

# 广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

## 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

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
<b>7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69

<b>8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	70
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	70
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	71
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	71
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	72
10.1	基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4	基金投资策略的改变.....	72
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8	其他重大事件.....	76
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	77
11.1	备查文件目录.....	77
11.2	存放地点.....	77
11.3	查阅方式.....	77

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金	
基金简称	广发中证 1000 指数	
基金主代码	006486	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 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	113,066,213.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
下属分级基金的交易代码	006486	006487
报告期末下属分级基金的份额总额	49,086,044.05 份	63,980,169.12 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，有效跟踪中证 1000 指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p> <p>本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。</p> <p>对无法严格按照标的指数进行复制的情况，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，优化确定投资组合中的个股权重，以获得更接近标的指数的收益率。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	广发基金管理有限公司		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	证券时报
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	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广 场南塔 31-33 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
本期已实现收益	-2,835,267.49	-2,068,020.08
本期利润	-12,761,188.93	-7,750,141.95
加权平均基金份额本期利润	-0.2299	-0.1781
本期加权平均净值利润率	-15.61%	-12.08%

本期基金份额净值增长率	-11.57%	-11.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
期末可供分配利润	13,323,294.14	16,394,337.38
期末可供分配基金份额利润	0.2714	0.2562
期末基金资产净值	74,217,410.17	95,764,448.55
期末基金份额净值	1.5120	1.4968
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
基金份额累计净值增长率	51.20%	49.68%

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

广发中证 1000 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.00%	1.17%	9.59%	1.24%	-0.59%	-0.07%
过去三个月	3.74%	1.89%	3.20%	1.95%	0.54%	-0.06%
过去六个月	-11.57%	1.74%	-11.98%	1.78%	0.41%	-0.04%
过去一年	-0.10%	1.47%	-1.02%	1.51%	0.92%	-0.04%
过去三年	34.96%	1.41%	30.26%	1.44%	4.70%	-0.03%
自基金合同生效起至今	51.20%	1.43%	55.30%	1.49%	-4.10%	-0.06%

广发中证 1000 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.97%	1.17%	9.59%	1.24%	-0.62%	-0.07%
过去三个月	3.64%	1.89%	3.20%	1.95%	0.44%	-0.06%
过去六个月	-11.74%	1.74%	-11.98%	1.78%	0.24%	-0.04%
过去一年	-0.50%	1.47%	-1.02%	1.51%	0.52%	-0.04%

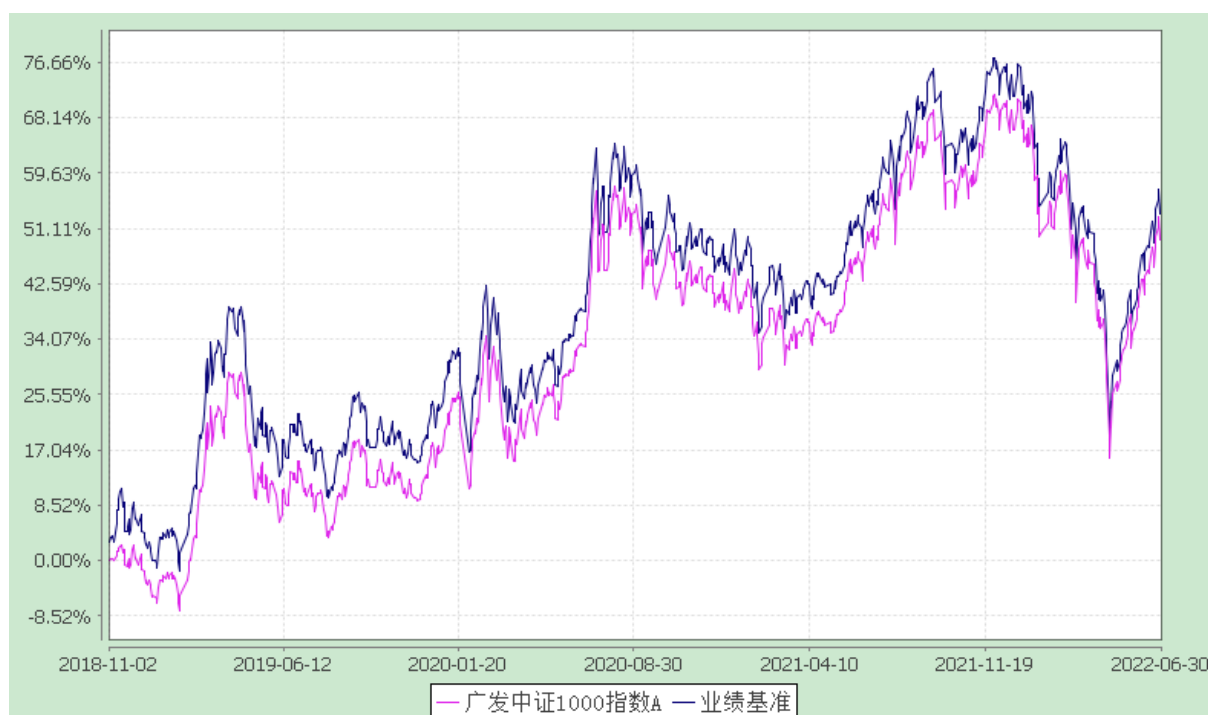
过去三年	33.45%	1.41%	30.26%	1.44%	3.19%	-0.03%
自基金合同生效起至今	49.68%	1.43%	55.30%	1.49%	-5.62%	-0.06%

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

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

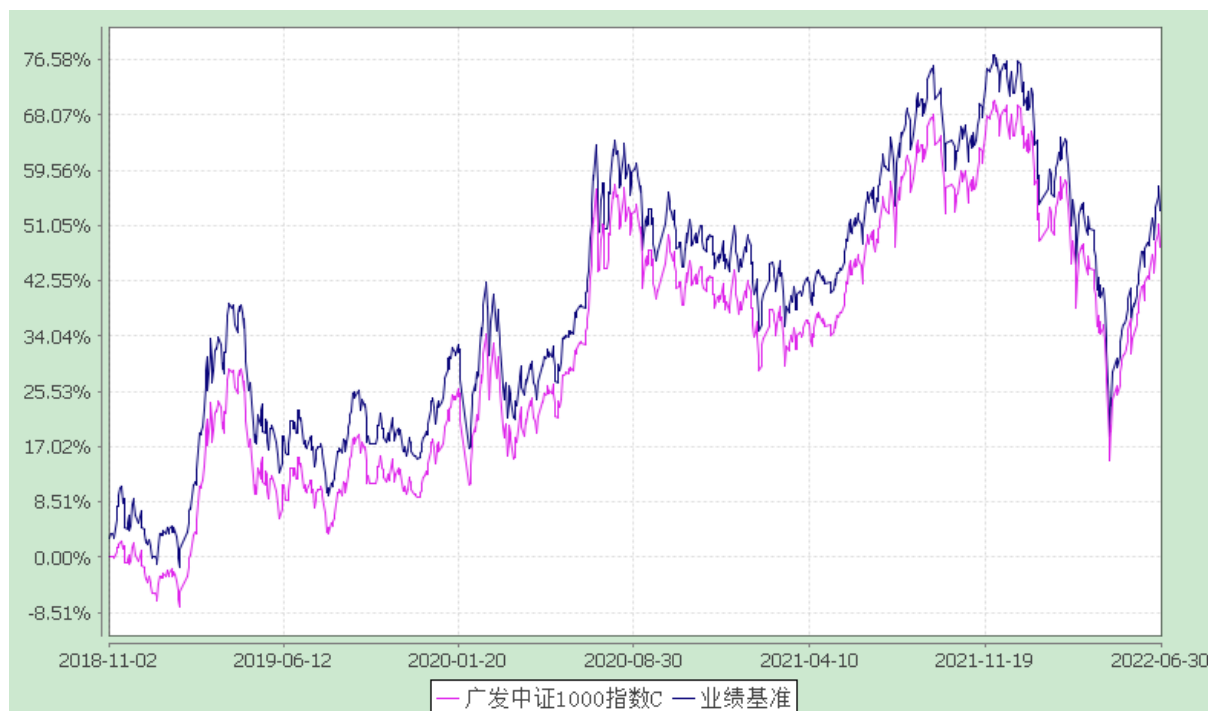
广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2018 年 11 月 2 日至 2022 年 6 月 30 日)

广发中证 1000 指数 A



广发中证 1000 指数 C





## 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		
陆志明	本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发中证	2021-06-17	-	23 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基

	<p>全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 50 成份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；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>			<p>基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、量化投资部副总经理、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 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 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 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源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 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指原材料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 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费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 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)、广发中证全指工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 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至</p>
--	---	--	--	--

				<p>2021 年 2 月 10 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术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 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费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 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生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 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产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 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年</p>
--	--	--	--	---

					5 月 10 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

2022 年上半年，在宏观经济和国际形势等因素的影响下，整体市场受到冲击，呈现出先抑后扬的特点。虽然在疫情好转以及宏观政策利好刺激下，市场出现反弹，但反弹未能填平前期下跌的幅度，整个上半年市场出现普遍下跌。中证全指全收益指数下跌 10.4%。从规模指数表现来看，大市值指数略强于小市值指数；从风格指数表现来看，价值风格表现好于成长风格。

本基金跟踪的标的是中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。本基金按照根据指数结构复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

上半年，中证 1000 指数作为小市值股票的代表指数，下跌幅度较大，后期反弹较弱，截止报告期末下跌 12.67%，跌幅略大于市场平均水平。上半年中证 1000 指数样本股票日均换手率高于市场平均水平，表明上半年作为小市值股票代表指数的中证 1000 的投资者关注度较高。

在基金投资运作方面，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，本基金在报告期内交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-11.57%，C 类基金份额净值增长率为-11.74%，同期业绩比较基准收益率为-11.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来半年，随着疫情逐步得到控制，复工复产的逐步深入和国际通胀得到控制，市场流动性或将保持充裕，企业利润或将逐步得到改善。作为流动性好，活跃度高的指数组合，中证 1000 指数仍然具有长期的成长性，随着未来中证 1000 指数期货等衍生工具的推出，该品种的活跃度或将进一步提升。

#### 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 1000 指数型发起式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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发中证 1000 指数型发起式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 1000 指数型发起式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 1000 指数型发起式证券投资基金 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 1000 指数型发起式证券投资基金

