

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：二〇二二年八月三十日

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 2022 年 8 月 25 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 2022 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	75
7.1 期末基金资产组合情况	75
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	75
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	76
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	89
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	91
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	91
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	91
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	91
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	91
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
7.12 投资组合报告附注	91

8	基金份额持有人信息	93
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	93
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	93
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	94
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	94
9	开放式基金份额变动	94
10	重大事件揭示	94
10.1	基金份额持有人大会决议.....	94
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.....	94
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	95
10.4	基金投资策略的改变.....	95
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	95
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.....	95
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	95
10.8	其他重大事件.....	99
11	影响投资者决策的其他重要信息	99
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	99
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	100
12	备查文件目录	101
12.1	备查文件目录.....	101
12.2	存放地点.....	101
12.3	查阅方式.....	101

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 500ETF
场内简称	广发 500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,457,038,319.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-05-24

注：本基金的扩位证券简称为“中证 500ETF 基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证 500 指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	95105828	95588
传真	020-89899158	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	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	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-66,729,937.06
本期利润	-332,669,347.94
加权平均基金份额本期利润	-0.2221
本期加权平均净值利润率	-11.69%
本期基金份额净值增长率	-11.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,370,259,318.57
期末可供分配基金份额利润	0.9404
期末基金资产净值	2,827,297,637.57
期末基金份额净值	1.9404
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	94.04%
-------------	--------

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.57%	1.09%	7.10%	1.10%	0.47%	-0.01%
过去三个月	2.86%	1.73%	2.04%	1.75%	0.82%	-0.02%
过去六个月	-11.60%	1.62%	-12.30%	1.63%	0.70%	-0.01%
过去一年	-3.97%	1.31%	-5.20%	1.33%	1.23%	-0.02%
过去三年	37.24%	1.33%	30.37%	1.35%	6.87%	-0.02%
自基金合同生效起至今	94.04%	1.61%	87.77%	1.64%	6.27%	-0.03%

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

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2013 年 4 月 11 日至 2022 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金	2014-04-01	-	18 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金从业证书。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

	<p>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；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理；广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；指数</p>				<p>2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 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)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、</p>
--	---	--	--	--	---

	投资部总经理 助理			广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)。
--	--------------	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作

需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 17 次，其中 14 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 3 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的标的指数是中证 500 指数，主要采用完全复制法来跟踪标的指数。

作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。本基金跟踪误差来源主要是申购赎回和成份股调整等因素。

中证 500 指数有着高波动、高收益的特征。就中长期表现而言，中证 500 指数收益相较大部分市场宽基指数存在一定优势；就短期表现而言，其往往被誉为“反弹急先锋”，值得投资者关注。

2022 年上半年，整体 A 股市场先抑后扬，沪深 300 指数下跌 9.22%，中证 500 指数下跌 12.30%，创业板指数下跌 15.41%。同期美股则受到通胀加息困扰，市场大跌，纳斯达克 100 指数下跌 29.51%，标普 500 指数下跌 20.58%。同期港股相对美股更多地受到 A 股影响，恒生指数下跌 6.57%，恒生国企精明指数下跌 7.02%，恒生中型股指数下跌 10.85%，恒生科技指数下跌 14.12%。

2022 年上半年，在俄乌冲突、美元加息和国内疫情等不利影响下，A 股表现疲弱；临近 5 月，在复工复产的稳步推进，以及国内以“稳增长”为重心的背景下，经济预期开始向上修正，5 月各项经济数据均开始修复，5 月工业增速转正，经济进入修复通道，在稳增长基调下，基建投资继续反弹，制造业投资则展现韧性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-11.60%，同期业绩比较基准收益率为-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四月底以来，A 股市场整体反弹，其中以高端制造为代表的成长板块领涨市场，站在当前时点上，A 股市场特别是成长板块在下半年的表现仍然值得期待。主要原因是下半年国内经济景气度或将逐步提升，支撑 A 股基本面。首先是疫情改善因素，上半年疫情引起的产业链缺失对经济，包括消费、投资、出口等产生了广泛的压制，虽然近期有所缓解，但距离生产完全恢复仍有一定的改善空间。因此随着下半年复工复产的有序进行，预期经济将出现环比上升趋势，支撑 A 股基本面；其次，一些稳增长、宽信用等方面的政策效果会滞后反映在经济数据上，这也将为下半年经济增长打下基础。在看到以上积极因素的同时，不能低估海外潜在的经济下行风险和疫情反复的风险。相比之下，需求刚性和政策重点刺激的高端制造业确定性更高，因此，我们认为在下半年经济复苏的趋势中，以高端制造为代表的成长板块将仍然具有比较优势。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	65,062,878.51	28,793,490.70
结算备付金		13,654,682.78	20,376,362.24
存出保证金		9,715,109.25	3,285,776.61
交易性金融资产	6.4.7.2	2,745,627,604.40	3,076,928,417.39
其中：股票投资		2,745,433,667.85	3,073,988,591.31
基金投资		-	-
债券投资		193,936.55	2,939,826.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		2,181,872.38	6,839,320.13
应收股利		831,721.82	700.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	148,805.08	93,118.93
资产总计		2,837,222,674.22	3,136,317,186.00
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		6,011,934.03	12,625,021.71
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,161,426.15	1,250,819.74
应付托管费		232,285.23	250,163.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,499.61	7,989.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	2,509,891.63	3,176,375.04
负债合计		9,925,036.65	17,310,370.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,457,038,319.00	1,421,038,319.00
未分配利润	6.4.7.9	1,370,259,318.57	1,697,968,496.81
净资产合计		2,827,297,637.57	3,119,006,815.81
负债和净资产总计		2,837,222,674.22	3,136,317,186.00

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.9404 元，基金份额总额 1,457,038,319.00 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-323,672,864.09	248,936,590.02
1.利息收入		1,655,131.10	2,231,238.15
其中：存款利息收入	6.4.7.10	195,464.53	343,466.80
债券利息收入		-	2,304.68
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		1,459,666.57	1,885,466.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-62,957,443.24	250,966,590.69

其中：股票投资收益	6.4.7.11	-94,950,154.16	223,636,971.44
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	723,970.27	923,360.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-411,196.55	5,475,495.15
股利收益	6.4.7.17	31,679,937.20	20,930,763.21
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-265,939,410.88	-8,930,021.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,568,858.93	4,668,782.49
减：二、营业总支出		8,996,483.85	11,414,880.23
1. 管理人报酬		7,059,118.28	6,545,707.85
2. 托管费		1,411,823.73	1,309,141.54
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		5,259.77	26,507.75
8. 其他费用	6.4.7.21	520,282.07	3,533,523.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-332,669,347.94	237,521,709.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-332,669,347.94	237,521,709.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-332,669,347.94	237,521,709.79

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,421,038,319.00	1,697,968,496.81	3,119,006,815.81
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,421,038,319.00	1,697,968,496.81	3,119,006,815.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	36,000,000.00	-327,709,178.24	-291,709,178.24
（一）、综合收益总额	-	-332,669,347.94	-332,669,347.94
（二）、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）	36,000,000.00	4,960,169.70	40,960,169.70
其中：1. 基金申购款	610,000,000.00	517,685,932.97	1,127,685,932.97
2. 基金赎回款	-574,000,000.00	-512,725,763.27	-1,086,725,763.27
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,457,038,319.00	1,370,259,318.57	2,827,297,637.57
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,825,038,319.00	1,574,939,796.90	3,399,978,115.90
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,825,038,319.00	1,574,939,796.90	3,399,978,115.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-532,000,000.00	-255,117,411.13	-787,117,411.13
（一）、综合收益总额	-	237,521,709.79	237,521,709.79

（二）、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）	-532,000,000.00	-492,639,120.92	-1,024,639,120.92
其中：1.基金申购款	538,000,000.00	468,649,900.19	1,006,649,900.19
2.基金赎回款	-1,070,000,000.00	-961,289,021.11	-2,031,289,021.11
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,293,038,319.00	1,319,822,385.77	2,612,860,704.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]165 号《关于核准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 4 月 11 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为 2013 年 3 月 18 日至 2013 年 3 月 29 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 425,038,319.00 元，有效认购户数为 3,122 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,399.00 元，折合基金份额 1,399.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2022 年 8 月 25 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

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

允价值变动计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），

按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.5 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产

转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 28,793,490.70 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,026.69 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 28,796,517.39 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,376,362.24 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9,158.29 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,385,520.53 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,285,776.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 91.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,285,867.61 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 93,118.93 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,026.69 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 9,158.29 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 91.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 297.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 80,545.95 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 80,545.95 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 80,545.95 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,076,928,417.39 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 297.00 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,076,928,714.39 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	65,062,878.51
等于：本金	65,057,246.19
加：应计利息	5,632.32
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	65,062,878.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,798,960,281.40	-	2,745,433,667.85	-53,526,613.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	193,900.00	36.55	193,936.55	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	193,900.00	36.55	193,936.55	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,799,154,181.40	36.55	2,745,627,604.40	-53,526,613.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	61,605,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	61,605,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	61,605,400.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	25.00	32,173,000.00	1,295,480.00
IC2208	IC2208	24.00	30,701,760.00	-26,120.00
合计	-	-	-	1,269,360.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,269,360.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为国债/股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/国债期货投

资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	148,805.08
待摊费用	-
合计	148,805.08

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	958,239.59
其中：交易所市场	958,239.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	170,203.31
应付替代款	1,178,229.52
应付指数使用费	203,219.21
合计	2,509,891.63

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,421,038,319.00	1,421,038,319.00

本期申购	610,000,000.00	610,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-574,000,000.00	-574,000,000.00
本期末	1,457,038,319.00	1,457,038,319.00

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,931,836,520.24	-1,233,868,023.43	1,697,968,496.81
本期利润	-66,729,937.06	-265,939,410.88	-332,669,347.94
本期基金份额交易产生的变动数	77,938,338.96	-72,978,169.26	4,960,169.70
其中：基金申购款	1,252,781,854.32	-735,095,921.35	517,685,932.97
基金赎回款	-1,174,843,515.36	662,117,752.09	-512,725,763.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,943,044,922.14	-1,572,785,603.57	1,370,259,318.57

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	45,626.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,312.62
结算备付金利息收入	147,525.06
其他	-
合计	195,464.53

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-76,180,423.07
股票投资收益——赎回差价收入	-18,769,731.09
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-94,950,154.16

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,014,424,714.87
减：卖出股票成本总额	1,088,245,547.39

减：交易费用	2,359,590.55
买卖股票差价收入	-76,180,423.07

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,086,725,763.27
减：现金支付赎回款总额	539,491,062.27
减：赎回股票成本总额	566,004,432.09
减：交易费用	-
赎回差价收入	-18,769,731.09

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,944.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	722,025.31
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	723,970.27

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,547,531.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,823,174.08
减：应计利息总额	2,236.60
减：交易费用	95.29
买卖债券差价收入	722,025.31

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-411,196.55

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	31,679,937.20
其中：证券出借权益补偿收入	2,029,418.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,679,937.20

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-267,034,865.43
——股票投资	-266,829,013.43
——债券投资	-205,852.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,095,454.55
——权证投资	-
——股指期货投资	1,095,454.55
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	-265,939,410.88

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	3,568,858.93
合计	3,568,858.93

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022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	459.84
指数使用费	423,547.13
其他	71.79
合计	520,282.07

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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	604,815.60	0.03%	-	-

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,116,100.00	27.02%	1,736,000.00	20.62%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,059,118.28	6,545,707.85
其中：支付销售机构的客户维护费	49,871.51	41,337.06

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,411,823.73	1,309,141.54

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1 % 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

单位：人民币元

本期				
2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	622,587,107.00	788,660.89	140,957,819.00	114,401.16
上年度可比期间				
2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

			务余额	额
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份 有限公司	2022 0104 0002 0663	微芯生物	2022- 01-04	348,2 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,019 .45	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0114 0001 9820	易华录	2022- 01-14	315,2 00.00	10,000.00	28	3.1 0	759.9 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0125 0000 8966	易华录	2022- 01-25	223,2 95.00	7,100.00	28	3.1 0	538.3 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0128 0002 1764	北京君 正	2022- 01-28	2,286 ,900. 00	21,000.00	28	3.1 0	5,513 .97	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0207 0005 2841	微芯生 物	2022- 02-07	295,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	713.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0208 0000 1929	圣湘生 物	2022- 02-08	667,0 30.00	13,000.00	28	3.1 0	1,608 .28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0211 0001 9462	易华录	2022- 02-11	262,5 00.00	10,000.00	28	3.1 0	632.9 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 0997	安科生 物	2022- 02-21	375,2 19.00	35,100.00	28	3.5 0	1,021 .43	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 0999	网宿科 技	2022- 02-21	533,2 50.00	75,000.00	28	3.5 0	1,451 .63	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1001	机器人	2022- 02-21	396,5 16.00	38,200.00	28	3.5 0	1,079 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1003	红日药 业	2022- 02-21	346,6 56.00	55,200.00	28	3.5 0	943.6 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1007	蓝色光 标	2022- 02-21	623,3 71.00	76,300.00	28	3.5 0	1,696 .95	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1009	信维通 信	2022- 02-21	665,1 12.00	29,600.00	28	3.5 0	1,810 .58	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1012	三聚环 保	2022- 02-21	375,4 08.00	43,200.00	28	3.5 0	1,021 .94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1017	华策影 视	2022- 02-21	211,8 43.00	34,900.00	28	3.5 0	576.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1021	汤臣倍 健	2022- 02-21	669,2 40.00	26,000.00	28	3.5 0	1,821 .82	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1026	捷成股 份	2022- 02-21	417,0 91.00	63,100.00	28	3.5 0	1,135 .41	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1030	容百科 技	2022- 02-21	1,084 ,696. 00	8,200.00	28	3.5 0	2,952 .78	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1035	道通科 技	2022- 02-21	426,0 72.00	8,200.00	28	3.5 0	1,159 .86	-	-
广发证	2022	光线传	2022-	352,1	35,900.00	28	3.5	958.7	-	-

券股份 有限公司	0221 0000 1047	媒	02-21	79.00			0	1		
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1049	国瓷材 料	2022- 02-21	952,7 58.00	24,600.00	28	3.5 0	2,593 .62	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1053	开山股 份	2022- 02-21	194,5 68.00	12,100.00	28	3.5 0	529.6 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1059	中际旭 创	2022- 02-21	661,5 99.00	17,100.00	28	3.5 0	1,801 .02	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1061	掌趣科 技	2022- 02-21	333,7 75.00	84,500.00	28	3.5 0	908.6 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1063	博腾股 份	2022- 02-21	809,5 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,203 .64	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1065	光环新 网	2022- 02-21	627,5 50.00	38,500.00	28	3.5 0	1,708 .33	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1066	我武生 物	2022- 02-21	418,6 56.00	9,600.00	28	3.5 0	1,139 .67	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1069	昆仑万 维	2022- 02-21	551,4 26.00	29,300.00	28	3.5 0	1,501 .10	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1079	光威复 材	2022- 02-21	669,7 50.00	9,500.00	28	3.5 0	1,823 .21	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0222 0001 1775	易华录	2022- 02-22	213,0 00.00	7,100.00	28	3.1 0	513.5 7	-	-
广发证 券股份	2022 0225	北京君 正	2022- 02-25	2,349 ,900.	21,000.00	28	3.1 0	5,665 .87	-	-

