽光	4,830,440.00	11.38
60	600782	新钢股份	4,804,184.00	11.32
61	603565	中谷物流	4,795,420.17	11.30
62	002601	龙佰集团	4,744,215.00	11.18
63	601997	贵阳银行	4,671,277.00	11.00
64	600395	盘江股份	4,645,258.00	10.94
65	600873	梅花生物	4,512,558.00	10.63
66	600000	浦发银行	4,498,706.00	10.60
67	600348	华阳股份	4,484,135.76	10.56
68	601668	中国建筑	4,326,911.00	10.19
69	600801	华新水泥	4,267,890.62	10.05
70	600642	申能股份	3,973,570.76	9.36
71	601216	君正集团	3,912,102.00	9.22
72	000932	华菱钢铁	3,900,900.00	9.19
73	600900	长江电力	3,891,483.00	9.17
74	002003	伟星股份	3,852,775.48	9.08

75	600808	马钢股份	3,772,182.00	8.89
76	002128	电投能源	3,703,471.00	8.72
77	000002	万科 A	3,701,392.30	8.72
78	600674	川投能源	3,597,044.00	8.47
79	601601	中国太保	3,561,304.00	8.39
80	600741	华域汽车	3,484,958.00	8.21
81	600048	保利发展	3,417,708.00	8.05
82	002737	葵花药业	3,140,863.00	7.40
83	601636	旗滨集团	3,079,492.00	7.25
84	600461	洪城环境	2,989,896.18	7.04
85	605368	蓝天燃气	2,890,036.20	6.81
86	600704	物产中大	2,849,610.00	6.71
87	002327	富安娜	2,766,801.00	6.52
88	600757	长江传媒	2,507,892.71	5.91
89	603886	元祖股份	2,491,119.00	5.87
90	603878	武进不锈	2,412,634.72	5.68
91	002233	塔牌集团	2,410,249.00	5.68
92	002088	鲁阳节能	2,367,375.00	5.58
93	002367	康力电梯	2,315,325.00	5.45
94	600479	千金药业	2,224,287.99	5.24
95	000090	天健集团	2,151,494.00	5.07
96	002932	明德生物	2,102,653.50	4.95
97	000789	万年青	2,068,824.00	4.87
98	002443	金洲管道	2,056,148.00	4.84
99	600389	江山股份	1,953,424.00	4.60
100	688606	奥泰生物	1,837,971.15	4.33

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601225	陕西煤业	9,607,724.00	22.63
2	601088	中国神华	9,301,305.00	21.91
3	601000	唐山港	8,648,532.00	20.37
4	601006	大秦铁路	8,040,731.00	18.94

5	600282	南钢股份	7,988,531.00	18.82
6	600028	中国石化	7,231,373.00	17.04
7	600971	恒源煤电	7,188,939.00	16.94
8	601169	北京银行	6,987,234.00	16.46
9	600398	海澜之家	6,801,779.19	16.02
10	600350	山东高速	6,715,084.00	15.82
11	601328	交通银行	6,541,685.00	15.41
12	600755	厦门国贸	6,532,887.00	15.39
13	601998	中信银行	6,417,061.00	15.12
14	600177	雅戈尔	6,404,679.00	15.09
15	601288	农业银行	6,399,467.00	15.08
16	600546	山煤国际	6,366,051.42	15.00
17	600295	鄂尔多斯	6,243,754.20	14.71
18	601988	中国银行	6,062,582.00	14.28
19	600919	江苏银行	6,002,935.00	14.14
20	600012	皖通高速	5,964,028.00	14.05
21	601098	中南传媒	5,961,474.00	14.04
22	601666	平煤股份	5,959,243.00	14.04
23	601077	渝农商行	5,944,659.00	14.00
24	601699	潞安环能	5,917,613.00	13.94
25	600373	中文传媒	5,826,084.00	13.72
26	600188	兖矿能源	5,634,983.00	13.27
27	600985	淮北矿业	5,628,260.00	13.26
28	601398	工商银行	5,609,762.00	13.22
29	600015	华夏银行	5,575,672.00	13.13
30	601229	上海银行	5,569,487.90	13.12
31	601818	光大银行	5,527,493.00	13.02
32	601857	中国石油	5,422,671.00	12.77
33	600153	建发股份	5,402,045.00	12.73
34	601166	兴业银行	5,352,710.01	12.61
35	601939	建设银行	5,262,113.00	12.40
36	600019	宝钢股份	5,246,157.00	12.36
37	601019	山东出版	5,215,951.00	12.29
38	601928	凤凰传媒	5,207,056.00	12.27
39	600997	开滦股份	5,146,789.00	12.12
40	601009	南京银行	5,141,898.00	12.11
41	600064	南京高科	5,050,997.00	11.90
42	600377	宁沪高速	4,937,818.00	11.63
43	600901	江苏金租	4,834,773.49	11.39
44	600057	厦门象屿	4,692,814.63	11.06
45	603565	中谷物流	4,670,428.00	11.00
46	600325	华发股份	4,644,000.00	10.94
47	600016	民生银行	4,625,941.00	10.90
48	600123	兰花科创	4,617,125.75	10.88