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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,438,542.89	11,749,885.62
结算备付金		8,073.19	-
存出保证金		32,675.32	44,882.20
交易性金融资产	6.4.7.2	158,351,831.97	174,236,955.15
其中：股票投资		158,351,831.97	174,236,955.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		643,606.64	1,017,196.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	1,305.76
资产总计		172,474,730.01	187,050,224.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		2,187,905.79	930,259.39
应付管理人报酬		59,782.36	73,887.67
应付托管费		11,956.45	14,777.54
应付销售服务费		23,903.32	30,384.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	209,323.37	361,238.63
负债合计		2,492,871.29	1,410,547.33
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	113,066,213.17	108,992,287.94
未分配利润	6.4.7.9	56,915,645.55	76,647,389.68
净资产合计		169,981,858.72	185,639,677.62
负债和净资产总计		172,474,730.01	187,050,224.95

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，广发中证 1000 指数 A 基金份额净值人民币 1.5120 元，基金份额总额 49,086,044.05 份；广发中证 1000 指数 C 基金份额净值人民币 1.4968 元，基金份额总额 63,980,169.12 份；总份额总额 113,066,213.17 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 1000 指数型发起式证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-19,852,425.35	6,549,617.11
1.利息收入		19,987.40	10,568.15
其中：存款利息收入	6.4.7.10	19,987.40	10,568.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,345,447.87	2,512,560.91
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-5,217,326.90	2,031,549.94
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	379.24	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	871,499.79	481,010.97
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	-15,608,043.31	3,937,141.67
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	81,078.43	89,346.38
<b>减：二、营业总支出</b>		658,905.53	527,782.96
1. 管理人报酬		361,613.74	178,744.77
2. 托管费		72,322.77	35,748.91
3. 销售服务费		126,654.55	66,878.56
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	98,314.47	246,410.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>-20,511,330.88</b>	<b>6,021,834.15</b>

列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-20,511,330.88</b>	<b>6,021,834.15</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-20,511,330.88</b>	<b>6,021,834.15</b>

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 1000 指数型发起式证券投资基金

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）	108,992,287.94	76,647,389.68	185,639,677.62
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	108,992,287.94	76,647,389.68	185,639,677.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,073,925.23	-19,731,744.13	-15,657,818.90
（一）、综合收益总额	-	-20,511,330.88	-20,511,330.88
（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）	4,073,925.23	779,586.75	4,853,511.98
其中：1.基金申购款	107,660,895.07	49,360,257.72	157,021,152.79
2.基金赎回款	-103,586,969.84	-48,580,670.97	-152,167,640.81
（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)	113,066,213.17	56,915,645.55	169,981,858.72
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)	37,877,796.76	15,680,231.81	53,558,028.57
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	37,877,796.76	15,680,231.81	53,558,028.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	21,459,395.11	14,514,891.39	35,974,286.50
(一)、综合收益总额	-	6,021,834.15	6,021,834.15
(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)	21,459,395.11	8,493,057.24	29,952,452.35
其中: 1.基金申购款	98,213,888.20	38,010,899.76	136,224,787.96
2.基金赎回款	-76,754,493.09	-29,517,842.52	-106,272,335.61
(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)	59,337,191.87	30,195,123.20	89,532,315.07

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 1000 指数型发起式证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2018]798 号《关于准予广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金注册的批复》核

准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2018 年 9 月 25 日向社会公开发行人募集并于 2018 年 11 月 2 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 9 月 25 日至 2018 年 10 月 26 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 19,676,167.43 元，有效认购户数为 971 户。其中广发中证 1000 指数 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 14,264,655.44 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 1,223.57 元；广发中证 1000 指数 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 5,409,779.19 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 509.23 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 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 年上半年度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 11,749,885.62 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,285.56 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 11,751,171.18 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 44,882.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20.20 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 44,902.40 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 1,305.76 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,285.56 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 20.20 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。

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	13,438,542.89
等于：本金	13,437,344.59
加：应计利息	1,198.30
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	13,438,542.89

#### 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	158,727,756.11	-	158,351,831.97	-375,924.14

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		158,727,756.11	-	158,351,831.97	-375,924.14

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 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	6.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	88,949.38
其中：交易所市场	88,949.38
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	110,367.52
应付指数使用费	10,000.00
合计	209,323.37

#### 6.4.7.8 实收基金

广发中证 1000 指数 A

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	57,289,710.46	57,289,710.46
本期申购	28,787,839.34	28,787,839.34
本期赎回（以“-”号填列）	-36,991,505.75	-36,991,505.75
本期末	49,086,044.05	49,086,044.05

广发中证 1000 指数 C

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	51,702,577.48	51,702,577.48
本期申购	78,873,055.73	78,873,055.73
本期赎回（以“-”号填列）	-66,595,464.09	-66,595,464.09
本期末	63,980,169.12	63,980,169.12

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

广发中证 1000 指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,632,841.43	22,032,470.91	40,665,312.34
本期利润	-2,835,267.49	-9,925,921.44	-12,761,188.93
本期基金份额交易产生的变动数	-2,474,279.80	-298,477.49	-2,772,757.29
其中：基金申购款	8,786,065.35	5,461,515.77	14,247,581.12
基金赎回款	-11,260,345.15	-5,759,993.26	-17,020,338.41

本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,323,294.14	11,808,071.98	25,131,366.12

广发中证 1000 指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,151,989.55	19,830,087.79	35,982,077.34
本期利润	-2,068,020.08	-5,682,121.87	-7,750,141.95
本期基金份额交易产生的变动数	2,310,367.91	1,241,976.13	3,552,344.04
其中：基金申购款	21,701,496.37	13,411,180.23	35,112,676.60
基金赎回款	-19,391,128.46	-12,169,204.10	-31,560,332.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,394,337.38	15,389,942.05	31,784,279.43

#### 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	18,575.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	387.86
结算备付金利息收入	1,024.33
其他	-
合计	19,987.40

#### 6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	98,777,014.64
减：卖出股票成本总额	103,690,345.10
减：交易费用	303,996.44
买卖股票差价收入	-5,217,326.90

#### 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	235.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	143.34
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	379.24

#### 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	2,828,497.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,804,667.00
减：应计利息总额	23,681.10
减：交易费用	5.66
买卖债券差价收入	143.34

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	871,499.79
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	871,499.79

#### 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	-15,608,043.31
——股票投资	-15,608,043.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-15,608,043.31

#### 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	74,894.11
基金转换费收入	6,184.32
合计	81,078.43

#### 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	16,860.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,946.95
指数使用费	20,000.00
合计	98,314.47

### 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、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

#### 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	8,823.60	0.00%	-	-

##### 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 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	361,613.74	178,744.77
其中：支付销售机构的客户维护费	108,255.60	60,424.80

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

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



H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径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	72,322.77	35,748.91

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C	合计
广发基金管理有限公司	-	37,296.22	37,296.22
广发证券股份有限公司	-	318.03	318.03
中国工商银行股份有限公司	-	6,350.88	6,350.88
合计	-	43,965.13	43,965.13
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		

	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C	合计
广发基金管理有限公司	-	7,045.83	7,045.83
中国工商银行股份有限公司	-	3,734.86	3,734.86
广发证券股份有限公司	-	740.07	740.07
合计	-	11,520.76	11,520.76

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前5个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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	
	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C
报告期初持有的基金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-

报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总额比例	20.37%	-	33.70%	-

注：基金管理人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。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

##### 广发中证 1000 指数 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 广发中证 1000 指数 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 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	
	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	13,438,542.89	18,575.21	8,054,915.52	9,678.85

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

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	000065	北方国际	配股	1,710.00	8,823.60
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	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-

#### 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
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	新股 流通 受限	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6 个月	新股 流通 受限	46.80	54.44	120.00	5,616.00	6,532.80	20220517 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
301288	清研环境	2022-04-14	6 个月	新股 流通 受限	19.09	19.98	311.00	5,936.99	6,213.78	-
301158	德石股份	2022-01-07	6 个月	新股 流通 受限	15.64	20.38	265.00	4,144.60	5,400.70	20220527 除权除息,派息比例 0.1200 (含税)
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新股 流通 受限	76.56	51.92	97.00	7,426.32	5,036.24	20220429 除权除息,派息比例

										0.4000 (含税)
301258	富士莱	2022-03-21	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	74.00	3,574.20	3,084.32	20220608 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)

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债券和权证。

#### 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
000881	中广核技	2022-06-28	重大事项停牌	9.02	2022-07-01	9.56	11,200.00	104,359.75	101,024.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风

险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VaR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	13,438,542.89	-	-	-	13,438,542.89
结算备付金	8,073.19	-	-	-	8,073.19
存出保证金	32,675.32	-	-	-	32,675.32
交易性金融资产	-	-	-	158,351,831.97	158,351,831.97
应收申购款	-	-	-	643,606.64	643,606.64
资产总计	13,479,291.40	-	-	158,995,438.61	172,474,730.01
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,187,905.79	2,187,905.79
应付管理人报酬	-	-	-	59,782.36	59,782.36
应付托管费	-	-	-	11,956.45	11,956.45
应付销售服务费	-	-	-	23,903.32	23,903.32
其他负债	-	-	-	209,323.37	209,323.37
负债总计	-	-	-	2,492,871.29	2,492,871.29
利率敏感度缺口	13,479,291.40	-	-	156,502,567.32	169,981,858.72
<b>上年度末</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>

<b>2021 年 12 月 31 日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	11,749,885.62	-	-	-	11,749,885.62
存出保证金	44,882.20	-	-	-	44,882.20
交易性金融资产	-	-	-	174,236,955.15	174,236,955.15
应收利息	-	-	-	1,305.76	1,305.76
应收申购款	-	-	-	1,017,196.22	1,017,196.22
资产总计	11,794,767.82	-	-	175,255,457.13	187,050,224.95
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	930,259.39	930,259.39
应付管理人报酬	-	-	-	73,887.67	73,887.67
应付托管费	-	-	-	14,777.54	14,777.54
应付销售服务费	-	-	-	30,384.10	30,384.10
应付交易费用	-	-	-	197,237.83	197,237.83
其他负债	-	-	-	164,000.80	164,000.80
负债总计	-	-	-	1,410,547.33	1,410,547.33
利率敏感度缺口	11,794,767.82	-	-	173,844,909.80	185,639,677.62

