

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
联接基金(LOF)
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末投资目标基金明细	41
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.4 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	42
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.7 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	57
7.8 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	57
7.9 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	57
7.10 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	57
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.13 投资组合报告附注	59

8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
9 开放式基金份额变动	61
10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	68
11 影响投资者决策的其他重要信息	68
12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
基金简称	广发中证 500ETF 联接(LOF)	
基金主代码	162711	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 11 月 26 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	1,715,633,401.71 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	2010-01-08	
下属分级基金的基金简称	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	162711	002903
报告期末下属分级基金的份额总额	892,754,842.24 份	822,878,559.47 份

注：本基金的扩位证券简称为“中证 500LOF”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证 500ETF
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 5 月 24 日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧

	密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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，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。

2.2.1 目标基金产品说明

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	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的网址	http://www.gffunds.com.cn

互联网网址	
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

注：本基金的 A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为广发基金管理有限公司。

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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
本期已实现收益	58,909,375.45	40,516,129.49
本期利润	108,149,136.14	76,199,180.99
加权平均基金份额本期利润	0.1169	0.0928
本期加权平均净值利润率	8.16%	8.13%
本期基金份额净值增长率	8.24%	8.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
期末可供分配利润	463,298,527.53	126,684,335.35
期末可供分配基金份额利润	0.5190	0.1540
期末基金资产净值	1,356,053,369.77	995,502,051.84
期末基金份额净值	1.5190	1.2098
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	51.90%	20.98%

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

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

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	1.80%	0.70%	1.12%	0.69%	0.68%	0.01%
过去三个月	9.68%	0.65%	8.41%	0.65%	1.27%	0.00%
过去六个月	8.24%	0.94%	6.61%	0.94%	1.63%	0.00%
过去一年	18.31%	1.19%	15.35%	1.19%	2.96%	0.00%
过去三年	34.46%	1.38%	29.32%	1.40%	5.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.90%	1.54%	51.06%	1.58%	0.84%	-0.04%

广发中证 500ETF 联接 C

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	1.78%	0.70%	1.12%	0.69%	0.66%	0.01%
过去三个月	9.63%	0.65%	8.41%	0.65%	1.22%	0.00%
过去六个月	8.13%	0.94%	6.61%	0.94%	1.52%	0.00%
过去一年	18.08%	1.19%	15.35%	1.19%	2.73%	0.00%
过去三年	33.68%	1.38%	29.32%	1.40%	4.36%	-0.02%
自基金合同生效起至今	20.98%	1.24%	17.88%	1.26%	3.10%	-0.02%

注: (1) 自 2013 年 10 月 10 日起, 本基金的业绩比较基准由“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率”变更为“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)”。

(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的, 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中, 需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求, 基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡, 再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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联接基金(LOF)

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

(2009 年 11 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日)

广发中证 500ETF 联接(LOF)A



广发中证 500ETF 联接 C



注：自 2013 年 10 月 10 日起，本基金的业绩比较基准由“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率”变更为“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”。

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，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、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、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 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，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； 广发道琼斯美国 石油开发与生产 指数证券投资基 金（QDII-LOF）	2014-04-01	-	17 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

	<p>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；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</p>			<p>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)。</p>
--	---	--	--	---

	联接基金的基金经理；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 13 次，其中 7 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 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合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

本基金的业绩基准是中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ ，本基金主要采用完全复制法来跟踪业绩基准。

（1）投资策略

作为 ETF 联接基金，本基金秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证 500ETF 及指数成份股等，间接复制指数，同时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，本基金跟踪误差来源主要是成份股调整、申购赎回和停牌股票估值调整等因素。

2021 年上半年，A 股总体呈现震荡上行趋势，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%，创业板指数上涨 17.22%，成长风格相对价值风格占优。

上半年，国内经济运行平稳，海外主要经济体生产恢复，加工贸易持续改善；低碳行动、保供稳价、经济结构升级等政策的推进带来了进口增量，2021 年前 5 个月进出口总值同比增长近 3 成。汽车外销火爆，出口同比数据近乎翻番，同时从汽车制造到消费电子行业，芯片短缺已经演变成全球性重大问题，也带来相关行业投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 8.24%，C 类基金份额净值增长率为 8.13%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

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，伴随央行全面降准，企业融资成本将有望下调，叠加监管层保供稳价措施见效，上游通胀压力缓释，下游制造业盈利将逐步好转。此外，内需将加速修复、接棒外需。5 月、6 月社零数据环比修复力度较大，下半年居民消费动能有望持续释放，利好相关行业上市公司。

中证 500 指数有着高波动、高收益的特征，因此就中长期表现而言，中证 500 指数收益相较大部分市场宽基指数存在一定优势；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联接基金(LOF)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联接基金(LOF)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联接基金(LOF)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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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联接基金(LOF)2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	163,943,838.23	169,059,101.78
结算备付金		6,628,280.22	28,150,551.19
存出保证金		4,224,913.54	13,666,250.90
交易性金融资产	6.4.7.2	2,190,274,204.87	2,212,110,148.13
其中：股票投资		63,265,943.12	38,243,171.61
基金投资		2,126,988,054.15	2,173,792,778.52
债券投资		20,207.60	74,198.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		69,014.53	-
应收利息	6.4.7.5	16,588.88	25,224.19
应收股利		-	-
应收申购款		4,400,378.45	2,140,545.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	5,760.00	3,896,994.62
资产总计		2,369,562,978.72	2,429,048,816.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,861,737.74	8,432,624.57
应付赎回款		11,371,044.43	9,724,884.31
应付管理人报酬		89,664.49	86,698.75
应付托管费		17,932.89	17,339.78
应付销售服务费		157,032.80	168,300.20
应付交易费用	6.4.7.7	40,676.95	237,076.48
应交税费		318,711.98	1,804,443.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,755.83	206,576.34
负债合计		18,007,557.11	20,677,943.66
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,715,633,401.71	1,895,934,224.44
未分配利润	6.4.7.10	635,922,019.90	512,436,648.31
所有者权益合计		2,351,555,421.61	2,408,370,872.75
负债和所有者权益总计		2,369,562,978.72	2,429,048,816.41

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发中证 500ETF 联接 (LOF) A 基金份额净值人民币 1.5190 元，基金份额总额 892,754,842.24 份；广发中证 500ETF 联接 C 基金份额净值人民币 1.2098 元，基金份额总额 822,878,559.47 份；总份额总额 1,715,633,401.71 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		186,531,714.20	487,491,642.80
1.利息收入		397,543.18	1,201,364.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	397,513.74	1,201,351.27
债券利息收入		29.44	12.94
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		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		100,840,801.96	188,015,986.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	871,811.95	3,207,620.51
基金投资收益	6.4.7.13	93,584,242.63	171,432,197.36
债券投资收益	6.4.7.14	13,245.67	5,149.43
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	5,942,249.80	13,262,601.93
股利收益	6.4.7.16	429,251.91	108,417.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	84,922,812.19	296,760,106.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	370,556.87	1,514,185.10
减：二、费用		2,183,397.07	4,794,855.70
1. 管理人报酬		511,996.34	843,646.03
2. 托管费		102,399.22	168,729.15
3. 销售服务费		931,100.86	2,366,609.98
4. 交易费用	6.4.7.19	145,240.62	744,691.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		358,295.43	530,155.03
7. 其他费用	6.4.7.20	134,364.60	141,024.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		184,348,317.13	482,696,787.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		184,348,317.13	482,696,787.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,895,934,224.44	512,436,648.31	2,408,370,872.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	184,348,317.13	184,348,317.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-180,300,822.73	-60,862,945.54	-241,163,768.27