有限公司	0001 8239			00							
广发证 券股份 有限公司	2022 0303 0000 1746	易华录	2022- 03-03	271,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	655.3 4	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0304 0000 0003	碧水源	2022- 03-04	1,845 ,200. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	4,448 .98	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0307 0004 1982	微芯生 物	2022- 03-07	271,0 00.00	10,000.00	28	3.1 0	700.0 8	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0308 0001 5056	圣湘生 物	2022- 03-08	567,3 20.00	13,000.00	28	3.1 0	1,416 .72	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0311 0001 7668	易华录	2022- 03-11	253,1 00.00	10,000.00	28	3.1 0	610.2 5	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1853	容百科 技	2022- 03-21	1,132 ,010. 00	8,200.00	28	3.5 0	3,081 .58	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1855	博腾股 份	2022- 03-21	881,0 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,398 .28	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1857	开山股 份	2022- 03-21	166,2 54.00	12,100.00	28	3.5 0	452.5 8	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1859	光线传 媒	2022- 03-21	288,2 77.00	35,900.00	28	3.5 0	784.7 5	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1863	华策影 视	2022- 03-21	174,1 51.00	34,900.00	28	3.5 0	474.0 8	-	-	
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003	汤臣倍 健	2022- 03-21	567,0 60.00	26,000.00	28	3.5 0	1,543 .66	-	-	

司	1867									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1877	捷成股 份	2022- 03-21	375,4 45.00	63,100.00	28	3.5 0	1,022 .04	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1899	光环新 网	2022- 03-21	528,9 90.00	38,500.00	28	3.5 0	1,440 .03	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1901	光威复 材	2022- 03-21	603,8 20.00	9,500.00	28	3.5 0	1,643 .73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1903	掌趣科 技	2022- 03-21	304,2 00.00	84,500.00	28	3.5 0	828.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1905	红日药 业	2022- 03-21	508,9 44.00	55,200.00	28	3.5 0	1,385 .46	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1907	国瓷材 料	2022- 03-21	842,5 50.00	24,600.00	28	3.5 0	2,293 .61	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1909	机器人	2022- 03-21	355,6 42.00	38,200.00	28	3.5 0	968.1 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1911	信维通 信	2022- 03-21	553,5 20.00	29,600.00	28	3.5 0	1,506 .80	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1913	我武生 物	2022- 03-21	388,8 00.00	9,600.00	28	3.5 0	1,058 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1915	网宿科 技	2022- 03-21	450,0 00.00	75,000.00	28	3.5 0	1,225 .00	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1917	安科生 物	2022- 03-21	361,8 81.00	35,100.00	28	3.5 0	985.1 2	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1919	道通科 技	2022- 03-21	343,0 06.00	8,200.00	28	3.5 0	933.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1921	昆仑万 维	2022- 03-21	484,9 15.00	29,300.00	28	3.5 0	1,320 .05	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1925	蓝色光 标	2022- 03-21	622,6 08.00	76,300.00	28	3.5 0	1,694 .88	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1931	中际旭 创	2022- 03-21	577,6 38.00	17,100.00	28	3.5 0	1,572 .46	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1937	三聚环 保	2022- 03-21	288,5 76.00	43,200.00	28	3.5 0	785.5 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0322 0001 2515	易华录	2022- 03-22	164,0 10.00	7,100.00	28	3.1 0	395.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0325 0001 8846	北京君 正	2022- 03-25	1,974 ,210. 00	21,000.00	28	3.1 0	4,760 .04	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0331 0000 6076	易华录	2022- 03-31	210,7 00.00	10,000.00	28	3.1 0	508.0 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0401 0000 4696	碧水源	2022- 04-01	1,671 ,600. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	4,030 .41	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0406 0005 0219	圣湘生 物	2022- 04-06	591,8 90.00	13,000.00	28	3.1 0	1,478 .08	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0408 0001 7195	易华录	2022- 04-08	192,1 00.00	10,000.00	28	3.1 0	463.1 7	-	-
广发证	2022	中际旭	2022-	513,6	17,100.00	28	3.5	1,398	-	-

券股份 有限公司	0418 0000 4145	创	04-18	84.00			0	.36		
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4147	三聚环 保	2022- 04-18	253,1 52.00	43,200.00	28	3.5 0	689.1 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4149	我武生 物	2022- 04-18	340,8 96.00	9,600.00	28	3.5 0	927.9 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4151	信维通 信	2022- 04-18	488,1 04.00	29,600.00	28	3.5 0	1,328 .73	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4153	网宿科 技	2022- 04-18	405,0 00.00	75,000.00	28	3.5 0	1,102 .50	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4155	红日药 业	2022- 04-18	361,5 60.00	55,200.00	28	3.5 0	984.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4157	机器人	2022- 04-18	342,2 72.00	38,200.00	28	3.5 0	931.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4159	国瓷材 料	2022- 04-18	823,6 08.00	24,600.00	28	3.5 0	2,242 .04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4161	蓝色光 标	2022- 04-18	508,9 21.00	76,300.00	28	3.5 0	1,385 .40	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4163	昆仑万 维	2022- 04-18	441,8 44.00	29,300.00	28	3.5 0	1,202 .80	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4165	道通科 技	2022- 04-18	284,8 68.00	8,200.00	28	3.5 0	775.4 7	-	-
广发证 券股份	2022 0418	安科生 物	2022- 04-18	320,4 63.00	35,100.00	28	3.5 0	872.3 7	-	-

有限公司	0000 4167										
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4169	开山股 份	2022- 04-18	176,9 02.00	12,100.00	28	3.5 0	481.5 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4171	光线传 媒	2022- 04-18	276,7 89.00	35,900.00	28	3.5 0	753.4 8	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4173	容百科 技	2022- 04-18	878,1 38.00	8,200.00	28	3.5 0	2,390 .49	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4175	博腾股 份	2022- 04-18	841,2 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,289 .93	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4177	掌趣科 技	2022- 04-18	289,8 35.00	84,500.00	28	3.5 0	789.0 0	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4179	捷成股 份	2022- 04-18	311,7 14.00	63,100.00	28	3.5 0	848.5 5	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4181	光环新 网	2022- 04-18	453,5 30.00	38,500.00	28	3.5 0	1,234 .61	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4183	光威复 材	2022- 04-18	475,9 50.00	9,500.00	28	3.5 0	1,295 .64	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4185	汤臣倍 健	2022- 04-18	548,8 60.00	26,000.00	28	3.5 0	1,494 .12	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4187	华策影 视	2022- 04-18	165,4 26.00	34,900.00	28	3.5 0	450.3 3	-	-	
广发证 券股份 有限公 司	2022 0419 0000	易华录	2022- 04-19	130,3 56.00	7,100.00	28	3.1 0	314.3 0	-	-	

司	2982									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0422 0001 4406	北京君 正	2022- 04-22	1,627 ,500. 00	21,000.00	28	3.1 0	3,924 .08	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0428 0000 1365	微芯生 物	2022- 04-28	651,0 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,569 .63	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0428 0000 7728	易华录	2022- 04-28	135,2 00.00	10,000.00	28	3.1 0	325.9 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0429 0000 5076	碧水源	2022- 04-29	1,313 ,200. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	3,166 .27	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0505 0007 1335	圣湘生 物	2022- 05-05	575,9 00.00	13,000.00	28	3.1 0	1,388 .56	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0506 0001 7501	易华录	2022- 05-06	148,0 00.00	10,000.00	28	3.1 0	395.0 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3487	蓝色光 标	2022- 05-16	439,4 88.00	76,300.00	28	3.5 0	1,196 .38	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3489	我武生 物	2022- 05-16	416,8 32.00	9,600.00	28	3.5 0	1,134 .71	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3491	网宿科 技	2022- 05-16	383,2 50.00	75,000.00	28	3.5 0	1,043 .29	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3493	安科生 物	2022- 05-16	325,7 28.00	35,100.00	28	3.5 0	886.7 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3495	三聚环 保	2022- 05-16	194,4 00.00	43,200.00	28	3.5 0	529.2 0	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3497	开山股 份	2022- 05-16	165,1 65.00	12,100.00	28	3.5 0	449.6 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3499	昆仑万 维	2022- 05-16	427,1 94.00	29,300.00	28	3.5 0	1,162 .92	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3501	信维通 信	2022- 05-16	456,7 28.00	29,600.00	28	3.5 0	1,243 .32	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3503	中际旭 创	2022- 05-16	542,9 25.00	17,100.00	28	3.5 0	1,477 .96	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3781	机器人	2022- 05-16	294,5 22.00	38,200.00	28	3.5 0	801.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3783	红日药 业	2022- 05-16	335,0 64.00	55,200.00	28	3.5 0	912.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3785	国瓷材 料	2022- 05-16	814,7 52.00	24,600.00	28	3.5 0	2,217 .94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3787	捷成股 份	2022- 05-16	317,3 93.00	63,100.00	28	3.5 0	864.0 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3789	掌趣科 技	2022- 05-16	258,5 70.00	84,500.00	28	3.5 0	703.8 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3791	容百科 技	2022- 05-16	759,3 20.00	8,200.00	28	3.5 0	2,067 .04	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3793	光环新 网	2022- 05-16	371,5 25.00	38,500.00	28	3.5 0	1,011 .37	-	-
广发证	2022	博腾股	2022-	714,5	10,000.00	28	3.5	1,945	-	-

券股份 有限公司	0516 0000 3795	份	05-16	00.00			0	.03		
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3797	光威复 材	2022- 05-16	505,4 00.00	9,500.00	28	3.5 0	1,375 .81	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3799	汤臣倍 健	2022- 05-16	505,4 40.00	26,000.00	28	3.5 0	1,375 .92	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3801	光线传 媒	2022- 05-16	255,6 08.00	35,900.00	28	3.5 0	695.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3803	华策影 视	2022- 05-16	151,4 66.00	34,900.00	28	3.5 0	412.3 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3805	道通科 技	2022- 05-16	251,9 04.00	8,200.00	28	3.5 0	685.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0517 0000 3413	易华录	2022- 05-17	108,1 33.00	7,100.00	28	3.1 0	260.7 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0526 0000 7294	易华录	2022- 05-26	159,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	385.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0526 0000 7296	微芯生 物	2022- 05-26	632,7 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,525 .51	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0527 0000 5270	碧水源	2022- 05-27	1,349 ,600. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	3,254 .04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0531 0000 1282	圣湘生 物	2022- 05-31	77,37 6.00	1,600.00	28	3.1 0	186.5 6	-	-
广发证 券股份	2022 0602	圣湘生 物	2022- 06-02	424,4 50.00	13,000.00	28	3.1 0	1,023 .40	-	-

有限公司	0001 8752										
广发证 券股份 有限公司	2022 0606 0001 2034	易华录	2022- 06-06	168,0 00.00	10,000.00	14	3.1 0	202.5 3	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0608 0000 1117	碧水源	2022- 06-08	62,92 0.00	13,000.00	28	3.5 0	134.5 8	67,730.00	134.58	
广发证 券股份 有限公司	2022 0609 0000 0831	易华录	2022- 06-09	113,8 20.00	7,000.00	28	3.1 0	205.8 2	121,800.00	205.82	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9323	国瓷材 料	2022- 06-13	910,4 46.00	24,600.00	28	3.5 0	1,504 .76	883,632.00	1,504.76	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9325	捷成股 份	2022- 06-13	309,1 90.00	63,100.00	28	3.5 0	511.0 2	347,050.00	511.02	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9327	光环新 网	2022- 06-13	390,0 05.00	38,500.00	28	3.5 0	644.5 9	401,170.00	644.59	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9329	道通科 技	2022- 06-13	296,5 94.00	8,200.00	28	3.5 0	490.2 0	269,944.00	490.20	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9331	光威复 材	2022- 06-13	539,5 05.00	9,500.00	28	3.5 0	891.6 8	559,265.00	891.68	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9333	博腾股 份	2022- 06-13	779,1 00.00	10,000.00	28	3.5 0	1,287 .68	779,900.00	1,287.68	
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 9335	光线传 媒	2022- 06-13	307,6 63.00	35,900.00	28	3.5 0	508.5 0	339,973.00	508.50	
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001	汤臣倍 健	2022- 06-13	514,8 00.00	26,000.00	28	3.5 0	850.8 5	562,900.00	850.85	

司	9337									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9339	红日药 业	2022- 06-13	320,7 12.00	55,200.00	28	3.5 0	530.0 7	425,040.00	530.07
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9341	机器人	2022- 06-13	323,5 54.00	38,200.00	28	3.5 0	534.7 6	385,056.00	534.76
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1187	三聚环 保	2022- 06-13	205,6 32.00	43,200.00	28	3.5 0	339.8 6	218,592.00	339.86
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1189	蓝色光 标	2022- 06-13	473,8 23.00	76,300.00	28	3.5 0	783.1 2	498,239.00	783.12
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1191	安科生 物	2022- 06-13	328,8 87.00	35,100.00	28	3.5 0	543.5 8	354,861.00	543.58
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1195	我武生 物	2022- 06-13	447,4 56.00	9,600.00	28	3.5 0	739.5 5	499,488.00	739.55
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1197	网宿科 技	2022- 06-13	388,5 00.00	75,000.00	28	3.5 0	642.1 0	402,000.00	642.10
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1199	开山股 份	2022- 06-13	177,5 07.00	12,100.00	28	3.5 0	293.3 8	181,016.00	293.38
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1201	信维通 信	2022- 06-13	469,1 60.00	29,600.00	28	3.5 0	775.4 2	498,760.00	775.42
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1203	昆仑万 维	2022- 06-13	437,7 42.00	29,300.00	28	3.5 0	723.4 9	468,800.00	723.49
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0002 1205	中际旭 创	2022- 06-13	560,8 80.00	17,100.00	28	3.5 0	927.0 1	530,955.00	927.01