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	158,351,831.97	93.16	174,236,955.15	93.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	158,351,831.97	93.16	174,236,955.15	93.86

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	上升 5%	7,992,943.35	8,825,277.88
	下降 5%	-7,992,943.35	-8,825,277.88

#### 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	156,892,236.69
第二层次	101,024.00
第三层次	1,358,571.28
合计	158,351,831.97

#### 6.4.14.2 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	158,351,831.97	91.81
	其中：普通股	158,351,831.97	91.81
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,446,616.08	7.80
8	其他各项资产	676,281.96	0.39
9	合计	172,474,730.01	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,045,436.40	0.62
B	采矿业	6,883,996.44	4.05
C	制造业	110,799,414.11	65.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,176,660.76	2.46
E	建筑业	3,034,209.50	1.79
F	批发和零售业	4,005,720.60	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	2,665,243.53	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,657,861.57	7.45
J	金融业	3,453,566.20	2.03
K	房地产业	3,018,615.60	1.78
L	租赁和商务服务业	907,387.69	0.53
M	科学研究和技术服务业	1,839,213.47	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,942,334.90	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	55,965.00	0.03
Q	卫生和社会工作	506,642.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	1,195,939.20	0.70
S	综合	163,625.00	0.10
	合计	158,351,831.97	93.16

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.78
2	002176	江特电机	40,700	1,019,128.00	0.60
3	002405	四维图新	56,500	851,455.00	0.50
4	002738	中矿资源	8,680	803,854.80	0.47
5	300568	星源材质	27,466	797,612.64	0.47
6	002192	融捷股份	5,000	768,500.00	0.45
7	688116	天奈科技	4,466	756,897.68	0.45
8	603606	东方电缆	9,800	750,680.00	0.44
9	600873	梅花生物	59,200	667,776.00	0.39
10	000683	远兴能源	60,500	635,855.00	0.37
11	688063	派能科技	1,900	593,180.00	0.35
12	002312	川发龙蟒	33,900	585,114.00	0.34
13	603688	石英股份	4,300	570,223.00	0.34
14	000762	西藏矿业	9,900	553,707.00	0.33
15	601677	明泰铝业	22,980	546,924.00	0.32
16	002432	九安医疗	9,100	546,546.00	0.32
17	002850	科达利	3,300	524,700.00	0.31
18	300118	东方日升	17,200	504,476.00	0.30
19	600559	老白干酒	17,500	502,075.00	0.30
20	000933	神火股份	37,700	493,116.00	0.29
21	601099	太平洋	162,700	486,473.00	0.29
22	600596	新安股份	22,040	477,166.00	0.28
23	002472	双环传动	14,900	474,416.00	0.28
24	688598	金博股份	1,600	471,520.00	0.28
25	002463	沪电股份	31,800	469,368.00	0.28
26	002245	蔚蓝锂芯	19,900	461,879.00	0.27
27	600872	中炬高新	13,300	460,313.00	0.27
28	002025	航天电器	6,500	453,830.00	0.27
29	300438	鹏辉能源	7,350	451,657.50	0.27
30	002610	爱康科技	107,000	442,980.00	0.26
31	300373	扬杰科技	6,200	441,750.00	0.26
32	000818	航锦科技	13,000	440,700.00	0.26
33	000422	湖北宜化	21,500	436,665.00	0.26
34	300395	菲利华	9,650	434,250.00	0.26
35	605111	新洁能	3,400	427,754.00	0.25
36	603236	移远通信	3,169	423,568.54	0.25
37	000591	太阳能	50,300	420,005.00	0.25
38	600711	盛屯矿业	53,900	418,264.00	0.25

39	002402	和而泰	21,900	417,414.00	0.25
40	600456	宝钛股份	7,000	415,800.00	0.24
41	600771	广誉远	11,780	414,067.00	0.24
42	300343	联创股份	27,100	411,649.00	0.24
43	000423	东阿阿胶	10,885	402,200.75	0.24
44	002436	兴森科技	35,600	401,212.00	0.24
45	603596	伯特利	5,000	400,900.00	0.24
46	000155	川能动力	17,700	392,055.00	0.23
47	300604	长川科技	8,640	390,096.00	0.23
48	002036	联创电子	25,275	388,224.00	0.23
49	600110	诺德股份	33,200	385,784.00	0.23
50	300035	中科电气	13,800	385,710.00	0.23
51	300432	富临精工	17,400	382,800.00	0.23
52	300725	药石科技	3,837	379,824.63	0.22
53	601666	平煤股份	27,700	376,443.00	0.22
54	600338	西藏珠峰	13,100	375,970.00	0.22
55	300346	南大光电	10,330	371,673.40	0.22
56	002456	欧菲光	54,400	365,024.00	0.21
57	002044	美年健康	65,500	364,835.00	0.21
58	300458	全志科技	11,950	359,575.50	0.21
59	601001	晋控煤业	20,100	356,775.00	0.21
60	002531	天顺风能	21,600	356,184.00	0.21
61	300393	中来股份	20,880	354,960.00	0.21
62	688301	奕瑞科技	748	353,833.92	0.21
63	300850	新强联	3,960	352,558.80	0.21
64	603005	晶方科技	12,408	352,263.12	0.21
65	300776	帝尔激光	2,032	351,129.60	0.21
66	600882	妙可蓝多	7,500	351,000.00	0.21
67	300803	指南针	5,900	346,802.00	0.20
68	300775	三角防务	7,200	346,680.00	0.20
69	600777	新潮能源	129,800	346,566.00	0.20
70	300339	润和软件	19,100	342,845.00	0.20
71	002597	金禾实业	7,900	342,307.00	0.20
72	688139	海尔生物	4,649	338,586.67	0.20
73	300083	创世纪	29,400	338,100.00	0.20
74	688388	嘉元科技	3,950	335,236.50	0.20
75	300054	鼎龙股份	15,800	334,486.00	0.20
76	300327	中颖电子	6,658	331,634.98	0.20
77	000860	顺鑫农业	12,300	329,886.00	0.19
78	002487	大金重工	7,900	329,667.00	0.19
79	600481	双良节能	19,500	328,575.00	0.19
80	002541	鸿路钢构	9,770	326,318.00	0.19
81	000875	吉电股份	46,600	323,870.00	0.19
82	600179	安通控股	83,300	318,206.00	0.19

83	300502	新易盛	12,100	317,020.00	0.19
84	300068	南都电源	20,500	314,470.00	0.19
85	688050	爱博医疗	1,400	313,880.00	0.18
86	603678	火炬电子	6,700	313,627.00	0.18
87	600416	湘电股份	16,500	312,840.00	0.18
88	002558	巨人网络	33,900	310,185.00	0.18
89	000893	亚钾国际	9,000	309,690.00	0.18
90	300777	中简科技	6,400	308,480.00	0.18
91	300748	金力永磁	8,320	306,176.00	0.18
92	002747	埃斯顿	12,400	303,800.00	0.18
93	002145	中核钛白	42,600	303,738.00	0.18
94	002617	露笑科技	26,800	303,644.00	0.18
95	300034	钢研高纳	7,100	299,478.00	0.18
96	300593	新雷能	7,200	298,872.00	0.18
97	002585	双星新材	16,500	298,485.00	0.18
98	002139	拓邦股份	23,900	293,253.00	0.17
99	601222	林洋能源	34,500	288,075.00	0.17
100	300679	电连技术	6,495	287,014.05	0.17
101	300409	道氏技术	11,000	285,780.00	0.17
102	688202	美迪西	840	285,272.40	0.17
103	603063	禾望电气	7,400	284,530.00	0.17
104	002706	良信股份	17,090	282,497.70	0.17
105	002484	江海股份	11,900	277,746.00	0.16
106	601908	京运通	34,600	277,492.00	0.16
107	002643	万润股份	13,300	277,438.00	0.16
108	688696	极米科技	900	277,083.00	0.16
109	601375	中原证券	66,000	275,220.00	0.16
110	603713	密尔克卫	2,000	273,400.00	0.16
111	600206	有研新材	14,100	272,694.00	0.16
112	601258	庞大集团	195,400	271,606.00	0.16
113	002182	云海金属	10,800	270,864.00	0.16
114	600123	兰花科创	16,400	269,780.00	0.16
115	300861	美畅股份	2,900	268,801.00	0.16
116	600641	万业企业	13,780	268,710.00	0.16
117	002151	北斗星通	8,500	268,260.00	0.16
118	603876	鼎胜新材	5,900	266,680.00	0.16
119	300671	富满微	3,700	266,622.00	0.16
120	600328	中盐化工	11,300	266,115.00	0.16
121	300294	博雅生物	7,400	266,030.00	0.16
122	603599	广信股份	9,440	265,736.00	0.16
123	600151	航天机电	23,900	265,529.00	0.16
124	600483	福能股份	18,800	264,516.00	0.16
125	000902	新洋丰	15,600	263,484.00	0.16
126	002389	航天彩虹	14,300	262,548.00	0.15

127	300077	国民技术	14,100	261,978.00	0.15
128	300457	赢合科技	9,200	261,372.00	0.15
129	002318	久立特材	16,300	260,637.00	0.15
130	300623	捷捷微电	10,500	260,400.00	0.15
131	603906	龙蟠科技	7,000	258,580.00	0.15
132	600378	昊华科技	6,700	258,084.00	0.15
133	600273	嘉化能源	23,700	257,382.00	0.15
134	002544	普天科技	11,300	257,075.00	0.15
135	600277	亿利洁能	51,110	255,550.00	0.15
136	300682	朗新科技	10,000	251,900.00	0.15
137	603129	春风动力	2,200	250,184.00	0.15
138	600100	同方股份	56,000	249,200.00	0.15
139	002258	利尔化学	10,540	248,954.80	0.15
140	603338	浙江鼎力	4,900	248,430.00	0.15
141	688608	恒玄科技	1,800	247,680.00	0.15
142	603588	高能环境	21,460	247,433.80	0.15
143	603612	索通发展	6,700	246,895.00	0.15
144	300747	锐科激光	6,337	246,509.30	0.15
145	688066	航天宏图	3,122	246,013.60	0.14
146	002851	麦格米特	9,350	245,531.00	0.14
147	002091	江苏国泰	22,800	245,100.00	0.14
148	600063	皖维高新	32,200	244,076.00	0.14
149	600055	万东医疗	10,000	243,300.00	0.14
150	300487	蓝晓科技	3,950	240,950.00	0.14
151	688516	奥特维	900	240,255.00	0.14
152	300613	富瀚微	2,828	239,814.40	0.14
153	600323	瀚蓝环境	11,650	238,825.00	0.14
154	601777	力帆科技	43,000	238,650.00	0.14
155	603008	喜临门	6,500	238,550.00	0.14
156	300666	江丰电子	3,900	237,900.00	0.14
157	002761	浙江建投	7,700	237,699.00	0.14
158	603027	千禾味业	13,717	237,304.10	0.14
159	002807	江阴银行	52,000	235,560.00	0.14
160	601678	滨化股份	39,200	234,808.00	0.14
161	688298	东方生物	2,020	230,583.00	0.14
162	600773	西藏城投	11,700	230,490.00	0.14
163	002539	云图控股	14,400	230,256.00	0.14
164	002079	苏州固锝	15,400	229,768.00	0.14
165	000403	派林生物	10,433	229,108.68	0.13
166	300036	超图软件	11,700	228,618.00	0.13
167	601231	环旭电子	15,900	228,324.00	0.13
168	600330	天通股份	19,100	227,481.00	0.13
169	600057	厦门象屿	25,700	225,903.00	0.13
170	300476	胜宏科技	12,300	225,828.00	0.13

