

广发均衡增长混合型证券投资基金

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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 27 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 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	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	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	63
11	备查文件目录.....	64
11.1	备查文件目录.....	64
11.2	存放地点.....	64
11.3	查阅方式.....	64

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发均衡增长混合型证券投资基金	
基金简称	广发均衡增长混合	
基金主代码	010534	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 27 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,918,668,055.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
下属分级基金的交易代码	010534	010535
报告期末下属分级基金的份额总额	6,692,585,733.02 份	226,082,322.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度承担风险的基础上进行投资，分享中国经济快速成长的红利，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×55%+人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	罗菲菲
	联系电话	020-83936666	010-58560666
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95568
传真		020-89899158	010-58560798

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2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2号
邮政编码	510308	100031
法定代表人	孙树明	高迎欣

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27日（基金合同生效日）至2021年6月30日）	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
本期已实现收益	154,936,968.57	5,303,701.26
本期利润	258,984,842.90	9,304,195.44
加权平均基金份额本期利润	0.0350	0.0319
本期加权平均净值利润率	3.48%	3.17%
本期基金份额净值增长率	3.63%	3.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
期末可供分配利润	146,538,509.25	4,705,408.67
期末可供分配基金份额利润	0.0219	0.0208
期末基金资产净值	6,935,192,587.07	234,030,438.73
期末基金份额净值	1.0363	1.0352
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	

	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
基金份额累计净值增长率	3.63%	3.52%

注：（1）本基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日，至披露时点不满半年。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发均衡增长混合 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	0.99%	0.31%	-0.41%	0.31%	1.40%	0.00%
过去三个月	3.82%	0.29%	2.64%	0.35%	1.18%	-0.06%
自基金合同生效起至今	3.63%	0.23%	-0.09%	0.48%	3.72%	-0.25%

广发均衡增长混合 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	0.98%	0.31%	-0.41%	0.31%	1.39%	0.00%
过去三个月	3.75%	0.29%	2.64%	0.35%	1.11%	-0.06%
自基金合同生效起至今	3.52%	0.23%	-0.09%	0.48%	3.61%	-0.25%

注：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。

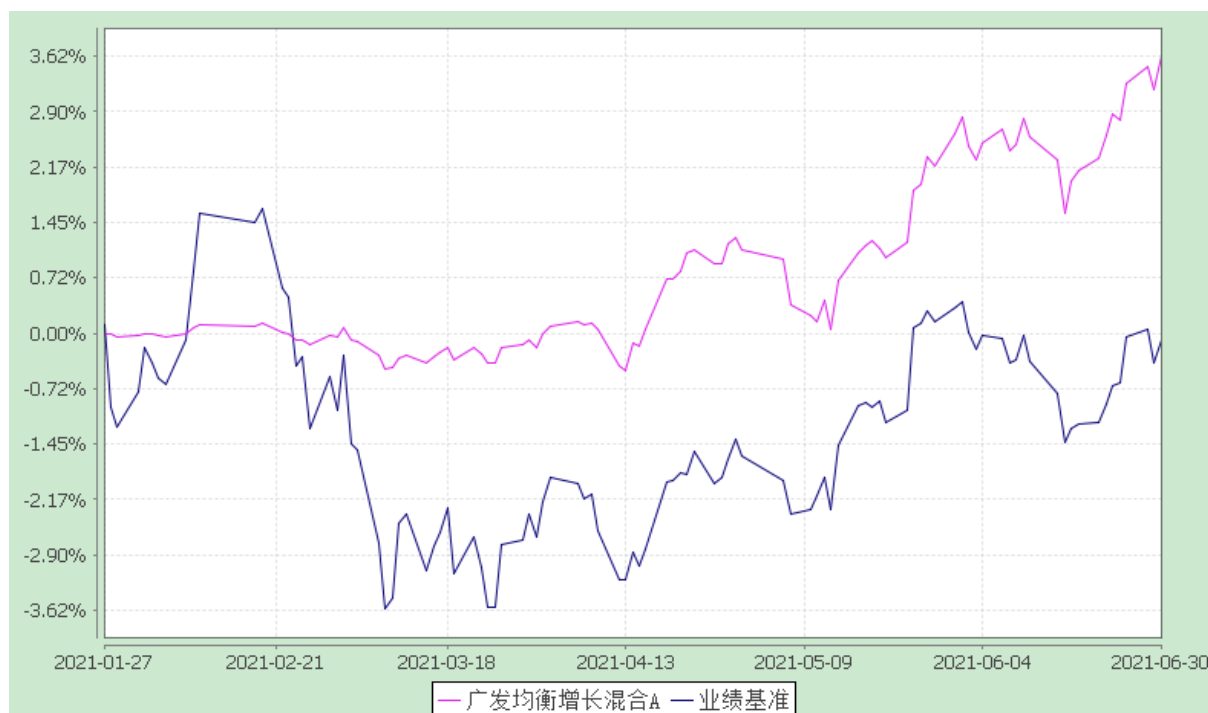
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发均衡增长混合型证券投资基金

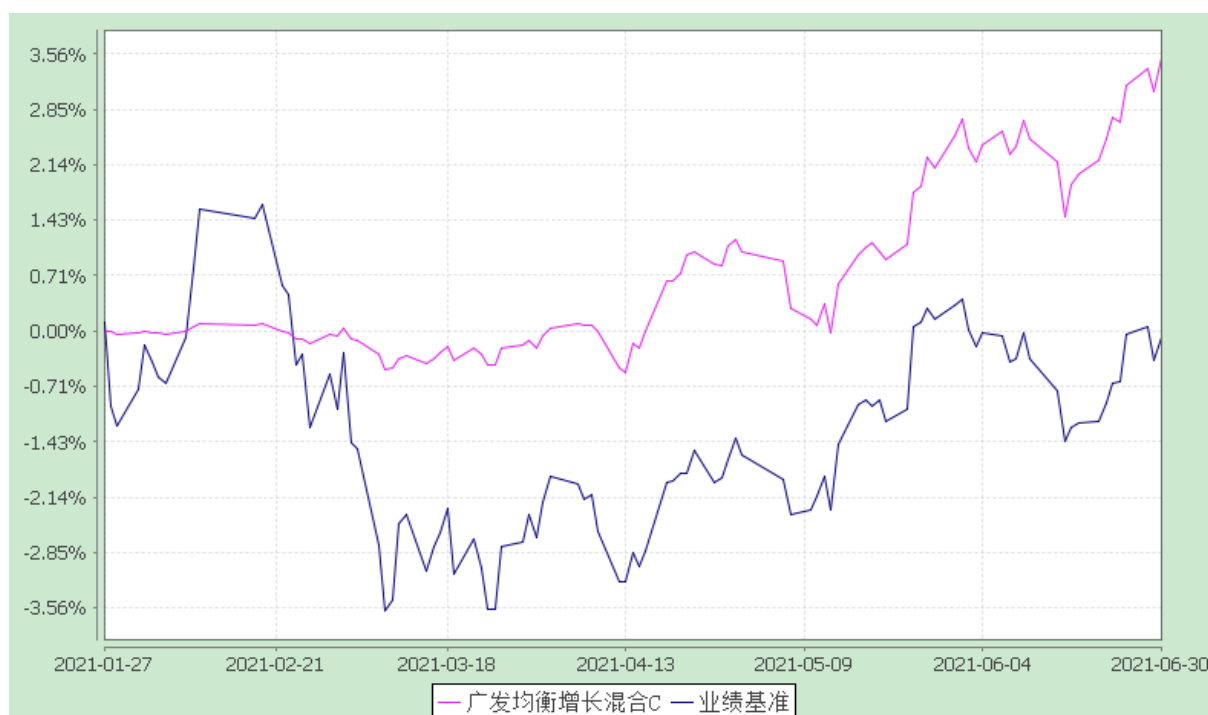
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 1 月 27 日至 2021 年 6 月 30 日)