其中：1.基金申购款	488,162,687.20	110,464,645.37	598,627,332.57
2.基金赎回款	-668,463,509.93	-171,327,590.91	-839,791,100.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,715,633,401.71	635,922,019.90	2,351,555,421.61
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,416,718,851.39	-18,127,858.94	4,398,590,992.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	482,696,787.10	482,696,787.10
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）	-1,217,150,039.58	-24,775,087.30	-1,241,925,126.88
其中：1.基金申购款	2,512,161,969.66	38,207,087.92	2,550,369,057.58
2.基金赎回款	-3,729,312,009.24	-62,982,175.22	-3,792,294,184.46
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）	3,199,568,811.81	439,793,840.86	3,639,362,652.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（原名为广发中证 500 指数证券投资基金（LOF），以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2009]982 号文核准，由基金发起人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 指数证券投资基金基金合同》（后更名为《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》，以下简称“基金合

同”)发起,于 2009 年 11 月 26 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。本基金已向中国证监会备案,并于 2009 年 11 月 26 日获得确认。

本基金募集期为 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 20 日,为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币 8,635,797,223.98 元,有效认购户数为 107,956 户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 634,322.52 元,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有限公司验资。基金合同于 2009 年 11 月 26 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,635,797,223.98 份。

根据本基金的管理人于 2013 年 10 月 11 日发布的《关于广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效公告》,本基金变更为广发中证 500ETF 的联接基金,允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务,并相应地对基金合同中有关本基金名称、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改。《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》修订为《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》,原《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》同日起失效。

本基金于 2016 年 6 月 15 日起,经基金管理人与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,在原有份额的基础上增设场外 C 类基金份额,原份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额注册登记业务办理机构为中国证券登记结算有限责任,在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,而不计提销售服务费;C 类基金份额注册登记业务办理机构为广发基金管理有限公司,在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式。本基金 C 类基金份额在场外申购和赎回。两类基金份额分别设置代码,并分别计算基金份额净值。两类份额之间不得相互转换。

本基金于 2016 年 6 月 15 日起增设场外 C 类基金份额,原份额转为 A 类份额。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增

值税纳税人；

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	163,943,838.23
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	163,943,838.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	56,024,303.65	63,265,943.12	7,241,639.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	19,000.00	20,207.60
	银行间市场	-	-
	合计	19,000.00	20,207.60
资产支持证券	-	-	-
基金	1,638,883,272.20	2,126,988,054.15	488,104,781.95
其他	-	-	-
合计	1,694,926,575.85	2,190,274,204.87	495,347,629.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	26,531,845.28	-	-	-
其中：股指期货投资	26,531,845.28	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	26,531,845.28	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。本基金本报告期末具体投资情况如下：股指期货 IC2107 买入持仓量 18 手，合约市值人民币 24,361,920.00 元，公允价

值变动人民币 498,074.72 元。股指期货 IC2108 买入持仓量 2 手，合约市值人民币 2,684,800.00 元，公允价值变动人民币 16,800.00 元。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,244.75
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	68.04
应收结算备付金利息	2,270.99
应收债券利息	5.10
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	16,588.88

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	5,760.00
合计	5,760.00

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	40,676.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,676.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24,799.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	125,956.09
合计	150,755.83

6.4.7.9 实收基金

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,008,956,719.39	1,008,956,719.39
本期申购	142,860,507.56	142,860,507.56
本期赎回（以“-”号填列）	-259,062,384.71	-259,062,384.71
本期末	892,754,842.24	892,754,842.24

广发中证 500ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	886,977,505.05	886,977,505.05
本期申购	345,302,179.64	345,302,179.64
本期赎回（以“-”号填列）	-409,401,125.22	-409,401,125.22
本期末	822,878,559.47	822,878,559.47

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	1,222,530,721.83	-815,502,302.66	407,028,419.17
本期利润	58,909,375.45	49,239,760.69	108,149,136.14
本期基金份额交易产生的变动数	-143,350,425.85	91,471,398.07	-51,879,027.78
其中：基金申购款	178,272,980.07	-116,278,988.41	61,993,991.66
基金赎回款	-321,623,405.92	207,750,386.48	-113,873,019.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,138,089,671.43	-674,791,143.90	463,298,527.53

广发中证 500ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	92,909,838.74	12,498,390.40	105,408,229.14
本期利润	40,516,129.49	35,683,051.50	76,199,180.99
本期基金份额交易产生的变动数	-6,741,632.88	-2,242,284.88	-8,983,917.76
其中：基金申购款	46,896,647.33	1,574,006.38	48,470,653.71
基金赎回款	-53,638,280.21	-3,816,291.26	-57,454,571.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,684,335.35	45,939,157.02	172,623,492.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	252,527.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,874.62
结算备付金利息收入	141,094.78
其他	2,016.45
合计	397,513.74

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,521,346.39
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-649,534.44
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	871,811.95

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,962,905.14
减：卖出股票成本总额	9,441,558.75
买卖股票差价收入	1,521,346.39

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	103,026,400.00
减：现金支付申购款总额	54,902,591.21
减：申购股票成本总额	48,773,343.23
申购差价收入	-649,534.44

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	488,501,168.31
减：卖出/赎回基金成本总额	394,916,925.68
基金投资收益	93,584,242.63

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,245.67
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	13,245.67

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	119,976.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	106,700.00

减：应收利息总额	31.03
买卖债券差价收入	13,245.67

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	5,942,249.80

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	429,251.91
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	429,251.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	86,322,609.47
——股票投资	7,112,935.70
——债券投资	-3,190.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	79,212,864.17
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,399,797.28
——权证投资	-
——股指期货投资	-1,399,797.28
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	84,922,812.19

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	346,796.77
基金转换费收入	23,760.10
合计	370,556.87

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	95,629.28
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	30,931.19
其中：申购费	1,352.23
赎回费	-
其他	29,578.96
期货交易费用	18,680.15
合计	145,240.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,408.51
上市费	29,752.78
合计	134,364.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
----------	-----------------

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	10,410,684.04	3.04%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	36,900.00	20.98%	-	-

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	201,734,627.50	9.63%

司				
---	--	--	--	--

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	9,661.54	3.03%	-	-

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。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	511,996.34	843,646.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,043,317.39	1,410,073.18

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。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 为前一日基金资产净值－前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	102,399.22	168,729.15

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 年费率计提。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 为前一日基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C	合计
广发基金管理有限公司	-	581,569.89	581,569.89
广发证券股份有限公司	-	4,999.78	4,999.78
合计	-	586,569.67	586,569.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证500ETF联接	广发中证500ETF联接C	合计

	接(LOF)A		
广发基金管理有限公司	-	1,777,042.47	1,777,042.47
广发证券股份有限公司	-	4,196.41	4,196.41
合计	-	1,781,238.88	1,781,238.88

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40%（根据《广发基金管理有限公司关于旗下部分基金实施销售费率优惠的公告》，本基金自 2018 年 5 月 16 日起适用 0.20% 优惠费率，结束时间届时将另行公告）年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \text{（优惠费率）} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，经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划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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。

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。

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	广发中证500ETF 联接(LOF)A	广发中证500ETF联 接C	广发中证500ETF联 接(LOF)A	广发中证500ETF联 接C
报告期初持有的基	-	-	32,422,670.38	-