171	300298	三诺生物	8,000	224,800.00	0.13
172	601567	三星医疗	16,900	224,432.00	0.13
173	601399	国机重装	68,900	223,236.00	0.13
174	600246	万通发展	24,400	222,040.00	0.13
175	605376	博迁新材	3,800	221,540.00	0.13
176	000035	中国天楹	42,100	221,025.00	0.13
177	300672	国科微	2,700	220,752.00	0.13
178	600621	华鑫股份	15,200	220,704.00	0.13
179	300627	华测导航	6,380	219,408.20	0.13
180	002839	张家港行	41,380	218,900.20	0.13
181	300101	振芯科技	10,600	218,784.00	0.13
182	600583	海油工程	52,700	218,705.00	0.13
183	600389	江山股份	3,600	218,628.00	0.13
184	688680	海优新材	1,100	218,570.00	0.13
185	603690	至纯科技	5,400	217,620.00	0.13
186	002126	银轮股份	19,000	217,550.00	0.13
187	603279	景津装备	7,000	217,070.00	0.13
188	300587	天铁股份	10,600	216,558.00	0.13
189	300459	汤姆猫	58,800	216,384.00	0.13
190	300685	艾德生物	6,740	215,680.00	0.13
191	000090	天健集团	31,200	214,968.00	0.13
192	300573	兴齐眼药	1,400	214,648.00	0.13
193	300233	金城医药	7,500	213,975.00	0.13
194	688200	华峰测控	600	213,840.00	0.13
195	300185	通裕重工	74,400	213,528.00	0.13
196	603565	中谷物流	13,448	213,419.76	0.13
197	002291	星期六	10,800	213,408.00	0.13
198	300451	创业慧康	29,572	212,918.40	0.13
199	600577	精达股份	38,000	210,900.00	0.12
200	603666	亿嘉和	3,068	210,464.80	0.12
201	002324	普利特	14,520	210,249.60	0.12
202	600172	黄河旋风	24,000	209,280.00	0.12
203	002335	科华数据	6,780	209,163.00	0.12
204	002171	楚江新材	22,400	208,992.00	0.12
205	000546	金圆股份	13,000	208,780.00	0.12
206	002906	华阳集团	4,600	208,426.00	0.12
207	600366	宁波韵升	16,500	207,900.00	0.12
208	600197	伊力特	6,900	207,690.00	0.12
209	600502	安徽建工	28,800	207,360.00	0.12
210	300171	东富龙	6,100	206,851.00	0.12
211	002675	东诚药业	15,300	206,550.00	0.12
212	000810	创维数字	12,700	205,867.00	0.12
213	600977	中国电影	17,900	205,850.00	0.12
214	002015	协鑫能科	11,600	205,784.00	0.12



215	000829	天音控股	17,200	204,852.00	0.12
216	002832	比音勒芬	8,120	204,624.00	0.12
217	300767	震安科技	3,512	204,328.16	0.12
218	603179	新泉股份	7,040	204,160.00	0.12
219	002216	三全食品	10,400	203,736.00	0.12
220	300567	精测电子	4,700	203,040.00	0.12
221	600129	太极集团	9,200	202,124.00	0.12
222	002163	海南发展	14,100	201,207.00	0.12
223	300398	飞凯材料	8,800	201,168.00	0.12
224	688333	铂力特	1,100	201,003.00	0.12
225	300443	金雷股份	4,400	200,552.00	0.12
226	600908	无锡银行	35,600	200,428.00	0.12
227	603826	坤彩科技	3,400	200,124.00	0.12
228	300065	海兰信	15,150	198,465.00	0.12
229	601137	博威合金	11,200	198,240.00	0.12
230	300638	广和通	7,450	197,350.50	0.12
231	002085	万丰奥威	36,600	196,542.00	0.12
232	600252	中恒集团	66,500	196,175.00	0.12
233	002984	森麒麟	6,300	195,993.00	0.12
234	300772	运达股份	7,700	195,888.00	0.12
235	002567	唐人神	23,000	195,730.00	0.12
236	600363	联创光电	8,700	195,402.00	0.11
237	601212	白银有色	70,600	194,856.00	0.11
238	600986	浙文互联	31,600	194,656.00	0.11
239	000049	德赛电池	4,300	193,930.00	0.11
240	601208	东材科技	15,000	193,800.00	0.11
241	300841	康华生物	1,675	193,362.00	0.11
242	002726	龙大美食	18,100	192,946.00	0.11
243	000657	中钨高新	12,800	192,000.00	0.11
244	002254	泰和新材	11,400	190,950.00	0.11
245	300379	东方通	10,840	190,892.40	0.11
246	300456	赛微电子	10,430	190,660.40	0.11
247	601918	新集能源	37,200	189,720.00	0.11
248	603128	华贸物流	18,870	189,266.10	0.11
249	600821	金开新能	29,300	188,692.00	0.11
250	002100	天康生物	19,400	188,568.00	0.11
251	688083	中望软件	900	188,478.00	0.11
252	600916	中国黄金	16,100	188,370.00	0.11
253	601311	骆驼股份	16,900	188,097.00	0.11
254	601126	四方股份	11,600	188,036.00	0.11
255	300696	爱乐达	4,260	187,227.00	0.11
256	300655	晶瑞电材	9,700	187,210.00	0.11
257	002099	海翔药业	27,000	187,110.00	0.11
258	002332	仙琚制药	19,000	186,580.00	0.11

259	603098	森特股份	5,200	186,472.00	0.11
260	000426	兴业矿业	26,300	186,467.00	0.11
261	000915	华特达因	4,500	186,075.00	0.11
262	300737	科顺股份	14,075	185,508.50	0.11
263	688408	中信博	2,005	185,422.40	0.11
264	600210	紫江企业	29,000	185,310.00	0.11
265	603308	应流股份	11,340	184,615.20	0.11
266	300087	荃银高科	11,200	184,352.00	0.11
267	600305	恒顺醋业	14,288	184,315.20	0.11
268	000672	上峰水泥	11,660	183,994.80	0.11
269	600116	三峡水利	18,300	183,732.00	0.11
270	600720	祁连山	14,800	183,520.00	0.11
271	300726	宏达电子	3,000	183,510.00	0.11
272	601952	苏垦农发	13,100	183,269.00	0.11
273	688017	绿的谐波	1,540	183,260.00	0.11
274	600267	海正药业	14,300	183,183.00	0.11
275	000951	中国重汽	14,000	181,860.00	0.11
276	600295	鄂尔多斯	10,040	181,222.00	0.11
277	300773	拉卡拉	9,500	181,070.00	0.11
278	300203	聚光科技	7,500	180,300.00	0.11
279	000917	电广传媒	33,900	180,009.00	0.11
280	002810	山东赫达	4,945	179,948.55	0.11
281	600586	金晶科技	23,800	179,690.00	0.11
282	300224	正海磁材	11,700	179,010.00	0.11
283	300079	数码视讯	34,200	178,524.00	0.11
284	002413	雷科防务	32,100	178,155.00	0.10
285	002123	梦网科技	15,300	178,092.00	0.10
286	600740	山西焦化	30,562	177,870.84	0.10
287	600888	新疆众和	19,300	177,560.00	0.10
288	002063	远光软件	25,184	177,043.52	0.10
289	600496	精工钢构	38,300	176,946.00	0.10
290	688133	泰坦科技	1,000	176,640.00	0.10
291	002201	正威新材	6,800	176,460.00	0.10
292	002626	金达威	7,400	176,416.00	0.10
293	603306	华懋科技	5,200	176,280.00	0.10
294	603323	苏农银行	34,490	175,899.00	0.10
295	688016	心脉医疗	900	175,329.00	0.10
296	600562	国睿科技	11,800	175,230.00	0.10
297	002041	登海种业	8,300	175,047.00	0.10
298	603489	八方股份	900	175,041.00	0.10
299	600850	电科数字	9,350	174,471.00	0.10
300	002518	科士达	5,700	174,420.00	0.10
301	300236	上海新阳	5,250	173,775.00	0.10
302	600645	中源协和	8,900	173,283.00	0.10