49	600273	嘉化能源	4,566,312.00	10.76
50	600585	海螺水泥	4,499,833.99	10.60
51	600782	新钢股份	4,450,424.00	10.48
52	601997	贵阳银行	4,322,327.00	10.18
53	600395	盘江股份	4,313,155.00	10.16
54	600039	四川路桥	4,273,589.07	10.07
55	600000	浦发银行	4,210,888.00	9.92
56	600873	梅花生物	4,121,902.00	9.71
57	600801	华新水泥	4,042,843.60	9.52
58	601668	中国建筑	3,994,806.00	9.41
59	600348	华阳股份	3,993,665.00	9.41
60	600642	申能股份	3,877,877.00	9.14
61	601216	君正集团	3,531,400.00	8.32
62	600900	长江电力	3,488,267.00	8.22
63	600674	川投能源	3,399,702.60	8.01
64	600808	马钢股份	3,379,623.00	7.96
65	601601	中国太保	3,298,553.00	7.77
66	600741	华域汽车	3,226,568.00	7.60
67	600048	保利发展	3,073,560.00	7.24
68	601636	旗滨集团	2,830,791.00	6.67
69	600461	洪城环境	2,705,578.76	6.37
70	605368	蓝天燃气	2,669,185.20	6.29
71	600704	物产中大	2,603,144.00	6.13
72	603878	武进不锈	2,437,608.40	5.74
73	600757	长江传媒	2,257,125.00	5.32
74	603886	元祖股份	2,202,053.00	5.19
75	600479	千金药业	2,040,442.80	4.81
76	600389	江山股份	1,737,430.55	4.09
77	688606	奥泰生物	1,653,688.64	3.90

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	512,516,622.57
卖出股票收入（成交）总额	389,021,364.20

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）的处罚。大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方交通运输局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	154,280.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	78,767.36
8	其他	-
9	合计	233,047.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
908	45,803.97	12,786,326.00	30.74%	28,803,679.00	69.26%

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	中国国际金融股份有限公司	3,830,474.00	9.21%
2	招商证券股份有限公司	3,079,349.00	7.40%
3	广发证券股份有限公司	1,946,469.00	4.68%
4	方正证券股份有限公司	1,879,780.00	4.52%
5	顾岳生	1,000,077.00	2.40%
6	上海东恺投资管理有限公司-东恺凌云二号私募证	1,000,077.00	2.40%

	券投资基金		
7	广州市骏泽投资有限公司-骏泽平衡 9 号私募证券投资基金	1,000,068.00	2.40%
8	张粼粼	1,000,068.00	2.40%
9	沈根方	700,034.00	1.68%
10	邓轩	510,024.00	1.23%

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（2024 年 3 月 14 日）基金份额总额	510,590,005.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	474,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	41,590,005.00

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2024 年 3 月 14 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；

于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	4	487,678,974.93	54.09%	363,746.56	53.67%	-
国投证券	2	387,057,463.02	42.93%	288,701.65	42.60%	-
广发证券	4	26,353,583.82	2.92%	24,931.64	3.68%	-
中金公司	2	447,965.00	0.05%	334.14	0.05%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

财通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (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、交易单元选择流程：

(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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交 总额的	成交金额	占当期权证成交总 额的比例

				比例		
长江证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

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	广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-27
2	关于增加广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金网下现金发售代理机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-04

3	广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15
4	关于广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-21
5	广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-21
6	广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-21
7	关于广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-26
8	广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-26
9	关于增加广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-03
10	关于增加渤海证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-17
11	关于增加浙商证券为广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-17

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金已于 2024 年 3 月 14 日成立，并于 2024 年 3 月 26 日开始在深圳证券交易所上市交易。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
- （二）《广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书

12.2 存放地点

广东省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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日