金份额				
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	32,422,670.38	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发中证 500ETF 联接 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	163,943,838.23	252,527.89	260,476,995.38	987,389.96

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

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有 1,052,599,621.00 份目标 ETF 基金广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额（2020 年 6 月 30 日：1,972,682,221.00 份），占其总份额的比例为 81.41%（2020 年 6 月 30 日：84.70%）。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。

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（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股流通受限	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
113051	节能转债	2021-06-22	2021-07-22	新债流通受限	100.00	100.00	100.00	10,000.00	10,000.00	-

注：截至本报告期末 2021 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权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项停牌	3.05	2021-07-14	3.36	26,000.00	86,080.00	79,300.00	-

600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	6,500.00	193,841.00	366,275.00	-
--------	-----	------------	--------	-------	------------	-------	----------	------------	------------	---

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 2021 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 2021 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 2021 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，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	57,000.00
AAA 以下	20,207.60	17,198.00
未评级	-	-
合计	20,207.60	74,198.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分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、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	163,943,838.23	-	-	-	163,943,838.23
结算备付金	6,628,280.22	-	-	-	6,628,280.22
存出保证金	4,224,913.54	-	-	-	4,224,913.54
交易性金融资产	20,207.60	-	-	2,190,253,997.27	2,190,274,204.87
应收证券清算款	-	-	-	69,014.53	69,014.53
应收利息	-	-	-	16,588.88	16,588.88
应收申购款	1,067,417.14	-	-	3,332,961.31	4,400,378.45
其他资产	-	-	-	5,760.00	5,760.00
资产总计	175,884,656.73	-	-	2,193,678,321.99	2,369,562,978.72
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	5,861,737.74	5,861,737.74
应付赎回款	-	-	-	11,371,044.43	11,371,044.43
应付管理人报酬	-	-	-	89,664.49	89,664.49
应付托管费	-	-	-	17,932.89	17,932.89
应付销售服务费	-	-	-	157,032.80	157,032.80
应付交易费用	-	-	-	40,676.95	40,676.95
应交税费	-	-	-	318,711.98	318,711.98
其他负债	-	-	-	150,755.83	150,755.83
负债总计	-	-	-	18,007,557.11	18,007,557.11
利率敏感度缺口	175,884,656.73	-	-	2,175,670,764.88	2,351,555,421.61
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产：					
银行存款	169,059,101.78	-	-	-	169,059,101.78
结算备付金	28,150,551.19	-	-	-	28,150,551.19
存出保证金	13,666,250.90	-	-	-	13,666,250.90
交易性金融资产	74,198.00	-	-	2,212,035,950.13	2,212,110,148.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	25,224.19	25,224.19
应收申购款	70,575.38	-	-	2,069,970.22	2,140,545.60
其他资产	-	-	-	3,896,994.62	3,896,994.62
资产总计	211,020,677.25	-	-	2,218,028,139.16	2,429,048,816.41
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	8,432,624.57	8,432,624.57
应付赎回款	-	-	-	9,724,884.31	9,724,884.31
应付管理人报酬	-	-	-	86,698.75	86,698.75
应付托管费	-	-	-	17,339.78	17,339.78
应付销售服务费	-	-	-	168,300.20	168,300.20
应付交易费用	-	-	-	237,076.48	237,076.48
应交税费	-	-	-	1,804,443.23	1,804,443.23
其他负债	-	-	-	206,576.34	206,576.34
负债总计	-	-	-	20,677,943.66	20,677,943.66
利率敏感度缺口	211,020,677.25	-	-	2,197,350,195.50	2,408,370,872.75

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，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、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	63,265,943.12	2.69	38,243,171.61	1.59
交易性金融资产—基金投资	2,126,988,054.15	90.45	2,173,792,778.52	90.26
交易性金融资产—债券投资	20,207.60	0.00	74,198.00	0.00
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	2,190,274,204.87	93.14	2,212,110,148.13	91.85

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	117,966,249.21	111,305,805.30
	下降 5%	-117,966,249.21	-111,305,805.30

注：上年度末的假设条件为“除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变”。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公

允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,184,652,240.83 元，属于第二层次的余额为人民币 5,621,964.04 元，无属于第三层次的金額（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 2,211,983,338.59 元，属于第二层次的余额为人民币 126,809.54 元，无属于第三层次的金額）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	63,265,943.12	2.67
	其中：股票	63,265,943.12	2.67
2	基金投资	2,126,988,054.15	89.76
3	固定收益投资	20,207.60	0.00
	其中：债券	20,207.60	0.00
	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	170,572,118.45	7.20
8	其他各项资产	8,716,655.40	0.37
9	合计	2,369,562,978.72	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	2,126,988,054.15	90.45

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	471,159.00	0.02
B	采矿业	1,783,631.00	0.08
C	制造业	38,605,384.69	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,250,970.60	0.27
E	建筑业	711,246.44	0.03
F	批发和零售业	1,984,902.10	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,090,514.60	0.05
H	住宿和餐饮业	241,124.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,882,359.79	0.21
J	金融业	2,555,371.10	0.11
K	房地产业	1,354,336.00	0.06

L	租赁和商务服务业	679,462.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	515,554.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	490,892.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	33,352.80	0.00
Q	卫生和社会工作	564,772.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	560,739.00	0.02
S	综合	490,172.00	0.02
	合计	63,265,943.12	2.69

7.3.2 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。

7.4 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	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.22
2	300274	阳光电源	9,100	1,047,046.00	0.04
3	603444	吉比特	1,300	689,000.00	0.03
4	603486	科沃斯	2,600	593,008.00	0.03
5	002709	天赐材料	5,140	547,821.20	0.02
6	600132	重庆啤酒	2,600	514,670.00	0.02
7	300012	华测检测	14,300	455,884.00	0.02
8	600089	特变电工	32,500	417,625.00	0.02
9	603290	斯达半导	1,300	416,000.00	0.02
10	603882	金域医学	2,600	415,402.00	0.02
11	300496	中科创达	2,600	408,356.00	0.02
12	300595	欧普康视	3,900	403,845.00	0.02
13	000009	中国宝安	22,100	403,767.00	0.02
14	600426	华鲁恒升	13,000	402,350.00	0.02
15	002074	国轩高科	9,100	396,396.00	0.02
16	600460	士兰微	6,500	366,275.00	0.02
17	002568	百润股份	3,640	345,035.60	0.01
18	601233	桐昆股份	14,300	344,487.00	0.01
19	002821	凯莱英	900	335,340.00	0.01
20	601966	玲珑轮胎	7,553	330,368.22	0.01