广发证 券股份 有限公 司	2022 0616 0000 1216	华大基 因	2022- 06-16	1,874 ,040. 00	28,000.00	28	3.1 0	2,259 .26	2,007,600.0 0	2,259.26
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2318	英科医 疗	2022- 06-17	230,1 12.00	9,400.00	28	3.1 0	257.6 0	238,384.00	257.60
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2319	当升科 技	2022- 06-17	818,9 31.00	8,700.00	28	3.1 0	916.7 5	785,958.00	916.75
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2320	宋城演 艺	2022- 06-17	389,6 85.00	31,300.00	28	3.1 0	436.2 3	480,455.00	436.23
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2322	稳健医 疗	2022- 06-17	155,2 80.00	2,400.00	28	3.1 0	173.8 3	159,600.00	173.83
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2324	华测检 测	2022- 06-17	668,4 18.00	30,300.00	28	3.1 0	748.2 6	703,263.00	748.26
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2326	贝达药 业	2022- 06-17	297,3 30.00	5,300.00	28	3.1 0	332.8 4	322,240.00	332.84
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2332	君实生 物	2022- 06-17	671,5 00.00	7,900.00	28	3.1 0	751.7 1	595,186.00	751.71
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2336	中控技 术	2022- 06-17	469,6 80.00	6,000.00	28	3.1 0	525.7 8	436,560.00	525.78
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2338	康希诺	2022- 06-17	278,4 90.00	1,500.00	28	3.1 0	311.7 5	298,620.00	311.75
广发证 券股份 有限公 司	2022 0617 0000 2340	西部超 导	2022- 06-17	497,8 38.00	5,700.00	28	3.1 0	557.3 0	525,540.00	557.30
广发证	2022	固德威	2022-	399,0	1,200.00	28	3.1	446.6	375,612.00	446.66

券股份 有限公司	0617 0000 2342		06-17	00.00			0	6		
广发证 券股份 有限公司	2022 0620 0000 1644	九号公 司	2022- 06-20	353,0 20.00	7,600.00	28	3.1 0	303.9 9	-	303.99
广发证 券股份 有限公司	2022 0623 0000 8533	微芯生 物	2022- 06-23	758,1 00.00	30,000.00	28	3.1 0	456.9 7	755,700.00	456.97
广发证 券股份 有限公司	2022 0623 0000 8535	易华录	2022- 06-23	177,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	107.1 7	174,000.00	107.17
广发证 券股份 有限公司	2022 0627 0000 0271	碧水源	2022- 06-27	707,8 20.00	141,000.0 0	28	3.1 0	182.8 5	734,610.00	182.85
广发证 券股份 有限公司	2022 0628 0001 0894	圣湘生 物	2022- 06-28	48,06 4.00	1,600.00	28	3.1 0	8.28	47,376.00	8.28
广发证 券股份 有限公司	2022 0630 0001 5575	圣湘生 物	2022- 06-30	384,9 30.00	13,000.00	28	3.1 0	-	384,930.00	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日										
关联方 名称	合约 编号	证券名 称	成交 时间	交易 金额	交易数量 (单位: 股)	出借期 限(单 位:天)	费 率 (%)	利息 收入	期末证券出 借业务余额	期末应 收利息 余额
广发证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,254,187,721.00	86.08%	1,183,711,221.00	83.30%
广发证券股份有限公司	6,550,721.00	0.45%	27,904,001.00	1.96%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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	65,062,878.51	45,626.85	13,691,196.35	66,649.51

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。本基金本报告期末持有 297,448 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（2021 年 12 月 31 日：294,848 股），成本总额为人民币 5,152,408.08 元（2021 年 12 月 31 日：5,419,594.32 元），估值总额为 4,307,047.04 元（2021 年 12 月 31 日：5,301,367.04 元），占本基金资产净值的比例为 0.15%（2021 年 12 月 31 日：0.17%）。

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（2022 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	受限期	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
688048	长光华芯	2022-03-25	6 个月	新股流通受限	80.80	111.97	6,790.00	548,632.00	760,276.30	-
301139	元道通信	2022-06-30	1 个月内(含)	新股流通受限	38.46	38.46	2,542.00	97,765.32	97,765.32	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	新股流通受限	72.88	31.38	2,076.00	100,865.92	65,144.88	20220609 除权除息,转增比例 0.5000
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6 个月	新股流通受限	17.27	14.83	4,284.00	73,984.68	63,531.72	20220610 除权除息,派息比例 0.1500 (含税)
301233	盛帮股份	2022-06-24	1 个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418.00	58,875.36	58,875.36	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	578.00	55,847.58	50,759.96	20220524 除权除息,派息比例 3.9900 (含税),转增比例

										0.8000
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	857.00	65,611.92	44,495.44	20220429 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新股流通受限	109.30	45.69	945.00	68,859.00	43,177.05	20220617 除权除息,派息比例 1.0000 (含税),转增比例 0.5000
301216	万凯新材	2022-03-21	6 个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120.00	39,961.60	33,420.80	20220623 除权除息,派息比例 0.2000 (含税)
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	569.00	32,364.72	32,102.98	20220616 除权除息,派息比例 0.2000 (含税)
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,838.00	42,642.25	29,665.32	20220617 除权除息,派息比例 0.3800 (含

										税),转 增比 例 0.5000
30130 2	华如 科技	2022-0 6-16	6 个月	新股 流通 受限	52.03	56.42	466.00	24,245 .98	26,291 .72	-
30120 1	诚达 药业	2022-0 1-12	6 个月	新股 流通 受限	72.69	71.54	353.00	25,659 .57	25,253 .62	20220 527 除 权除 息,派 息比 例 0.4500 (含税)
30112 2	采纳 股份	2022-0 1-19	6 个月	新股 流通 受限	50.31	70.37	301.00	15,143 .31	21,181 .37	20220 425 除 权除 息,派 息比 例 0.3500 (含税)
30110 2	兆讯 传媒	2022-0 3-15	6 个月	新股 流通 受限	39.88	31.09	642.00	25,602 .96	19,959 .78	-
30118 7	欧圣 电气	2022-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	21.33	22.54	876.00	18,685 .08	19,745 .04	20220 607 除 权除 息,派 息比 例 0.5000 (含税)
30110 3	何氏 眼科	2022-0 3-14	6 个月	新股 流通 受限	42.50	32.02	507.00	16,575 .00	16,234 .14	20220 601 除 权除 息,派 息比 例 0.6000 (含 税),转 增比 例

										0.3000
301235	华康医疗	2022-01-21	6 个月	新股流通受限	39.30	37.93	418.00	16,427.40	15,854.74	20220518 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
301117	佳缘科技	2022-01-07	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262.00	12,261.60	14,263.28	20220517 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新股流通受限	39.07	29.87	472.00	18,441.04	14,098.64	20220617 除权除息,派息比例 0.2000 (含税)
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新股流通受限	29.67	33.28	416.00	12,342.72	13,844.48	20220629 除权除息,派息比例 0.2050 (含税)
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	516.00	19,809.24	12,332.40	20220621 除权除息,派息比例 0.5200 (含税)
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新股流通受限	52.37	47.83	249.00	13,040.13	11,909.67	20220607 除权除息,派

										息比例 0.2500 (含税)
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新股流通受限	56.69	41.86	261.00	14,796.09	10,925.46	20220524 除权除息,派息比例 0.7000 (含税)
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新股流通受限	38.46	38.46	283.00	10,884.18	10,884.18	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271.00	17,365.68	10,167.92	20220615 除权除息,派息比例 0.6000 (含税)
301222	浙江恒威	2022-03-02	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	332.00	11,281.36	9,614.72	20220610 除权除息,派息比例 0.6000 (含税)
301288	清研环境	2022-04-14	6 个月	新股流通受限	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	20220630 除权除息,派息比例 0.1300 (含税)
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新股流通受限	31.98	26.26	338.00	10,809.24	8,875.88	20220615 除权除

										息,派 息比 例 0.3000 (含税)
30115 8	德石 股份	2022-0 1-07	6 个月	新股 流通 受限	15.64	20.38	379.00	5,927. 56	7,724. 02	2022 527 除 权除 息,派 息比 例 0.1200 (含税)
30122 8	实朴 检测	2022-0 1-21	6 个月	新股 流通 受限	20.08	20.34	373.00	7,489. 84	7,586. 82	2022 616 除 权除 息,派 息比 例 0.2000 (含税)
30123 3	盛帮 股份	2022-0 6-24	6 个月	新股 流通 受限	41.52	41.52	158.00	6,560. 16	6,560. 16	-

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	受限 期	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
12706 4	杭氧 转债	2022-0 5-19	1 个月 内(含)	新债 流通 受限	100.00	100.02	1,939. 00	193,90 0.00	193,93 6.55	-

注：截至本报告期末 2022 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
00267 0	国盛金 控	2022-06 -01	重大事 项停牌	9.60	2022-0 7-14	9.99	549,011.00	5,437,200.04	5,270,505.60	-

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 2022 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 2022 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	601615	明阳智能	2022 年 7 月 6 日	33.80	100,000.00	3,380,000.00
2	600096	云天化	2022 年 7 月 13 日 -2022 年 7 月 15 日	31.48	76,300.00	2,401,924.00
3	002268	卫士通	2022 年 7 月 28 日	42.91	55,000.00	2,360,050.00
4	603127	昭衍新药	2022 年 7 月 11 日	113.80	20,000.00	2,276,000.00
5	600141	兴发集团	2022 年 7 月 21 日	43.99	49,000.00	2,155,510.00
6	600522	中天科技	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	23.10	91,500.00	2,113,650.00
7	600497	驰宏锌锗	2022 年 7 月 4 日	5.19	400,000.00	2,076,000.00
8	600563	法拉电子	2022 年 7 月 11 日	205.16	10,000.00	2,051,600.00
9	300676	华大基因	2022 年 7 月 14 日	71.70	28,000.00	2,007,600.00
10	600256	广汇能源	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 25 日	10.54	170,900.00	1,801,286.00
11	600157	永泰能源	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	1.59	1,075,400.00	1,709,886.00
12	300058	蓝色光标	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.53	259,600.00	1,695,188.00
13	603345	安井食品	2022 年 7 月 15 日	167.87	10,000.00	1,678,700.00
14	600418	江淮汽车	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 15 日	17.16	97,300.00	1,669,668.00
15	000983	山西焦煤	2022 年 7 月 5 日	13.39	116,900.00	1,565,291.00

			-2022 年 7 月 15 日			0
16	002756	永兴材料	2022 年 7 月 15 日	152.21	10,000.00	1,522,100.00
17	603026	石大胜华	2022 年 7 月 15 日	145.35	10,000.00	1,453,500.00
18	002497	雅化集团	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 15 日	32.65	44,200.00	1,443,130.00
19	600499	科达制造	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 15 日	20.64	67,700.00	1,397,328.00
20	603267	鸿远电子	2022 年 7 月 11 日	134.33	10,000.00	1,343,300.00
21	600486	扬农化工	2022 年 7 月 11 日	133.28	10,000.00	1,332,800.00
22	603077	和邦生物	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	4.26	302,700.00	1,289,502.00
23	000807	云铝股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	9.88	127,200.00	1,256,736.00
24	600297	广汇汽车	2022 年 7 月 4 日	2.61	475,000.00	1,239,750.00
25	002603	以岭药业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	24.30	51,000.00	1,239,300.00
26	002056	横店东磁	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	26.62	44,900.00	1,195,238.00
27	300012	华测检测	2022 年 7 月 13 日 -2022 年 7 月 15 日	23.21	51,300.00	1,190,673.00
28	002180	纳思达	2022 年 7 月 11 日	50.62	21,600.00	1,093,392.00
29	000519	中兵红箭	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	29.15	35,600.00	1,037,740.00
30	002385	大北农	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 20 日	7.81	131,600.00	1,027,796.00
31	002183	怡亚通	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	7.21	136,900.00	987,049.00
32	600546	山煤国际	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	19.46	50,300.00	978,838.00
33	600392	盛和资源	2022 年 7 月 11 日	22.60	43,000.00	971,800.00
34	300182	捷成股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.50	175,700.00	966,350.00
35	300363	博腾股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 27 日	77.99	12,200.00	951,478.00
36	600155	华创阳安	2022 年 7 月 20 日	8.48	110,000.00	932,800.00
37	600885	宏发股份	2022 年 7 月 6 日	41.85	22,260.00	931,581.00
38	002624	完美世界	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 15 日	14.37	64,100.00	921,117.00

39	002506	协鑫集成	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 12 日	3.72	246,000.00	915,120.00
40	600516	方大炭素	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 14 日	7.60	120,200.00	913,520.00
41	600056	中国医药	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	14.82	60,820.00	901,352.40
42	600348	华阳股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	15.46	57,200.00	884,312.00
43	300285	国瓷材料	2022 年 7 月 11 日	35.92	24,600.00	883,632.00
44	600233	圆通速递	2022 年 7 月 11 日	20.39	42,100.00	858,419.00
45	600988	赤峰黄金	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	15.95	53,600.00	854,920.00
46	601872	招商轮船	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.76	148,100.00	853,056.00
47	601058	赛轮轮胎	2022 年 7 月 13 日 -2022 年 7 月 15 日	11.27	75,600.00	852,012.00
48	600487	亨通光电	2022 年 7 月 6 日	14.54	57,900.00	841,866.00
49	601696	中银证券	2022 年 7 月 12 日 -2022 年 7 月 15 日	13.30	63,100.00	839,230.00
50	002797	第一创业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	6.41	130,700.00	837,787.00
51	002127	南极电商	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 14 日	5.34	151,700.00	810,078.00
52	002240	盛新锂能	2022 年 7 月 15 日	60.36	13,300.00	802,788.00
53	300070	碧水源	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 25 日	5.21	154,000.00	802,340.00
54	002078	太阳纸业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	12.31	64,700.00	796,457.00
55	603456	九洲药业	2022 年 7 月 11 日	51.70	15,300.00	791,010.00
56	300073	当升科技	2022 年 7 月 15 日	90.34	8,700.00	785,958.00
57	000039	中集集团	2022 年 7 月 13 日 -2022 年 7 月 14 日	13.85	56,600.00	783,910.00
58	600026	中远海能	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 14 日	10.33	75,000.00	774,750.00
59	000027	深圳能源	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	6.41	119,400.00	765,354.00
60	002092	中泰化学	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	7.76	97,400.00	755,824.00
61	688321	微芯生物	2022 年 7 月 21 日	25.19	30,000.00	755,700.00
62	600298	安琪酵母	2022 年 7 月 6 日	48.75	15,300.00	745,875.00
63	300357	我武生物	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 27 日	52.03	14,300.00	744,029.00
64	002195	二三四五	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	2.25	329,800.00	742,050.00