广发均衡增长混合 A



广发均衡增长混合 C



注：（1）本基金合同生效日期为 2021 年 1 月 27 日，至披露时点未满一年。

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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，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		
王颂	本基金的基金经 理；广发价值回 报混合型证券投 资基金的基金经 理；广发稳安灵 活配置混合型证 券投资基金的基 金经理；广发睿 享稳健增利混合 型证券投资基金 的基金经理；资 产配置总监	2021-01-27	-	23 年	王颂先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任平安证券资产管理部投资经理，平安资产基金投资部总经理，广发基金管理有限公司机构投资部总经理、权益投资二部总经理、资产配置部（原另类投资部）总经理、广发聚瑞混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 24 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 24 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 9 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发新动力混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)。

李阳	本基金的基金经理；广发睿享稳健增利混合型证券投资基金的基金经理	2021-05-20	-	5 年	李阳先生，工程硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国工商银行股份有限公司产品研发中心产品经理，新时代证券股份有限公司资产管理总部量化研究员、量化投资经理，泰康养老保险股份有限公司养老金投资部高级投资经理，广发基金管理有限公司资产配置部研究员。
----	---------------------------------	------------	---	-----	---

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

2021 年上半年，债券收益率先上后下。春节前后为利率高点，十年国债利率上行至 3.3% 附近，随后呈现震荡下行的趋势。5 月份，在大宗商品价格快速下行期间，十年国债利率接近 3.0%。长端利率的震荡区间与 2019 年持平。在宽松的流动性环境下，信用债市场表现出超额收益的特征。信用利差压缩明显，如 3 年期 AA+ 与 AAA 债券的评级利差压缩至近 10 年的最低值。上半年，本组合保持积极的信用债配置，精选优质的发行主体，获取稳健的票息收益。

2021 年上半年，权益市场震荡向上，上证综指涨幅 3.40%，沪深 300 涨幅 0.24%，中证 500 涨幅 6.93%。整体而言，以中证 500 为代表的中盘股表现优于大盘股。在市场流动性保持相对宽裕的背景下，上半年成长风格表现优于价值风格。上半年，本基金保持行业的均衡配比，对有业绩支撑、基本面较好的中小盘股票进行了重点配置，持股分散度较高。

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 3.63%，C 类基金份额净值增长率为 3.52%，同期业绩比较基准收益率为 -0.09%。

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，经济基本面仍面临下行压力。近期央行迅速落实降准措施，打消了市场因通胀而产生的货币收紧预期。债券市场仍有基本面和政策面的支撑，但当前绝对利率及信用利差处于历史偏低水平，债券资产的预期回报亦有所下降。本组合将密切跟踪国内外政策动向，底仓配置以高等级信用债为主，同时加强把握利率债交易机会。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

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：广发均衡增长混合型证券投资基金

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
资 产：		-
银行存款	6.4.7.1	35,881,458.37
结算备付金		99,568,481.89
存出保证金		9,875,140.39
交易性金融资产	6.4.7.2	6,653,269,737.80
其中：股票投资		2,807,817,709.18
基金投资		-
债券投资		3,590,089,028.62
资产支持证券投资		255,363,000.00
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	410,000,185.00
应收证券清算款		30,318,257.64
应收利息	6.4.7.5	24,191,683.86
应收股利		-
应收申购款		689,340.47
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		7,263,794,285.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负 债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		50,119.07
应付赎回款		78,719,956.50
应付管理人报酬		7,280,239.57
应付托管费		1,213,373.28
应付销售服务费		51,164.00
应付交易费用	6.4.7.7	6,689,884.89
应交税费		284,927.01
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	281,595.30
负债合计		94,571,259.62
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	6,918,668,055.56
未分配利润	6.4.7.10	250,554,970.24
所有者权益合计		7,169,223,025.80
负债和所有者权益总计		7,263,794,285.42

注：（1）报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发均衡增长混合 A 基金份额净值人民币 1.0363 元，基金份额总额 6,692,585,733.02 份；广发均衡增长混合 C 基金份额净值人民币 1.0352 元，基金份额总额 226,082,322.54 份；总份额总额 6,918,668,055.56 份。

（2）本会计期间为 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：广发均衡增长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		327,517,217.41
1.利息收入		74,333,998.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,780,389.67
债券利息收入		52,985,509.91
资产支持证券利息收入		1,906,361.87
买入返售金融资产收入		11,661,737.43
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		142,518,123.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	112,896,712.26
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,325,244.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	3,969,116.51
股利收益	6.4.7.15	24,327,050.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	108,048,368.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,616,726.28
减：二、费用		59,228,179.07
1. 管理人报酬		39,235,165.38
2. 托管费		6,539,194.22
3. 销售服务费		309,999.64
4. 交易费用	6.4.7.18	12,887,175.65
5. 利息支出		30,472.61
其中：卖出回购金融资产支出		30,472.61
6. 税金及附加		108,170.02
7. 其他费用	6.4.7.19	118,001.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		268,289,038.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		268,289,038.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发均衡增长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）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）	7,931,476,515.48	-	7,931,476,515.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	268,289,038.34	268,289,038.34
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）	-1,012,808,459.92	-17,734,068.10	-1,030,542,528.02

其中：1.基金申购款	19,750,133.83	254,439.42	20,004,573.25
2.基金赎回款	-1,032,558,593.75	-17,988,507.52	-1,050,547,101.27
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）	6,918,668,055.56	250,554,970.24	7,169,223,025.80

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

广发均衡增长混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2020]2629 号《关于准予广发均衡增长混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2021 年 1 月 25 日向社会公开发行募集并于 2021 年 1 月 27 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2021 年 1 月 25 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 7,931,476,515.48 元，有效认购户数为 67,728 户。其中 广发均衡增长混合 A（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 7,614,156,429.29 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 1,645.51 元； 广发均衡增长混合 C（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 317,318,292.91 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 147.77 元。认购资金在募集期间产生的利息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。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

（2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公

允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵

销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

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

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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	35,881,458.37
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	35,881,458.37

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	2,703,426,580.18	2,807,817,709.18	104,391,129.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	868,101,394.73	870,232,528.62
	银行间市场	2,717,419,314.11	2,719,856,500.00
	合计	3,585,520,708.84	3,590,089,028.62
资产支持证券	255,234,700.27	255,363,000.00	128,299.73
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,544,181,989.29	6,653,269,737.80	109,087,748.51

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	63,322,980.00	-	-	-
其中：股指期货投资	63,322,980.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	63,322,980.00	-	-	-

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 IH2109 买入持仓量 60 手，合约市值人民币 62,283,600.00 元，公允价值变动人民币-1,039,380.00 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	280,000,000.00	-
银行间市场	130,000,185.00	-
合计	410,000,185.00	-

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	10,720.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	720.27
应收结算备付金利息	38,471.90
应收债券利息	23,260,939.39
应收资产支持证券利息	867,482.75
应收买入返售证券利息	13,349.25
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	24,191,683.86

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	6,638,860.69
银行间市场应付交易费用	51,024.20
合计	6,689,884.89

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	188,465.95
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,129.35
合计	281,595.30

6.4.7.9 实收基金

广发均衡增长混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,614,158,074.80	7,614,158,074.80
本期申购	17,323,548.01	17,323,548.01
本期赎回（以“-”号填列）	-938,895,889.79	-938,895,889.79
本期末	6,692,585,733.02	6,692,585,733.02

广发均衡增长混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	317,318,440.68	317,318,440.68
本期申购	2,426,585.82	2,426,585.82
本期赎回（以“-”号填列）	-93,662,703.96	-93,662,703.96
本期末	226,082,322.54	226,082,322.54

注：1、本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额的情况，详见于附注

6.4.1“基金基本情况”之说明。

2、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

广发均衡增长混合 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
本期利润	154,936,968.57	104,047,874.33	258,984,842.90
本期基金份额交易产生的变动数	-8,398,459.32	-7,979,529.53	-16,377,988.85
其中：基金申购款	90,919.15	130,219.87	221,139.02
基金赎回款	-8,489,378.47	-8,109,749.40	-16,599,127.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	146,538,509.25	96,068,344.80	242,606,854.05