303	600610	中毅达	10,100	171,700.00	0.10
304	603348	文灿股份	3,200	171,520.00	0.10
305	300662	科锐国际	3,300	171,237.00	0.10
306	600185	格力地产	27,000	170,370.00	0.10
307	000650	仁和药业	26,700	170,346.00	0.10
308	600993	马应龙	7,300	170,090.00	0.10
309	688356	键凯科技	700	169,267.00	0.10
310	688339	亿华通-U	1,720	169,213.60	0.10
311	002061	浙江交科	24,300	169,128.00	0.10
312	603919	金徽酒	4,930	167,570.70	0.10
313	000034	神州数码	11,000	167,420.00	0.10
314	600688	上海石化	52,600	167,268.00	0.10
315	600059	古越龙山	15,200	167,200.00	0.10
316	000681	视觉中国	11,700	167,193.00	0.10
317	002038	双鹭药业	17,200	167,012.00	0.10
318	300075	数字政通	9,400	166,568.00	0.10
319	600552	凯盛科技	14,600	165,418.00	0.10
320	000582	北部湾港	21,300	165,288.00	0.10
321	002727	一心堂	7,200	165,096.00	0.10
322	002239	奥特佳	54,100	165,005.00	0.10
323	301035	润丰股份	2,000	164,900.00	0.10
324	000767	晋控电力	44,100	164,493.00	0.10
325	600869	远东股份	31,900	164,285.00	0.10
326	002400	省广集团	33,300	164,169.00	0.10
327	600770	综艺股份	18,700	163,625.00	0.10
328	601028	玉龙股份	9,200	163,392.00	0.10
329	002217	合力泰	52,200	163,386.00	0.10
330	002262	恩华药业	12,000	163,200.00	0.10
331	002960	青鸟消防	5,933	162,504.87	0.10
332	002895	川恒股份	4,800	162,288.00	0.10
333	603979	金诚信	8,400	162,204.00	0.10
334	600477	杭萧钢构	34,040	162,030.40	0.10
335	600685	中船防务	9,800	161,602.00	0.10
336	000016	深康佳 A	26,700	161,535.00	0.10
337	000712	锦龙股份	10,700	161,463.00	0.09
338	600682	南京新百	16,100	161,322.00	0.09
339	002537	海联金汇	19,700	161,146.00	0.09
340	688520	神州细胞-U	3,113	161,035.49	0.09
341	000627	天茂集团	47,200	160,952.00	0.09
342	688033	天宜上佳	7,556	160,489.44	0.09
343	002759	天际股份	5,900	160,362.00	0.09
344	002556	辉隆股份	13,700	160,290.00	0.09
345	002428	云南锗业	12,400	160,208.00	0.09
346	600320	振华重工	47,600	159,936.00	0.09

347	000758	中色股份	33,000	159,390.00	0.09
348	300674	宇信科技	10,140	158,995.20	0.09
349	300639	凯普生物	7,417	158,575.46	0.09
350	688007	光峰科技	6,519	158,411.70	0.09
351	601369	陕鼓动力	16,500	158,400.00	0.09
352	300133	华策影视	31,800	158,364.00	0.09
353	300821	东岳硅材	8,600	158,068.00	0.09
354	300401	花园生物	9,100	157,794.00	0.09
355	600877	声光电科	14,100	157,638.00	0.09
356	300323	华灿光电	20,800	156,624.00	0.09
357	300188	美亚柏科	11,600	156,368.00	0.09
358	601519	大智慧	24,200	156,332.00	0.09
359	600075	新疆天业	24,400	155,916.00	0.09
360	603018	华设集团	16,312	155,779.60	0.09
361	600963	岳阳林纸	25,800	155,574.00	0.09
362	603505	金石资源	3,800	155,458.00	0.09
363	000503	国新健康	17,300	155,354.00	0.09
364	688023	安恒信息	1,050	155,043.00	0.09
365	300761	立华股份	3,900	155,025.00	0.09
366	603583	捷昌驱动	4,636	154,796.04	0.09
367	300855	图南股份	3,700	154,623.00	0.09
368	600422	昆药集团	12,700	154,305.00	0.09
369	300394	天孚通信	5,700	154,299.00	0.09
370	300303	聚飞光电	32,100	154,080.00	0.09
371	600163	中闽能源	18,200	153,790.00	0.09
372	000969	安泰科技	17,200	153,424.00	0.09
373	688617	惠泰医疗	700	153,356.00	0.09
374	000921	海信家电	10,800	153,144.00	0.09
375	002645	华宏科技	7,000	152,740.00	0.09
376	002261	拓维信息	23,800	152,558.00	0.09
377	600635	大众公用	46,200	152,460.00	0.09
378	300170	汉得信息	16,900	152,269.00	0.09
379	600452	涪陵电力	13,104	152,137.44	0.09
380	600459	贵研铂业	8,375	151,671.25	0.09
381	300653	正海生物	2,700	151,200.00	0.09
382	002446	盛路通信	21,800	151,074.00	0.09
383	601965	中国汽研	9,300	150,753.00	0.09
384	000735	罗牛山	22,100	150,722.00	0.09
385	600158	中体产业	18,300	150,609.00	0.09
386	300208	青岛中程	10,700	150,549.00	0.09
387	300355	蒙草生态	38,200	150,508.00	0.09
388	600578	京能电力	48,000	150,240.00	0.09
389	600491	龙元建设	22,000	150,040.00	0.09
390	002612	朗姿股份	5,300	149,884.00	0.09

391	603187	海容冷链	4,100	149,855.00	0.09
392	000848	承德露露	15,400	149,072.00	0.09
393	688019	安集科技	700	149,044.00	0.09
394	600966	博汇纸业	19,200	148,608.00	0.09
395	000923	河钢资源	10,900	148,567.00	0.09
396	300027	华谊兄弟	46,400	148,480.00	0.09
397	300827	上能电气	2,900	148,335.00	0.09
398	603229	奥翔药业	3,896	148,281.76	0.09
399	002639	雪人股份	12,900	147,834.00	0.09
400	000727	冠捷科技	65,000	147,550.00	0.09
401	002108	沧州明珠	23,700	147,414.00	0.09
402	002130	沃尔核材	24,000	147,360.00	0.09
403	002023	海特高新	14,400	147,312.00	0.09
404	603529	爱玛科技	2,800	146,664.00	0.09
405	600761	安徽合力	12,300	146,370.00	0.09
406	301155	海力风电	1,600	145,600.00	0.09
407	600360	华微电子	18,330	145,540.20	0.09
408	300428	立中集团	4,400	145,420.00	0.09
409	600797	浙大网新	24,400	144,448.00	0.08
410	688166	博瑞医药	5,978	144,368.70	0.08
411	002698	博实股份	12,200	144,326.00	0.08
412	002214	大立科技	11,340	144,244.80	0.08
413	002649	博彦科技	14,100	143,961.00	0.08
414	000498	山东路桥	14,900	143,934.00	0.08
415	300525	博思软件	6,700	143,715.00	0.08
416	601963	重庆银行	18,100	143,714.00	0.08
417	300055	万邦达	15,300	143,208.00	0.08
418	600490	鹏欣资源	37,100	142,835.00	0.08
419	600248	陕西建工	26,300	142,809.00	0.08
420	603363	傲农生物	7,680	142,156.80	0.08
421	300326	凯利泰	17,200	142,072.00	0.08
422	002928	华夏航空	12,050	141,828.50	0.08
423	600587	新华医疗	7,000	141,750.00	0.08
424	300287	飞利信	34,300	141,659.00	0.08
425	002226	江南化工	25,220	141,484.20	0.08
426	600657	信达地产	20,500	141,245.00	0.08
427	300470	中密控股	4,000	141,160.00	0.08
428	300596	利安隆	3,200	141,152.00	0.08
429	000612	焦作万方	22,700	140,967.00	0.08
430	605123	派克新材	1,000	140,720.00	0.08
431	603520	司太立	4,980	140,037.60	0.08
432	300369	绿盟科技	13,300	139,916.00	0.08
433	301071	力量钻石	900	139,617.00	0.08
434	300497	富祥药业	10,368	139,345.92	0.08

435	300477	合纵科技	18,060	139,062.00	0.08
436	603995	甬金股份	4,100	138,006.00	0.08
437	300151	昌红科技	7,300	137,970.00	0.08
438	688106	金宏气体	7,049	137,807.95	0.08
439	002020	京新药业	15,140	137,774.00	0.08
440	600812	华北制药	20,500	137,760.00	0.08
441	603043	广州酒家	5,440	137,196.80	0.08
442	300263	隆华科技	15,300	137,088.00	0.08
443	002859	洁美科技	4,980	137,049.60	0.08
444	600643	爱建集团	23,100	136,983.00	0.08
445	603305	旭升股份	4,520	136,594.40	0.08
446	300663	科蓝软件	8,800	136,224.00	0.08
447	603733	仙鹤股份	5,100	135,660.00	0.08
448	002545	东方铁塔	11,900	135,422.00	0.08
449	600285	羚锐制药	10,800	135,324.00	0.08
450	002276	万马股份	17,300	135,286.00	0.08
451	002498	汉缆股份	31,800	135,150.00	0.08
452	300229	拓尔思	11,900	135,065.00	0.08
453	600395	盘江股份	15,400	135,058.00	0.08
454	000059	华锦股份	22,800	134,976.00	0.08
455	002467	二六三	32,580	134,881.20	0.08
456	300180	华峰超纤	33,600	134,736.00	0.08
457	002581	未名医药	7,800	134,472.00	0.08
458	002237	恒邦股份	13,700	134,260.00	0.08
459	300377	赢时胜	14,300	133,848.00	0.08
460	300348	长亮科技	13,825	133,549.50	0.08
461	002274	华昌化工	13,700	133,438.00	0.08
462	600675	中华企业	43,600	133,416.00	0.08
463	000935	四川双马	5,500	133,210.00	0.08
464	300131	英唐智控	25,400	133,096.00	0.08
465	002135	东南网架	13,900	133,023.00	0.08
466	002440	闰土股份	16,500	132,990.00	0.08
467	002222	福晶科技	8,100	132,840.00	0.08
468	600933	爱柯迪	8,100	132,678.00	0.08
469	002635	安洁科技	8,100	132,597.00	0.08
470	603010	万盛股份	7,100	132,415.00	0.08
471	002646	天佑德酒	6,900	132,135.00	0.08
472	603936	博敏电子	9,700	132,114.00	0.08
473	300102	乾照光电	17,300	131,999.00	0.08
474	000555	神州信息	11,700	131,976.00	0.08
475	002967	广电计量	6,964	131,898.16	0.08
476	300319	麦捷科技	14,300	131,846.00	0.08
477	600266	城建发展	32,300	131,784.00	0.08
478	002611	东方精工	25,300	131,560.00	0.08