21	603345	安井食品	1,300	330,226.00	0.01
22	603806	福斯特	3,120	328,005.60	0.01
23	600143	金发科技	15,600	325,416.00	0.01
24	603737	三棵树	1,820	320,320.00	0.01
25	300285	国瓷材料	6,500	316,875.00	0.01
26	002340	格林美	32,500	303,875.00	0.01
27	002185	华天科技	19,500	300,105.00	0.01
28	300207	欣旺达	9,100	296,296.00	0.01
29	601799	星宇股份	1,300	293,436.00	0.01
30	688099	晶晨股份	2,600	291,720.00	0.01
31	300316	晶盛机电	5,200	262,600.00	0.01
32	688002	睿创微纳	2,600	259,558.00	0.01
33	600079	人福医药	9,100	257,257.00	0.01
34	603605	珀莱雅	1,300	255,723.00	0.01
35	002791	坚朗五金	1,300	252,265.00	0.01
36	600733	北汽蓝谷	18,200	245,336.00	0.01
37	600885	宏发股份	3,900	244,530.00	0.01
38	600884	杉杉股份	10,400	242,528.00	0.01
39	002353	杰瑞股份	5,200	232,440.00	0.01
40	600219	南山铝业	62,400	224,640.00	0.01
41	002444	巨星科技	6,500	221,520.00	0.01
42	000547	航天发展	11,700	220,779.00	0.01
43	600739	辽宁成大	10,400	216,424.00	0.01
44	002648	卫星石化	5,460	213,977.40	0.01
45	300146	汤臣倍健	6,500	213,850.00	0.01
46	600563	法拉电子	1,300	205,868.00	0.01
47	600392	盛和资源	11,700	203,112.00	0.01
48	601168	西部矿业	16,900	201,617.00	0.01
49	002138	顺络电子	5,200	201,604.00	0.01
50	603816	顾家家居	2,600	200,928.00	0.01
51	600862	中航高科	6,500	200,070.00	0.01
52	601099	太平洋	58,500	198,315.00	0.01
53	002223	鱼跃医疗	5,200	198,276.00	0.01
54	300699	光威复材	2,600	197,470.00	0.01
55	000636	风华高科	6,500	196,430.00	0.01
56	002507	涪陵榨菜	5,200	195,832.00	0.01
57	000830	鲁西化工	10,400	194,792.00	0.01
58	002030	达安基因	9,100	193,284.00	0.01
59	002625	光启技术	9,100	189,371.00	0.01
60	002797	第一创业	26,000	185,640.00	0.01
61	002250	联化科技	6,500	181,350.00	0.01
62	603893	瑞芯微	1,300	181,298.00	0.01
63	002385	大北农	26,000	176,800.00	0.01
64	603589	口子窖	2,600	175,994.00	0.01

65	300253	卫宁健康	10,800	175,716.00	0.01
66	600704	物产中大	22,100	173,927.00	0.01
67	002078	太阳纸业	13,000	173,550.00	0.01
68	601127	小康股份	2,600	173,342.00	0.01
69	000630	铜陵有色	63,700	173,264.00	0.01
70	603659	璞泰来	1,260	172,116.00	0.01
71	300088	长信科技	20,800	171,808.00	0.01
72	002075	沙钢股份	15,600	170,196.00	0.01
73	002013	中航机电	16,900	170,183.00	0.01
74	300357	我武生物	2,600	166,712.00	0.01
75	002064	华峰化学	11,700	166,140.00	0.01
76	600699	均胜电子	6,500	165,880.00	0.01
77	002985	北摩高科	1,700	165,750.00	0.01
78	000039	中集集团	9,100	165,438.00	0.01
79	600779	水井坊	1,300	164,255.00	0.01
80	300463	迈克生物	3,900	164,151.00	0.01
81	000301	东方盛虹	7,800	163,020.00	0.01
82	600549	厦门钨业	7,800	162,474.00	0.01
83	002028	思源电气	5,200	160,108.00	0.01
84	002407	多氟多	4,500	159,930.00	0.01
85	600201	生物股份	9,100	158,795.00	0.01
86	601997	贵阳银行	22,100	158,236.00	0.01
86	600171	上海贝岭	5,200	158,236.00	0.01
87	300001	特锐德	5,200	156,572.00	0.01
88	600315	上海家化	2,600	156,364.00	0.01
89	300009	安科生物	10,400	154,960.00	0.01
90	000807	云铝股份	13,000	154,700.00	0.01
91	002212	天融信	7,800	154,206.00	0.01
92	000988	华工科技	6,500	152,880.00	0.01
92	000739	普洛药业	5,200	152,880.00	0.01
93	002273	水晶光电	10,400	152,776.00	0.01
94	603517	绝味食品	1,800	151,722.00	0.01
95	002603	以岭药业	5,200	151,632.00	0.01
96	000983	山西焦煤	18,200	151,242.00	0.01
97	600316	洪都航空	3,900	150,072.00	0.01
98	300244	迪安诊断	3,900	149,370.00	0.01
99	000021	深科技	7,800	149,292.00	0.01
100	600754	锦江酒店	2,600	148,070.00	0.01
101	002465	海格通信	15,600	147,576.00	0.01
102	002092	中泰化学	14,300	146,861.00	0.01
103	600298	安琪酵母	2,700	146,826.00	0.01
104	000825	太钢不锈	19,500	146,055.00	0.01
105	601689	拓普集团	3,900	145,977.00	0.01
106	000960	锡业股份	9,100	145,873.00	0.01

107	600418	江淮汽车	11,700	145,431.00	0.01
108	600486	扬农化工	1,300	145,301.00	0.01
109	601128	常熟银行	23,400	145,080.00	0.01
109	600516	方大炭素	19,500	145,080.00	0.01
110	002690	美亚光电	2,600	144,976.00	0.01
111	688088	虹软科技	2,600	144,950.00	0.01
112	002511	中顺洁柔	5,200	143,260.00	0.01
113	002920	德赛西威	1,300	143,104.00	0.01
114	600380	健康元	10,400	142,792.00	0.01
115	300070	碧水源	19,500	142,545.00	0.01
116	600867	通化东宝	11,700	139,698.00	0.01
117	600166	福田汽车	40,300	139,035.00	0.01
118	002414	高德红外	5,040	139,003.20	0.01
119	000750	国海证券	32,500	137,800.00	0.01
120	600038	中直股份	2,600	137,124.00	0.01
121	002131	利欧股份	58,500	136,890.00	0.01
122	600879	航天电子	18,200	136,864.00	0.01
123	300630	普利制药	2,600	136,240.00	0.01
124	002080	中材科技	5,200	136,084.00	0.01
125	000975	银泰黄金	14,300	135,993.00	0.01
126	002152	广电运通	10,400	135,512.00	0.01
127	600529	山东药玻	3,900	132,405.00	0.01
128	600909	华安证券	23,660	131,786.20	0.01
129	300223	北京君正	1,300	131,196.00	0.01
130	600827	百联股份	6,500	130,975.00	0.01
131	002439	启明星辰	4,500	130,545.00	0.01
132	000513	丽珠集团	2,600	130,052.00	0.01
133	000050	深天马 A	9,100	129,038.00	0.01
134	600511	国药股份	3,900	128,934.00	0.01
135	300115	长盈精密	6,240	128,544.00	0.01
136	002294	信立泰	3,900	128,310.00	0.01
137	600642	申能股份	20,800	127,712.00	0.01
138	300474	景嘉微	1,300	127,296.00	0.01
139	601866	中远海发	33,800	126,750.00	0.01
140	002572	索菲亚	5,200	125,840.00	0.01
141	000998	隆平高科	7,800	125,112.00	0.01
142	002156	通富微电	5,200	125,008.00	0.01
143	688029	南微医学	400	124,676.00	0.01
144	002299	圣农发展	5,200	124,176.00	0.01
145	600161	天坛生物	3,600	123,300.00	0.01
146	601699	潞安环能	10,400	122,824.00	0.01
147	002500	山西证券	18,200	122,122.00	0.01
148	300296	利亚德	15,600	121,992.00	0.01
149	603866	桃李面包	3,900	121,680.00	0.01