广发均衡增长混合 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
本期利润	5,303,701.26	4,000,494.18	9,304,195.44
本期基金份额交易产生的变动数	-598,292.59	-757,786.66	-1,356,079.25
其中：基金申购款	15,322.78	17,977.62	33,300.40
基金赎回款	-613,615.37	-775,764.28	-1,389,379.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,705,408.67	3,242,707.52	7,948,116.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	722,218.08
定期存款利息收入	6,598,333.33
其他存款利息收入	4,830.03
结算备付金利息收入	455,008.23
其他	-
合计	7,780,389.67

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,028,119,868.04
减：卖出股票成本总额	3,915,223,155.78
买卖股票差价收入	112,896,712.26

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）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	1,325,244.00
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	1,325,244.00

6.4.7.13.2 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27日（基金合同生效日）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	8,441,511,788.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,359,827,355.15
减：应收利息总额	80,359,189.62
买卖债券差价收入	1,325,244.00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	24,760,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	24,760,000.00
减：应收利息总额	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股指期货投资收益	7,152,368.94
国债期货投资收益	-3,183,252.43

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	24,327,050.97
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	24,327,050.97

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	109,087,748.51
——股票投资	104,391,129.00

——债券投资	4,568,319.78
——资产支持证券投资	128,299.73
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,039,380.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-1,039,380.00
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	108,048,368.51

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	2,561,340.79
基金转换费收入	55,385.49
合计	2,616,726.28

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	12,768,702.24
银行间市场交易费用	54,562.50
期货交易费用	63,910.91
合计	12,887,175.65

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	33,834.95
信息披露费	50,294.40
证券出借违约金	-
银行汇划费	24,472.20
账户维护费	9,000.00
其他	400.00
合计	118,001.55

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
中国民生银行股份有限公司	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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	39,235,165.38
其中：支付销售机构的客户维护费	19,149,976.99

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,539,194.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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27日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C	合计
中国民生银行股份有限公司	-	249,975.40	249,975.40
广发基金管理有限公司	-	6,626.64	6,626.64
广发证券股份有限公司	-	549.28	549.28
合计	-	257,151.32	257,151.32

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 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，

自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付，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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固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

广发均衡增长混合 A

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发均衡增长混合 C

本报告期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27日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	35,881,458.37	722,218.08

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	新股流通受限	36.35	79.48	3,486.00	126,716.10	277,067.28	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股流通受限	7.72	19.11	3,493.00	26,965.96	66,751.23	-
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	新股流通受限	18.42	58.40	1,040.00	19,156.80	60,736.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	20210622 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股流通受限	19.11	33.21	1,137.00	21,728.07	37,759.77	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股流通	9.56	14.54	1,899.00	18,154.44	27,611.46	-

				受限						
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
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	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	20210610 除权除息,派息比例 0.1600 (含税)
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300966	深水	2021-0	2021-0	新股	8.48	22.07	394.00	3,341.	8,695.	20210

1	海纳	3-23	9-30	流通受限				12	58	611 除权除息,派息比例 0.0530 (含税)
60516 2	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	-
30098 6	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
30098 7	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
30098 5	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
30097 1	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股流通受限	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	20210611 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
30101 8	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
30097 5	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	20210608 除权除息,派息比例 0.0360 (含税)
30096 3	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	20210611 除权除息,派息比例 0.1500

										(含税)
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	20210623 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
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	12,530.00	1,253,000.00	1,253,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新债流通受限	100.00	100.00	882.00	88,200.00	88,200.00	-
113049	长汽转债	2021-06-11	2021-07-08	新债流通受限	100.00	100.00	120.00	12,000.00	12,000.00	-

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688368	晶丰明源	2021-06-21	重大事项停牌	335.26	2021-07-05	402.31	3,800.00	1,158,702.79	1,273,988.00	-
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	475,651.00	3,195,985.70	2,658,889.09	-

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	50,235,000.00
A-1 以下	-
未评级	1,145,906,500.00
合计	1,196,141,500.00

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内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	255,363,000.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	255,363,000.00

注：1、资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

2、短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券均为 AAA 的短期资产支持证券，短期信用评级 A-1 以下所填列的资产支持证券均为 AAA 以下的短期资产支持证券。

6.4.13.2.3 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
AAA	1,258,470,833.60
AAA 以下	53,577,695.02
未评级	1,081,899,000.00
合计	2,393,947,528.62

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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。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	35,881,458.37	-	-	-	35,881,458.37
结算备付金	99,568,481.89	-	-	-	99,568,481.89
存出保证金	9,875,140.39	-	-	-	9,875,140.39
交易性金融资产	2,040,137,028.62	1,755,015,000.00	50,300,000.00	2,807,817,709.18	6,653,269,737.80
买入返售金融资产	410,000,185.00	-	-	-	410,000,185.00
应收证券清算款	-	-	-	30,318,257.64	30,318,257.64
应收利息	-	-	-	24,191,683.86	24,191,683.86
应收申购款	-	-	-	689,340.47	689,340.47
资产总计	2,595,462,294.27	1,755,015,000.00	50,300,000.00	2,863,016,991.15	7,263,794,285.42
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	50,119.07	50,119.07
应付赎回款	-	-	-	78,719,956.50	78,719,956.50
应付管理人报酬	-	-	-	7,280,239.57	7,280,239.57
应付托管费	-	-	-	1,213,373.28	1,213,373.28
应付销售服务费	-	-	-	51,164.00	51,164.00
应付交易费用	-	-	-	6,689,884.89	6,689,884.89
应交税费	-	-	-	284,927.01	284,927.01
其他负债	-	-	-	281,595.30	281,595.30
负债总计	-	-	-	94,571,259.62	94,571,259.62
利率敏感度缺口	2,595,462,294.27	1,755,015,000.00	50,300,000.00	2,768,445,731.53	7,169,223,025.80

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

假设	除市场利率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
	市场利率上升 25 个基点	-14,456,696.12
	市场利率下降 25 个基点	14,556,478.57

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,807,817,709.18	39.16
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	36,590,528.62	0.51
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	2,844,408,237.80	39.68

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
	上升 5%	128,638,745.24
	下降 5%	-128,638,745.24

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 2,838,108,953.75 元，属于第二层次的余额为人民币 3,815,160,784.05 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	2,807,817,709.18	38.65
	其中：股票	2,807,817,709.18	38.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,845,452,028.62	52.94
	其中：债券	3,590,089,028.62	49.42
	资产支持证券	255,363,000.00	3.52
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	410,000,185.00	5.64
	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	135,449,940.26	1.86

	计		
8	其他各项资产	65,074,422.36	0.90
9	合计	7,263,794,285.42	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	20,794,415.52	0.29
B	采矿业	30,483,121.35	0.43
C	制造业	1,824,443,307.99	25.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,918,472.99	0.49
E	建筑业	12,725,334.37	0.18
F	批发和零售业	63,456,311.35	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	64,001,985.74	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,839,462.13	1.94
J	金融业	391,852,427.90	5.47
K	房地产业	48,748,082.90	0.68
L	租赁和商务服务业	52,962,907.90	0.74
M	科学研究和技术服务业	33,533,919.23	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	36,015,970.81	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,261,032.00	0.03
Q	卫生和社会工作	8,993,477.52	0.13
R	文化、体育和娱乐业	43,554,515.48	0.61
S	综合	232,964.00	0.00
	合计	2,807,817,709.18	39.16