479	300755	华致酒行	3,000	131,550.00	0.08
480	603393	新天然气	6,152	131,406.72	0.08
481	605168	三人行	1,213	131,161.69	0.08
482	600108	亚盛集团	37,300	130,550.00	0.08
483	002293	罗莱生活	9,900	130,383.00	0.08
484	002773	康弘药业	8,700	129,978.00	0.08
485	002283	天润工业	19,000	129,770.00	0.08
486	000851	高鸿股份	27,200	129,744.00	0.08
487	002206	海利得	20,500	129,560.00	0.08
488	600612	老凤祥	3,100	129,518.00	0.08
489	002837	英维克	5,230	129,390.20	0.08
490	688686	奥普特	500	129,325.00	0.08
491	600649	城投控股	30,200	129,256.00	0.08
492	002488	金固股份	19,200	129,216.00	0.08
493	603916	苏博特	5,060	128,979.40	0.08
494	000682	东方电子	19,300	128,538.00	0.08
495	300352	北信源	27,700	127,974.00	0.08
496	002043	兔宝宝	11,000	127,600.00	0.08
497	600072	中船科技	10,500	127,470.00	0.07
498	600750	江中药业	8,900	127,448.00	0.07
499	603396	金辰股份	1,400	127,442.00	0.07
500	600776	东方通信	11,300	127,125.00	0.07
501	002481	双塔食品	14,900	126,501.00	0.07
502	300284	苏交科	18,140	126,435.80	0.07
503	300633	开立医疗	4,200	126,126.00	0.07
504	688508	芯朋微	1,692	126,054.00	0.07
505	603033	三维股份	5,590	125,998.60	0.07
506	603298	杭叉集团	8,160	125,908.80	0.07
507	600223	鲁商发展	12,000	125,760.00	0.07
508	603566	普莱柯	4,700	125,631.00	0.07
509	300031	宝通科技	7,800	125,580.00	0.07
510	000688	国城矿业	8,000	125,520.00	0.07
511	600211	西藏药业	3,020	125,360.20	0.07
512	600073	上海梅林	15,700	125,129.00	0.07
513	600864	哈投股份	24,800	124,744.00	0.07
514	300973	立高食品	1,200	124,740.00	0.07
514	000795	英洛华	16,200	124,740.00	0.07
515	000927	中国铁物	43,300	124,704.00	0.07
516	601890	亚星锚链	16,100	124,292.00	0.07
517	002310	东方园林	51,400	123,874.00	0.07
518	688018	乐鑫科技	1,100	123,640.00	0.07
519	002421	达实智能	36,900	123,615.00	0.07
520	688266	泽璟制药-U	3,429	123,066.81	0.07
521	300406	九强生物	7,100	122,759.00	0.07

522	300184	力源信息	22,300	122,650.00	0.07
523	002550	千红制药	21,400	122,622.00	0.07
524	000789	万年青	11,290	122,383.60	0.07
525	000036	华联控股	28,280	122,169.60	0.07
526	603801	志邦家居	4,520	121,949.60	0.07
527	301050	雷电微力	1,200	121,872.00	0.07
528	600428	中远海特	25,600	121,856.00	0.07
529	000592	平潭发展	46,100	121,243.00	0.07
530	000968	蓝焰控股	11,600	121,220.00	0.07
531	002158	汉钟精机	5,200	120,900.00	0.07
532	600420	国药现代	12,200	120,780.00	0.07
533	000901	航天科技	13,270	120,624.30	0.07
534	603368	柳药集团	6,980	120,195.60	0.07
535	300222	科大智能	14,900	120,094.00	0.07
536	600284	浦东建设	16,200	120,042.00	0.07
537	600742	一汽富维	12,900	119,712.00	0.07
538	000966	长源电力	19,800	119,592.00	0.07
539	300271	华宇软件	15,900	119,568.00	0.07
540	300232	洲明科技	18,320	119,446.40	0.07
541	601619	嘉泽新能	29,100	119,310.00	0.07
542	600557	康缘药业	8,100	118,989.00	0.07
543	600512	腾达建设	38,100	118,491.00	0.07
544	603301	振德医疗	2,800	117,740.00	0.07
545	600169	太原重工	47,800	117,588.00	0.07
546	300226	上海钢联	5,164	116,964.60	0.07
547	600984	建设机械	18,050	116,964.00	0.07
548	002190	成飞集成	4,300	116,960.00	0.07
549	600125	铁龙物流	21,900	116,946.00	0.07
550	301047	义翘神州	900	116,757.00	0.07
551	300020	银江技术	15,700	116,651.00	0.07
552	600751	海航科技	43,000	116,530.00	0.07
553	603997	继峰股份	10,700	116,416.00	0.07
554	300158	振东制药	17,200	116,100.00	0.07
555	600575	淮河能源	37,200	116,064.00	0.07
556	688037	芯源微	800	115,976.00	0.07
557	600997	开滦股份	15,200	115,824.00	0.07
558	600955	维远股份	4,000	115,360.00	0.07
559	600523	贵航股份	4,900	115,150.00	0.07
560	300177	中海达	14,200	114,878.00	0.07
561	601011	宝泰隆	27,400	114,532.00	0.07
562	600691	阳煤化工	28,300	114,332.00	0.07
563	000913	钱江摩托	6,500	114,140.00	0.07
564	601015	陕西黑猫	19,500	114,075.00	0.07
565	000976	华铁股份	26,700	114,009.00	0.07



566	600331	宏达股份	34,000	113,900.00	0.07
567	002741	光华科技	5,700	113,601.00	0.07
568	300007	汉威科技	6,300	113,337.00	0.07
569	000560	我爱我家	39,300	113,184.00	0.07
570	301089	拓新药业	900	113,058.00	0.07
571	600971	恒源煤电	14,300	112,970.00	0.07
572	601929	吉视传媒	55,100	112,955.00	0.07
573	603896	寿仙谷	2,910	112,849.80	0.07
574	000989	九芝堂	12,400	112,840.00	0.07
575	603766	隆鑫通用	24,400	112,484.00	0.07
576	000088	盐田港	21,564	112,348.44	0.07
577	600017	日照港	36,900	112,176.00	0.07
578	300894	火星人	3,000	112,170.00	0.07
579	002589	瑞康医药	28,800	112,032.00	0.07
580	002243	力合科创	11,600	111,940.00	0.07
581	002746	仙坛股份	12,225	111,858.75	0.07
582	600458	时代新材	11,400	111,720.00	0.07
583	603113	金能科技	10,100	111,706.00	0.07
584	000811	冰轮环境	10,700	111,601.00	0.07
585	600810	神马股份	12,400	111,600.00	0.07
586	300738	奥飞数据	9,744	111,568.80	0.07
587	300598	诚迈科技	2,700	111,483.00	0.07
588	600308	华泰股份	19,500	111,345.00	0.07
589	002737	葵花药业	7,100	111,044.00	0.07
590	300039	上海凯宝	17,500	110,950.00	0.07
591	600103	青山纸业	44,070	110,615.70	0.07
592	000603	盛达资源	9,800	110,544.00	0.07
593	600789	鲁抗医药	16,900	110,526.00	0.07
594	600602	云赛智联	15,400	110,264.00	0.06
595	600531	豫光金铅	20,900	110,143.00	0.06
596	600662	外服控股	16,300	110,025.00	0.06
597	603989	艾华集团	3,900	109,980.00	0.06
598	688198	佰仁医疗	900	109,728.00	0.06
599	300382	斯莱克	7,000	109,690.00	0.06
600	002106	莱宝高科	13,400	109,612.00	0.06
601	600639	浦东金桥	8,000	108,720.00	0.06
602	688568	中科星图	1,600	108,416.00	0.06
603	688158	优刻得-W	7,427	107,914.31	0.06
604	000543	皖能电力	27,000	107,730.00	0.06
605	300770	新媒股份	2,840	107,437.20	0.06
606	603881	数据港	4,000	107,400.00	0.06
607	300149	睿智医药	9,500	107,160.00	0.06
608	002055	得润电子	8,600	106,984.00	0.06
609	002930	宏川智慧	5,410	106,955.70	0.06

610	002314	南山控股	25,800	106,812.00	0.06
611	688233	神工股份	1,900	106,780.00	0.06
612	002034	旺能环境	5,200	106,756.00	0.06
613	000006	深振业 A	22,600	106,446.00	0.06
614	300709	精研科技	3,592	106,287.28	0.06
615	002097	山河智能	15,600	105,924.00	0.06
616	601609	金田股份	14,100	105,891.00	0.06
617	600729	重庆百货	4,900	105,693.00	0.06
618	600391	航发科技	5,500	105,655.00	0.06
619	002847	盐津铺子	1,200	105,528.00	0.06
620	601686	友发集团	13,800	105,432.00	0.06
621	688586	江航装备	3,949	105,082.89	0.06
622	603387	基蛋生物	7,344	104,725.44	0.06
623	603718	海利生物	9,100	104,468.00	0.06
624	300080	易成新能	20,800	104,416.00	0.06
625	300123	亚光科技	16,840	104,408.00	0.06
626	001696	宗申动力	16,400	103,812.00	0.06
627	603212	赛伍技术	3,900	103,779.00	0.06
628	300143	盈康生命	9,100	103,285.00	0.06
629	600335	国机汽车	10,300	103,103.00	0.06
630	002833	弘亚数控	6,177	103,032.36	0.06
631	300266	兴源环境	26,200	102,966.00	0.06
632	002307	北新路桥	17,300	102,935.00	0.06
633	300397	天和防务	9,880	102,850.80	0.06
634	600581	八一钢铁	18,300	102,846.00	0.06
635	300219	鸿利智汇	11,800	102,660.00	0.06
636	002194	武汉凡谷	9,700	102,626.00	0.06
637	600326	西藏天路	17,500	102,375.00	0.06
638	300267	尔康制药	29,500	102,365.00	0.06
639	002425	凯撒文化	18,300	102,297.00	0.06
640	300191	潜能恒信	4,700	102,272.00	0.06
641	300762	上海瀚讯	9,184	102,217.92	0.06
642	000676	智度股份	18,340	101,970.40	0.06
643	603915	国茂股份	4,840	101,591.60	0.06
644	000828	东莞控股	9,900	101,475.00	0.06
645	000567	海德股份	6,830	101,084.00	0.06
646	000881	中广核技	11,200	101,024.00	0.06
647	000557	西部创业	21,000	101,010.00	0.06
648	603636	南威软件	8,300	100,845.00	0.06
649	000065	北方国际	11,910	100,639.50	0.06
650	000061	农产品	16,200	100,440.00	0.06
651	301080	百普赛斯	600	100,134.00	0.06
652	000801	四川九洲	14,700	100,107.00	0.06
653	000903	云内动力	33,000	99,990.00	0.06