65	002131	利欧股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	1.94	381,700.00	740,498.00
66	000630	铜陵有色	2022 年 7 月 11 日	3.26	225,900.00	736,434.00
67	600985	淮北矿业	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	14.56	50,400.00	733,824.00
68	300026	红日药业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	7.70	95,300.00	733,810.00
69	002203	海亮股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	11.55	62,700.00	724,185.00
70	000629	攀钢钒钛	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	3.80	190,400.00	723,520.00
71	600862	中航高科	2022 年 7 月 11 日	28.10	25,600.00	719,360.00
72	000988	华工科技	2022 年 7 月 11 日	23.17	30,800.00	713,636.00
73	002353	杰瑞股份	2022 年 7 月 11 日	40.30	17,600.00	709,280.00
74	601077	渝农商行	2022 年 7 月 11 日	3.70	189,700.00	701,890.00
75	600166	福田汽车	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	2.83	246,200.00	696,746.00
76	601168	西部矿业	2022 年 7 月 11 日	11.83	58,400.00	690,872.00
77	600153	建发股份	2022 年 7 月 11 日	13.07	52,600.00	687,482.00
78	300024	机器人	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	10.08	68,200.00	687,456.00
79	300017	网宿科技	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.36	127,500.00	683,400.00
80	000960	锡业股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	16.77	40,600.00	680,862.00
81	002422	科伦药业	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	18.70	36,200.00	676,940.00
82	600160	巨化股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	13.15	51,300.00	674,595.00
83	600867	通化东宝	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	10.34	65,000.00	672,100.00
84	002028	思源电气	2022 年 7 月 6 日	35.66	18,700.00	666,842.00
85	603198	迎驾贡酒	2022 年 7 月 11 日	65.14	10,000.00	651,400.00
86	300383	光环新网	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	10.42	62,500.00	651,250.00
87	000932	华菱钢铁	2022 年 7 月 11 日	5.09	127,000.00	646,430.00
88	603589	口子窖	2022 年 7 月 11 日	58.61	11,000.00	644,710.00
89	002185	华天科技	2022 年 7 月 11 日	9.38	68,700.00	644,406.00
90	601128	常熟银行	2022 年 7 月 11 日	7.64	84,000.00	641,760.00
91	600704	物产中大	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	5.13	125,000.00	641,250.00
92	601636	旗滨集团	2022 年 7 月 11 日	12.75	49,400.00	629,850.00
93	300418	昆仑万维	2022 年 7 月 11 日	16.00	39,300.00	628,800.00
94	601866	中远海发	2022 年 7 月 6 日	3.00	209,600.00	628,800.00

			-2022 年 7 月 14 日			
95	600739	辽宁成大	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	14.58	42,900.00	625,482.00
96	600765	中航重机	2022 年 7 月 11 日	32.18	19,300.00	621,074.00
97	600699	均胜电子	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	15.71	39,300.00	617,403.00
98	600598	北大荒	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	14.76	41,800.00	616,968.00
99	002739	万达电影	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	13.65	44,600.00	608,790.00
100	000830	鲁西化工	2022 年 7 月 28 日	17.29	35,000.00	605,150.00
101	000970	中科三环	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	18.78	32,000.00	600,960.00
102	688180	君实生物-U	2022 年 7 月 15 日	75.34	7,900.00	595,186.00
103	600820	隧道股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	6.12	97,000.00	593,640.00
104	600827	百联股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	13.21	44,500.00	587,845.00
105	002408	齐翔腾达	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	8.11	71,800.00	582,298.00
106	000728	国元证券	2022 年 7 月 11 日	6.22	93,600.00	582,192.00
107	000930	中粮科技	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 14 日	9.04	64,300.00	581,272.00
108	603517	绝味食品	2022 年 7 月 15 日	57.82	10,000.00	578,200.00
109	600236	桂冠电力	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	6.09	94,900.00	577,941.00
110	600511	国药股份	2022 年 7 月 8 日 -2022 年 7 月 11 日	26.78	21,500.00	575,770.00
111	002557	洽洽食品	2022 年 7 月 11 日	56.93	10,000.00	569,300.00
112	600705	中航产融	2022 年 7 月 11 日	3.46	164,000.00	567,440.00
113	000738	航发控制	2022 年 7 月 11 日	28.10	20,100.00	564,810.00
114	600177	雅戈尔	2022 年 7 月 11 日	6.63	85,100.00	564,213.00
115	300146	汤臣倍健	2022 年 7 月 11 日	21.65	26,000.00	562,900.00
116	002507	涪陵榨菜	2022 年 7 月 11 日	34.52	16,300.00	562,676.00
117	002434	万里扬	2022 年 7 月 5 日	8.55	65,600.00	560,880.00
118	300699	光威复材	2022 年 7 月 11 日	58.87	9,500.00	559,265.00
119	600216	浙江医药	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	13.65	40,700.00	555,555.00
120	002409	雅克科技	2022 年 7 月 11 日	55.51	10,000.00	555,100.00
121	002155	湖南黄金	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	12.14	45,700.00	554,798.00
122	600667	太极实业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 12 日	7.38	75,000.00	553,500.00
123	600021	上海电力	2022 年 7 月 8 日	10.25	54,000.00	553,500.00

			-2022 年 7 月 14 日			
124	600580	卧龙电驱	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	14.42	38,200.00	550,844.00
125	002396	星网锐捷	2022 年 7 月 8 日 -2022 年 7 月 11 日	22.64	24,300.00	550,152.00
126	601717	郑煤机	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	14.41	38,100.00	549,021.00
127	600863	内蒙华电	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 22 日	3.65	150,000.00	547,500.00
128	600673	东阳光	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	8.99	60,400.00	542,996.00
129	603858	步长制药	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	19.71	27,500.00	542,025.00
130	000999	华润三九	2022 年 7 月 11 日	45.00	12,000.00	540,000.00
131	000998	隆平高科	2022 年 7 月 11 日	16.66	32,300.00	538,118.00
132	002124	天邦食品	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	6.72	79,800.00	536,256.00
133	002572	索菲亚	2022 年 7 月 11 日	27.50	19,500.00	536,250.00
134	601699	潞安环能	2022 年 7 月 11 日	14.62	36,600.00	535,092.00
135	002382	蓝帆医疗	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 26 日	9.55	55,900.00	533,845.00
136	600380	健康元	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	12.35	43,200.00	533,520.00
137	300308	中际旭创	2022 年 7 月 11 日	31.05	17,100.00	530,955.00
138	002002	鸿达兴业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	3.71	142,900.00	530,159.00
139	300009	安科生物	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 27 日	10.11	52,400.00	529,764.00
140	603939	益丰药房	2022 年 7 月 15 日	52.83	10,000.00	528,300.00
141	600536	中国软件	2022 年 7 月 11 日	40.59	13,000.00	527,670.00
142	002505	鹏都农牧	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	3.39	155,500.00	527,145.00
143	600170	上海建工	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 11 日	3.03	173,900.00	526,917.00
144	688390	固德威	2022 年 7 月 15 日	313.0 1	1,680.00	525,856.80
145	688122	西部超导	2022 年 7 月 15 日	92.20	5,700.00	525,540.00
146	002508	老板电器	2022 年 7 月 11 日	36.03	14,500.00	522,435.00
147	600482	中国动力	2022 年 7 月 11 日	15.71	33,100.00	520,001.00
148	002221	东华能源	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	9.31	55,300.00	514,843.00
149	601016	节能风电	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	4.80	107,200.00	514,560.00
150	600325	华发股份	2022 年 7 月 6 日	7.57	67,900.00	514,003.00

			-2022 年 7 月 11 日			
151	601005	重庆钢铁	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	1.91	269,000.00	513,790.00
152	002465	海格通信	2022 年 7 月 6 日	9.09	56,500.00	513,585.00
153	000060	中金岭南	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 6 日	4.46	114,700.00	511,562.00
154	600259	广晟有色	2022 年 7 月 11 日	50.65	10,000.00	506,500.00
155	002373	千方科技	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	11.12	45,300.00	503,736.00
156	002266	浙富控股	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	4.79	104,700.00	501,513.00
157	300136	信维通信	2022 年 7 月 11 日	16.85	29,600.00	498,760.00
158	000975	银泰黄金	2022 年 7 月 11 日	9.74	51,000.00	496,740.00
159	000012	南玻 A	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	7.42	66,900.00	496,398.00
160	603658	安图生物	2022 年 7 月 15 日	48.89	10,000.00	488,900.00
161	002625	光启技术	2022 年 7 月 15 日	17.27	28,200.00	487,014.00
162	600409	三友化工	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	8.19	58,800.00	481,572.00
163	300144	宋城演艺	2022 年 7 月 15 日	15.35	31,300.00	480,455.00
164	000883	湖北能源	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.11	94,000.00	480,340.00
165	002019	亿帆医药	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	13.98	33,800.00	472,524.00
166	600066	宇通客车	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	8.65	54,600.00	472,290.00
167	002223	鱼跃医疗	2022 年 7 月 11 日	25.66	18,400.00	472,144.00
168	601108	财通证券	2022 年 7 月 15 日	7.87	59,700.00	469,839.00
169	002372	伟星新材	2022 年 7 月 11 日	24.04	19,500.00	468,780.00
170	000987	越秀金控	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	7.03	66,520.00	467,635.60
171	600037	歌华有线	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	9.39	49,800.00	467,622.00
172	002249	大洋电机	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	6.14	75,900.00	466,026.00
173	600039	四川路桥	2022 年 7 月 11 日	10.53	43,900.00	462,267.00
174	000690	宝新能源	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	4.38	105,300.00	461,214.00
175	000598	兴蓉环境	2022 年 7 月 6 日	5.11	89,800.00	458,878.00
176	601997	贵阳银行	2022 年 7 月 11 日	5.81	78,400.00	455,504.00
177	002701	奥瑞金	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	5.20	87,300.00	453,960.00
178	600038	中直股份	2022 年 7 月 11 日	45.20	10,000.00	452,000.00
179	600859	王府井	2022 年 7 月 11 日	25.98	17,300.00	449,454.00

180	600637	东方明珠	2022 年 7 月 6 日	7.15	62,800.00	449,020.00
181	300251	光线传媒	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	9.47	47,200.00	446,984.00
182	600109	国金证券	2022 年 7 月 15 日	9.00	49,500.00	445,500.00
183	002191	劲嘉股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	10.72	41,500.00	444,880.00
184	600315	上海家化	2022 年 7 月 11 日	42.75	10,400.00	444,600.00
185	603883	老百姓	2022 年 7 月 8 日	33.88	13,000.00	440,440.00
186	002156	通富微电	2022 年 7 月 11 日	15.40	28,500.00	438,900.00
187	601608	中信重工	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	3.79	115,700.00	438,503.00
188	002299	圣农发展	2022 年 7 月 11 日	19.18	22,800.00	437,304.00
189	688777	中控技术	2022 年 7 月 15 日	72.76	6,000.00	436,560.00
190	600535	天士力	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	10.51	41,500.00	436,165.00
191	002326	永太科技	2022 年 7 月 15 日	32.93	13,200.00	434,676.00
192	002244	滨江集团	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	8.65	50,100.00	433,365.00
193	688289	圣湘生物	2022 年 7 月 26 日 -2022 年 7 月 28 日	29.61	14,600.00	432,306.00
194	600879	航天电子	2022 年 7 月 11 日	6.49	66,600.00	432,234.00
195	600642	申能股份	2022 年 7 月 6 日	5.68	75,200.00	427,136.00
196	600372	中航电子	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 13 日	19.39	21,900.00	424,641.00
197	600258	首旅酒店	2022 年 7 月 11 日	24.80	17,100.00	424,080.00
198	000750	国海证券	2022 年 7 月 11 日	3.63	116,800.00	423,984.00
199	000623	吉林敖东	2022 年 7 月 11 日	14.76	28,500.00	420,660.00
200	000729	燕京啤酒	2022 年 7 月 6 日	9.66	43,200.00	417,312.00
201	601880	辽港股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	1.70	245,000.00	416,500.00
202	600755	厦门国贸	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	7.50	55,400.00	415,500.00
203	600201	生物股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	9.16	45,100.00	413,116.00
204	000513	丽珠集团	2022 年 7 月 11 日	36.21	11,400.00	412,794.00
205	000831	五矿稀土	2022 年 7 月 15 日	31.25	13,100.00	409,375.00
206	000887	中鼎股份	2022 年 7 月 11 日	18.24	22,400.00	408,576.00
207	600062	华润双鹤	2022 年 7 月 11 日	25.66	15,900.00	407,994.00
208	600801	华新水泥	2022 年 7 月 11 日	19.51	20,800.00	405,808.00
209	300072	三聚环保	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.06	79,900.00	404,294.00
210	003035	南网能源	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	6.35	63,200.00	401,320.00
211	002273	水晶光电	2022 年 7 月 6 日	12.11	32,800.00	397,208.00

			-2022 年 7 月 13 日			
212	600316	洪都航空	2022 年 7 月 11 日	30.24	13,100.00	396,144.00
213	002444	巨星科技	2022 年 7 月 11 日	18.84	21,000.00	395,640.00
214	600909	华安证券	2022 年 7 月 11 日	4.55	86,400.00	393,120.00
215	600027	华电国际	2022 年 7 月 11 日	3.93	99,900.00	392,607.00
216	600008	首创环保	2022 年 7 月 6 日	2.90	135,000.00	391,500.00
217	600782	新钢股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	5.04	76,700.00	386,568.00
218	603225	新凤鸣	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	11.54	33,400.00	385,436.00
219	603568	伟明环保	2022 年 7 月 11 日	33.37	11,500.00	383,755.00
220	002294	信立泰	2022 年 7 月 11 日	28.10	13,600.00	382,160.00
221	601958	金铂股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 6 日	8.84	43,200.00	381,888.00
222	002683	广东宏大	2022 年 7 月 11 日	27.83	13,700.00	381,271.00
223	002500	山西证券	2022 年 7 月 11 日	5.74	66,000.00	378,840.00
224	002926	华西证券	2022 年 7 月 11 日	7.84	48,200.00	377,888.00
225	603218	日月股份	2022 年 7 月 11 日	25.40	14,800.00	375,920.00
226	000050	深天马 A	2022 年 7 月 11 日	9.97	37,600.00	374,872.00
227	002065	东华软件	2022 年 7 月 11 日	6.32	58,900.00	372,248.00
228	600271	航天信息	2022 年 7 月 11 日	10.94	34,000.00	371,960.00
229	002250	联化科技	2022 年 7 月 6 日	16.37	22,600.00	369,962.00
230	002430	杭氧股份	2022 年 7 月 11 日	31.26	11,800.00	368,868.00
231	002212	天融信	2022 年 7 月 11 日	10.15	36,300.00	368,445.00
232	601990	南京证券	2022 年 7 月 15 日	8.34	43,700.00	364,458.00
233	600208	新湖中宝	2022 年 7 月 11 日	2.76	131,800.00	363,768.00
234	600118	中国卫星	2022 年 7 月 11 日	20.08	18,100.00	363,448.00
235	002081	金螳螂	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	5.08	71,300.00	362,204.00
236	000540	中天金融	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 14 日	1.93	187,000.00	360,910.00
237	000547	航天发展	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	11.94	30,000.00	358,200.00
238	000400	许继电气	2022 年 7 月 11 日	19.20	18,500.00	355,200.00
239	002004	华邦健康	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	5.58	63,500.00	354,330.00
240	601992	金隅集团	2022 年 7 月 6 日	2.77	127,800.00	354,006.00
241	002110	三钢闽光	2022 年 7 月 6 日	6.09	58,100.00	353,829.00
242	000778	新兴铸管	2022 年 7 月 11 日	4.82	73,400.00	353,788.00
243	603156	养元饮品	2022 年 7 月 11 日	22.72	15,500.00	352,160.00
244	600507	方大特钢	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	6.99	50,200.00	350,898.00
245	600717	天津港	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	4.01	86,200.00	345,662.00