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	36,200	74,452,540.00	1.04
2	600036	招商银行	1,051,700	56,991,623.00	0.79
3	601166	兴业银行	1,984,000	40,771,200.00	0.57
4	000858	五粮液	121,370	36,154,909.30	0.50
5	000725	京东方 A	5,604,200	34,970,208.00	0.49
6	601636	旗滨集团	1,508,270	27,993,491.20	0.39
7	603337	杰克股份	981,268	26,229,293.64	0.37
8	002727	一心堂	791,700	26,213,187.00	0.37
9	300633	开立医疗	753,769	23,804,025.02	0.33
10	601888	中国中免	78,800	23,647,880.00	0.33
11	000100	TCL 科技	3,078,500	23,550,525.00	0.33
12	300496	中科创达	141,316	22,195,090.96	0.31
13	300059	东方财富	658,056	21,577,656.24	0.30
14	600426	华鲁恒升	691,440	21,400,068.00	0.30
15	601318	中国平安	330,700	21,257,396.00	0.30
16	000012	南玻 A	2,054,819	21,041,346.56	0.29
17	002064	华峰化学	1,434,100	20,364,220.00	0.28
18	600809	山西汾酒	45,100	20,204,800.00	0.28
19	603026	石大胜华	124,386	20,156,751.30	0.28
20	002714	牧原股份	330,186	20,081,912.52	0.28
21	600309	万华化学	183,800	20,001,116.00	0.28
22	002430	杭氧股份	574,273	19,864,103.07	0.28
23	300122	智飞生物	104,000	19,419,920.00	0.27
24	603259	药明康德	123,337	19,313,340.83	0.27
25	603486	科沃斯	84,600	19,295,568.00	0.27
26	000933	神火股份	2,029,000	19,174,050.00	0.27
27	600884	杉杉股份	815,630	19,020,491.60	0.27
28	300750	宁德时代	35,200	18,824,960.00	0.26
29	300327	中颖电子	218,703	18,640,056.69	0.26
30	002311	海大集团	226,728	18,501,004.80	0.26
31	300316	晶盛机电	365,628	18,464,214.00	0.26
32	000333	美的集团	255,040	18,202,204.80	0.25
33	000001	平安银行	788,100	17,826,822.00	0.25
34	600176	中国巨石	1,148,081	17,806,736.31	0.25
35	002129	中环股份	453,300	17,497,380.00	0.24
36	300463	迈克生物	410,049	17,258,962.41	0.24
37	002649	博彦科技	1,634,100	17,158,050.00	0.24
38	000733	振华科技	272,118	16,618,246.26	0.23
39	600919	江苏银行	2,303,100	16,352,010.00	0.23
40	601919	中远海控	533,500	16,293,090.00	0.23
41	002138	顺络电子	410,300	15,907,331.00	0.22

42	002027	分众传媒	1,638,000	15,413,580.00	0.21
43	600438	通威股份	356,100	15,408,447.00	0.21
44	002293	罗莱生活	1,133,236	15,174,030.04	0.21
45	601398	工商银行	2,926,200	15,128,454.00	0.21
46	002139	拓邦股份	811,172	14,592,984.28	0.20
47	603186	华正新材	394,836	14,395,720.56	0.20
48	603773	沃格光电	539,088	14,215,750.56	0.20
49	601336	新华保险	308,244	14,151,482.04	0.20
50	002179	中航光电	178,000	14,065,560.00	0.20
51	002541	鸿路钢构	239,621	13,981,885.35	0.20
52	300413	芒果超媒	201,800	13,843,480.00	0.19
53	000560	我爱我家	3,059,285	13,675,003.95	0.19
54	300373	扬杰科技	222,274	13,456,467.96	0.19
55	002840	华统股份	1,493,200	13,453,732.00	0.19
56	601827	三峰环境	1,415,000	13,400,050.00	0.19
57	001965	招商公路	1,847,710	13,340,466.20	0.19
58	000887	中鼎股份	1,103,200	13,326,656.00	0.19
59	002913	奥士康	169,800	13,235,910.00	0.18
60	000039	中集集团	710,860	12,923,434.80	0.18
61	601689	拓普集团	343,900	12,872,177.00	0.18
62	300408	三环集团	302,900	12,849,018.00	0.18
63	601628	中国人寿	378,300	12,820,587.00	0.18
64	600132	重庆啤酒	64,600	12,787,570.00	0.18
65	000561	烽火电子	1,907,771	12,762,987.99	0.18
66	600201	生物股份	720,660	12,575,517.00	0.18
67	600887	伊利股份	332,500	12,245,975.00	0.17
68	002022	科华生物	683,255	12,237,097.05	0.17
69	300168	万达信息	829,100	12,104,860.00	0.17
70	002920	德赛西威	109,000	11,998,720.00	0.17
71	601601	中国太保	410,155	11,882,190.35	0.17
72	002402	和而泰	493,100	11,819,607.00	0.16
73	300124	汇川技术	155,398	11,539,855.48	0.16
74	603659	璞泰来	84,088	11,486,420.80	0.16
75	000519	中兵红箭	1,067,800	11,446,816.00	0.16
76	601328	交通银行	2,323,600	11,385,640.00	0.16
77	600409	三友化工	1,121,732	11,340,710.52	0.16
78	600660	福耀玻璃	202,000	11,281,700.00	0.16
79	600966	博汇纸业	856,200	11,173,410.00	0.16
80	603331	百达精工	1,135,260	11,148,253.20	0.16
81	002206	海利得	1,783,800	11,077,398.00	0.15
82	603010	万盛股份	527,840	11,068,804.80	0.15
83	300196	长海股份	643,800	11,047,608.00	0.15
84	000568	泸州老窖	46,301	10,924,257.94	0.15
85	002106	莱宝高科	968,503	10,895,658.75	0.15

86	601012	隆基股份	120,020	10,662,576.80	0.15
87	002034	旺能环境	660,437	10,533,970.15	0.15
88	002609	捷顺科技	1,034,200	10,352,342.00	0.14
89	300783	三只松鼠	218,200	10,333,952.00	0.14
90	300799	左江科技	188,100	10,307,880.00	0.14
91	600184	光电股份	938,004	10,196,103.48	0.14
92	300760	迈瑞医疗	21,209	10,181,380.45	0.14
93	300775	三角防务	263,134	10,051,718.80	0.14
94	002701	奥瑞金	1,947,100	10,008,094.00	0.14
95	601939	建设银行	1,491,300	9,917,145.00	0.14
96	600779	水井坊	78,100	9,867,935.00	0.14
97	300653	正海生物	123,650	9,681,795.00	0.14
98	000661	长春高新	24,900	9,636,300.00	0.13
99	002603	以岭药业	329,000	9,593,640.00	0.13
100	002066	瑞泰科技	975,101	9,575,491.82	0.13
101	000989	九芝堂	973,806	9,543,298.80	0.13
102	300788	中信出版	256,823	9,443,381.71	0.13
103	601599	浙文影业	2,827,400	9,160,776.00	0.13
104	603728	鸣志电器	520,400	9,153,836.00	0.13
105	000930	中粮科技	1,015,700	9,151,457.00	0.13
106	002142	宁波银行	234,300	9,130,671.00	0.13
107	600031	三一重工	309,500	8,997,165.00	0.13
108	000683	远兴能源	1,905,100	8,896,817.00	0.12
109	002020	京新药业	1,038,998	8,831,483.00	0.12
110	300207	欣旺达	271,200	8,830,272.00	0.12
111	002171	楚江新材	1,008,817	8,806,972.41	0.12
112	300685	艾德生物	81,850	8,518,948.00	0.12
113	600000	浦发银行	851,200	8,512,000.00	0.12
114	000830	鲁西化工	452,900	8,482,817.00	0.12
115	601211	国泰君安	492,600	8,443,164.00	0.12
116	000702	正虹科技	1,730,983	8,412,577.38	0.12
117	002015	协鑫能科	929,900	8,396,997.00	0.12
118	002961	瑞达期货	390,826	8,332,410.32	0.12
119	603108	润达医疗	732,418	8,225,054.14	0.11
120	000651	格力电器	157,500	8,205,750.00	0.11
121	300274	阳光电源	70,849	8,151,885.94	0.11
122	002479	富春环保	1,229,600	7,955,512.00	0.11
123	603790	雅运股份	770,500	7,905,330.00	0.11
124	002706	良信股份	335,530	7,562,846.20	0.11
125	002135	东南网架	964,400	7,377,660.00	0.10
126	601009	南京银行	681,100	7,165,172.00	0.10
127	002315	焦点科技	393,300	7,118,730.00	0.10
128	002636	金安国纪	431,500	6,998,930.00	0.10
129	603288	海天味业	54,113	6,977,871.35	0.10

