

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

联接基金

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.....	7
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.....	14
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.....	49
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.13 投资组合报告附注.....	53

8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 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.....	54
9 开放式基金份额变动	55
10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	62
11 影响投资者决策的其他重要信息	62
12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	广发沪深 300ETF 联接	
基金主代码	270010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 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	
报告期末基金份额总额	929,809,331.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	270010	002987
报告期末下属分级基金的份额总额	602,975,377.95 份	326,833,953.58 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 20 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 9 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	本基金主要通过投资于目标 ETF，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的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
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策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合，但因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。
业绩比较基准	沪深 300 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	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
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	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

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）	
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
本期已实现收益	128,753,528.21	66,926,427.68
本期利润	47,459,047.06	7,859,490.57
加权平均基金份额本期利润	0.0765	0.0245
本期加权平均净值利润率	3.05%	0.99%
本期基金份额净值增长率	1.31%	1.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
期末可供分配利润	904,446,649.26	476,403,857.73
期末可供分配基金份额利润	1.5000	1.4576
期末基金资产净值	1,516,182,161.00	811,360,286.63
期末基金份额净值	2.5145	2.4825
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	207.68%	72.16%

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

广发沪深 300ETF 联接 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	-1.23%	0.76%	-1.91%	0.76%	0.68%	0.00%
过去三个月	4.47%	0.92%	3.32%	0.93%	1.15%	-0.01%
过去六个月	1.31%	1.24%	0.29%	1.25%	1.02%	-0.01%
过去一年	26.66%	1.26%	24.19%	1.27%	2.47%	-0.01%
过去三年	54.25%	1.27%	46.42%	1.30%	7.83%	-0.03%
自基金合同生效起至今	207.68%	1.44%	172.88%	1.43%	34.80%	0.01%

广发沪深 300ETF 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	-1.25%	0.76%	-1.91%	0.76%	0.66%	0.00%
过去三个月	4.42%	0.92%	3.32%	0.93%	1.10%	-0.01%
过去六个月	1.21%	1.24%	0.29%	1.25%	0.92%	-0.01%
过去一年	26.41%	1.26%	24.19%	1.27%	2.22%	-0.01%
过去三年	53.16%	1.27%	46.42%	1.30%	6.74%	-0.03%
自基金合同生效起至今	72.16%	1.10%	59.74%	1.12%	12.42%	-0.02%

注：（1）自 2016 年 1 月 18 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%”变更为“沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

（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

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 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
 （2008 年 12 月 30 日至 2021 年 6 月 30 日）

广发沪深 300ETF 联接 A



广发沪深 300ETF 联接 C



注：自 2016 年 1 月 18 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%”变更为“沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

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；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金	2016-01-18	-	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>(QDII-LOF) 的基金经理; 广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF) 的基金经理; 广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理; 广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理; 广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理; 广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理; 广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII) 的基金经理; 广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发中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</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>
--	---	--	--	--	---

	投资基金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沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ ，主要采用完全复制法来跟踪业绩基准。

（1）投资策略

作为指数基金，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。

本基金是 ETF 联接基金，主要持有广发沪深 300ETF 及指数成份股，间接复制指数，本质上是被动投资策略，跟踪效果与直接持有成份股效果相同，同时作为联接基金，可参与场内广发沪深 300ETF 折溢价套利等交易，更有利于广发沪深 300ETF 及其联接基金持有人的利益。

（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，也带来相关行业的投资机会。

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 1.31%，C 类基金份额净值增长率为 1.21%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

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。

沪深 300 指数作为市场中核心宽基指数之一，覆盖沪深两个市场的大盘蓝筹股票，是资产配置的重要标的。投资者若看好 A 股市场，可关注沪深 300ETF 及其联接基金。

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及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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——广发基金管

理有限公司在广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	154,303,381.62	139,513,029.11
结算备付金		29,233,626.47	2,196,258.13
存出保证金		11,051,548.57	677,713.84
交易性金融资产	6.4.7.2	2,138,850,461.70	2,445,705,192.52
其中：股票投资		27,934,785.11	85,421,862.86
基金投资		2,110,864,519.60	2,360,143,526.66
债券投资		51,156.99	139,803.00
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		1,780,401.79	3,388,138.59
应收利息	6.4.7.5	106,115.02	57,260.79
应收股利		-	-
应收申购款		2,387,087.92	4,350,702.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,337,712,623.09	2,595,888,295.49

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		-	-
应付赎回款		9,172,512.26	15,411,130.36
应付管理人报酬		90,232.35	101,655.35
应付托管费		18,046.48	20,331.06
应付销售服务费		138,356.58	126,307.70
应付交易费用	6.4.7.7	24,758.05	75,763.90
应交税费		498,662.25	398,487.06
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,607.49	217,613.21
负债合计		10,170,175.46	16,351,288.64
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	929,809,331.53	1,042,776,041.45
未分配利润	6.4.7.10	1,397,733,116.10	1,536,760,965.40
所有者权益合计		2,327,542,447.63	2,579,537,006.85
负债和所有者权益总计		2,337,712,623.09	2,595,888,295.49

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值人民币 2.5145 元，基金份额总额 602,975,377.95 份；广发沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值人民币 2.4825 元，基金份额总额 326,833,953.58 份；总份额总额 929,809,331.53 份。