246	002468	申通快递	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	11.92	28,700.00	342,104.00
247	000401	冀东水泥	2022 年 7 月 11 日	10.52	32,500.00	341,900.00
248	600998	九州通	2022 年 7 月 11 日	11.91	28,700.00	341,817.00
249	689009	九号公司	2022 年 7 月 18 日	44.50	7,600.00	338,200.00
250	600390	五矿资本	2022 年 7 月 11 日	4.89	68,900.00	336,921.00
251	002128	电投能源	2022 年 7 月 11 日	14.32	23,500.00	336,520.00
252	000997	新大陆	2022 年 7 月 11 日	13.21	25,300.00	334,213.00
253	000021	深科技	2022 年 7 月 11 日	11.64	28,700.00	334,068.00
254	600528	中铁工业	2022 年 7 月 11 日	8.05	40,800.00	328,440.00
255	000959	首钢股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	4.76	68,900.00	327,964.00
256	600839	四川长虹	2022 年 7 月 11 日	2.88	113,200.00	326,016.00
257	000488	晨鸣纸业	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	5.64	57,500.00	324,300.00
258	603885	吉祥航空	2022 年 7 月 11 日	17.99	18,000.00	323,820.00
259	300558	贝达药业	2022 年 7 月 15 日	60.80	5,300.00	322,240.00
260	002085	万丰奥威	2022 年 7 月 4 日	5.37	60,000.00	322,200.00
261	600737	中粮糖业	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	7.52	42,800.00	321,856.00
262	601333	广深铁路	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	2.18	147,100.00	320,678.00
263	000937	冀中能源	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	7.46	42,500.00	317,050.00
264	603712	七一二	2022 年 7 月 11 日	31.50	10,000.00	315,000.00
265	002233	塔牌集团	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	8.85	35,500.00	314,175.00
266	600398	海澜之家	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	4.75	66,000.00	313,500.00
267	002390	信邦制药	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	6.91	45,300.00	313,023.00
268	603233	大参林	2022 年 7 月 15 日	31.30	10,000.00	313,000.00
269	002010	传化智联	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	6.43	48,100.00	309,283.00
270	600718	东软集团	2022 年 7 月 11 日	11.51	26,600.00	306,166.00
271	600006	东风汽车	2022 年 7 月 7 日	7.55	39,900.00	301,245.00
272	600498	烽火通信	2022 年 7 月 11 日	14.48	20,800.00	301,184.00
273	000686	东北证券	2022 年 7 月 11 日	6.99	43,000.00	300,570.00
274	600060	海信视像	2022 年 7 月 11 日	12.50	24,000.00	300,000.00
275	000559	万向钱潮	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	5.94	50,500.00	299,970.00
276	688185	康希诺	2022 年 7 月 15 日	199.08	1,500.00	298,620.00
277	000028	国药一致	2022 年 7 月 6 日	29.79	10,000.00	297,900.00

278	600572	康恩贝	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	4.43	67,200.00	297,696.00
279	000869	张裕 A	2022 年 7 月 11 日	29.74	10,000.00	297,400.00
280	600282	南钢股份	2022 年 7 月 6 日	3.15	94,400.00	297,360.00
281	000415	渤海租赁	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	2.17	136,500.00	296,205.00
282	300212	易华录	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 21 日	17.40	17,000.00	295,800.00
283	000581	威孚高科	2022 年 7 月 6 日	19.25	15,300.00	294,525.00
284	000709	河钢股份	2022 年 7 月 6 日	2.26	130,200.00	294,252.00
285	601179	中国西电	2022 年 7 月 11 日	4.68	62,800.00	293,904.00
286	600566	济川药业	2022 年 7 月 11 日	27.16	10,800.00	293,328.00
287	601577	长沙银行	2022 年 7 月 11 日	7.93	36,900.00	292,617.00
288	600022	山东钢铁	2022 年 7 月 6 日	1.74	167,800.00	291,972.00
289	600064	南京高科	2022 年 7 月 11 日	11.00	26,500.00	291,500.00
290	600871	石化油服	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	1.89	153,000.00	289,170.00
291	601598	中国外运	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	3.88	73,700.00	285,956.00
292	600167	联美控股	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	7.49	38,000.00	284,620.00
293	002958	青农商行	2022 年 7 月 11 日	3.32	85,100.00	282,532.00
294	600500	中化国际	2022 年 7 月 11 日	6.65	42,400.00	281,960.00
295	601718	际华集团	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	3.10	90,700.00	281,170.00
296	600928	西安银行	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	3.67	76,200.00	279,654.00
297	600307	酒钢宏兴	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	1.94	143,600.00	278,584.00
298	600728	佳都科技	2022 年 7 月 11 日	6.46	43,100.00	278,426.00
299	002595	豪迈科技	2022 年 7 月 11 日	22.34	12,200.00	272,548.00
300	600517	国网英大	2022 年 7 月 11 日	5.19	52,500.00	272,475.00
301	000528	柳工	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	6.51	41,600.00	270,816.00
302	688208	道通科技	2022 年 7 月 11 日	32.92	8,200.00	269,944.00
303	600787	中储股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.69	46,900.00	266,861.00
304	600597	光明乳业	2022 年 7 月 6 日	12.63	21,100.00	266,493.00
305	002146	荣盛发展	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	3.03	87,100.00	263,913.00
306	000158	常山北明	2022 年 7 月 1 日 -2022 年 7 月 14 日	6.00	43,800.00	262,800.00
307	600764	中国海防	2022 年 7 月 11 日	25.24	10,000.00	252,400.00
308	601118	海南橡胶	2022 年 7 月 11 日	4.78	52,400.00	250,472.00

309	601106	中国一重	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	3.07	81,000.00	248,670.00
310	000563	陕国投 A	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 11 日	3.12	79,400.00	247,728.00
311	000089	深圳机场	2022 年 7 月 6 日	7.72	31,400.00	242,408.00
312	002939	长城证券	2022 年 7 月 13 日	10.16	23,600.00	239,776.00
313	002048	宁波华翔	2022 年 7 月 11 日	16.02	14,900.00	238,698.00
314	300677	英科医疗	2022 年 7 月 15 日	25.36	9,400.00	238,384.00
315	002368	太极股份	2022 年 7 月 11 日	19.21	12,400.00	238,204.00
316	600967	内蒙一机	2022 年 7 月 6 日	9.12	26,100.00	238,032.00
317	000656	金科股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	2.86	82,600.00	236,236.00
318	600582	天地科技	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	4.78	49,300.00	235,654.00
319	600435	北方导航	2022 年 7 月 6 日	8.62	27,300.00	235,326.00
320	601000	唐山港	2022 年 7 月 6 日	2.58	90,800.00	234,264.00
321	001914	招商积余	2022 年 7 月 11 日	17.97	13,000.00	233,610.00
322	603228	景旺电子	2022 年 7 月 11 日	23.33	10,000.00	233,300.00
323	600195	中牧股份	2022 年 7 月 11 日	12.26	18,600.00	228,036.00
324	002281	光迅科技	2022 年 7 月 11 日	17.58	12,800.00	225,024.00
325	603379	三美股份	2022 年 7 月 11 日	22.25	10,000.00	222,500.00
326	000537	广宇发展	2022 年 7 月 11 日	12.99	17,100.00	222,129.00
327	002705	新宝股份	2022 年 7 月 11 日	21.99	10,100.00	222,099.00
328	002174	游族网络	2022 年 7 月 11 日	9.77	22,400.00	218,848.00
329	002690	美亚光电	2022 年 7 月 6 日	21.68	10,000.00	216,800.00
330	002925	盈趣科技	2022 年 7 月 11 日	21.52	10,000.00	215,200.00
331	002429	兆驰股份	2022 年 7 月 11 日	3.84	55,500.00	213,120.00
332	601228	广州港	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	3.67	57,900.00	212,493.00
333	600126	杭钢股份	2022 年 7 月 6 日	5.12	41,400.00	211,968.00
334	603638	艾迪精密	2022 年 7 月 6 日	20.50	10,300.00	211,150.00
335	002416	爱施德	2022 年 7 月 11 日	9.30	22,700.00	211,110.00
336	000990	诚志股份	2022 年 7 月 6 日	10.95	19,200.00	210,240.00
337	002030	达安基因	2022 年 7 月 6 日	17.19	12,200.00	209,718.00
338	601991	大唐发电	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	2.43	86,000.00	208,980.00
339	600446	金证股份	2022 年 7 月 11 日	10.38	20,100.00	208,638.00
340	000685	中山公用	2022 年 7 月 6 日	7.68	27,100.00	208,128.00
341	002745	木林森	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	9.77	21,300.00	208,101.00
342	601098	中南传媒	2022 年 7 月 6 日	9.44	22,000.00	207,680.00
343	600373	中文传媒	2022 年 7 月 11 日	9.99	20,700.00	206,793.00
344	000739	普洛药业	2022 年 7 月 13 日	20.64	10,000.00	206,400.00
345	002563	森马服饰	2022 年 7 月 6 日	5.92	34,700.00	205,424.00

			-2022 年 7 月 11 日			
346	002399	海普瑞	2022 年 7 月 11 日	17.58	11,400.00	200,412.00
347	600959	江苏有线	2022 年 7 月 6 日	3.26	61,300.00	199,838.00
348	600120	浙江东方	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	4.01	49,700.00	199,297.00
349	600143	金发科技	2022 年 7 月 6 日	9.52	20,800.00	198,016.00
350	600415	小商品城	2022 年 7 月 6 日	5.57	34,200.00	190,494.00
351	603000	人民网	2022 年 7 月 11 日	11.20	16,900.00	189,280.00
352	000636	风华高科	2022 年 7 月 13 日	18.79	10,000.00	187,900.00
353	600901	江苏租赁	2022 年 7 月 11 日	5.13	36,600.00	187,758.00
354	600968	海油发展	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	2.58	72,300.00	186,534.00
355	300296	利亚德	2022 年 7 月 6 日	7.30	25,400.00	185,420.00
356	300166	东方国信	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 13 日	9.22	20,100.00	185,322.00
357	600079	人福医药	2022 年 7 月 13 日	16.00	11,500.00	184,000.00
358	002242	九阳股份	2022 年 7 月 11 日	18.36	10,000.00	183,600.00
359	300257	开山股份	2022 年 7 月 11 日	14.96	12,100.00	181,016.00
360	603515	欧普照明	2022 年 7 月 6 日	17.45	10,000.00	174,500.00
361	601298	青岛港	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.47	31,400.00	171,758.00
362	601611	中国核建	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 7 日	8.39	20,400.00	171,156.00
363	601928	凤凰传媒	2022 年 7 月 6 日	7.15	23,400.00	167,310.00
364	000671	阳光城	2022 年 7 月 11 日	2.19	76,100.00	166,659.00
365	600369	西南证券	2022 年 7 月 6 日	3.97	41,400.00	164,358.00
366	600811	东方集团	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	2.83	58,000.00	164,140.00
367	000718	苏宁环球	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	3.68	44,400.00	163,392.00
368	002653	海思科	2022 年 7 月 11 日	16.11	10,000.00	161,100.00
369	601860	紫金银行	2022 年 7 月 11 日	2.87	56,100.00	161,007.00
370	600707	彩虹股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	4.68	34,400.00	160,992.00
371	300888	稳健医疗	2022 年 7 月 15 日	66.50	2,400.00	159,600.00
372	002153	石基信息	2022 年 7 月 13 日	15.87	10,000.00	158,700.00
373	001872	招商港口	2022 年 7 月 11 日	15.60	10,000.00	156,000.00
374	600648	外高桥	2022 年 7 月 6 日	13.60	11,400.00	155,040.00
375	000825	太钢不锈	2022 年 7 月 6 日	5.45	28,400.00	154,780.00
376	000967	盈峰环境	2022 年 7 月 6 日	5.06	29,000.00	146,740.00
377	600623	华谊集团	2022 年 7 月 11 日	8.30	17,300.00	143,590.00
378	000402	金融街	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	5.95	23,900.00	142,205.00
379	300168	万达信息	2022 年 7 月 6 日	9.44	14,800.00	139,712.00

380	600835	上海机电	2022 年 7 月 6 日	13.73	10,000.00	137,300.00
381	000961	中南建设	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	3.05	44,900.00	136,945.00
382	600970	中材国际	2022 年 7 月 6 日	9.69	14,100.00	136,629.00
383	002387	维信诺	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	6.72	20,200.00	135,744.00
384	000156	华数传媒	2022 年 7 月 6 日	7.97	17,000.00	135,490.00
385	600377	宁沪高速	2022 年 7 月 6 日	8.57	15,200.00	130,264.00
386	000062	深圳华强	2022 年 7 月 11 日	12.70	10,000.00	127,000.00
387	600376	首开股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	4.91	25,100.00	123,241.00
388	601456	国联证券	2022 年 7 月 13 日	12.27	10,000.00	122,700.00
389	601139	深圳燃气	2022 年 7 月 11 日	6.94	17,600.00	122,144.00
390	600299	安迪苏	2022 年 7 月 11 日	9.58	12,300.00	117,834.00
391	600339	中油工程	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	2.89	40,000.00	115,600.00
392	600808	马钢股份	2022 年 7 月 6 日	3.79	30,100.00	114,079.00
393	600663	陆家嘴	2022 年 7 月 6 日	10.36	11,000.00	113,960.00
394	600567	山鹰国际	2022 年 7 月 6 日	2.77	40,300.00	111,631.00
395	300115	长盈精密	2022 年 7 月 13 日	10.31	10,600.00	109,286.00
396	601969	海南矿业	2022 年 7 月 11 日	8.59	12,300.00	105,657.00
397	600823	世茂股份	2022 年 7 月 11 日	2.98	34,500.00	102,810.00
398	600350	山东高速	2022 年 7 月 6 日	5.25	19,100.00	100,275.00
399	000898	鞍钢股份	2022 年 7 月 6 日	3.22	29,900.00	96,278.00
400	300088	长信科技	2022 年 7 月 12 日	7.42	12,500.00	92,750.00
401	002152	广电运通	2022 年 7 月 14 日	9.27	10,000.00	92,700.00
402	601198	东兴证券	2022 年 7 月 14 日	8.90	10,000.00	89,000.00
403	601828	美凯龙	2022 年 7 月 6 日	6.06	14,400.00	87,264.00
404	600917	重庆燃气	2022 年 7 月 11 日	7.22	10,000.00	72,200.00
405	601003	柳钢股份	2022 年 7 月 11 日	4.05	15,700.00	63,585.00
406	000717	韶钢松山	2022 年 7 月 6 日	3.50	15,100.00	52,850.00
407	000031	大悦城	2022 年 7 月 14 日	4.00	10,000.00	40,000.00
合计	-	-	-	-	23,346,880.00	206,790,961.80