150	000623	吉林敖东	7,800	120,822.00	0.01
151	600415	小商品城	23,400	120,510.00	0.01
152	688321	微芯生物	2,600	120,094.00	0.01
153	000012	南玻 A	11,700	119,808.00	0.01
153	600188	兖州煤业	7,800	119,808.00	0.01
154	600845	宝信软件	2,340	119,106.00	0.01
155	600895	张江高科	6,500	118,755.00	0.01
156	002670	国盛金控	10,400	118,456.00	0.01
157	600667	太极实业	13,000	118,300.00	0.01
158	600765	中航重机	5,200	117,780.00	0.01
159	603858	步长制药	5,200	116,948.00	0.00
160	600256	广汇能源	35,100	116,883.00	0.00
161	000878	云南铜业	9,100	116,753.00	0.00
162	600153	建发股份	14,300	115,830.00	0.00
163	002831	裕同科技	3,900	115,791.00	0.00
164	600535	天士力	7,800	115,518.00	0.00
165	603198	迎驾贡酒	2,600	115,180.00	0.00
166	600801	华新水泥	6,500	114,205.00	0.00
167	300168	万达信息	7,800	113,880.00	0.00
167	002221	东华能源	10,400	113,880.00	0.00
168	600008	首创环保	37,700	113,477.00	0.00
169	002081	金螳螂	14,300	113,256.00	0.00
170	002926	华西证券	11,700	112,671.00	0.00
171	600859	王府井	3,900	112,632.00	0.00
172	002019	亿帆医药	6,500	112,125.00	0.00
173	002557	洽洽食品	2,600	112,060.00	0.00
174	603927	中科软	2,600	111,670.00	0.00
175	002174	游族网络	6,500	111,605.00	0.00
176	600155	华创阳安	10,400	111,280.00	0.00
177	300024	机器人	10,400	110,968.00	0.00
178	600060	海信视像	6,500	109,850.00	0.00
179	300482	万孚生物	1,690	109,326.10	0.00
180	002390	信邦制药	10,400	108,992.00	0.00
181	002373	千方科技	6,500	108,550.00	0.00
182	002382	蓝帆医疗	5,200	108,420.00	0.00
183	000738	航发控制	5,200	108,316.00	0.00
184	002683	宏大爆破	3,900	108,303.00	0.00
185	000997	新大陆	6,500	107,835.00	0.00
186	000718	苏宁环球	13,000	107,770.00	0.00
187	600170	上海建工	39,000	107,640.00	0.00
188	600372	中航电子	6,500	107,575.00	0.00
189	002372	伟星新材	5,200	107,484.00	0.00
190	000027	深圳能源	11,700	107,289.00	0.00
191	300418	昆仑万维	6,500	106,470.00	0.00

192	600039	四川路桥	16,900	105,963.00	0.00
193	601717	郑煤机	9,100	105,833.00	0.00
194	002127	南极电商	10,800	105,516.00	0.00
195	601615	明阳智能	6,500	105,235.00	0.00
196	600409	三友化工	10,400	105,144.00	0.00
197	002966	苏州银行	14,300	105,105.00	0.00
198	000999	华润三九	3,900	104,325.00	0.00
199	002595	豪迈科技	3,900	104,130.00	0.00
199	601005	重庆钢铁	39,000	104,130.00	0.00
200	002506	协鑫集成	29,900	104,052.00	0.00
201	600160	巨化股份	11,700	103,428.00	0.00
202	300212	易华录	3,829	103,038.39	0.00
203	000932	华菱钢铁	15,600	102,960.00	0.00
204	601865	福莱特	2,600	102,778.00	0.00
205	300618	寒锐钴业	1,300	102,492.00	0.00
206	300058	蓝色光标	16,900	102,245.00	0.00
207	002268	卫士通	5,200	101,296.00	0.00
208	002195	二三四五	49,400	100,282.00	0.00
209	300271	华宇软件	5,200	100,100.00	0.00
210	603260	合盛硅业	1,300	99,983.00	0.00
211	000060	中金岭南	22,100	99,892.00	0.00
212	600875	东方电气	9,100	99,827.00	0.00
213	300315	掌趣科技	23,400	99,450.00	0.00
214	000540	中天金融	36,400	99,372.00	0.00
215	300017	网宿科技	16,900	98,865.00	0.00
215	000686	东北证券	11,700	98,865.00	0.00
216	002925	盈趣科技	2,540	98,831.40	0.00
217	603786	科博达	1,300	98,150.00	0.00
218	600141	兴发集团	5,200	97,916.00	0.00
218	601992	金隅集团	36,400	97,916.00	0.00
219	300558	贝达药业	900	97,416.00	0.00
220	600598	北大荒	6,500	97,240.00	0.00
221	002408	齐翔腾达	7,800	96,876.00	0.00
222	300166	东方国信	7,800	96,408.00	0.00
223	600325	华发股份	14,300	96,382.00	0.00
224	000401	冀东水泥	7,800	96,330.00	0.00
225	600755	厦门国贸	11,700	96,057.00	0.00
226	002281	光迅科技	3,900	95,940.00	0.00
227	600497	驰宏锌锗	22,100	95,251.00	0.00
228	600528	中铁工业	11,700	94,770.00	0.00
229	002901	大博医疗	1,300	94,757.00	0.00
230	002429	兆驰股份	15,600	94,692.00	0.00
231	603077	和邦生物	45,500	94,640.00	0.00
232	600839	四川长虹	32,500	94,575.00	0.00

233	600567	山鹰国际	27,300	94,185.00	0.00
234	600521	华海药业	4,500	93,960.00	0.00
235	603712	七一二	2,600	93,860.00	0.00
236	600258	首旅酒店	3,900	93,054.00	0.00
237	000898	鞍钢股份	20,800	92,560.00	0.00
237	600282	南钢股份	26,000	92,560.00	0.00
238	600500	中化国际	11,700	91,962.00	0.00
239	600737	中粮糖业	9,100	91,091.00	0.00
240	300182	捷成股份	18,200	90,818.00	0.00
241	002010	传化智联	11,700	90,207.00	0.00
242	000158	常山北明	7,800	89,622.00	0.00
243	000709	河钢股份	36,400	89,544.00	0.00
244	600820	隧道股份	16,900	89,401.00	0.00
245	603000	人民网	5,200	89,388.00	0.00
246	600808	马钢股份	20,800	89,232.00	0.00
247	603568	伟明环保	3,900	89,037.00	0.00
248	002004	华邦健康	14,300	88,803.00	0.00
249	002745	木林森	6,500	87,100.00	0.00
250	600728	佳都科技	11,700	86,697.00	0.00
251	600580	卧龙电驱	6,500	86,450.00	0.00
252	000629	攀钢钒钛	37,700	86,333.00	0.00
253	000729	燕京啤酒	11,700	84,708.00	0.00
253	600398	海澜之家	11,700	84,708.00	0.00
254	000488	晨鸣纸业	10,400	84,656.00	0.00
255	002056	横店东磁	6,500	84,500.00	0.00
256	002242	九阳股份	2,600	84,474.00	0.00
257	600970	中材国际	9,100	83,447.00	0.00
258	002396	星网锐捷	3,900	83,265.00	0.00
259	600216	浙江医药	5,200	83,252.00	0.00
260	002191	劲嘉股份	7,800	82,992.00	0.00
260	002203	海亮股份	7,800	82,992.00	0.00
261	002124	天邦股份	11,700	82,017.00	0.00
262	000930	中粮科技	9,100	81,991.00	0.00
263	300002	神州泰岳	16,900	81,965.00	0.00
264	600881	亚泰集团	28,600	81,510.00	0.00
265	000598	兴蓉环境	15,600	81,276.00	0.00
266	000581	威孚高科	3,900	81,237.00	0.00
267	603355	莱克电气	1,300	80,899.00	0.00
268	600260	凯乐科技	9,100	80,808.00	0.00
269	600022	山东钢铁	46,800	80,496.00	0.00
270	000959	首钢股份	14,300	80,366.00	0.00
271	601456	国联证券	5,200	80,080.00	0.00
272	600782	新钢股份	14,300	79,794.00	0.00
273	000690	宝新能源	15,600	79,716.00	0.00