654	601606	长城军工	8,600	99,846.00	0.06
655	300119	瑞普生物	5,700	99,693.00	0.06
656	002218	拓日新能	16,900	99,541.00	0.06
657	605369	拱东医疗	800	99,360.00	0.06
658	002777	久远银海	6,896	99,164.48	0.06
659	000615	奥园美谷	13,000	98,930.00	0.06
660	003012	东鹏控股	11,300	98,762.00	0.06
661	600604	市北高新	16,900	98,696.00	0.06
662	002697	红旗连锁	19,500	98,475.00	0.06
663	000652	泰达股份	24,600	98,400.00	0.06
664	000070	特发信息	14,140	98,273.00	0.06
665	603959	百利科技	8,100	98,172.00	0.06
666	002573	清新环境	16,800	97,608.00	0.06
667	600217	中再资环	20,000	97,600.00	0.06
668	600876	洛阳玻璃	3,900	97,578.00	0.06
669	603686	福龙马	9,820	97,414.40	0.06
670	603429	集友股份	7,568	97,324.48	0.06
671	000507	珠海港	15,300	97,155.00	0.06
672	002717	岭南股份	32,250	97,072.50	0.06
673	003031	中瓷电子	1,500	96,900.00	0.06
674	600343	航天动力	9,100	96,824.00	0.06
675	600480	凌云股份	10,880	96,723.20	0.06
676	300109	新开源	5,900	96,288.00	0.06
677	300900	广联航空	3,600	96,120.00	0.06
678	600550	保变电气	17,700	96,111.00	0.06
679	002941	新疆交建	6,200	96,100.00	0.06
680	603025	大豪科技	4,400	96,096.00	0.06
681	000928	中钢国际	15,300	95,931.00	0.06
682	300735	光弘科技	9,166	95,784.70	0.06
683	002733	雄韬股份	5,500	95,755.00	0.06
684	600783	鲁信创投	7,200	95,472.00	0.06
685	002449	国星光电	11,800	95,462.00	0.06
686	688366	昊海生科	900	95,202.00	0.06
687	600990	四创电子	2,300	95,105.00	0.06
688	601702	华峰铝业	7,200	95,040.00	0.06
689	600746	江苏索普	8,200	94,956.00	0.06
690	002285	世联行	29,100	94,866.00	0.06
691	300702	天宇股份	3,320	94,321.20	0.06
692	002035	华帝股份	16,200	94,284.00	0.06
693	002489	浙江永强	25,900	94,276.00	0.06
694	600775	南京熊猫	9,600	94,080.00	0.06
695	002234	民和股份	5,900	94,046.00	0.06
696	603299	苏盐井神	7,500	93,975.00	0.06
697	300792	壹网壹创	2,900	93,786.00	0.06

698	002437	誉衡药业	36,900	93,357.00	0.05
699	601886	江河集团	11,000	92,950.00	0.05
700	300311	任子行	12,900	92,622.00	0.05
701	000030	富奥股份	16,900	92,612.00	0.05
702	002298	中电兴发	14,100	92,496.00	0.05
703	603601	再升科技	14,520	92,347.20	0.05
704	000823	超声电子	8,900	92,026.00	0.05
705	300846	首都在线	6,800	91,936.00	0.05
706	301217	铜冠铜箔	6,000	91,260.00	0.05
707	300085	银之杰	8,300	91,217.00	0.05
708	688399	硕世生物	800	91,216.00	0.05
709	600696	岩石股份	3,200	91,072.00	0.05
710	002320	海峡股份	15,987	90,966.03	0.05
711	002677	浙江美大	6,200	90,954.00	0.05
712	688027	国盾量子	900	90,900.00	0.05
713	300292	吴通控股	25,600	90,880.00	0.05
714	603595	东尼电子	2,200	90,838.00	0.05
715	688578	艾利斯-U	4,300	90,730.00	0.05
716	002614	奥佳华	10,400	90,064.00	0.05
717	002461	珠江啤酒	10,600	89,888.00	0.05
718	002516	旷达科技	17,500	89,600.00	0.05
719	600694	大商股份	5,000	89,500.00	0.05
720	000025	特力 A	3,800	89,490.00	0.05
721	000539	粤电力 A	21,300	89,460.00	0.05
722	002351	漫步者	10,550	89,253.00	0.05
723	600929	雪天盐业	9,600	89,088.00	0.05
724	002891	中宠股份	3,500	88,970.00	0.05
725	601588	北辰实业	38,000	88,920.00	0.05
726	300423	昇辉科技	8,200	88,724.00	0.05
727	688127	蓝特光学	3,945	88,604.70	0.05
728	000597	东北制药	16,105	88,577.50	0.05
729	300145	中金环境	32,200	88,550.00	0.05
730	300910	瑞丰新材	1,400	88,508.00	0.05
731	688278	特宝生物	3,001	88,469.48	0.05
732	002838	道恩股份	3,600	88,416.00	0.05
733	300205	天喻信息	7,300	88,111.00	0.05
734	000697	炼石航空	11,200	88,032.00	0.05
735	688277	天智航-U	6,116	88,009.24	0.05
736	603068	博通集成	2,200	87,934.00	0.05
737	600510	黑牡丹	9,900	87,417.00	0.05
738	300091	金通灵	21,400	87,312.00	0.05
739	300130	新国都	7,100	87,046.00	0.05
740	300657	弘信电子	7,460	86,685.20	0.05
741	300366	创意信息	10,100	86,355.00	0.05

742	002534	西子洁能	5,300	86,337.00	0.05
743	688526	科前生物	3,315	86,156.85	0.05
744	000710	贝瑞基因	6,000	86,040.00	0.05
745	600184	光电股份	6,200	85,808.00	0.05
746	300378	鼎捷软件	5,200	85,644.00	0.05
747	300276	三丰智能	20,300	85,463.00	0.05
748	000566	海南海药	18,700	85,459.00	0.05
749	601827	三峰环境	12,000	85,440.00	0.05
750	002251	步步高	12,300	85,239.00	0.05
751	600449	宁夏建材	7,000	85,190.00	0.05
752	600565	迪马股份	36,600	84,912.00	0.05
753	600105	永鼎股份	23,500	84,835.00	0.05
754	002768	国恩股份	3,300	84,744.00	0.05
755	603060	国检集团	7,007	84,434.35	0.05
756	002367	康力电梯	11,300	84,411.00	0.05
757	300078	思创医惠	16,500	84,315.00	0.05
758	002376	新北洋	10,900	84,257.00	0.05
759	601069	西部黄金	6,200	84,196.00	0.05
760	002664	长鹰信质	4,900	84,182.00	0.05
761	603118	共进股份	11,300	83,846.00	0.05
762	603609	禾丰股份	8,700	83,781.00	0.05
763	300328	宜安科技	9,850	83,725.00	0.05
764	300867	圣元环保	4,000	83,680.00	0.05
765	000950	重药控股	16,700	83,500.00	0.05
766	600337	美克家居	27,200	83,232.00	0.05
767	603416	信捷电气	2,020	83,102.80	0.05
768	002292	奥飞娱乐	17,700	83,013.00	0.05
769	300659	中孚信息	3,900	82,953.00	0.05
770	300114	中航电测	7,100	82,928.00	0.05
771	000931	中关村	12,600	82,656.00	0.05
772	300740	水羊股份	6,000	82,440.00	0.05
773	300579	数字认证	3,277	81,925.00	0.05
774	600748	上实发展	22,100	81,770.00	0.05
775	600114	东睦股份	10,240	81,715.20	0.05
776	002605	姚记科技	4,900	81,585.00	0.05
777	301029	怡合达	1,000	81,500.00	0.05
778	300429	强力新材	8,580	81,424.20	0.05
779	300183	东软载波	5,500	81,345.00	0.05
780	300607	拓斯达	6,145	81,236.90	0.05
781	002204	大连重工	18,500	80,845.00	0.05
782	603920	世运电路	4,670	80,791.00	0.05
783	603108	润达医疗	8,200	80,770.00	0.05
784	603105	芯能科技	7,200	80,496.00	0.05
785	000550	江铃汽车	5,000	80,400.00	0.05

786	300602	飞荣达	4,900	80,360.00	0.05
787	002782	可立克	4,700	80,088.00	0.05
788	600590	泰豪科技	12,200	79,666.00	0.05
789	688383	新益昌	700	79,625.00	0.05
790	300523	辰安科技	2,850	79,486.50	0.05
791	002215	诺普信	14,200	79,378.00	0.05
792	300307	慈星股份	13,000	79,170.00	0.05
793	603055	台华新材	6,300	79,128.00	0.05
794	002929	润建股份	2,200	78,980.00	0.05
795	603728	鸣志电器	3,700	78,551.00	0.05
796	300548	博创科技	4,400	78,408.00	0.05
797	601882	海天精工	3,800	78,318.00	0.05
798	300045	华力创通	10,200	78,234.00	0.05
799	600715	文投控股	31,000	78,120.00	0.05
800	603960	克来机电	3,800	78,090.00	0.05
801	002662	京威股份	21,500	78,045.00	0.05
802	603466	风语筑	4,055	78,018.20	0.05
803	300204	舒泰神	5,800	77,836.00	0.05
804	000601	韶能股份	15,400	77,616.00	0.05
805	002950	奥美医疗	6,150	77,613.00	0.05
806	002017	东信和平	6,400	77,120.00	0.05
807	002042	华孚时尚	20,400	77,112.00	0.05
808	300322	硕贝德	8,800	77,088.00	0.05
809	002918	蒙娜丽莎	4,100	76,752.00	0.05
810	300768	迪普科技	4,750	76,712.50	0.05
811	002987	京北方	3,868	76,625.08	0.05
812	688100	威胜信息	3,641	76,424.59	0.04
813	300723	一品红	2,840	76,396.00	0.04
814	000958	电投产融	16,800	76,272.00	0.04
815	300590	移为通信	5,580	75,720.60	0.04
816	603328	依顿电子	11,900	75,565.00	0.04
817	300799	左江科技	1,000	75,200.00	0.04
818	002979	雷赛智能	3,650	74,533.00	0.04
819	300134	大富科技	9,100	74,165.00	0.04
820	002530	金财互联	11,100	74,148.00	0.04
821	002267	陕天然气	10,600	74,094.00	0.04
822	002522	浙江众成	13,000	73,840.00	0.04
823	601158	重庆水务	13,800	73,830.00	0.04
823	000813	德展健康	21,400	73,830.00	0.04
824	301069	凯盛新材	1,600	73,776.00	0.04
825	300368	汇金股份	10,100	73,629.00	0.04
826	300006	莱美药业	17,700	73,455.00	0.04
827	002978	安宁股份	1,900	73,397.00	0.04
828	600032	浙江新能	5,000	73,250.00	0.04