130	601699	潞安环能	587,700	6,940,737.00	0.10
131	605166	聚合顺	745,600	6,934,080.00	0.10
132	603267	鸿远电子	53,943	6,900,388.56	0.10
133	600873	梅花生物	1,225,100	6,860,560.00	0.10
134	603260	合盛硅业	87,500	6,729,625.00	0.09
135	601288	农业银行	2,213,400	6,706,602.00	0.09
136	603568	伟明环保	292,500	6,677,775.00	0.09
137	600522	中天科技	660,700	6,607,000.00	0.09
138	603566	普莱柯	285,924	6,519,067.20	0.09
139	600926	杭州银行	431,600	6,366,100.00	0.09
140	002415	海康威视	98,400	6,346,800.00	0.09
141	601598	中国外运	1,255,500	6,340,275.00	0.09
142	002410	广联达	92,900	6,335,780.00	0.09
143	300782	卓胜微	11,783	6,333,362.50	0.09
144	000905	厦门港务	950,366	6,329,437.56	0.09
145	002314	南山控股	1,875,586	6,245,701.38	0.09
146	002850	科达利	71,400	6,240,360.00	0.09
147	300753	爱朋医疗	272,488	6,163,678.56	0.09
148	600008	首创环保	2,006,100	6,038,361.00	0.08
149	300476	胜宏科技	275,300	6,015,305.00	0.08
150	000060	中金岭南	1,328,900	6,006,628.00	0.08
151	600690	海尔智家	230,020	5,959,818.20	0.08
152	600039	四川路桥	948,700	5,948,349.00	0.08
153	600782	新钢股份	1,065,000	5,942,700.00	0.08
154	300406	九强生物	301,100	5,940,703.00	0.08
155	601169	北京银行	1,198,400	5,836,208.00	0.08
156	601377	兴业证券	590,300	5,702,298.00	0.08
157	601988	中国银行	1,836,800	5,657,344.00	0.08
158	002839	张家港行	1,027,000	5,586,880.00	0.08
159	002254	泰和新材	275,000	5,574,250.00	0.08
160	300724	捷佳伟创	47,627	5,525,208.27	0.08
161	300369	绿盟科技	345,881	5,516,801.95	0.08
162	601139	深圳燃气	834,000	5,471,040.00	0.08
163	300138	晨光生物	357,400	5,468,220.00	0.08
164	000666	经纬纺机	681,300	5,429,961.00	0.08
165	300662	科锐国际	88,800	5,383,056.00	0.08
166	002876	三利谱	82,600	5,344,220.00	0.07
167	600282	南钢股份	1,500,500	5,341,780.00	0.07
168	600030	中信证券	213,300	5,319,702.00	0.07
169	601818	光大银行	1,404,200	5,307,876.00	0.07
170	000028	国药一致	139,500	5,278,680.00	0.07
171	600019	宝钢股份	679,600	5,192,144.00	0.07
172	300529	健帆生物	59,600	5,147,056.00	0.07
173	002245	蔚蓝锂芯	260,900	5,139,730.00	0.07

174	000046	泛海控股	2,230,200	5,129,460.00	0.07
175	601928	凤凰传媒	716,000	5,112,240.00	0.07
176	300451	创业慧康	572,610	5,061,872.40	0.07
177	002376	新北洋	552,680	5,051,495.20	0.07
178	300627	华测导航	147,996	5,048,143.56	0.07
179	601229	上海银行	609,000	4,993,800.00	0.07
180	000488	晨鸣纸业	608,900	4,956,446.00	0.07
181	600901	江苏租赁	950,181	4,940,941.20	0.07
182	000923	河钢资源	256,205	4,885,829.35	0.07
183	603660	苏州科达	701,802	4,884,541.92	0.07
184	002231	奥维通信	908,100	4,867,416.00	0.07
185	601678	滨化股份	609,724	4,822,916.84	0.07
186	000528	柳工	586,000	4,805,200.00	0.07
187	300567	精测电子	77,900	4,783,060.00	0.07
188	600323	瀚蓝环境	218,100	4,752,399.00	0.07
189	601233	桐昆股份	195,300	4,704,777.00	0.07
190	002921	联诚精密	296,430	4,585,772.10	0.06
191	002833	弘亚数控	117,900	4,568,625.00	0.06
192	600748	上实发展	990,160	4,554,736.00	0.06
193	601319	中国人保	765,800	4,541,194.00	0.06
194	600549	厦门钨业	217,500	4,530,525.00	0.06
195	300679	电连技术	156,000	4,495,920.00	0.06
196	600308	华泰股份	809,100	4,466,232.00	0.06
197	603008	喜临门	135,200	4,462,952.00	0.06
198	000732	泰禾集团	2,063,800	4,457,808.00	0.06
199	002362	汉王科技	215,633	4,442,039.80	0.06
200	002539	云图控股	500,177	4,366,545.21	0.06
201	600587	新华医疗	192,700	4,364,655.00	0.06
202	603685	晨丰科技	356,113	4,348,139.73	0.06
203	601666	平煤股份	608,200	4,324,302.00	0.06
204	600512	腾达建设	1,421,800	4,322,272.00	0.06
205	300458	全志科技	49,300	4,321,638.00	0.06
206	603678	火炬电子	63,430	4,281,525.00	0.06
207	000538	云南白药	36,932	4,273,771.04	0.06
208	603612	索通发展	232,631	4,180,379.07	0.06
209	603355	莱克电气	67,166	4,179,740.18	0.06
210	601098	中南传媒	469,606	4,141,924.92	0.06
211	002818	富森美	341,715	4,121,082.90	0.06
212	603599	广信股份	137,000	4,120,960.00	0.06
213	300002	神州泰岳	828,600	4,018,710.00	0.06
214	600596	新安股份	223,300	3,956,876.00	0.06
215	002657	中科金财	347,400	3,946,464.00	0.06
216	603103	横店影视	267,600	3,939,072.00	0.05
217	300896	爱美客	4,980	3,928,622.40	0.05

218	603799	华友钴业	34,000	3,882,800.00	0.05
219	600096	云天化	274,500	3,853,980.00	0.05
220	002209	达意隆	563,600	3,849,388.00	0.05
221	002332	仙琚制药	306,392	3,842,155.68	0.05
222	603869	新智认知	430,435	3,813,654.10	0.05
223	601916	浙商银行	957,600	3,801,672.00	0.05
224	600729	重庆百货	136,400	3,744,180.00	0.05
225	002335	科华数据	164,246	3,739,881.42	0.05
226	600592	龙溪股份	390,400	3,724,416.00	0.05
227	603801	志邦家居	116,404	3,720,271.84	0.05
228	000006	深振业 A	740,300	3,708,903.00	0.05
229	603128	华贸物流	262,200	3,694,398.00	0.05
230	600483	福能股份	350,880	3,680,731.20	0.05
231	600808	马钢股份	854,900	3,667,521.00	0.05
232	600057	厦门象屿	586,100	3,663,125.00	0.05
233	603833	欧派家居	25,700	3,648,372.00	0.05
234	002852	道道全	250,900	3,640,559.00	0.05
235	603997	继峰股份	438,496	3,604,437.12	0.05
236	300223	北京君正	35,700	3,602,844.00	0.05
237	600800	渤海化学	830,300	3,595,199.00	0.05
238	603466	风语筑	219,795	3,593,648.25	0.05
239	300747	锐科激光	31,414	3,583,080.84	0.05
240	601929	吉视传媒	1,930,700	3,571,795.00	0.05
241	603081	大丰实业	322,100	3,562,426.00	0.05
242	600499	科达制造	246,500	3,549,600.00	0.05
243	600459	贵研铂业	143,790	3,537,234.00	0.05
244	000918	嘉凯城	806,400	3,523,968.00	0.05
245	603180	金牌厨柜	73,720	3,515,706.80	0.05
246	603882	金域医学	21,900	3,498,963.00	0.05
247	603676	卫信康	438,507	3,481,745.58	0.05
248	300014	亿纬锂能	33,300	3,460,869.00	0.05
249	600489	中金黄金	400,000	3,448,000.00	0.05
250	600548	深高速	391,000	3,409,520.00	0.05
251	000807	云铝股份	286,000	3,403,400.00	0.05
252	601900	南方传媒	432,037	3,369,888.60	0.05
253	603357	设计总院	382,400	3,311,584.00	0.05
254	603727	博迈科	179,100	3,263,202.00	0.05
255	600298	安琪酵母	59,800	3,251,924.00	0.05
256	600986	浙文互联	755,600	3,173,520.00	0.04
257	603298	杭叉集团	174,397	3,163,561.58	0.04
258	300465	高伟达	258,400	3,136,976.00	0.04
259	002807	江阴银行	783,600	3,087,384.00	0.04
260	601456	国联证券	199,300	3,069,220.00	0.04
261	601688	华泰证券	193,000	3,049,400.00	0.04