6.2 利润表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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		57,899,465.86	115,355,043.64
1.利息收入		414,720.92	929,254.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	414,692.02	929,252.25
债券利息收入		28.90	2.41
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）		197,113,741.39	103,993,970.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,591,311.62	6,678,915.81
基金投资收益	6.4.7.13	189,147,089.88	84,254,165.80
债券投资收益	6.4.7.14	7,108.27	2,664.61
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	-808,893.20	12,782,155.34
股利收益	6.4.7.16	177,124.82	276,068.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-140,361,418.26	9,496,406.06
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	732,421.81	935,412.72
减：二、费用		2,580,928.23	3,431,357.38
1. 管理人报酬		464,379.56	673,845.39
2. 托管费		92,875.90	134,769.09
3. 销售服务费		784,332.40	1,566,048.02
4. 交易费用	6.4.7.19	553,288.65	622,493.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		584,308.51	329,473.06
7. 其他费用	6.4.7.20	101,743.21	104,728.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		55,318,537.63	111,923,686.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		55,318,537.63	111,923,686.26

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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）	1,042,776,041.45	1,536,760,965.40	2,579,537,006.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,318,537.63	55,318,537.63

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）	-112,966,709.92	-194,346,386.93	-307,313,096.85
其中：1.基金申购款	457,850,924.04	677,502,724.96	1,135,353,649.00
2.基金赎回款	-570,817,633.96	-871,849,111.89	-1,442,666,745.85
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）	929,809,331.53	1,397,733,116.10	2,327,542,447.63
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）	1,918,535,873.11	1,785,353,688.41	3,703,889,561.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	111,923,686.26	111,923,686.26
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）	-173,829,144.54	-195,842,856.03	-369,672,000.57
其中：1.基金申购款	1,107,502,450.71	921,621,222.38	2,029,123,673.09
2.基金赎回款	-1,281,331,595.25	-1,117,464,078.41	-2,398,795,673.66
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）	1,744,706,728.57	1,701,434,518.64	3,446,141,247.21

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

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原名：广发沪深 300 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[2008]1295 号文《关于核准广发沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》批准，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《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2008 年 12 月 30 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，并获中国证监会基金部函（2008）545 号《关于广发沪深 300 指数证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为 2008 年 12 月 8 日至 2008 年 12 月 26 日，本基金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 653,693,988.31 元，有效认购户数为 12,912 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 44,015.09 元，折合基金份额 44,015.09 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2008 年 12 月 30 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 653,693,988.31 份。

根据本基金的管理人于 2016 年 1 月 19 日发布的《关于广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，变更本基金的投资范围及相关事项，将本基金变更为广发沪深 300ETF 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。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，广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议经中国证券监督管理委员会于 2016 年 1 月 18 日备案确认，自该日生效。根据《关于广发沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》、《广发沪深 300 指数证券投资基金托管协议》修订为《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合同》、《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》，并已报中国证监会审核。《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合同》和《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》自中国证监会备案确认广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效之日，原《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》、《广发沪深 300 指数证券投资基金托管协议》同日失效。

本基金自 2016 年 7 月 6 日起增设 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	154,303,381.62
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	154,303,381.62

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	27,335,012.79	27,934,785.11	599,772.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	46,900.00	51,156.99
	银行间市场	-	-
	合计	46,900.00	51,156.99
资产支持证券	-	-	-
基金	1,538,660,840.70	2,110,864,519.60	572,203,678.90
其他	-	-	-
合计	1,566,042,753.49	2,138,850,461.70	572,807,708.21

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	88,231,200.00	-	-	-
其中：股指期货投资	88,231,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	88,231,200.00	-	-	-

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 IF2107 买入持仓量 58 手，合约市值人民币 90,326,880.00 元，公允价值变动人民币 2,095,680.00 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	13,519.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	86.04
应收结算备付金利息	92,496.75
应收债券利息	12.34
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	106,115.02

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	24,758.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,758.05

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	11,404.18
应付证券出借违约金	-
预提费用	216,203.31
合计	227,607.49

6.4.7.9 实收基金

广发沪深 300ETF 联接 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	742,543,633.53	742,543,633.53
本期申购	159,595,752.92	159,595,752.92
本期赎回（以“-”号填列）	-299,164,008.50	-299,164,008.50
本期末	602,975,377.95	602,975,377.95

广发沪深 300ETF 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	300,232,407.92	300,232,407.92
本期申购	298,255,171.12	298,255,171.12
本期赎回（以“-”号填列）	-271,653,625.46	-271,653,625.46
本期末	326,833,953.58	326,833,953.58

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

广发沪深 300ETF 联接 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	956,038,728.19	144,509,840.20	1,100,548,568.39
本期利润	128,753,528.21	-81,294,481.15	47,459,047.06
本期基金份额交易产生的变动数	-180,345,607.14	-54,455,225.26	-234,800,832.40
其中：基金申购款	226,165,461.09	11,619,717.45	237,785,178.54
基金赎回款	-406,511,068.23	-66,074,942.71	-472,586,010.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	904,446,649.26	8,760,133.79	913,206,783.05

广发沪深 300ETF 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	375,338,027.10	60,874,369.91	436,212,397.01
本期利润	66,926,427.68	-59,066,937.11	7,859,490.57
本期基金份额交易产生的变动数	34,139,402.95	6,315,042.52	40,454,445.47
其中：基金申购款	407,371,983.89	32,345,562.53	439,717,546.42
基金赎回款	-373,232,580.94	-26,030,520.01	-399,263,100.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	476,403,857.73	8,122,475.32	484,526,333.05