274	600985	淮北矿业	6,500	79,365.00	0.00
275	603885	吉祥航空	5,200	79,352.00	0.00
276	601106	中国一重	23,400	79,326.00	0.00
277	600811	东方集团	26,000	79,300.00	0.00
278	600273	嘉化能源	9,100	79,170.00	0.00
279	600967	内蒙一机	7,800	78,936.00	0.00
280	000887	中鼎股份	6,500	78,520.00	0.00
281	002368	太极股份	3,900	78,234.00	0.00
282	603638	艾迪精密	1,820	78,023.40	0.00
283	300251	光线传媒	7,200	77,832.00	0.00
284	601880	辽港股份	45,500	77,805.00	0.00
285	002563	森马服饰	6,500	77,675.00	0.00
286	000883	湖北能源	16,900	77,571.00	0.00
287	000778	新兴铸管	20,800	77,376.00	0.00
288	600348	华阳股份	10,400	77,168.00	0.00
289	002867	周大生	3,900	77,103.00	0.00
290	603338	浙江鼎力	1,300	76,297.00	0.00
291	600718	东软集团	7,800	76,284.00	0.00
292	002048	宁波华翔	3,900	76,050.00	0.00
293	600908	无锡银行	13,000	75,400.00	0.00
294	603707	健友股份	1,800	75,150.00	0.00
295	600446	金证股份	5,200	75,088.00	0.00
296	601179	中国西电	18,200	74,984.00	0.00
297	600037	歌华有线	7,800	74,958.00	0.00
298	600597	光明乳业	5,200	74,932.00	0.00
299	000528	柳工	9,100	74,620.00	0.00
300	000970	中科三环	7,800	74,490.00	0.00
300	002183	怡亚通	13,000	74,490.00	0.00
301	002701	奥瑞金	14,300	73,502.00	0.00
302	600329	中新药业	2,600	73,034.00	0.00
303	002085	万丰奥威	13,000	72,800.00	0.00
304	601118	海南橡胶	14,300	72,787.00	0.00
305	600064	南京高科	7,800	72,462.00	0.00
306	600435	北方导航	9,100	72,254.00	0.00
307	600026	中远海能	11,700	72,072.00	0.00
308	002807	江阴银行	18,200	71,708.00	0.00
309	002266	浙富控股	14,300	71,357.00	0.00
310	000089	深圳机场	9,100	70,707.00	0.00
311	600410	华胜天成	9,100	70,616.00	0.00
312	000402	金融街	10,400	70,200.00	0.00
313	002110	三钢闽光	10,400	70,096.00	0.00
314	000519	中兵红箭	6,500	69,680.00	0.00
315	600167	联美控股	7,800	69,654.00	0.00
316	600572	康恩贝	15,600	69,264.00	0.00

317	603883	老百姓	1,300	68,484.00	0.00
318	002705	新宝股份	2,600	68,250.00	0.00
319	603228	景旺电子	2,600	68,120.00	0.00
320	002387	维信诺	6,500	67,795.00	0.00
321	000877	天山股份	5,200	67,756.00	0.00
322	603983	丸美股份	1,300	67,743.00	0.00
323	002128	露天煤业	6,500	67,665.00	0.00
324	300072	三聚环保	11,700	67,158.00	0.00
325	001914	招商积余	3,900	67,002.00	0.00
326	002233	塔牌集团	6,500	66,820.00	0.00
327	002002	鸿达兴业	16,900	66,417.00	0.00
328	300026	红日药业	15,600	66,300.00	0.00
329	000990	诚志股份	5,200	66,196.00	0.00
330	000400	许继电气	5,200	65,832.00	0.00
331	601598	中国外运	13,000	65,650.00	0.00
332	603939	益丰药房	1,170	65,625.30	0.00
333	600376	首开股份	11,700	65,520.00	0.00
334	600120	浙江东方	15,210	65,098.80	0.00
335	000090	天健集团	11,700	64,701.00	0.00
336	600373	中文传媒	6,500	64,090.00	0.00
337	601975	招商南油	29,900	63,986.00	0.00
338	000685	中山公用	7,800	63,648.00	0.00
339	601333	广深铁路	29,900	63,388.00	0.00
340	600307	酒钢宏兴	27,300	63,336.00	0.00
341	601016	节能风电	16,900	63,206.00	0.00
342	600056	中国医药	5,200	63,180.00	0.00
343	600804	鹏博士	13,000	62,920.00	0.00
344	600021	上海电力	9,100	62,881.00	0.00
345	300376	易事特	7,800	62,712.00	0.00
346	601000	唐山港	26,000	62,660.00	0.00
347	603650	彤程新材	1,300	62,530.00	0.00
348	601200	上海环境	5,200	62,244.00	0.00
349	600195	中牧股份	5,200	62,192.00	0.00
350	000559	万向钱潮	11,700	62,127.00	0.00
351	600507	方大特钢	9,100	61,698.00	0.00
352	300133	华策影视	10,400	61,568.00	0.00
353	002249	大洋电机	11,700	61,425.00	0.00
354	600707	彩虹股份	6,500	61,165.00	0.00
355	002155	湖南黄金	7,800	60,450.00	0.00
356	600126	杭钢股份	11,700	60,021.00	0.00
357	600645	中源协和	2,600	59,670.00	0.00
358	600158	中体产业	5,200	59,332.00	0.00
359	603719	良品铺子	1,300	58,500.00	0.00
360	000800	一汽解放	5,400	58,428.00	0.00

361	600673	东阳光	13,000	58,370.00	0.00
362	600648	外高桥	3,900	57,642.00	0.00
363	002440	闰土股份	6,500	57,525.00	0.00
364	601098	中南传媒	6,500	57,330.00	0.00
365	002936	郑州银行	15,600	57,252.00	0.00
366	601678	滨化股份	7,200	56,952.00	0.00
367	601860	紫金银行	15,600	56,628.00	0.00
368	002839	张家港行	10,400	56,576.00	0.00
369	300257	开山股份	3,900	56,043.00	0.00
370	600582	天地科技	14,300	55,770.00	0.00
371	002217	合力泰	15,600	55,692.00	0.00
372	000758	中色股份	11,700	55,575.00	0.00
373	600266	城建发展	11,700	55,458.00	0.00
374	600388	龙净环保	6,500	55,380.00	0.00
375	600338	西藏珠峰	3,900	55,263.00	0.00
376	603233	大参林	1,080	55,198.80	0.00
377	601718	际华集团	19,500	54,990.00	0.00
378	002038	双鹭药业	5,200	54,756.00	0.00
379	603868	飞科电器	1,300	54,678.00	0.00
380	600928	西安银行	11,700	54,522.00	0.00
381	002244	滨江集团	13,000	54,470.00	0.00
382	000563	陕国投 A	16,900	54,418.00	0.00
383	600901	江苏租赁	10,400	54,080.00	0.00
384	600094	大名城	14,300	53,911.00	0.00
385	000967	盈峰环境	7,800	53,586.00	0.00
386	601608	中信重工	14,300	53,482.00	0.00
387	603225	新凤鸣	2,600	52,780.00	0.00
388	002416	爱施德	5,200	52,156.00	0.00
389	002458	益生股份	5,200	51,844.00	0.00
390	600959	江苏有线	16,900	51,545.00	0.00
391	300180	华峰超纤	10,400	51,480.00	0.00
392	601958	金钼股份	7,800	50,544.00	0.00
393	300113	顺网科技	3,900	50,466.00	0.00
394	000681	视觉中国	3,900	50,427.00	0.00
395	300459	金科文化	15,600	50,388.00	0.00
396	000415	渤海租赁	20,800	50,336.00	0.00
397	002505	鹏都农牧	22,100	49,504.00	0.00
397	600649	城投控股	10,400	49,504.00	0.00
398	000028	国药一致	1,300	49,192.00	0.00
399	600717	天津港	12,480	48,921.60	0.00
400	600675	中华企业	15,600	48,828.00	0.00
401	600776	东方通信	3,900	48,360.00	0.00
402	000869	张裕 A	1,300	48,282.00	0.00
403	002424	贵州百灵	6,500	47,840.00	0.00