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	1,970,974.08
AAA 以下	193,936.55	968,852.00
未评级	-	-
合计	193,936.55	2,939,826.08

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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

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 2022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	65,062,878.51	-	-	-	65,062,878.51
结算备付金	13,654,682.78	-	-	-	13,654,682.78
存出保证金	9,715,109.25	-	-	-	9,715,109.25
交易性金融资产	193,936.55	-	-	2,745,433,667.85	2,745,627,604.40
应收清算款	-	-	-	2,181,872.38	2,181,872.38
应收股利	-	-	-	831,721.82	831,721.82
其他资产	-	-	-	148,805.08	148,805.08

资产总计	88,626,607.09	-	-	2,748,596,067.13	2,837,222,674.22
负债					
应付清算款	-	-	-	6,011,934.03	6,011,934.03
应付管理人报酬	-	-	-	1,161,426.15	1,161,426.15
应付托管费	-	-	-	232,285.23	232,285.23
应交税费	-	-	-	9,499.61	9,499.61
其他负债	-	-	-	2,509,891.63	2,509,891.63
负债总计	-	-	-	9,925,036.65	9,925,036.65
利率敏感度缺口	88,626,607.09	-	-	2,738,671,030.48	2,827,297,637.57
上年度末					
2021 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	28,793,490.70	-	-	-	28,793,490.70
结算备付金	20,376,362.24	-	-	-	20,376,362.24
存出保证金	3,285,776.61	-	-	-	3,285,776.61
交易性金融资产	2,939,826.08	-	-	3,073,988,591.31	3,076,928,417.39
应收证券清算款	-	-	-	6,839,320.13	6,839,320.13
应收利息	-	-	-	93,118.93	93,118.93
应收股利	-	-	-	700.00	700.00
资产总计	55,395,455.63	-	-	3,080,921,730.37	3,136,317,186.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,625,021.71	12,625,021.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,250,819.74	1,250,819.74
应付托管费	-	-	-	250,163.95	250,163.95
应付交易费用	-	-	-	1,141,176.25	1,141,176.25
应交税费	-	-	-	7,989.75	7,989.75
其他负债	-	-	-	2,035,198.79	2,035,198.79
负债总计	-	-	-	17,310,370.19	17,310,370.19
利率敏感度缺口	55,395,455.63	-	-	3,063,611,360.18	3,119,006,815.81

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

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	2,745,433,667.85	97.10	3,073,988,591.31	98.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	193,936.55	0.01	2,939,826.08	0.09
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	2,745,627,604.40	97.11	3,076,928,417.39	98.65

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	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
	上升 5%	139,294,890.70	145,047,401.77
	下降 5%	-139,294,890.70	-145,047,401.77

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	2,738,582,673.22
第二层次	5,638,527.17
第三层次	1,406,404.01
合计	2,745,627,604.40

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,745,433,667.85	96.76
	其中：普通股	2,738,821,991.35	96.53
	存托凭证	6,611,676.50	0.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,936.55	0.01
	其中：债券	193,936.55	0.01
	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	78,717,561.29	2.77
8	其他各项资产	12,877,508.53	0.45
9	合计	2,837,222,674.22	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 206,790,961.80 元，占基金资产净值比例 7.31%。

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	25,264,744.42	0.89
B	采矿业	122,125,311.16	4.32
C	制造业	1,630,154,290.23	57.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,878,243.35	3.00

E	建筑业	35,444,657.90	1.25
F	批发和零售业	105,916,956.89	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	73,335,172.26	2.59
H	住宿和餐饮业	5,808,110.40	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	203,694,801.71	7.20
J	金融业	243,441,369.08	8.61
K	房地产业	64,953,405.21	2.30
L	租赁和商务服务业	33,227,404.22	1.18
M	科学研究和技术服务业	34,182,105.56	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	20,051,469.58	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,402,121.54	0.23
R	文化、体育和娱乐业	36,352,399.43	1.29
S	综合	20,201,104.91	0.71
	合计	2,745,433,667.85	97.10

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

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	600522	中天科技	1,138,800	26,306,280.00	0.93
2	601615	明阳智能	696,300	23,534,940.00	0.83
3	600256	广汇能源	1,916,812	20,203,198.48	0.71
4	600096	云天化	531,500	16,731,620.00	0.59
5	300012	华测检测	696,300	16,161,123.00	0.57
6	002497	雅化集团	476,800	15,567,520.00	0.55
7	002407	多氟多	316,977	15,503,345.07	0.55
8	002240	盛新锂能	250,300	15,108,108.00	0.53
9	002180	纳思达	296,275	14,997,440.50	0.53

10	600157	永泰能源	9,265,400	14,731,986.00	0.52
11	000009	中国宝安	1,078,710	14,551,797.90	0.51
12	600885	宏发股份	344,755	14,427,996.75	0.51
13	300769	德方纳米	35,300	14,426,404.00	0.51
14	600141	兴发集团	324,169	14,260,194.31	0.50
15	300390	天华超净	151,900	13,276,060.00	0.47
16	600392	盛和资源	585,155	13,224,503.00	0.47
17	002384	东山精密	572,000	13,115,960.00	0.46
18	603613	国联股份	145,718	12,910,614.80	0.46
19	300073	当升科技	140,200	12,665,668.00	0.45
20	002756	永兴材料	82,677	12,584,266.17	0.45
21	600418	江淮汽车	725,325	12,446,577.00	0.44
22	300285	国瓷材料	335,094	12,036,576.48	0.43
23	600765	中航重机	368,637	11,862,738.66	0.42
24	600399	抚顺特钢	658,300	11,783,570.00	0.42
25	600233	圆通速递	573,300	11,689,587.00	0.41
26	601555	东吴证券	1,670,200	11,574,486.00	0.41
27	600563	法拉电子	56,118	11,513,168.88	0.41
28	000983	山西焦煤	856,682	11,470,971.98	0.41
29	601058	赛轮轮胎	1,017,500	11,467,225.00	0.41
30	600487	亨通光电	788,300	11,461,882.00	0.41
31	300037	新宙邦	217,418	11,427,490.08	0.40
32	600499	科达制造	547,300	11,296,272.00	0.40
33	600732	爱旭股份	339,466	11,209,167.32	0.40
34	603077	和邦生物	2,578,545	10,984,601.70	0.39
35	002385	大北农	1,385,648	10,821,910.88	0.38
36	688180	君实生物-U	143,461	10,808,351.74	0.38
37	603456	九洲药业	208,800	10,794,960.00	0.38
38	002268	卫士通	248,240	10,651,978.40	0.38
39	300363	博腾股份	136,500	10,645,635.00	0.38
40	688122	西部超导	115,088	10,611,113.60	0.38
41	601108	财通证券	1,348,100	10,609,547.00	0.38
42	600486	扬农化工	77,688	10,354,256.64	0.37
43	688099	晶晨股份	102,049	10,306,949.00	0.36
44	000519	中兵红箭	349,382	10,184,485.30	0.36
45	603345	安井食品	60,600	10,172,922.00	0.36
46	600298	安琪酵母	208,300	10,154,625.00	0.36
47	000630	铜陵有色	3,081,340	10,045,168.40	0.36
48	600862	中航高科	348,493	9,792,653.30	0.35
49	000988	华工科技	420,524	9,743,541.08	0.34
50	002353	杰瑞股份	240,714	9,700,774.20	0.34
51	603605	珀莱雅	58,515	9,665,507.70	0.34
52	300144	宋城演艺	625,200	9,596,820.00	0.34
53	601077	渝农商行	2,582,200	9,554,140.00	0.34

54	000783	长江证券	1,604,100	9,512,313.00	0.34
55	601168	西部矿业	795,318	9,408,611.94	0.33
56	002625	光启技术	534,600	9,232,542.00	0.33
57	601696	中银证券	690,400	9,182,320.00	0.32
58	300146	汤臣倍健	422,930	9,156,434.50	0.32
59	300724	捷佳伟创	102,400	9,149,440.00	0.32
60	601162	天风证券	2,873,600	9,138,048.00	0.32
61	002028	思源电气	255,072	9,095,867.52	0.32
62	002056	横店东磁	339,983	9,050,347.46	0.32
63	002797	第一创业	1,405,903	9,011,838.23	0.32
64	688777	中控技术	123,259	8,968,324.84	0.32
65	600988	赤峰黄金	555,000	8,852,250.00	0.31
66	002507	涪陵榨菜	256,423	8,851,721.96	0.31
67	000932	华菱钢铁	1,733,980	8,825,958.20	0.31
68	603589	口子窖	150,266	8,807,090.26	0.31
69	603517	绝味食品	152,313	8,806,737.66	0.31
70	002185	华天科技	938,373	8,801,938.74	0.31
71	601128	常熟银行	1,143,180	8,733,895.20	0.31
72	601636	旗滨集团	672,502	8,574,400.50	0.30
73	600521	华海药业	374,600	8,503,420.00	0.30
74	002603	以岭药业	349,372	8,489,739.60	0.30
75	600039	四川路桥	801,908	8,444,091.24	0.30
76	605117	德业股份	30,000	8,396,700.00	0.30
77	002326	永太科技	253,700	8,354,341.00	0.30
78	000830	鲁西化工	481,517	8,325,428.93	0.29
79	002078	太阳纸业	674,395	8,301,802.45	0.29
80	600109	国金证券	922,400	8,301,600.00	0.29
81	601607	上海医药	458,822	8,295,501.76	0.29
82	603026	石大胜华	56,100	8,154,135.00	0.29
83	600153	建发股份	620,739	8,113,058.73	0.29
84	688390	固德威	25,804	8,076,910.04	0.29
85	002624	完美世界	562,000	8,075,940.00	0.29
86	600546	山煤国际	413,000	8,036,980.00	0.28
87	603939	益丰药房	148,400	7,839,972.00	0.28
88	601872	招商轮船	1,352,700	7,791,552.00	0.28
89	603267	鸿远电子	58,000	7,791,140.00	0.28
90	600348	华阳股份	501,581	7,754,442.26	0.27
91	000738	航发控制	274,911	7,724,999.10	0.27
92	600705	中航产融	2,232,100	7,723,066.00	0.27
93	002422	科伦药业	412,791	7,719,191.70	0.27
94	600497	驰宏锌锗	1,486,300	7,713,897.00	0.27
95	600177	雅戈尔	1,158,709	7,682,240.67	0.27
96	600549	厦门钨业	354,999	7,675,078.38	0.27
97	300699	光威复材	129,959	7,650,686.33	0.27

98	000970	中科三环	406,537	7,634,764.86	0.27
99	300088	长信科技	1,027,102	7,621,096.84	0.27
100	600875	东方电气	463,136	7,618,587.20	0.27
101	601990	南京证券	912,900	7,613,586.00	0.27
102	603127	昭衍新药	66,900	7,613,220.00	0.27
103	000831	五矿稀土	243,300	7,603,125.00	0.27
104	000999	华润三九	165,513	7,448,085.00	0.26
105	600160	巨化股份	562,885	7,401,937.75	0.26
106	300676	华大基因	103,200	7,399,440.00	0.26
107	002138	顺络电子	269,623	7,347,226.75	0.26
108	000998	隆平高科	440,800	7,343,728.00	0.26
109	002572	索菲亚	266,973	7,341,757.50	0.26
110	002673	西部证券	1,121,400	7,333,956.00	0.26
111	601699	潞安环能	499,119	7,297,119.78	0.26
112	600859	王府井	280,486	7,287,026.28	0.26
113	600516	方大炭素	952,876	7,241,857.60	0.26
114	002557	洽洽食品	127,036	7,232,159.48	0.26
115	000807	云铝股份	725,392	7,166,872.96	0.25
116	002508	老板电器	198,300	7,144,749.00	0.25
117	000039	中集集团	513,847	7,116,780.95	0.25
118	603444	吉比特	18,335	7,113,980.00	0.25
119	600143	金发科技	745,239	7,094,675.28	0.25
120	600482	中国动力	451,000	7,085,210.00	0.25
121	002030	达安基因	410,666	7,059,348.54	0.25
122	000960	锡业股份	418,681	7,021,280.37	0.25
123	601997	贵阳银行	1,207,474	7,015,423.94	0.25
124	002465	海格通信	770,918	7,007,644.62	0.25
125	002273	水晶光电	577,141	6,989,177.51	0.25
126	000629	攀钢钒钛	1,799,293	6,837,313.40	0.24
127	300357	我武生物	131,308	6,831,955.24	0.24
128	300136	信维通信	404,400	6,814,140.00	0.24
129	000728	国元证券	1,095,400	6,813,388.00	0.24
130	300058	蓝色光标	1,041,541	6,801,262.73	0.24
131	000975	银泰黄金	696,589	6,784,776.86	0.24
132	600536	中国软件	165,563	6,720,202.17	0.24
133	600170	上海建工	2,216,554	6,716,158.62	0.24
134	600704	物产中大	1,300,584	6,671,995.92	0.24
135	002092	中泰化学	852,933	6,618,760.08	0.23
136	002409	雅克科技	119,200	6,616,792.00	0.23
137	689009	九号公司	148,577	6,611,676.50	0.23
138	601577	长沙银行	831,849	6,596,562.57	0.23
139	603198	迎驾贡酒	100,627	6,554,842.78	0.23
140	002294	信立泰	231,977	6,518,553.70	0.23
141	600739	辽宁成大	446,969	6,516,808.02	0.23