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	270,104.91
定期存款利息收入	13,222.22
其他存款利息收入	1,713.61
结算备付金利息收入	129,651.28
其他	-
合计	414,692.02

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	7,698,231.60
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	893,080.02
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,591,311.62

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	197,307,972.22
减：卖出股票成本总额	189,609,740.62
买卖股票差价收入	7,698,231.60

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	16,959,600.00
减：现金支付申购款总额	6,616,535.49
减：申购股票成本总额	9,449,984.49
申购差价收入	893,080.02

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	617,415,976.49
减：卖出/赎回基金成本总额	428,268,886.61
基金投资收益	189,147,089.88

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	7,108.27
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	7,108.27

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	167,936.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,800.00

减：应收利息总额	27.74
买卖债券差价收入	7,108.27

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	-808,893.20

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	177,124.82
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	177,124.82

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	-142,333,678.26
——股票投资	-4,692,796.30
——债券投资	2,453.99
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-137,643,335.95
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,972,260.00
——权证投资	-
——股指期货投资	1,972,260.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-140,361,418.26

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	653,638.90
基金转换费收入	78,782.91
合计	732,421.81

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	498,950.98
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	38,818.12
其中：申购费	149.25
赎回费	694.33
其他	37,974.54
期货交易费用	15,519.55
合计	553,288.65

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	5,539.90
合计	101,743.21

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
广发沪深 300 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
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

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	-	-	53,242,582.94	13.32%

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	26,700.00	11.24%	9,700.00	47.63%

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	-	-	425,029,553.10	34.61%

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	49,568.68	13.72%	-	-

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	464,379.56
其中：支付销售机构的客户维护费	937,627.85	986,662.38

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的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。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	92,875.90	134,769.09

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的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% 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－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		
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C	合计
广发基金管理有限公司	-	499,158.94	499,158.94
广发证券股份有限公司	-	5,968.61	5,968.61
合计	-	505,127.55	505,127.55
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		
	广发沪深300ETF联接A	广发沪深300ETF联接C	合计

广发基金管理有限公司	-	1,240,950.82	1,240,950.82
广发证券股份有限公司	-	6,219.27	6,219.27
合计	-	1,247,170.09	1,247,170.09

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，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。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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

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

广发沪深 300ETF 联接 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。

广发沪深 300ETF 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 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	
	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	154,303,381.62	270,104.91	175,192,129.79	755,966.16

注：本基金的部分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 1,180,176,965.00 份目标 ETF 基金广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额（2020 年 6 月 30 日：2,335,929,165.00 份），占其总份额的比例为 86.88%（2020 年 6 月 30 日：89.11%）。本基金本报告期末持有 4,000 股基金管理人控股股东广发证券股份有限公司的 A 股普通股（2020 年 6 月 30 日：3,200 股），成本总额为人民币 60,000.00 元（2020 年 6 月 30 日：43,872.00 元），估值总额为 60,560.00 元（2020 年 6 月 30 日：45,184.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.00%（2020 年 6 月 30 日：0.00%）。本基金本报告期末持有 1,000 股基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股（2020 年 6 月 30 日：800 股），成本总额为人民币 17,298.00 元（2020 年 6 月 30 日：26,705.60 元），估值总额为 18,630.00 元（2020 年 6 月 30 日：23,128.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.00%（2020 年 6 月 30 日：0.00%）。本基金本报告期末持有 47,500 股基金托管人中国工商银行股份有限公司的 A 股普通股（2020 年 6 月 30 日：39,200 股），成本总额为人民币 246,050.00 元（2020 年 6 月 30 日：199,645.60 元），估值总额为 245,575.00 元（2020 年 6 月 30 日：195,216.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.01%（2020 年 6 月 30 日：0.01%）。

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
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
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新债流通受限	100.00	100.00	160.00	16,000.00	16,000.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债流通受限	100.00	100.00	12.00	1,200.00	1,200.00	-
113049	长汽转债	2021-06-11	2021-07-08	新债流通受限	100.00	100.00	10.00	1,000.00	1,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新债流通受限	100.00	100.00	6.00	600.00	600.00	-

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
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	5,000.00	33,700.00	27,950.00	-

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	46,606.20	134,803.00
AAA 以下	4,550.79	5,000.00
未评级	-	-
合计	51,156.99	139,803.00

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，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	154,303,381.62	-	-	-	154,303,381.62
结算备付金	29,233,626.47	-	-	-	29,233,626.47
存出保证金	11,051,548.57	-	-	-	11,051,548.57
交易性金融资产	51,156.99	-	-	2,138,799,304.71	2,138,850,461.70
应收证券清算款	-	-	-	1,780,401.79	1,780,401.79
应收利息	-	-	-	106,115.02	106,115.02
应收申购款	-	-	-	2,387,087.92	2,387,087.92
资产总计	194,639,713.65	-	-	2,143,072,909.44	2,337,712,623.09
负债：					
应付赎回款	-	-	-	9,172,512.26	9,172,512.26
应付管理人报酬	-	-	-	90,232.35	90,232.35
应付托管费	-	-	-	18,046.48	18,046.48
应付销售服务费	-	-	-	138,356.58	138,356.58
应付交易费用	-	-	-	24,758.05	24,758.05
应交税费	-	-	-	498,662.25	498,662.25
其他负债	-	-	-	227,607.49	227,607.49
负债总计	-	-	-	10,170,175.46	10,170,175.46
利率敏感度缺口	194,639,713.65	-	-	2,132,902,733.98	2,327,542,447.63
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	139,513,029.11	-	-	-	139,513,029.11
结算备付金	2,196,258.13	-	-	-	2,196,258.13
存出保证金	677,713.84	-	-	-	677,713.84
交易性金融资产	139,803.00	-	-	2,445,565,389.52	2,445,705,192.17