262	001979	招商蛇口	277,000	3,033,150.00	0.04
263	300548	博创科技	85,182	3,031,627.38	0.04
264	601857	中国石油	562,300	2,974,567.00	0.04
265	300006	莱美药业	419,900	2,960,295.00	0.04
266	600315	上海家化	48,100	2,892,734.00	0.04
267	603290	斯达半导	8,700	2,784,000.00	0.04
268	600741	华域汽车	105,000	2,758,350.00	0.04
269	600577	精达股份	422,500	2,695,550.00	0.04
270	002024	苏宁易购	475,651	2,658,889.09	0.04
271	603501	韦尔股份	8,100	2,608,200.00	0.04
272	002425	凯撒文化	308,700	2,583,819.00	0.04
273	601998	中信银行	492,800	2,513,280.00	0.04
274	600643	爱建集团	353,400	2,466,732.00	0.03
275	002258	利尔化学	95,300	2,458,740.00	0.03
276	688202	美迪西	4,626	2,405,057.40	0.03
277	002475	立讯精密	52,200	2,401,200.00	0.03
278	600563	法拉电子	14,862	2,353,546.32	0.03
279	002078	太阳纸业	175,700	2,345,595.00	0.03
280	600803	新奥股份	141,340	2,333,523.40	0.03
281	001872	招商港口	137,914	2,333,504.88	0.03
282	002508	老板电器	50,100	2,329,650.00	0.03
283	603877	太平鸟	43,300	2,311,354.00	0.03
284	600276	恒瑞医药	33,790	2,296,706.30	0.03
285	600422	昆药集团	234,400	2,273,680.00	0.03
286	601128	常熟银行	365,400	2,265,480.00	0.03
287	601838	成都银行	179,000	2,262,560.00	0.03
288	600661	昂立教育	186,400	2,261,032.00	0.03
289	002966	苏州银行	306,659	2,253,943.65	0.03
290	002459	晶澳科技	45,700	2,239,300.00	0.03
291	300015	爱尔眼科	31,474	2,234,024.52	0.03
292	000517	荣安地产	839,600	2,224,940.00	0.03
293	601100	恒立液压	25,671	2,205,652.32	0.03
294	600115	中国东航	427,400	2,171,192.00	0.03
295	300363	博腾股份	25,800	2,170,296.00	0.03
296	600183	生益科技	90,800	2,125,628.00	0.03
297	300009	安科生物	139,400	2,077,060.00	0.03
298	000799	酒鬼酒	8,000	2,044,800.00	0.03
299	002614	奥佳华	89,800	2,032,174.00	0.03
300	603713	密尔克卫	18,695	2,018,686.10	0.03
301	000002	万科 A	82,400	1,961,944.00	0.03
302	603093	南华期货	133,300	1,946,180.00	0.03
303	300347	泰格医药	9,800	1,894,340.00	0.03
304	000059	华锦股份	231,600	1,889,856.00	0.03
305	300294	博雅生物	52,100	1,883,415.00	0.03

306	600835	上海机电	114,700	1,863,875.00	0.03
307	603444	吉比特	3,500	1,855,000.00	0.03
308	300146	汤臣倍健	56,200	1,848,980.00	0.03
309	300582	英飞特	77,500	1,808,850.00	0.03
310	600141	兴发集团	95,600	1,800,148.00	0.03
311	603995	甬金股份	46,800	1,799,460.00	0.03
312	600406	国电南瑞	76,940	1,788,085.60	0.02
313	600256	广汇能源	528,100	1,758,573.00	0.02
314	600570	恒生电子	18,800	1,753,100.00	0.02
315	300759	康龙化成	8,000	1,735,920.00	0.02
316	600571	信雅达	235,956	1,731,917.04	0.02
317	603127	昭衍新药	9,400	1,727,250.00	0.02
318	002601	龙佰集团	49,661	1,717,277.38	0.02
319	300012	华测检测	51,600	1,645,008.00	0.02
320	600346	恒力石化	61,800	1,621,632.00	0.02
321	600827	百联股份	79,000	1,591,850.00	0.02
322	688200	华峰测控	3,350	1,585,655.50	0.02
323	002709	天赐材料	14,870	1,584,844.60	0.02
324	002841	视源股份	12,600	1,566,054.00	0.02
325	603392	万泰生物	6,000	1,555,080.00	0.02
326	600219	南山铝业	427,600	1,539,360.00	0.02
327	688383	新益昌	10,900	1,537,009.00	0.02
328	002493	荣盛石化	86,400	1,492,128.00	0.02
329	002645	华宏科技	92,800	1,482,944.00	0.02
330	300081	恒信东方	188,900	1,456,419.00	0.02
331	002812	恩捷股份	6,081	1,423,562.10	0.02
332	002946	新乳业	93,200	1,411,980.00	0.02
333	000425	徐工机械	218,200	1,389,934.00	0.02
334	002466	天齐锂业	22,400	1,389,248.00	0.02
335	002271	东方雨虹	25,100	1,388,532.00	0.02
336	300558	贝达药业	12,700	1,374,648.00	0.02
337	600143	金发科技	65,800	1,372,588.00	0.02
338	300566	激智科技	46,600	1,304,334.00	0.02
339	000501	鄂武商 A	110,600	1,294,020.00	0.02
340	601899	紫金矿业	132,700	1,285,863.00	0.02
341	688396	华润微	14,100	1,283,382.00	0.02
342	000301	东方盛虹	61,400	1,283,260.00	0.02
343	000895	双汇发展	40,300	1,281,540.00	0.02
344	688368	晶丰明源	3,800	1,273,988.00	0.02
345	002773	康弘药业	54,300	1,255,959.00	0.02
346	002268	卫士通	64,200	1,250,616.00	0.02
347	000822	山东海化	158,000	1,232,400.00	0.02
348	601155	新城控股	29,300	1,218,880.00	0.02
349	002092	中泰化学	113,900	1,169,753.00	0.02