142	300474	景嘉微	94,819	6,484,671.41	0.23
143	600079	人福医药	404,100	6,465,600.00	0.23
144	002223	鱼跃医疗	251,208	6,445,997.28	0.23
145	000547	航天发展	536,240	6,402,705.60	0.23
146	300418	昆仑万维	400,148	6,402,368.00	0.23
147	002372	伟星新材	266,173	6,398,798.92	0.23
148	300244	迪安诊断	205,334	6,385,887.40	0.23
149	600415	小商品城	1,145,292	6,379,276.44	0.23
150	002506	协鑫集成	1,712,800	6,371,616.00	0.23
151	002739	万达电影	466,100	6,362,265.00	0.23
152	300253	卫宁健康	718,736	6,310,502.08	0.22
153	300558	贝达药业	103,581	6,297,724.80	0.22
154	000636	风华高科	335,021	6,295,044.59	0.22
155	600699	均胜电子	399,025	6,268,682.75	0.22
156	600372	中航电子	321,216	6,228,378.24	0.22
157	300308	中际旭创	200,501	6,225,556.05	0.22
158	300296	利亚德	850,840	6,211,132.00	0.22
159	600637	东方明珠	854,480	6,109,532.00	0.22
160	600867	通化东宝	586,984	6,069,414.56	0.21
161	600315	上海家化	141,787	6,061,394.25	0.21
162	002683	广东宏大	216,990	6,038,831.70	0.21
163	600985	淮北矿业	413,740	6,024,054.40	0.21
164	000887	中鼎股份	330,127	6,021,516.48	0.21
165	601016	节能风电	1,254,102	6,019,689.60	0.21
166	600236	桂冠电力	986,100	6,005,349.00	0.21
167	002156	通富微电	389,600	5,999,840.00	0.21
168	601198	东兴证券	673,800	5,996,820.00	0.21
169	002299	圣农发展	312,540	5,994,517.20	0.21
170	600026	中远海能	579,924	5,990,614.92	0.21
171	600171	上海贝岭	238,081	5,959,167.43	0.21
172	600879	航天电子	907,016	5,886,533.84	0.21
173	002065	东华软件	928,873	5,870,477.36	0.21
174	300832	新产业	130,060	5,867,006.60	0.21
175	600380	健康元	474,636	5,861,754.60	0.21
176	600642	申能股份	1,024,809	5,820,915.12	0.21
177	600258	首旅酒店	234,198	5,808,110.40	0.21
178	300026	红日药业	753,505	5,801,988.50	0.21
179	000750	国海证券	1,594,364	5,787,541.32	0.20
180	002936	郑州银行	2,151,146	5,786,582.74	0.20
181	000623	吉林敖东	389,645	5,751,160.20	0.20
182	688185	康希诺	28,839	5,741,268.12	0.20
183	002408	齐翔腾达	705,992	5,725,595.12	0.20
184	002203	海亮股份	493,485	5,699,751.75	0.20
185	000729	燕京啤酒	589,718	5,696,675.88	0.20

186	000513	丽珠集团	157,126	5,689,532.46	0.20
187	600673	东阳光	628,399	5,649,307.01	0.20
188	601717	郑煤机	389,787	5,616,830.67	0.20
189	000400	许继电气	292,224	5,610,700.80	0.20
190	000878	云南铜业	492,408	5,608,527.12	0.20
191	600820	隧道股份	908,274	5,558,636.88	0.20
192	600038	中直股份	122,660	5,544,232.00	0.20
193	600580	卧龙电驱	384,428	5,543,451.76	0.20
194	600529	山东药玻	198,297	5,542,401.15	0.20
195	600801	华新水泥	284,041	5,541,639.91	0.20
196	002439	启明星辰	277,181	5,524,217.33	0.20
197	600369	西南证券	1,385,147	5,499,033.59	0.19
198	300383	光环新网	526,652	5,487,713.84	0.19
199	300017	网宿科技	1,023,800	5,487,568.00	0.19
200	002131	利欧股份	2,824,822	5,480,154.68	0.19
201	603568	伟明环保	163,456	5,454,526.72	0.19
202	600166	福田汽车	1,919,642	5,432,586.86	0.19
203	002183	怡亚通	752,125	5,422,821.25	0.19
204	600316	洪都航空	178,948	5,411,387.52	0.19
205	002444	巨星科技	287,019	5,407,437.96	0.19
206	002195	二三四五	2,393,954	5,386,396.50	0.19
207	002958	青农商行	1,617,037	5,368,562.84	0.19
208	600848	上海临港	394,800	5,353,488.00	0.19
209	688256	寒武纪-U	82,670	5,348,749.00	0.19
210	600325	华发股份	706,342	5,347,008.94	0.19
211	600909	华安证券	1,175,009	5,346,290.95	0.19
212	600027	华电国际	1,360,267	5,345,849.31	0.19
213	601005	重庆钢铁	2,796,018	5,340,394.38	0.19
214	600008	首创环保	1,836,778	5,326,656.20	0.19
215	002670	国盛金控	549,011	5,270,505.60	0.19
216	300618	寒锐钴业	90,955	5,268,113.60	0.19
217	300024	机器人	518,987	5,231,388.96	0.19
218	300001	特锐德	301,764	5,223,534.84	0.18
219	000825	太钢不锈	953,285	5,195,403.25	0.18
220	002500	山西证券	900,483	5,168,772.42	0.18
221	002926	华西证券	658,983	5,166,426.72	0.18
222	002430	杭氧股份	164,900	5,154,774.00	0.18
223	002373	千方科技	462,717	5,145,413.04	0.18
224	000050	深天马 A	514,161	5,126,185.17	0.18
225	603218	日月股份	201,600	5,120,640.00	0.18
226	000027	深圳能源	796,044	5,102,642.04	0.18
227	000739	普洛药业	246,923	5,096,490.72	0.18
228	688521	芯原股份-U	102,611	5,068,983.40	0.18
229	600271	航天信息	463,159	5,066,959.46	0.18

230	002250	联化科技	309,275	5,062,831.75	0.18
231	002212	天融信	495,799	5,032,359.85	0.18
232	600863	内蒙华电	1,361,252	4,968,569.80	0.18
233	600118	中国卫星	247,100	4,961,768.00	0.18
234	601866	中远海发	1,653,632	4,960,896.00	0.18
235	600208	新湖中宝	1,793,515	4,950,101.40	0.18
236	603233	大参林	156,900	4,910,970.00	0.17
237	002985	北摩高科	83,427	4,887,153.66	0.17
238	000060	中金岭南	1,094,532	4,881,612.72	0.17
239	002249	大洋电机	791,568	4,860,227.52	0.17
240	300009	安科生物	479,510	4,847,846.10	0.17
241	300677	英科医疗	190,760	4,837,673.60	0.17
242	688009	中国通号	1,067,668	4,836,536.04	0.17
243	000778	新兴铸管	1,001,314	4,826,333.48	0.17
244	601992	金隅集团	1,739,069	4,817,221.13	0.17
245	002152	广电运通	519,570	4,816,413.90	0.17
246	603156	养元饮品	211,130	4,796,873.60	0.17
247	600066	宇通客车	553,828	4,790,612.20	0.17
248	603658	安图生物	97,180	4,751,130.20	0.17
249	300182	捷成股份	861,636	4,738,998.00	0.17
250	300070	碧水源	909,253	4,737,208.13	0.17
251	603858	步长制药	238,454	4,699,928.34	0.17
252	300168	万达信息	496,665	4,688,517.60	0.17
253	000401	冀东水泥	444,964	4,681,021.28	0.17
254	002966	苏州银行	766,628	4,676,430.80	0.17
255	002191	劲嘉股份	434,003	4,652,512.16	0.16
256	600998	九州通	390,264	4,648,044.24	0.16
257	300251	光线传媒	490,679	4,646,730.13	0.16
258	002831	裕同科技	155,892	4,606,608.60	0.16
259	002128	电投能源	321,059	4,597,564.88	0.16
260	600390	五矿资本	938,263	4,588,106.07	0.16
261	600056	中国医药	309,477	4,586,449.14	0.16
262	600970	中材国际	472,155	4,575,181.95	0.16
263	000997	新大陆	345,198	4,560,065.58	0.16
264	000021	深科技	391,540	4,557,525.60	0.16
265	600667	太极实业	614,583	4,535,622.54	0.16
266	002505	鹏都农牧	1,332,760	4,518,056.40	0.16
267	300482	万孚生物	110,976	4,517,832.96	0.16
268	002244	滨江集团	520,870	4,505,525.50	0.16
269	002221	东华能源	482,596	4,492,968.76	0.16
270	600062	华润双鹤	174,595	4,480,107.70	0.16
271	600528	中铁工业	555,715	4,473,505.75	0.16
272	600021	上海电力	434,579	4,454,434.75	0.16
273	603885	吉祥航空	246,538	4,435,218.62	0.16

274	600839	四川长虹	1,539,878	4,434,848.64	0.16
275	000987	越秀金控	629,435	4,424,928.05	0.16
276	000656	金科股份	1,547,100	4,424,706.00	0.16
277	688002	睿创微纳	111,291	4,420,478.52	0.16
278	600827	百联股份	334,296	4,416,050.16	0.16
279	002396	星网锐捷	194,996	4,414,709.44	0.16
280	600297	广汇汽车	1,691,177	4,413,971.97	0.16
281	603707	健友股份	155,860	4,395,252.00	0.16
282	002127	南极电商	821,028	4,384,289.52	0.16
283	600598	北大荒	296,778	4,380,443.28	0.15
284	002019	亿帆医药	310,003	4,333,841.94	0.15
285	600155	华创阳安	508,012	4,307,941.76	0.15
286	600498	烽火通信	297,448	4,307,047.04	0.15
287	002266	浙富控股	898,019	4,301,511.01	0.15
288	600201	生物股份	469,275	4,298,559.00	0.15
289	002155	湖南黄金	351,930	4,272,430.20	0.15
290	000012	南玻 A	574,269	4,261,075.98	0.15
291	600409	三友化工	516,915	4,233,533.85	0.15
292	600259	广晟有色	83,490	4,228,768.50	0.15
293	000930	中粮科技	467,689	4,227,908.56	0.15
294	600511	国药股份	157,613	4,220,876.14	0.15
295	000883	湖北能源	823,972	4,210,496.92	0.15
296	002153	石基信息	263,140	4,176,031.80	0.15
297	600718	东软集团	362,802	4,175,851.02	0.15
298	002124	天邦食品	615,082	4,133,351.04	0.15
299	600755	厦门国贸	550,541	4,129,057.50	0.15
300	002511	中顺洁柔	329,131	4,120,720.12	0.15
301	000686	东北证券	587,552	4,106,988.48	0.15
302	600060	海信视像	327,026	4,087,825.00	0.14
303	603712	七一二	128,673	4,053,199.50	0.14
304	600282	南钢股份	1,285,133	4,048,168.95	0.14
305	000581	威孚高科	209,879	4,040,170.75	0.14
306	600959	江苏有线	1,238,971	4,039,045.46	0.14
307	600566	济川药业	148,316	4,028,262.56	0.14
308	600782	新钢股份	798,200	4,022,928.00	0.14
309	688188	柏楚电子	18,276	4,021,451.04	0.14
310	600895	张江高科	322,500	4,015,125.00	0.14
311	000709	河钢股份	1,776,431	4,014,734.06	0.14
312	601880	辽港股份	2,355,906	4,005,040.20	0.14
313	601179	中国西电	855,234	4,002,495.12	0.14
314	000690	宝新能源	909,842	3,985,107.96	0.14
315	600022	山东钢铁	2,282,789	3,972,052.86	0.14
316	600064	南京高科	360,941	3,970,351.00	0.14
317	002939	长城证券	389,800	3,960,368.00	0.14

318	600535	天士力	375,620	3,947,766.20	0.14
319	300376	易事特	483,624	3,927,026.88	0.14
320	002701	奥瑞金	753,020	3,915,704.00	0.14
321	002002	鸿达兴业	1,044,312	3,874,397.52	0.14
322	601778	晶科科技	716,900	3,871,260.00	0.14
323	600216	浙江医药	281,811	3,846,720.15	0.14
324	600500	中化国际	576,794	3,835,680.10	0.14
325	300630	普利制药	108,898	3,827,764.70	0.14
326	000598	兴蓉环境	748,916	3,826,960.76	0.14
327	600808	马钢股份	1,008,359	3,821,680.61	0.14
328	002532	天山铝业	583,900	3,812,867.00	0.13
329	600037	歌华有线	406,011	3,812,443.29	0.13
330	600663	陆家嘴	367,233	3,804,533.88	0.13
331	600728	佳都科技	586,914	3,791,464.44	0.13
332	002468	申通快递	316,647	3,774,432.24	0.13
333	002595	豪迈科技	167,637	3,745,010.58	0.13
334	600567	山鹰国际	1,347,643	3,732,971.11	0.13
335	600517	国网英大	715,600	3,713,964.00	0.13
336	688208	道通科技	112,388	3,699,812.96	0.13
337	002004	华邦健康	662,734	3,698,055.72	0.13
338	603225	新凤鸣	319,402	3,685,899.08	0.13
339	603866	桃李面包	222,595	3,683,947.25	0.13
340	601456	国联证券	299,185	3,670,999.95	0.13
341	300463	迈克生物	178,886	3,665,374.14	0.13
342	002745	木林森	372,691	3,641,191.07	0.13
343	600597	光明乳业	287,600	3,632,388.00	0.13
344	300115	长盈精密	351,609	3,625,088.79	0.13
345	000785	居然之家	810,300	3,605,835.00	0.13
346	688006	杭可科技	51,423	3,602,695.38	0.13
347	002429	兆驰股份	937,111	3,598,506.24	0.13
348	688289	圣湘生物	121,144	3,587,073.84	0.13
349	601958	金钼股份	403,389	3,565,958.76	0.13
350	300166	东方国信	381,961	3,521,680.42	0.12
351	002390	信邦制药	508,853	3,516,174.23	0.12
352	601106	中国一重	1,144,209	3,512,721.63	0.12
353	300888	稳健医疗	52,700	3,504,550.00	0.12
354	601860	紫金银行	1,215,086	3,487,296.82	0.12
355	603927	中科软	148,734	3,468,476.88	0.12
356	600572	康恩贝	778,734	3,449,791.62	0.12
357	300072	海新能科	680,449	3,443,071.94	0.12
358	601118	海南橡胶	713,955	3,412,704.90	0.12
359	601718	际华集团	1,099,026	3,406,980.60	0.12
360	600398	海澜之家	716,946	3,405,493.50	0.12
361	600507	方大特钢	486,154	3,398,216.46	0.12