					52
应收证券清算款	-	-	-	3,388,138.59	3,388,138.59
应收利息	-	-	-	57,260.79	57,260.79
应收申购款	-	-	-	4,350,702.51	4,350,702.51
资产总计	142,526,804.08	-	-	2,453,361,491.41	2,595,888,295.49
负债：					
应付赎回款	-	-	-	15,411,130.36	15,411,130.36
应付管理人报酬	-	-	-	101,655.35	101,655.35
应付托管费	-	-	-	20,331.06	20,331.06
应付销售服务费	-	-	-	126,307.70	126,307.70
应付交易费用	-	-	-	75,763.90	75,763.90
应交税费	-	-	-	398,487.06	398,487.06
其他负债	-	-	-	217,613.21	217,613.21
负债总计	-	-	-	16,351,288.64	16,351,288.64
利率敏感度缺口	142,526,804.08	-	-	2,437,010,202.77	2,579,537,006.85

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	上年度末
----	-----	------

	2021 年 6 月 30 日		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	27,934,785.11	1.20	85,421,862.86	3.31
交易性金融资产—基金投资	2,110,864,519.60	90.69	2,360,143,526.66	91.49
交易性金融资产—债券投资	51,156.99	0.00	139,803.00	0.01
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	2,138,850,461.70	91.89	2,445,705,192.52	94.81

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%	116,176,740.76	122,909,770.30
	下降 5%	-116,176,740.76	-122,909,770.30

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 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 2,138,784,338.87 元，属于第二层次的余额为人民币 66,122.83 元，无属于第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 2,445,500,038.58 元，属于第二层次的余额为人民币 205,153.94 元，无属于第三层次的金额）。

(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	27,934,785.11	1.19
	其中：股票	27,934,785.11	1.19
2	基金投资	2,110,864,519.60	90.30
3	固定收益投资	51,156.99	0.00
	其中：债券	51,156.99	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	183,537,008.09	7.85
8	其他各项资产	15,325,153.30	0.66
9	合计	2,337,712,623.09	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	广发沪深 300 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	2,110,864,519.60	90.69

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	299,090.00	0.01
B	采矿业	682,782.00	0.03
C	制造业	15,018,508.74	0.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	481,755.39	0.02
E	建筑业	481,523.44	0.02
F	批发和零售业	183,695.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	832,585.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	817,046.40	0.04
J	金融业	6,857,083.00	0.29
K	房地产业	633,990.00	0.03
L	租赁和商务服务业	603,490.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	341,162.00	0.01
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	20,890.00	0.00
Q	卫生和社会工作	518,086.14	0.02
R	文化、体育和娱乐业	163,098.00	0.01
S	综合	-	-

	合计	27,934,785.11	1.20
--	----	---------------	------

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	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	0.04
2	601318	中国平安	14,500	932,060.00	0.04
3	600036	招商银行	16,500	894,135.00	0.04
4	000858	五粮液	2,500	744,725.00	0.03
5	000333	美的集团	6,500	463,905.00	0.02
6	601888	中国中免	1,500	450,150.00	0.02
7	601012	隆基股份	4,900	435,316.00	0.02
8	600276	恒瑞医药	6,000	407,820.00	0.02
9	601166	兴业银行	19,500	400,725.00	0.02
10	300059	东方财富	11,400	373,806.00	0.02
11	000651	格力电器	6,500	338,650.00	0.01
12	002466	天齐锂业	5,400	334,908.00	0.01
13	002415	海康威视	5,000	322,500.00	0.01
14	600887	伊利股份	8,000	294,640.00	0.01
15	000001	平安银行	13,000	294,060.00	0.01
16	600030	中信证券	11,500	286,810.00	0.01
17	603259	药明康德	1,800	281,862.00	0.01
18	600900	长江电力	12,500	258,000.00	0.01
19	002475	立讯精密	5,500	253,000.00	0.01
20	002594	比亚迪	1,000	251,000.00	0.01
21	601398	工商银行	47,500	245,575.00	0.01
22	000568	泸州老窖	1,000	235,940.00	0.01
23	600031	三一重工	8,000	232,560.00	0.01
24	600089	特变电工	17,800	228,730.00	0.01
25	000725	京东方 A	36,500	227,760.00	0.01
26	600436	片仔癀	500	224,150.00	0.01
27	600809	山西汾酒	500	224,000.00	0.01
28	600309	万华化学	2,000	217,640.00	0.01
29	000002	万科 A	9,000	214,290.00	0.01
30	002714	牧原股份	3,500	212,870.00	0.01