350	300454	深信服	4,500	1,167,660.00	0.02
351	300395	菲利华	24,200	1,166,924.00	0.02
352	603020	爱普股份	62,000	1,157,540.00	0.02
353	002745	木林森	86,300	1,156,420.00	0.02
354	000656	金科股份	197,483	1,143,426.57	0.02
355	002422	科伦药业	57,000	1,137,150.00	0.02
356	300790	宇瞳光学	33,500	1,136,655.00	0.02
357	603915	国茂股份	28,700	1,133,650.00	0.02
358	600110	诺德股份	92,400	1,125,432.00	0.02
359	300873	海晨股份	26,200	1,121,622.00	0.02
360	688005	容百科技	9,200	1,115,040.00	0.02
361	601965	中国汽研	63,500	1,097,280.00	0.02
362	000821	京山轻机	121,400	1,092,600.00	0.02
363	688036	传音控股	5,100	1,068,450.00	0.01
364	002555	三七互娱	44,300	1,064,086.00	0.01
365	300751	迈为股份	2,340	1,063,998.00	0.01
366	002110	三钢闽光	157,000	1,058,180.00	0.01
367	000739	普洛药业	35,400	1,040,760.00	0.01
368	603369	今世缘	19,100	1,034,456.00	0.01
369	002925	盈趣科技	26,200	1,019,442.00	0.01
370	601882	海天精工	64,900	1,009,195.00	0.01
371	600737	中粮糖业	100,200	1,003,002.00	0.01
372	603345	安井食品	3,900	990,678.00	0.01
373	603100	川仪股份	56,200	984,062.00	0.01
374	300677	英科医疗	7,800	973,440.00	0.01
375	002937	兴瑞科技	68,400	969,912.00	0.01
376	000403	派林生物	31,000	964,720.00	0.01
377	601369	陕鼓动力	117,800	957,714.00	0.01
378	300796	贝斯美	52,000	949,520.00	0.01
379	688111	金山办公	2,400	947,520.00	0.01
380	000429	粤高速 A	131,600	943,572.00	0.01
381	603517	绝味食品	11,000	927,190.00	0.01
382	002460	赣锋锂业	7,600	920,284.00	0.01
383	000062	深圳华强	54,300	918,213.00	0.01
384	600882	妙可蓝多	13,000	907,400.00	0.01
385	300642	透景生命	10,550	905,295.50	0.01
386	002867	周大生	44,500	879,765.00	0.01
387	002594	比亚迪	3,500	878,500.00	0.01
388	600711	盛屯矿业	120,600	859,878.00	0.01
389	600048	保利地产	71,300	858,452.00	0.01
390	300979	华利集团	7,725	855,457.50	0.01
391	300676	华大基因	7,100	842,060.00	0.01
392	601668	中国建筑	179,000	832,350.00	0.01
393	300033	同花顺	7,300	823,294.00	0.01

394	600383	金地集团	80,100	820,224.00	0.01
395	600900	长江电力	39,700	819,408.00	0.01
396	000963	华东医药	17,700	814,377.00	0.01
397	601966	玲珑轮胎	18,400	804,816.00	0.01
398	601633	长城汽车	18,300	797,697.00	0.01
399	603658	安图生物	10,500	795,585.00	0.01
400	300450	先导智能	13,060	785,428.40	0.01
401	002030	达安基因	36,800	781,632.00	0.01
402	688029	南微医学	2,500	779,225.00	0.01
403	003016	欣贺股份	47,600	762,076.00	0.01
404	002154	报喜鸟	118,900	757,393.00	0.01
405	688608	恒玄科技	2,370	751,076.70	0.01
406	601058	赛轮轮胎	75,000	749,250.00	0.01
407	688696	极米科技	900	748,800.00	0.01
408	601898	中煤能源	103,800	742,170.00	0.01
409	300271	华宇软件	38,500	741,125.00	0.01
410	603300	华铁应急	64,800	734,184.00	0.01
411	002025	航天电器	14,600	732,482.00	0.01
412	603738	泰晶科技	20,900	721,468.00	0.01
413	300244	迪安诊断	18,500	708,550.00	0.01
414	603408	建霖家居	47,231	699,963.42	0.01
415	001914	招商积余	40,700	699,226.00	0.01
416	601865	福莱特	17,300	683,869.00	0.01
417	300604	长川科技	10,000	682,100.00	0.01
418	000026	飞亚达	48,900	680,688.00	0.01
419	002859	洁美科技	21,200	662,924.00	0.01
420	600763	通策医疗	1,600	657,600.00	0.01
421	002484	江海股份	41,600	643,968.00	0.01
422	688208	道通科技	7,400	643,726.00	0.01
423	002153	石基信息	27,260	640,882.60	0.01
424	688016	心脉医疗	1,400	636,454.00	0.01
425	300815	玉禾田	18,082	629,796.06	0.01
426	000031	大悦城	172,700	621,720.00	0.01
427	000786	北新建材	15,700	616,225.00	0.01
428	600066	宇通客车	49,000	612,010.00	0.01
429	688023	安恒信息	2,418	609,336.00	0.01
430	002439	启明星辰	20,700	600,507.00	0.01
431	601901	方正证券	64,100	599,976.00	0.01
432	000498	山东路桥	106,500	596,400.00	0.01
433	300687	赛意信息	27,600	589,812.00	0.01
434	002050	三花智控	24,323	583,265.54	0.01
435	300861	美畅股份	6,600	556,446.00	0.01
436	603737	三棵树	3,140	552,640.00	0.01
437	688617	惠泰医疗	1,448	551,673.52	0.01

438	300737	科顺股份	17,500	550,200.00	0.01
439	600755	厦门国贸	65,700	539,397.00	0.01
440	002847	盐津铺子	5,400	538,488.00	0.01
441	002444	巨星科技	15,600	531,648.00	0.01
442	600018	上港集团	111,400	531,378.00	0.01
443	603933	睿能科技	33,000	528,660.00	0.01
444	300639	凯普生物	16,000	528,160.00	0.01
445	000898	鞍钢股份	117,200	521,540.00	0.01
446	600104	上汽集团	23,700	520,689.00	0.01
447	300142	沃森生物	8,400	518,280.00	0.01
448	000783	长江证券	70,300	514,596.00	0.01
449	603279	景津环保	23,100	511,896.00	0.01
450	600502	安徽建工	131,000	508,280.00	0.01
451	002624	完美世界	20,700	494,937.00	0.01
452	601117	中国化学	56,200	492,312.00	0.01
453	300253	卫宁健康	29,600	481,592.00	0.01
454	002304	洋河股份	2,300	476,560.00	0.01
455	300595	欧普康视	4,600	476,330.00	0.01
456	603602	纵横通信	45,360	474,012.00	0.01
457	300285	国瓷材料	9,700	472,875.00	0.01
458	603939	益丰药房	7,960	446,476.40	0.01
459	000785	居然之家	73,500	446,145.00	0.01
460	600885	宏发股份	7,100	445,170.00	0.01
461	002599	盛通股份	116,500	445,030.00	0.01
462	002008	大族激光	11,000	444,290.00	0.01
463	002353	杰瑞股份	9,600	429,120.00	0.01
464	603605	珀莱雅	2,103	413,681.13	0.01
465	002690	美亚光电	7,400	412,624.00	0.01
466	600872	中炬高新	9,500	399,190.00	0.01
467	002372	伟星新材	19,225	397,380.75	0.01
468	300441	鲍斯股份	38,200	396,516.00	0.01
469	002563	森马服饰	32,600	389,570.00	0.01
470	002180	纳思达	12,000	386,400.00	0.01
471	300761	立华股份	11,400	377,682.00	0.01
472	603786	科博达	5,000	377,500.00	0.01
473	002747	埃斯顿	9,604	375,036.20	0.01
474	605123	派克新材	4,900	373,380.00	0.01
475	688139	海尔生物	3,500	367,850.00	0.01
476	300308	中际旭创	9,480	365,169.60	0.01
477	603489	八方股份	1,500	354,570.00	0.00
478	600588	用友网络	10,500	349,230.00	0.00
479	002242	九阳股份	10,700	347,643.00	0.00
480	300073	当升科技	6,028	338,713.32	0.00
481	300498	温氏股份	23,300	334,821.00	0.00

482	600602	云赛智联	53,400	316,662.00	0.00
483	002557	洽洽食品	7,200	310,320.00	0.00
484	002572	索菲亚	12,600	304,920.00	0.00
485	603898	好莱客	21,500	294,550.00	0.00
486	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.00
487	300650	太龙照明	11,300	264,759.00	0.00
488	000049	德赛电池	5,500	252,450.00	0.00
489	002345	潮宏基	47,000	246,280.00	0.00
490	000551	创元科技	27,800	232,964.00	0.00
491	600905	三峡能源	33,000	209,880.00	0.00
492	002230	科大讯飞	3,000	202,740.00	0.00
493	603948	建业股份	10,100	192,102.00	0.00
494	600560	金自天正	21,200	192,072.00	0.00
495	300673	佩蒂股份	8,100	180,306.00	0.00
496	300593	新雷能	3,680	159,896.00	0.00
497	300691	联合光电	9,900	156,717.00	0.00
498	601006	大秦铁路	23,500	154,630.00	0.00
499	000338	潍柴动力	8,000	142,960.00	0.00
500	300470	中密控股	3,300	127,512.00	0.00
501	300817	双飞股份	5,700	122,892.00	0.00
502	603083	剑桥科技	7,700	111,881.00	0.00
503	300144	宋城演艺	6,600	110,880.00	0.00
504	002928	华夏航空	6,200	93,620.00	0.00
505	002084	海鸥住工	16,500	88,935.00	0.00
506	600377	宁沪高速	8,900	86,864.00	0.00
507	002517	恺英网络	17,500	75,600.00	0.00
508	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
509	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
510	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
511	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
512	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
513	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
514	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
515	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
516	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
517	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
518	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
519	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
520	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
521	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
522	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
523	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
524	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
525	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00