362	000540	中天金融	1,757,642	3,392,249.06	0.12
363	600737	中粮糖业	446,403	3,356,950.56	0.12
364	000089	深圳机场	428,948	3,311,478.56	0.12
365	000937	冀中能源	443,569	3,309,024.74	0.12
366	603883	老百姓	97,470	3,302,283.60	0.12
367	600582	天地科技	690,118	3,298,764.04	0.12
368	000559	万向钱潮	552,520	3,281,968.80	0.12
369	002048	宁波华翔	204,184	3,271,027.68	0.12
370	002368	太极股份	170,105	3,267,717.05	0.12
371	600967	内蒙一机	355,418	3,241,412.16	0.11
372	000898	鞍钢股份	1,002,789	3,228,980.58	0.11
373	600435	北方导航	373,027	3,215,492.74	0.11
374	002690	美亚光电	147,582	3,199,577.76	0.11
375	601000	唐山港	1,236,179	3,189,341.82	0.11
376	001914	招商积余	177,174	3,183,816.78	0.11
377	600871	石化油服	1,684,200	3,183,138.00	0.11
378	002110	三钢闽光	512,841	3,123,201.69	0.11
379	601568	北元集团	491,769	3,117,815.46	0.11
380	600195	中牧股份	253,769	3,111,207.94	0.11
381	002281	光迅科技	175,933	3,092,902.14	0.11
382	600556	天下秀	375,804	3,092,866.92	0.11
383	002233	塔牌集团	349,031	3,088,924.35	0.11
384	601333	广深铁路	1,414,364	3,083,313.52	0.11
385	000959	首钢股份	647,524	3,082,214.24	0.11
386	000156	华数传媒	385,605	3,073,271.85	0.11
387	002705	新宝股份	138,333	3,041,942.67	0.11
388	000537	广宇发展	233,965	3,039,205.35	0.11
389	600811	东方集团	1,068,302	3,023,294.66	0.11
390	002010	传化智联	468,490	3,012,390.70	0.11
391	688321	微芯生物	119,561	3,011,741.59	0.11
392	002174	游族网络	306,793	2,997,367.61	0.11
393	003035	南网能源	470,060	2,984,881.00	0.11
394	600764	中国海防	118,200	2,983,368.00	0.11
395	000402	金融街	500,089	2,975,529.55	0.11
396	600329	达仁堂	119,246	2,931,066.68	0.10
397	300212	易华录	167,460	2,913,804.00	0.10
398	600120	浙江东方	725,045	2,907,430.45	0.10
399	002416	爱施德	311,368	2,895,722.40	0.10
400	000488	晨鸣纸业	512,366	2,889,744.24	0.10
401	600126	杭钢股份	563,322	2,884,208.64	0.10
402	603638	艾迪精密	140,425	2,878,712.50	0.10
403	000990	诚志股份	261,820	2,866,929.00	0.10
404	600167	联美控股	382,197	2,862,655.53	0.10
405	601200	上海环境	280,734	2,852,257.44	0.10

406	600446	金证股份	274,609	2,850,441.42	0.10
407	000685	中山公用	370,406	2,844,718.08	0.10
408	002867	周大生	183,054	2,842,828.62	0.10
409	002081	金螳螂	558,543	2,837,398.44	0.10
410	601098	中南传媒	299,926	2,831,301.44	0.10
411	600373	中文传媒	282,599	2,823,164.01	0.10
412	002382	蓝帆医疗	295,026	2,817,498.30	0.10
413	002925	盈趣科技	130,911	2,817,204.72	0.10
414	000158	常山北明	467,686	2,806,116.00	0.10
415	600707	彩虹股份	599,149	2,804,017.32	0.10
416	601611	中国核建	331,057	2,777,568.23	0.10
417	688029	南微医学	31,720	2,765,984.00	0.10
418	001965	招商公路	361,900	2,761,297.00	0.10
419	002399	海普瑞	156,740	2,755,489.20	0.10
420	002146	荣盛发展	909,132	2,754,669.96	0.10
421	601608	中信重工	724,126	2,744,437.54	0.10
422	600095	湘财股份	355,206	2,731,534.14	0.10
423	603317	天味食品	95,708	2,724,806.76	0.10
424	002387	维信诺	400,231	2,689,552.32	0.10
425	600131	国网信通	199,249	2,679,899.05	0.09
426	000967	盈峰环境	526,476	2,663,968.56	0.09
427	000528	柳工	408,621	2,660,122.71	0.09
428	002948	青岛银行	732,748	2,652,547.76	0.09
429	600376	首开股份	537,495	2,639,100.45	0.09
430	688088	虹软科技	82,778	2,614,957.02	0.09
431	601187	厦门银行	435,901	2,597,969.96	0.09
432	600623	华谊集团	312,206	2,591,309.80	0.09
433	603000	人民网	230,869	2,585,732.80	0.09
434	000563	陕国投 A	828,699	2,585,540.88	0.09
435	002423	中粮资本	381,860	2,562,280.60	0.09
436	600901	江苏租赁	498,285	2,556,202.05	0.09
437	601598	中国外运	657,923	2,552,741.24	0.09
438	600307	酒钢宏兴	1,306,549	2,534,705.06	0.09
439	600006	东风汽车	333,388	2,517,079.40	0.09
440	601991	大唐发电	1,033,552	2,511,531.36	0.09
441	300257	开山股份	166,536	2,491,378.56	0.09
442	603228	景旺电子	106,097	2,475,243.01	0.09
443	000961	中南建设	800,448	2,441,366.40	0.09
444	603650	彤程新材	74,826	2,437,831.08	0.09
445	600906	财达证券	270,500	2,431,795.00	0.09
446	600717	天津港	604,052	2,422,248.52	0.09
447	002242	九阳股份	128,211	2,353,953.96	0.08
448	002434	万里扬	274,412	2,346,222.60	0.08
449	000718	苏宁环球	634,508	2,334,989.44	0.08

450	601928	凤凰传媒	318,860	2,279,849.00	0.08
451	000671	阳光城	1,038,600	2,274,534.00	0.08
452	000415	渤海租赁	1,034,440	2,244,734.80	0.08
453	000553	安道麦 A	181,796	2,201,549.56	0.08
454	600968	海油发展	847,805	2,187,336.90	0.08
455	601969	海南矿业	251,616	2,161,381.44	0.08
456	000031	大悦城	537,427	2,149,708.00	0.08
457	600648	外高桥	156,215	2,124,524.00	0.08
458	600787	中储股份	365,565	2,080,064.85	0.07
459	600928	西安银行	555,957	2,040,362.19	0.07
460	600339	中油工程	698,406	2,018,393.34	0.07
461	002563	森马服饰	337,855	2,000,101.60	0.07
462	601228	广州港	516,955	1,897,224.85	0.07
463	002815	崇达技术	146,575	1,877,625.75	0.07
464	300869	康泰医学	66,400	1,876,464.00	0.07
465	000028	国药一致	62,383	1,858,389.57	0.07
466	600835	上海机电	134,506	1,846,767.38	0.07
467	688819	天能股份	52,477	1,814,654.66	0.06
468	600377	宁沪高速	206,809	1,772,353.13	0.06
469	000717	韶钢松山	506,048	1,771,168.00	0.06
470	603056	德邦股份	128,304	1,723,122.72	0.06
471	002945	华林证券	112,000	1,708,000.00	0.06
472	603379	三美股份	76,538	1,702,970.50	0.06
473	000869	张裕 A	56,678	1,685,603.72	0.06
474	601139	深圳燃气	240,378	1,668,223.32	0.06
475	000062	深圳华强	131,089	1,664,830.30	0.06
476	600299	安迪苏	168,263	1,611,959.54	0.06
477	601298	青岛港	292,551	1,600,253.97	0.06
478	601869	长飞光纤	50,410	1,558,677.20	0.06
479	603868	飞科电器	19,846	1,503,334.50	0.05
480	001872	招商港口	95,091	1,483,419.60	0.05
481	601156	东航物流	72,900	1,443,420.00	0.05
482	002653	海思科	88,998	1,433,757.78	0.05
483	300741	华宝股份	50,990	1,418,541.80	0.05
484	600823	世茂股份	468,925	1,397,396.50	0.05
485	600350	山东高速	260,486	1,367,551.50	0.05
486	601828	美凯龙	223,900	1,356,834.00	0.05
487	600927	永安期货	66,000	1,331,220.00	0.05
488	001227	兰州银行	260,700	1,282,644.00	0.05
489	603355	莱克电气	47,325	1,194,009.75	0.04
490	603786	科博达	18,304	1,126,977.28	0.04
491	603515	欧普照明	62,851	1,096,749.95	0.04
492	001203	大中矿业	93,200	1,053,160.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	207,400	1,012,112.00	0.04

494	603719	良品铺子	34,000	973,420.00	0.03
495	002946	新乳业	72,636	943,541.64	0.03
496	601003	柳钢股份	213,836	866,035.80	0.03
497	688048	长光华芯	6,790	760,276.30	0.03
498	002901	大博医疗	19,044	745,382.16	0.03
499	600956	新天绿能	58,605	722,013.60	0.03
500	603983	丸美股份	21,788	583,918.40	0.02
501	600917	重庆燃气	72,200	521,284.00	0.02
502	002085	万丰奥威	60,000	322,200.00	0.01
503	601966	玲珑轮胎	6,745	171,120.65	0.01
504	301139	元道通信	2,825	108,649.50	0.00
505	600903	贵州燃气	10,000	77,900.00	0.00
506	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
507	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
508	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
509	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
510	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
511	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
512	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
513	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
514	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
515	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
516	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
517	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
518	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
519	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
520	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
521	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
522	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
523	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
524	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
525	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
526	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
527	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
528	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
529	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
530	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
531	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
532	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
533	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
534	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
535	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
536	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
537	301199	迈赫股份	2	64.08	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	600096	云天化	17,719,108.47	0.57
2	300012	华测检测	16,386,656.00	0.53
3	002497	雅化集团	16,073,437.00	0.52
4	002240	盛新锂能	15,734,810.00	0.50
5	300769	德方纳米	14,693,097.80	0.47
6	002407	多氟多	13,361,506.94	0.43
7	688180	君实生物-U	12,540,730.04	0.40
8	300073	当升科技	12,171,033.73	0.39
9	300390	天华超净	12,060,264.00	0.39
10	002756	永兴材料	11,806,303.70	0.38
11	601058	赛轮轮胎	11,776,111.00	0.38
12	688122	西部超导	11,075,066.12	0.36
13	601108	财通证券	10,789,343.00	0.35
14	688777	中控技术	10,355,464.89	0.33
15	000783	长江证券	9,852,636.00	0.32
16	600499	科达制造	9,671,678.00	0.31
17	601696	中银证券	9,642,643.73	0.31
18	601162	天风证券	9,603,303.00	0.31
19	002625	光启技术	9,020,004.00	0.29
20	603345	安井食品	8,877,853.00	0.28

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	000733	振华科技	26,111,045.00	0.84
2	002340	格林美	25,676,755.69	0.82
3	000723	美锦能源	19,603,805.00	0.63

4	600188	兖矿能源	17,342,901.02	0.56
5	300763	锦浪科技	17,175,767.30	0.55
6	300751	迈为股份	16,894,638.80	0.54
7	002013	中航机电	14,482,315.31	0.46
8	688005	容百科技	14,235,457.41	0.46
9	601117	中国化学	13,917,213.15	0.45
10	600884	杉杉股份	13,112,192.92	0.42
11	601689	拓普集团	12,581,323.78	0.40
12	605358	立昂微	11,257,178.80	0.36
13	600754	锦江酒店	10,654,214.76	0.34
14	300223	北京君正	10,478,490.70	0.34
15	002080	中材科技	9,980,267.61	0.32
16	600733	北汽蓝谷	8,147,739.65	0.26
17	688536	思瑞浦	7,640,560.56	0.24
18	000009	中国宝安	7,483,054.00	0.24
19	603290	斯达半导	7,466,738.00	0.24
20	600803	新奥股份	7,067,851.00	0.23

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,043,265,126.92
卖出股票收入（成交）总额	1,014,424,714.87

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	-	-
	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）	193,936.55	0.01
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	193,936.55	0.01

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	127064	杭氧转债	1,939	193,936.55	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 基金，主要投资标的指数的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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	9,715,109.25
2	应收清算款	2,181,872.38
3	应收股利	831,721.82
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	148,805.08
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,877,508.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601615	明阳智能	3,380,000.00	0.12	转融通流通受限
2	600096	云天化	2,401,924.00	0.08	转融通流通受限
3	600522	中天科技	2,113,650.00	0.07	转融通流通受限
4	600256	广汇能源	1,801,286.00	0.06	转融通流通受限
5	600157	永泰能源	1,709,886.00	0.06	转融通流通受限
6	002497	雅化集团	1,443,130.00	0.05	转融通流通受限
7	300012	华测检测	1,190,673.00	0.04	转融通流通受限
8	002180	纳思达	1,093,392.00	0.04	转融通流通受限

9	002240	盛新锂能	802,788.00	0.03	转融通流通受限
---	--------	------	------------	------	---------

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金(LOF)	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
18,212	80,004.30	1,319,181,985.00	90.54%	137,856,334.00	9.46%	1,254,187,721.00	86.08%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券-浦发银行-中信证券星辰 54 号集合资产管理计划	21,190,900.00	1.45%
2	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	16,685,800.00	1.15%
3	广发证券股份有限公司	6,550,721.00	0.45%
4	招商证券股份有限公司	3,480,700.00	0.24%
5	交银理财有限责任公司-交银理财稳享悦添利私银尊享(260天持有期)理财产品	3,465,300.00	0.24%
6	方正证券股份有限公司	3,134,369.00	0.22%

7	华泰证券股份有限公司	2,118,474.00	0.15%
8	孙建刚	2,000,000.00	0.14%
9	中信证券股份有限公司融 券专用证券账户	1,800,900.00	0.12%
10	马丽静	1,600,700.00	0.11%
11	广发中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金(LOF)	1,254,187,721.00	86.08%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业 人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 4 月 11 日）基金份额总额	425,038,319.00
本报告期期初基金份额总额	1,421,038,319.00
本报告期基金总申购份额	610,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	574,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,457,038,319.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
万联证券	4	1,088,835,157.37	53.32%	251,860.86	22.11%	-
粤开证券	2	499,303,277.44	24.45%	465,164.45	40.83%	-
中泰证券	5	453,495,358.12	22.21%	422,342.29	37.07%	-
广发证券	8	604,815.60	0.03%	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
北京高华	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	减少 2 个
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-

上海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	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	
	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
万联证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	3,410,635.40	43.56%	-	-	-	-
中泰证券	2,303,895.88	29.42%	-	-	-	-
广发证券	2,116,100.00	27.02%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-21
2	关于增加开源证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-02-15
3	关于增加华安证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-22
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-30
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-21
6	关于增加平安证券为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-06-09
7	关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-06-17

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份 额	申 购 份 额	赎 回 份 额	持有份额	份额占比
广发中 证 500 交易型 开放式 指数证 券投资 基金联 接基金 (LOF)	1	20220101-202206 30	1,183,7 11,221. 00	711,143, 500.00	640,66 7,000.0 0	1,254,187,72 1.00	86.08%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海证券交易所《关于上海证券交易所 ETF 申赎业务多码合一及迁移上线切换有关事项的通知》，自 2022 年 6 月 20 日起，本基金取消申赎业务相关代码，投资者可通过本基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与 ETF 申赎业务。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日