31	688036	传音控股	1,000	209,500.00	0.01
32	002304	洋河股份	1,000	207,200.00	0.01
33	600763	通策医疗	500	205,500.00	0.01
34	601919	中远海控	6,500	198,510.00	0.01
35	000661	长春高新	500	193,500.00	0.01
36	603288	海天味业	1,500	193,425.00	0.01
37	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.01
38	002821	凯莱英	500	186,300.00	0.01
39	300015	爱尔眼科	2,593	184,051.14	0.01
40	601328	交通银行	37,000	181,300.00	0.01
41	601899	紫金矿业	18,500	179,265.00	0.01
42	002352	顺丰控股	2,500	169,250.00	0.01
43	002230	科大讯飞	2,500	168,950.00	0.01
44	300124	汇川技术	2,250	167,085.00	0.01
45	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.01
46	600000	浦发银行	16,000	160,000.00	0.01
47	300014	亿纬锂能	1,500	155,895.00	0.01
48	002142	宁波银行	4,000	155,880.00	0.01
49	600438	通威股份	3,500	151,445.00	0.01
50	000100	TCL 科技	19,000	145,350.00	0.01
51	002371	北方华创	500	138,690.00	0.01
52	002271	东方雨虹	2,500	138,300.00	0.01
53	601668	中国建筑	28,500	132,525.00	0.01
54	002027	分众传媒	14,000	131,740.00	0.01
55	601601	中国太保	4,500	130,365.00	0.01
56	600219	南山铝业	36,000	129,600.00	0.01
57	600690	海尔智家	5,000	129,550.00	0.01
58	002241	歌尔股份	3,000	128,220.00	0.01
59	600016	民生银行	29,000	127,890.00	0.01
60	601688	华泰证券	8,000	126,400.00	0.01
61	300142	沃森生物	2,000	123,400.00	0.01
62	600585	海螺水泥	3,000	123,150.00	0.01
63	002460	赣锋锂业	1,000	121,090.00	0.01
64	600837	海通证券	10,500	120,750.00	0.01
65	601288	农业银行	39,000	118,170.00	0.01
66	002812	恩捷股份	500	117,050.00	0.01
67	000063	中兴通讯	3,500	116,305.00	0.00
68	000338	潍柴动力	6,500	116,155.00	0.00
69	600048	保利地产	9,500	114,380.00	0.00
70	603799	华友钴业	1,000	114,200.00	0.00
71	600919	江苏银行	16,000	113,600.00	0.00
72	600660	福耀玻璃	2,000	111,700.00	0.00
73	601229	上海银行	13,500	110,700.00	0.00
74	600196	复星医药	1,500	108,195.00	0.00

75	601211	国泰君安	6,000	102,840.00	0.00
76	002410	广联达	1,500	102,300.00	0.00
77	601766	中国中车	16,500	100,320.00	0.00
78	600104	上汽集团	4,500	98,865.00	0.00
79	601169	北京银行	20,000	97,400.00	0.00
80	300347	泰格医药	500	96,650.00	0.00
81	002129	中环股份	2,500	96,500.00	0.00
82	600703	三安光电	3,000	96,150.00	0.00
83	600999	招商证券	5,000	95,100.00	0.00
84	603986	兆易创新	500	93,950.00	0.00
85	600570	恒生电子	1,000	93,250.00	0.00
86	600019	宝钢股份	12,000	91,680.00	0.00
87	601088	中国神华	4,500	87,840.00	0.00
88	601988	中国银行	28,500	87,780.00	0.00
89	300498	温氏股份	6,000	86,220.00	0.00
90	601628	中国人寿	2,500	84,725.00	0.00
91	601009	南京银行	8,000	84,160.00	0.00
92	600406	国电南瑞	3,600	83,664.00	0.00
93	002311	海大集团	1,000	81,600.00	0.00
94	601818	光大银行	21,500	81,270.00	0.00
95	600893	航发动力	1,500	79,785.00	0.00
96	000625	长安汽车	3,000	78,840.00	0.00
97	600867	通化东宝	6,600	78,804.00	0.00
98	600346	恒力石化	3,000	78,720.00	0.00
99	600028	中国石化	18,000	78,480.00	0.00
100	601997	贵阳银行	10,800	77,328.00	0.00
101	002049	紫光国微	500	77,095.00	0.00
102	300601	康泰生物	500	74,500.00	0.00
103	600516	方大炭素	10,000	74,400.00	0.00
104	601390	中国中铁	14,000	73,360.00	0.00
105	600009	上海机场	1,500	72,195.00	0.00
106	603833	欧派家居	500	70,980.00	0.00
107	002601	龙佰集团	2,000	69,160.00	0.00
108	601857	中国石油	13,000	68,770.00	0.00
109	300413	芒果超媒	1,000	68,600.00	0.00
110	601377	兴业证券	7,000	67,620.00	0.00
111	600588	用友网络	2,000	66,520.00	0.00
112	601633	长城汽车	1,500	65,385.00	0.00
113	601225	陕西煤业	5,500	65,175.00	0.00
114	603160	汇顶科技	500	64,815.00	0.00
115	002493	荣盛石化	3,750	64,762.50	0.00
116	300408	三环集团	1,500	63,630.00	0.00
117	688008	澜起科技	1,000	62,380.00	0.00
118	002841	视源股份	500	62,145.00	0.00