526	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
527	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
528	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
529	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
530	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
531	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
532	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
533	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
534	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
535	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
536	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
537	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
538	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
539	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
540	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
541	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
542	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
543	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
544	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
545	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
546	603657	春光科技	82	2,636.30	0.00
547	002803	吉宏股份	80	2,270.40	0.00
548	002987	京北方	61	1,948.95	0.00
549	603739	蔚蓝生物	66	1,132.56	0.00
550	002798	帝欧家居	68	1,059.44	0.00
551	000829	天音控股	4	32.96	0.00
552	000158	常山北明	1	11.49	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	84,737,787.38	1.18
2	600036	招商银行	79,560,110.10	1.11
3	000725	京东方 A	58,268,549.00	0.81
4	000333	美的集团	56,667,190.95	0.79
5	601166	兴业银行	55,513,191.00	0.77
6	002714	牧原股份	52,571,341.51	0.73
7	000858	五粮液	51,548,892.88	0.72

8	000001	平安银行	51,548,749.36	0.72
9	601318	中国平安	49,240,254.16	0.69
10	002727	一心堂	45,205,607.00	0.63
11	002027	分众传媒	41,907,592.07	0.58
12	000100	TCL 科技	39,221,992.92	0.55
13	000039	中集集团	35,497,096.92	0.50
14	300124	汇川技术	34,804,520.88	0.49
15	000933	神火股份	34,702,279.31	0.48
16	600176	中国巨石	34,228,408.52	0.48
17	300059	东方财富	33,346,674.01	0.47
18	002430	杭氧股份	32,352,122.16	0.45
19	300274	阳光电源	32,145,580.97	0.45
20	300633	开立医疗	31,861,359.50	0.44

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	33,002,543.52	0.46
2	000333	美的集团	32,815,970.26	0.46
3	002714	牧原股份	29,913,959.11	0.42
4	300379	东方通	29,551,877.81	0.41
5	300274	阳光电源	29,329,213.00	0.41
6	002747	埃斯顿	29,192,122.39	0.41
7	300124	汇川技术	28,097,680.85	0.39
8	300737	科顺股份	28,094,954.03	0.39
9	002027	分众传媒	27,135,365.00	0.38
10	300673	佩蒂股份	26,516,054.75	0.37
11	002139	拓邦股份	25,166,402.98	0.35
12	000039	中集集团	24,946,619.04	0.35
13	300740	水羊股份	24,788,248.53	0.35
14	002648	卫星石化	24,722,732.51	0.34
15	601318	中国平安	23,082,310.20	0.32
16	300573	兴齐眼药	22,945,639.50	0.32
17	603806	福斯特	22,827,738.27	0.32
18	300119	瑞普生物	22,709,675.66	0.32
19	600036	招商银行	22,355,723.35	0.31

20	300036	超图软件	21,812,961.93	0.30
----	--------	------	---------------	------

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,618,649,735.96
卖出股票收入（成交）总额	4,028,119,868.04

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	763,703,000.00	10.65
	其中：政策性金融债	461,932,000.00	6.44
4	企业债券	833,642,000.00	11.63
5	企业短期融资券	995,701,500.00	13.89
6	中期票据	960,452,000.00	13.40
7	可转债（可交换债）	36,590,528.62	0.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,590,089,028.62	50.08

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	190403	19 农发 03	3,300,000	331,485,000.00	4.62
2	175987	21 国君 G1	3,000,000	301,260,000.00	4.20
3	042100222	21 电网 CP003	2,500,000	250,000,000.00	3.49
4	163865	21 招证 S1	2,000,000	200,440,000.00	2.80

5	102100982	21 大唐集 MTN001	2,000,000	200,020,000.00	2.79
---	-----------	------------------	-----------	----------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
1	2189141	21 捷赢 2A_bc	1,000,000	75,250,000.00	1.05
2	189342	光信 11A	600,000	60,012,000.00	0.84
3	189078	GC 晓 12A2	500,000	50,045,000.00	0.70
4	189310	21 信易 2A	500,000	50,010,000.00	0.70
5	137928	天铭优 03	200,000	20,046,000.00	0.28

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IH2109	IH2109	60.00	62,283,600.00	-1,039,380.00	买入股指期货多头合约是为了更有效地进行流动性管理。
公允价值变动总额合计					-1,039,380.00
股指期货投资本期收益					7,152,368.94
股指期货投资本期公允价值变动					-1,039,380.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过股指期货

的运用可降低本基金频繁调整股票仓位的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，以及对债券市场的分析，采用流动性好、交易活跃的期货合约，调节债券组合的久期和流动性，降低投资组合的整体风险，实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-3,183,252.43
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货投资为基金的久期控制提供了更便利、更具有流动性的工具，有效降低了基金净值波动，提高了净值增长的平稳性。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商证券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。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,875,140.39
2	应收证券清算款	30,318,257.64

3	应收股利	-
4	应收利息	24,191,683.86
5	应收申购款	689,340.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,074,422.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	6,174,600.00	0.09
2	127012	招路转债	5,351,500.00	0.07
3	110057	现代转债	2,236,200.00	0.03
4	110034	九州转债	2,164,800.00	0.03
5	113024	核建转债	2,049,400.00	0.03
6	110052	贵广转债	2,024,200.00	0.03
7	113033	利群转债	2,004,000.00	0.03
7	113532	海环转债	2,004,000.00	0.03
8	127007	湖广转债	1,911,210.00	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
广发均衡增长	55,238	121,159.09	5,001,677	0.07%	6,687,584	99.93%

混合 A			.23		055.79	
广发均衡增长混合 C	4,275	52,884.75	0.00	0.00%	226,082,322.54	100.00%
合计	59,513	116,254.74	5,001,677.23	0.07%	6,913,666,378.33	99.93%

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	广发均衡增长混合 A	19,777.24	0.0003%
	广发均衡增长混合 C	10,953.17	0.0048%
	合计	30,730.41	0.0004%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发均衡增长混合 A	0
	广发均衡增长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发均衡增长混合 A	0
	广发均衡增长混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 27 日）基金份额总额	7,614,158,074.80	317,318,440.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	17,323,548.01	2,426,585.82
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	938,895,889.79	93,662,703.96

基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,692,585,733.02	226,082,322.54

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国联证券	2	2,238,538,673.98	21.03%	1,637,081.06	21.03%	新增 2 个
中信证券	2	8,404,234,451.44	78.97%	6,146,064.82	78.97%	新增 2 个
渤海证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

注：1、交易单元选择标准：

(1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国联证券	10,173,482.80	0.40%	3,959,400,000.00	18.67%	-	-
中信证券	2,512,397,812.00	99.60%	17,250,000,000.00	81.33%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

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	广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-06
2	关于广发均衡增长混合型证券投资基金设置募集规模上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-19
3	关于广发均衡增长混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-25
4	关于广发均衡增长混合型证券投资基金认购	中国证监会规定报刊及	2021-01-26

	申请确认比例结果的公告	网站	
5	关于广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-28
6	关于广发均衡增长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-25
7	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
8	关于广发均衡增长混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-20

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会注册广发均衡增长混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发均衡增长混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书

11.2 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

11.3 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