404	000717	韶钢松山	10,400	47,736.00	0.00
405	600006	东风汽车	6,500	47,450.00	0.00
406	600968	海油发展	18,200	47,138.00	0.00
407	601611	中国核建	6,500	46,930.00	0.00
408	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
409	601828	美凯龙	3,900	46,800.00	0.00
410	600633	浙数文化	6,500	46,670.00	0.00
410	600546	山煤国际	6,500	46,670.00	0.00
411	000078	海王生物	14,300	46,618.00	0.00
412	600566	济川药业	2,600	46,540.00	0.00
413	600062	华润双鹤	3,900	46,449.00	0.00
414	000712	锦龙股份	2,700	46,440.00	0.00
415	601928	凤凰传媒	6,500	46,410.00	0.00
416	603317	天味食品	1,560	45,910.80	0.00
417	600623	华谊集团	5,200	45,812.00	0.00
418	000501	鄂武商 A	3,900	45,630.00	0.00
419	000987	越秀金控	3,600	45,576.00	0.00
420	600863	内蒙华电	19,500	45,435.00	0.00
421	600643	爱建集团	6,500	45,370.00	0.00
422	601969	海南矿业	3,900	45,357.00	0.00
423	603708	家家悦	2,600	45,162.00	0.00
424	002317	众生药业	5,200	44,772.00	0.00
425	300324	旋极信息	10,400	44,304.00	0.00
426	000062	深圳华强	2,600	43,966.00	0.00
427	600869	远东股份	9,100	43,953.00	0.00
427	600259	广晟有色	1,300	43,953.00	0.00
428	300134	大富科技	3,900	43,719.00	0.00
429	000848	承德露露	3,600	42,984.00	0.00
430	600073	上海梅林	5,200	42,588.00	0.00
430	601778	晶科科技	7,800	42,588.00	0.00
431	600835	上海机电	2,600	42,250.00	0.00
432	002434	万里扬	5,200	42,172.00	0.00
433	000031	大悦城	11,700	42,120.00	0.00
434	600823	世茂股份	10,400	42,016.00	0.00
435	000826	启迪环境	7,800	41,730.00	0.00
436	600787	中储股份	7,800	41,574.00	0.00
437	002399	海普瑞	2,600	41,418.00	0.00
438	002375	亚厦股份	5,200	41,184.00	0.00
439	600339	中油工程	14,300	40,612.00	0.00
440	002589	瑞康医药	9,100	40,313.00	0.00
441	601298	青岛港	6,500	40,170.00	0.00
442	000156	华数传媒	5,200	40,092.00	0.00
443	002468	申通快递	5,200	39,624.00	0.00
444	600777	新潮能源	25,200	39,564.00	0.00

445	600478	科力远	7,200	39,528.00	0.00
446	600277	亿利洁能	11,700	39,429.00	0.00
447	000543	皖能电力	10,400	39,416.00	0.00
448	002583	海能达	7,800	39,312.00	0.00
449	600466	蓝光发展	13,000	38,350.00	0.00
450	002635	安洁科技	2,600	38,038.00	0.00
451	600312	平高电气	6,500	37,960.00	0.00
452	600138	中青旅	3,600	37,800.00	0.00
453	600664	哈药股份	13,000	37,570.00	0.00
454	000008	神州高铁	16,900	37,518.00	0.00
455	300010	豆神教育	6,500	36,855.00	0.00
456	600428	中远海特	6,300	36,162.00	0.00
457	000553	安道麦 A	3,900	36,153.00	0.00
458	000061	农产品	6,500	35,880.00	0.00
458	600748	上实发展	7,800	35,880.00	0.00
459	000937	冀中能源	9,100	35,763.00	0.00
460	600729	重庆百货	1,300	35,685.00	0.00
461	600639	浦东金桥	2,600	35,490.00	0.00
462	600517	国网英大	5,200	35,412.00	0.00
462	000813	德展健康	7,800	35,412.00	0.00
463	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
464	002544	杰赛科技	2,600	34,684.00	0.00
465	600131	国网信通	2,600	34,424.00	0.00
466	601139	深圳燃气	5,200	34,112.00	0.00
467	603515	欧普照明	1,300	33,371.00	0.00
468	603377	东方时尚	3,120	33,352.80	0.00
469	600871	石化油服	16,900	33,293.00	0.00
470	002957	科瑞技术	1,300	33,098.00	0.00
471	601228	广州港	10,400	33,072.00	0.00
472	002815	崇达技术	2,600	32,448.00	0.00
473	002948	青岛银行	6,500	32,305.00	0.00
474	600350	山东高速	5,200	31,980.00	0.00
475	000600	建投能源	6,500	31,915.00	0.00
476	600640	号百控股	2,600	31,694.00	0.00
477	601869	长飞光纤	1,300	31,668.00	0.00
478	600017	日照港	11,700	31,239.00	0.00
479	002302	西部建设	3,900	30,810.00	0.00
480	300197	节能铁汉	9,900	30,393.00	0.00
481	600557	康缘药业	2,700	30,348.00	0.00
482	600751	海航科技	10,800	30,024.00	0.00
483	000046	泛海控股	13,000	29,900.00	0.00
484	002285	世联行	4,800	29,424.00	0.00
485	603328	依顿电子	3,900	29,055.00	0.00
486	600545	卓郎智能	9,100	28,665.00	0.00