119	600111	北方稀土	3,000	62,100.00	0.00
120	600170	上海建工	22,400	61,824.00	0.00
121	603195	公牛集团	300	60,600.00	0.00
122	000776	广发证券	4,000	60,560.00	0.00
123	002050	三花智控	2,500	59,950.00	0.00
124	601939	建设银行	9,000	59,850.00	0.00
125	300676	华大基因	500	59,300.00	0.00
126	600926	杭州银行	4,000	59,000.00	0.00
127	000786	北新建材	1,500	58,875.00	0.00
128	300433	蓝思科技	2,000	58,820.00	0.00
129	000538	云南白药	500	57,860.00	0.00
130	600600	青岛啤酒	500	57,825.00	0.00
131	002001	新和成	2,000	57,360.00	0.00
132	600584	长电科技	1,500	56,520.00	0.00
133	300033	同花顺	500	56,390.00	0.00
134	000166	申万宏源	12,000	56,160.00	0.00
135	002916	深南电路	500	55,565.00	0.00
136	002007	华兰生物	1,500	55,020.00	0.00
137	600958	东方证券	5,500	54,945.00	0.00
138	603369	今世缘	1,000	54,160.00	0.00
139	600050	中国联通	12,500	54,000.00	0.00
140	601018	宁波港	13,400	52,930.00	0.00
141	002236	大华股份	2,500	52,750.00	0.00
142	601006	大秦铁路	8,000	52,640.00	0.00
143	600015	华夏银行	8,500	52,615.00	0.00
144	000768	中航西飞	2,000	52,560.00	0.00
145	600741	华域汽车	2,000	52,540.00	0.00
146	601989	中国重工	12,500	51,500.00	0.00
147	601901	方正证券	5,500	51,480.00	0.00
148	000157	中联重科	5,500	50,820.00	0.00
149	601877	正泰电器	1,500	50,070.00	0.00
150	001979	招商蛇口	4,500	49,275.00	0.00
151	603658	安图生物	650	49,250.50	0.00
152	600398	海澜之家	6,800	49,232.00	0.00
153	603993	洛阳钼业	9,500	49,020.00	0.00
154	600745	闻泰科技	500	48,450.00	0.00
155	300003	乐普医疗	1,500	48,180.00	0.00
156	600352	浙江龙盛	3,500	48,090.00	0.00
157	600010	包钢股份	31,000	48,050.00	0.00
157	600547	山东黄金	2,500	48,050.00	0.00
158	601600	中国铝业	9,000	47,700.00	0.00
158	000895	双汇发展	1,500	47,700.00	0.00
159	601066	中信建投	1,500	47,145.00	0.00
160	600176	中国巨石	3,000	46,530.00	0.00

161	000963	华东医药	1,000	46,010.00	0.00
162	601336	新华保险	1,000	45,910.00	0.00
163	600977	中国电影	3,600	45,108.00	0.00
164	601788	光大证券	2,500	44,725.00	0.00
165	601186	中国铁建	6,000	44,580.00	0.00
166	600109	国金证券	3,500	44,415.00	0.00
167	000876	新希望	3,000	44,010.00	0.00
168	000938	紫光股份	2,000	43,760.00	0.00
169	300529	健帆生物	500	43,180.00	0.00
170	002736	国信证券	4,000	43,000.00	0.00
171	601100	恒立液压	500	42,960.00	0.00
172	003816	中国广核	16,000	42,720.00	0.00
173	002202	金风科技	3,500	42,560.00	0.00
174	600583	海油工程	9,400	42,300.00	0.00
175	603899	晨光文具	500	42,280.00	0.00
176	600760	中航沈飞	700	42,210.00	0.00
177	000977	浪潮信息	1,500	42,195.00	0.00
178	600872	中炬高新	1,000	42,020.00	0.00
179	300628	亿联网络	500	41,900.00	0.00
180	601155	新城控股	1,000	41,600.00	0.00
181	603019	中科曙光	1,500	41,415.00	0.00
182	000425	徐工机械	6,500	41,405.00	0.00
183	000069	华侨城 A	5,500	40,920.00	0.00
184	601669	中国电建	10,500	40,635.00	0.00
185	002008	大族激光	1,000	40,390.00	0.00
186	002179	中航光电	500	39,510.00	0.00
187	600795	国电电力	16,000	38,880.00	0.00
188	002414	高德红外	1,400	38,612.00	0.00
189	600886	国投电力	4,000	38,440.00	0.00
190	601838	成都银行	3,000	37,920.00	0.00
191	002600	领益智造	4,000	36,760.00	0.00
192	601108	财通证券	3,500	36,715.00	0.00
193	601360	三六零	3,000	36,630.00	0.00
194	000783	长江证券	5,000	36,600.00	0.00
195	000066	中国长城	2,500	36,500.00	0.00
196	600029	南方航空	6,000	36,120.00	0.00
197	002555	三七互娱	1,500	36,030.00	0.00
198	002938	鹏鼎控股	1,000	35,880.00	0.00
199	002624	完美世界	1,500	35,865.00	0.00
200	601985	中国核电	7,000	35,420.00	0.00
201	600183	生益科技	1,500	35,115.00	0.00
202	600522	中天科技	3,500	35,000.00	0.00
203	600161	天坛生物	1,000	34,250.00	0.00
204	600332	白云山	1,000	33,850.00	0.00

205	300144	宋城演艺	2,000	33,600.00	0.00
206	600362	江西铜业	1,500	33,570.00	0.00
207	600928	西安银行	7,200	33,552.00	0.00
208	601555	东吴证券	4,000	33,360.00	0.00
209	600845	宝信软件	650	33,085.00	0.00
210	601878	浙商证券	2,500	32,700.00	0.00
211	601800	中国交建	5,000	32,400.00	0.00
212	600061	国投资本	3,800	32,262.00	0.00
213	002602	世纪华通	5,000	32,100.00	0.00
214	603087	甘李药业	300	31,974.00	0.00
215	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.00
216	002044	美年健康	3,500	31,885.00	0.00
217	601607	上海医药	1,500	31,695.00	0.00
218	002384	东山精密	1,500	31,260.00	0.00
218	000708	中信特钢	1,500	31,260.00	0.00
219	601111	中国国航	4,000	31,120.00	0.00
220	601138	工业富联	2,500	31,025.00	0.00
221	300136	信维通信	1,000	30,880.00	0.00
222	600383	金地集团	3,000	30,720.00	0.00
223	601117	中国化学	3,500	30,660.00	0.00
224	600115	中国东航	6,000	30,480.00	0.00
225	002773	康弘药业	1,300	30,069.00	0.00
226	002422	科伦药业	1,500	29,925.00	0.00
227	000703	恒逸石化	2,500	29,875.00	0.00
228	600118	中国卫星	1,000	29,260.00	0.00
229	600705	中航产融	7,500	29,025.00	0.00
230	601021	春秋航空	500	28,450.00	0.00
231	601618	中国中冶	9,500	28,310.00	0.00
232	600968	海油发展	10,800	27,972.00	0.00
233	002024	苏宁易购	5,000	27,950.00	0.00
234	000728	国元证券	3,500	27,895.00	0.00
235	002468	申通快递	3,600	27,432.00	0.00
236	600606	绿地控股	5,000	27,250.00	0.00
237	002456	欧菲光	3,000	26,640.00	0.00
238	600177	雅戈尔	4,000	26,360.00	0.00
239	600068	葛洲坝	3,500	26,215.00	0.00
239	002252	上海莱士	3,500	26,215.00	0.00
240	000656	金科股份	4,500	26,055.00	0.00
241	600011	华能国际	6,000	25,320.00	0.00
242	601658	邮储银行	5,000	25,100.00	0.00
243	600066	宇通客车	2,000	24,980.00	0.00
244	600637	东方明珠	3,000	24,570.00	0.00
245	002157	正邦科技	2,000	23,900.00	0.00
246	601816	京沪高铁	4,500	23,805.00	0.00

247	601933	永辉超市	5,000	23,650.00	0.00
248	002508	老板电器	500	23,250.00	0.00
249	002463	沪电股份	1,500	23,205.00	0.00
250	600655	豫园股份	2,000	23,180.00	0.00
251	601216	君正集团	4,500	22,905.00	0.00
252	600487	亨通光电	2,000	22,800.00	0.00
253	000723	美锦能源	3,000	22,680.00	0.00
254	601298	青岛港	3,600	22,248.00	0.00
255	600369	西南证券	4,500	21,915.00	0.00
256	601162	天风证券	4,500	21,870.00	0.00
257	601198	东兴证券	2,000	21,860.00	0.00
258	601828	美凯龙	1,800	21,600.00	0.00
259	600489	中金黄金	2,500	21,550.00	0.00
260	600848	上海临港	1,200	21,480.00	0.00
261	600018	上港集团	4,500	21,465.00	0.00
262	601727	上海电气	5,000	21,200.00	0.00
263	000860	顺鑫农业	500	21,090.00	0.00
264	601990	南京证券	2,000	21,040.00	0.00
265	002607	中公教育	1,000	20,890.00	0.00
266	002673	西部证券	2,500	20,625.00	0.00
267	600085	同仁堂	500	20,425.00	0.00
268	601998	中信银行	4,000	20,400.00	0.00
269	002120	韵达股份	1,500	20,295.00	0.00
270	688009	中国通号	3,500	19,915.00	0.00
271	600271	航天信息	1,500	19,545.00	0.00
272	601238	广汽集团	1,500	19,425.00	0.00
273	601212	白银有色	7,200	18,792.00	0.00
274	600498	烽火通信	1,000	18,630.00	0.00
275	600208	新湖中宝	6,000	18,240.00	0.00
276	600390	五矿资本	3,000	17,940.00	0.00
277	601916	浙商银行	4,500	17,865.00	0.00
278	601319	中国人保	3,000	17,790.00	0.00
279	600482	中国动力	1,000	17,420.00	0.00
280	002958	青农商行	4,000	17,120.00	0.00
281	601231	环旭电子	1,000	16,810.00	0.00
282	600004	白云机场	1,500	16,770.00	0.00
283	002939	长城证券	1,500	16,695.00	0.00
284	600150	中国船舶	1,000	16,510.00	0.00
285	002153	石基信息	700	16,457.00	0.00
286	601881	中国银河	1,500	16,170.00	0.00
287	600297	广汇汽车	5,500	15,840.00	0.00
288	002739	万达电影	1,000	15,790.00	0.00
289	600027	华电国际	4,500	15,480.00	0.00
290	600998	九州通	1,000	15,370.00	0.00