487	603056	德邦股份	2,600	28,574.00	0.00
488	600575	淮河能源	13,000	28,210.00	0.00
489	600770	综艺股份	4,500	28,035.00	0.00
490	002653	海思科	1,300	27,976.00	0.00
491	603888	新华网	1,300	27,521.00	0.00
492	600556	天下秀	2,600	27,456.00	0.00
493	002665	首航高科	12,600	27,216.00	0.00
494	000537	广宇发展	5,200	27,196.00	0.00
495	600657	信达地产	7,800	27,144.00	0.00
496	600125	铁龙物流	5,400	26,622.00	0.00
497	002419	天虹股份	3,900	25,584.00	0.00
498	600565	迪马股份	9,900	25,146.00	0.00
499	002051	中工国际	3,900	24,843.00	0.00
500	601801	皖新传媒	5,200	24,544.00	0.00
501	002503	搜于特	15,600	24,492.00	0.00
502	002093	国脉科技	3,900	24,453.00	0.00
503	603379	三美股份	1,300	24,323.00	0.00
504	600903	贵州燃气	2,600	23,920.00	0.00
505	601003	柳钢股份	3,900	23,010.00	0.00
506	603766	隆鑫通用	6,300	22,869.00	0.00
507	600053	九鼎投资	1,300	22,763.00	0.00
508	001872	招商港口	1,300	21,996.00	0.00
509	600058	五矿发展	2,700	21,276.00	0.00
510	601019	山东出版	3,600	20,664.00	0.00
511	002946	新乳业	1,300	19,695.00	0.00
512	000732	泰禾集团	9,100	19,656.00	0.00
513	600757	长江传媒	3,600	19,116.00	0.00
514	600694	大商股份	900	18,684.00	0.00
515	002491	通鼎互联	4,500	17,460.00	0.00
516	600874	创业环保	2,700	16,497.00	0.00
517	600335	国机汽车	2,700	16,011.00	0.00
518	002818	富森美	1,300	15,678.00	0.00
519	600996	贵广网络	2,700	13,959.00	0.00
520	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
521	002941	新疆交建	1,300	13,897.00	0.00
522	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
523	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
524	000025	特力 A	900	13,392.00	0.00
525	688533	上声电子	500	13,150.00	0.00
526	601512	中新集团	1,300	12,948.00	0.00
527	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
528	002118	紫鑫药业	4,500	12,060.00	0.00
529	603256	宏和科技	1,300	11,882.00	0.00
530	002423	中粮资本	1,300	11,765.00	0.00

531	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
532	000785	居然之家	1,800	10,926.00	0.00
533	600917	重庆燃气	1,300	10,621.00	0.00
534	603556	海兴电力	900	10,548.00	0.00
535	601068	中铝国际	2,600	8,970.00	0.00
536	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
537	601811	新华文轩	900	7,848.00	0.00
538	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
539	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.14
2	600426	华鲁恒升	1,045,958.00	0.04
3	600089	特变电工	1,008,562.00	0.04
4	600143	金发科技	1,003,712.00	0.04
5	603882	金城医学	989,543.00	0.04
6	601233	桐昆股份	879,123.00	0.04
7	600132	重庆啤酒	867,338.80	0.04
8	603345	安井食品	795,870.00	0.03
9	600079	人福医药	679,283.00	0.03
10	688002	睿创微纳	678,142.20	0.03
11	603737	三棵树	638,309.00	0.03
12	601799	星宇股份	625,022.00	0.03
13	603806	福斯特	619,371.00	0.03
14	603486	科沃斯	617,290.00	0.03
15	603605	珀莱雅	615,992.00	0.03
16	600739	辽宁成大	614,516.00	0.03
17	601168	西部矿业	598,118.00	0.02
18	600219	南山铝业	593,816.00	0.02
19	688099	晶晨股份	584,186.18	0.02
20	600885	宏发股份	551,245.00	0.02

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 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。

7.5.2 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	600905	三峡能源	1,735,118.40	0.07
2	002080	中材科技	188,902.00	0.01
3	605499	东鹏饮料	144,109.40	0.01
4	300274	阳光电源	114,261.00	0.00
5	601963	重庆银行	100,722.56	0.00
6	603444	吉比特	88,909.00	0.00
7	003035	南网能源	78,647.52	0.00
8	603529	爱玛科技	74,101.68	0.00
9	300012	华测检测	71,071.00	0.00
10	601665	齐鲁银行	62,867.54	0.00
11	600426	华鲁恒升	61,704.00	0.00
12	600089	特变电工	61,275.00	0.00
13	603486	科沃斯	59,640.00	0.00
14	600132	重庆啤酒	57,894.00	0.00
15	600916	中国黄金	55,870.53	0.00
16	603882	金城医学	55,480.00	0.00
17	601156	东航物流	55,385.00	0.00
18	300496	中科创达	53,196.00	0.00
19	605077	华康股份	52,814.16	0.00
20	605339	南侨食品	52,221.60	0.00

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	76,124,737.79
卖出股票收入（成交）总额	10,962,905.14

7.6 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）	20,207.60	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,207.60	0.00

7.7 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	113051	节能转债	100	10,000.00	0.00
2	113048	晶科转债	80	8,751.20	0.00
3	113621	彤程转债	10	1,456.40	0.00

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变	风险说明
----	----	-----	------	-------	------

				动	
IC2107	IC2107	18.00	24,361,920.00	498,074.72	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,能够较好地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前后一致。
IC2108	IC2108	2.00	2,684,800.00	16,800.00	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,能够较好地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前后一致。
公允价值变动总额合计					514,874.72
股指期货投资本期收益					5,942,249.80
股指期货投资本期公允价值变动					-1,399,797.28

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 联接基金,主要投资目标 ETF 基金、标的指数成份股及备选成份股,同时可以投资股指期货。

本基金投资股指期货,可以更好地应对申购和赎回,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,力争更好地跟踪标的指数。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广州金域医学检验集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西宁市公安消防支队东川大队的处罚。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	4,224,913.54
2	应收证券清算款	69,014.53
3	应收股利	-
4	应收利息	16,588.88
5	应收申购款	4,400,378.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	5,760.00
9	合计	8,716,655.40

7.13.4 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。

7.13.5 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	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.22	新股流通受限
---	--------	------	--------------	------	--------

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

份额级别	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
广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	84,344	10,584.69	138,233,441.92	15.48%	754,521,400.32	84.52%
广发中证 500ETF 联接 C	92,949	8,853.01	479,290,730.74	58.25%	343,587,828.73	41.75%
合计	177,293	9,676.83	617,524,172.66	35.99%	1,098,109,229.05	64.01%

8.2 期末上市基金前十名持有人

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	蔡静岚	306,734.00	2.33%
2	阮肇熙	300,024.00	2.28%
3	吴本明	300,018.00	2.28%
4	张敬忠	300,009.00	2.28%
5	赵宪扬	274,390.00	2.09%
6	牟善玉	266,700.00	2.03%
7	赵天相	260,000.00	1.98%
8	洪桂芳	225,000.00	1.71%
9	梁少梅	209,006.00	1.59%
10	庄晓静	200,232.00	1.52%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	189,369.21	0.0212%
	广发中证 500ETF 联接 C	322,818.72	0.0392%
	合计	512,187.93	0.0299%

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	份额级别	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	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	0
	广发中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	0
	广发中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日（2009 年 11 月 26 日）基金份额总额	8,635,797,223.98	-
本报告期期初基金份额总额	1,008,956,719.39	886,977,505.05
本报告期基金总申购份额	142,860,507.56	345,302,179.64
减：本报告期基金总赎回份额	259,062,384.71	409,401,125.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	892,754,842.24	822,878,559.47

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	3	83,036,158.70	100.00%	77,300.92	100.00%	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
安信证券	5	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
新时代证券	3	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-

证券								
长江证券	3	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	5	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-	-	减少 2 个
华创证券	2	-	-	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		的比例		总额的 比例		的比例		的比例
光大 证券	138,976.7 0	79.02 %	-	-	-	-	657,142,7 90.30	100.00 %
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 华南	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中山 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时 代证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华林 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

华菁 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
万联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华福 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	36,900.00	20.98%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
3	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21

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

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会《关于核准广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议的批复》
- 2.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日