291	600233	圆通速递	1,500	15,015.00	0.00
292	000961	中南建设	2,500	14,800.00	0.00
293	600025	华能水电	2,500	14,475.00	0.00
294	601808	中海油服	1,000	14,360.00	0.00
295	603156	养元饮品	500	14,290.00	0.00
296	002146	荣盛发展	2,500	14,100.00	0.00
297	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
298	601872	招商轮船	3,000	13,860.00	0.00
299	600989	宝丰能源	1,000	13,680.00	0.00
300	601236	红塔证券	1,000	13,560.00	0.00
301	601577	长沙银行	1,500	13,410.00	0.00
302	002558	巨人网络	1,000	13,300.00	0.00
303	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
304	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
305	600918	中泰证券	1,000	10,820.00	0.00
306	600340	华夏幸福	2,000	10,480.00	0.00
307	000671	阳光城	2,000	10,400.00	0.00
308	601696	中银证券	500	10,295.00	0.00
309	601077	渝农商行	2,500	9,975.00	0.00
310	000627	天茂集团	2,500	9,050.00	0.00
311	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
312	601698	中国卫通	500	8,095.00	0.00
313	002945	华林证券	500	6,910.00	0.00
314	600299	安迪苏	500	5,980.00	0.00
315	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	601318	中国平安	3,739,036.00	0.14
2	600036	招商银行	3,669,949.20	0.14
3	600519	贵州茅台	3,269,851.00	0.13
4	000333	美的集团	1,928,953.00	0.07
5	600276	恒瑞医药	1,920,023.00	0.07
6	601166	兴业银行	1,894,546.43	0.07
7	000858	五粮液	1,765,755.00	0.07
8	601888	中国中免	1,464,524.00	0.06
9	600887	伊利股份	1,354,710.00	0.05

10	601012	隆基股份	1,343,663.00	0.05
11	600031	三一重工	1,217,025.00	0.05
12	600030	中信证券	1,197,958.00	0.05
13	600900	长江电力	1,085,750.00	0.04
14	601398	工商银行	1,059,056.00	0.04
15	000001	平安银行	1,029,334.00	0.04
16	002415	海康威视	1,022,147.00	0.04
17	300059	东方财富	1,003,922.00	0.04
18	000651	格力电器	980,283.00	0.04
19	603288	海天味业	978,065.00	0.04
20	000002	万科 A	976,896.00	0.04

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	601318	中国平安	8,749,878.00	0.34
2	600519	贵州茅台	7,971,089.00	0.31
3	600036	招商银行	7,229,122.92	0.28
4	600276	恒瑞医药	4,306,527.84	0.17
5	601166	兴业银行	3,953,962.00	0.15
6	601888	中国中免	3,672,722.00	0.14
7	000858	五粮液	3,470,837.96	0.13
8	000333	美的集团	3,433,357.00	0.13
9	601012	隆基股份	3,021,577.75	0.12
10	600887	伊利股份	3,001,096.00	0.12
11	600031	三一重工	2,777,522.00	0.11
12	600030	中信证券	2,666,779.00	0.10
13	603288	海天味业	2,341,895.00	0.09
14	600900	长江电力	2,127,850.90	0.08
15	601398	工商银行	2,119,721.00	0.08
16	600309	万华化学	2,048,634.00	0.08
17	603259	药明康德	2,048,336.00	0.08
18	000651	格力电器	1,854,748.00	0.07
19	300059	东方财富	1,771,787.00	0.07
20	002415	海康威视	1,711,964.00	0.07

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	98,955,923.66
卖出股票收入（成交）总额	197,307,972.22

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）	51,156.99	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,156.99	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	110079	杭银转债	260	29,606.20	0.00
2	113050	南银转债	160	16,000.00	0.00
3	127036	三花转债	21	2,750.79	0.00
4	127038	国微转债	12	1,200.00	0.00
5	113049	长汽转债	10	1,000.00	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	公允价值变动	风险说明
IF2107	IF2107	58.00	90,326,880.00	2,095,680.00	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					2,095,680.00
股指期货投资本期收益					-808,893.20
股指期货投资本期公允价值变动					1,972,260.00

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，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚。江苏恒瑞医药股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国财政部的处罚。

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	11,051,548.57
2	应收证券清算款	1,780,401.79
3	应收股利	-
4	应收利息	106,115.02
5	应收申购款	2,387,087.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	15,325,153.30
---	----	---------------

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

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

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
广发沪深 300ETF 联接 A	70,814	8,514.92	132,101,869.82	21.91%	470,873,508.13	78.09%
广发沪深 300ETF 联接 C	25,640	12,747.03	248,035,276.89	75.89%	78,798,676.69	24.11%
合计	96,454	9,639.93	380,137,146.71	40.88%	549,672,184.82	59.12%

8.2 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	广发沪深 300ETF 联接 A	237,590.26	0.0394%
	广发沪深 300ETF 联接 C	17,095.35	0.0052%
	合计	254,685.61	0.0274%

8.3 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	广发沪深 300ETF 联接 A	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发沪深 300ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发沪深 300ETF 联接 A	0
	广发沪深 300ETF 联接 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
基金合同生效日(2008 年 12 月 30 日)基金份额总额	653,693,988.31	-
本报告期期初基金份额总额	742,543,633.53	300,232,407.92
本报告期基金总申购份额	159,595,752.92	298,255,171.12
减：本报告期基金总赎回份额	299,164,008.50	271,653,625.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	602,975,377.95	326,833,953.58

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	295,743,773.16	100.00%	275,407.91	100.00%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
南京证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
中泰证券	5	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
开源证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-

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的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	210,936.01	88.76%	-	-	-	-	843,805,467.20	100.00%
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中山 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中原 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
中金 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时 代证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华林 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华福 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华菁 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
万联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中天 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	26,700.00	11.24 %	-	-	-	-	-	-	-
财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 华南	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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. 广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会相关决议
2. 《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. 《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
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