829	605338	巴比食品	2,400	73,224.00	0.04
830	000791	甘肃电投	13,000	73,190.00	0.04
831	600710	苏美达	12,400	73,160.00	0.04
832	002803	吉宏股份	5,500	72,875.00	0.04
833	300485	赛升药业	5,900	72,865.00	0.04
834	300455	康拓红外	8,500	72,845.00	0.04
835	601330	绿色动力	9,300	72,819.00	0.04
836	002913	奥士康	2,300	72,795.00	0.04
837	300783	三只松鼠	2,900	72,645.00	0.04
838	002435	长江健康	14,800	72,372.00	0.04
839	600007	中国国贸	4,900	72,275.00	0.04
840	603208	江山欧派	1,000	72,230.00	0.04
841	000517	荣安地产	22,700	72,186.00	0.04
842	000600	建投能源	17,100	72,162.00	0.04
843	605388	均瑶健康	4,200	72,114.00	0.04
844	600569	安阳钢铁	27,400	71,788.00	0.04
845	300206	理邦仪器	7,000	71,750.00	0.04
846	300856	科思股份	1,650	71,577.00	0.04
847	000910	大亚圣象	7,800	71,526.00	0.04
848	300842	帝科股份	1,200	71,520.00	0.04
849	002344	海宁皮城	15,300	71,451.00	0.04
850	002378	章源钨业	8,800	71,104.00	0.04
851	688389	普门科技	4,058	70,974.42	0.04
852	002724	海洋王	5,700	70,851.00	0.04
853	603313	梦百合	5,900	70,800.00	0.04
854	002993	奥海科技	1,700	70,652.00	0.04
855	000048	京基智农	3,800	70,566.00	0.04
856	002232	启明信息	5,000	70,500.00	0.04
857	300829	金丹科技	2,160	70,027.20	0.04
858	300365	恒华科技	10,000	70,000.00	0.04
859	600800	渤海化学	17,000	69,870.00	0.04
860	300624	万兴科技	2,180	69,738.20	0.04
861	601700	风范股份	13,600	69,496.00	0.04
862	600996	贵广网络	10,100	69,488.00	0.04
863	600874	创业环保	10,300	69,319.00	0.04
864	300255	常山药业	11,100	69,153.00	0.04
865	688505	复旦张江	6,793	68,948.95	0.04
866	000011	深物业 A	5,100	68,901.00	0.04
867	600098	广州发展	11,000	68,860.00	0.04
868	603877	太平鸟	3,400	68,816.00	0.04
869	300386	飞天诚信	6,100	68,747.00	0.04
870	603337	杰克股份	3,200	68,736.00	0.04
871	000936	华西股份	12,700	68,707.00	0.04
872	300510	金冠股份	13,879	68,701.05	0.04

873	002301	齐心集团	10,400	68,640.00	0.04
874	300132	青松股份	9,800	68,600.00	0.04
875	002959	小熊电器	1,100	68,563.00	0.04
876	300527	中船应急	9,066	68,538.96	0.04
877	600261	阳光照明	20,300	68,411.00	0.04
878	300616	尚品宅配	2,400	68,280.00	0.04
879	003040	楚天龙	3,300	67,848.00	0.04
880	603533	掌阅科技	4,200	67,620.00	0.04
881	600618	氯碱化工	5,400	67,500.00	0.04
882	600548	深高速	7,000	66,780.00	0.04
883	300439	美康生物	5,500	66,770.00	0.04
884	300531	优博讯	4,800	66,720.00	0.04
885	688699	明微电子	600	65,076.00	0.04
886	300872	天阳科技	4,880	65,050.40	0.04
887	603359	东珠生态	5,340	64,507.20	0.04
888	002636	金安国纪	7,100	64,113.00	0.04
889	000761	本钢板材	17,800	64,080.00	0.04
890	301087	可孚医疗	1,500	63,960.00	0.04
891	300552	万集科技	2,080	63,939.20	0.04
892	603222	济民医疗	5,780	63,580.00	0.04
893	300318	博晖创新	9,700	63,438.00	0.04
894	603693	江苏新能	3,300	63,360.00	0.04
895	002303	美盈森	18,300	63,135.00	0.04
896	601949	中国出版	13,000	62,660.00	0.04
897	688222	成都先导	3,896	62,180.16	0.04
898	002991	甘源食品	900	62,091.00	0.04
899	002695	煌上煌	5,000	61,850.00	0.04
900	300215	电科院	9,000	61,830.00	0.04
901	605136	丽人丽妆	3,900	61,698.00	0.04
902	603169	兰石重装	9,300	61,659.00	0.04
903	000032	深桑达 A	4,100	61,418.00	0.04
904	600855	航天长峰	5,400	60,642.00	0.04
905	601515	东风股份	13,140	60,575.40	0.04
906	605090	九丰能源	2,980	60,404.60	0.04
907	000019	深粮控股	7,800	60,138.00	0.04
908	688085	三友医疗	2,752	59,580.80	0.04
909	002609	捷顺科技	7,700	59,521.00	0.04
910	000918	嘉凯城	25,800	59,340.00	0.03
911	002912	中新赛克	2,400	59,184.00	0.03
912	300127	银河磁体	3,100	59,179.00	0.03
913	603730	岱美股份	4,513	59,165.43	0.03
914	002651	利君股份	7,500	58,875.00	0.03
915	603626	科森科技	7,900	58,697.00	0.03
916	605009	豪悦护理	1,500	58,320.00	0.03



917	000885	城发环境	6,240	58,032.00	0.03
918	002961	瑞达期货	3,200	57,728.00	0.03
919	603610	麒盛科技	4,264	57,606.64	0.03
920	301031	中熔电气	400	57,352.00	0.03
921	003021	兆威机电	1,200	57,324.00	0.03
922	300684	中石科技	4,100	57,195.00	0.03
923	000639	西王食品	12,900	57,018.00	0.03
924	002641	公元股份	11,800	56,876.00	0.03
925	300765	新诺威	3,978	56,766.06	0.03
926	605007	五洲特纸	2,900	56,376.00	0.03
927	300791	仙乐健康	1,800	56,196.00	0.03
928	688318	财富趋势	560	56,000.00	0.03
929	003032	传智教育	3,900	55,965.00	0.03
930	603587	地素时尚	3,460	54,841.00	0.03
931	300634	彩讯股份	4,300	54,610.00	0.03
932	300981	中红医疗	2,120	53,466.40	0.03
933	603567	珍宝岛	4,500	53,415.00	0.03
934	603013	亚普股份	3,800	53,086.00	0.03
935	300441	鲍斯股份	7,800	52,650.00	0.03
936	603439	贵州三力	4,000	52,480.00	0.03
937	600935	华塑股份	10,000	52,400.00	0.03
938	001213	中铁特货	10,600	52,046.00	0.03
939	605589	圣泉集团	2,100	51,807.00	0.03
940	003009	中天火箭	1,100	51,469.00	0.03
941	605199	葫芦娃	2,900	51,185.00	0.03
942	603508	思维列控	3,776	50,560.64	0.03
943	688095	福昕软件	700	49,700.00	0.03
944	603378	亚士创能	4,228	49,298.48	0.03
945	688268	华特气体	700	49,182.00	0.03
946	603071	物产环能	2,700	48,978.00	0.03
947	301039	中集车辆	4,500	48,735.00	0.03
948	688128	中国电研	2,000	48,700.00	0.03
949	605507	国邦医药	2,000	48,300.00	0.03
950	688368	晶丰明源	300	47,958.00	0.03
951	002990	盛视科技	1,700	47,923.00	0.03
952	002792	通宇通讯	3,950	47,637.00	0.03
953	300860	锋尚文化	1,000	47,230.00	0.03
954	301090	华润材料	4,300	46,913.00	0.03
955	603093	南华期货	4,400	46,596.00	0.03
956	603258	电魂网络	2,300	46,575.00	0.03
957	601921	浙版传媒	5,900	45,902.00	0.03
958	605222	起帆电缆	2,000	45,540.00	0.03
959	603180	金牌厨柜	1,452	44,953.92	0.03
960	002880	卫光生物	1,700	44,744.00	0.03

961	002977	火箭科技	940	44,490.20	0.03
962	300942	易瑞生物	1,900	43,890.00	0.03
963	002287	奇正藏药	1,700	43,775.00	0.03
964	605008	长鸿高科	3,100	43,462.00	0.03
965	688788	科思科技	960	43,401.60	0.03
966	000058	深赛格	7,100	43,026.00	0.03
967	600903	贵州燃气	5,500	42,845.00	0.03
968	688055	龙腾光电	7,882	42,483.98	0.02
969	002970	锐明技术	1,500	42,375.00	0.02
970	003039	顺控发展	1,700	41,055.00	0.02
971	300815	玉禾田	2,360	41,040.40	0.02
972	300857	协创数据	2,000	40,980.00	0.02
973	605339	南侨食品	1,600	40,592.00	0.02
974	603053	成都燃气	4,300	40,162.00	0.02
975	301060	兰卫医学	1,100	38,522.00	0.02
976	003006	百亚股份	3,100	38,254.00	0.02
977	002975	博杰股份	1,000	38,250.00	0.02
978	603530	神马电力	2,100	36,099.00	0.02
979	605296	神农集团	1,340	34,451.40	0.02
980	300785	值得买	1,250	32,675.00	0.02
981	688001	华兴源创	1,200	32,664.00	0.02
982	601528	瑞丰银行	4,000	32,240.00	0.02
983	603171	税友股份	1,100	30,778.00	0.02
984	301078	孩子王	1,900	27,854.00	0.02
985	002911	佛燃能源	3,000	27,240.00	0.02
986	688365	光云科技	2,896	26,932.80	0.02
987	300788	中信出版	1,300	26,780.00	0.02
988	603103	横店影视	1,900	26,733.00	0.02
989	605099	共创草坪	1,000	26,590.00	0.02
990	301015	百洋医药	1,200	25,896.00	0.02
991	601279	英利汽车	3,600	24,588.00	0.01
992	600841	动力新科	2,800	24,248.00	0.01
993	688020	方邦股份	600	23,394.00	0.01
994	000982	中银绒业	10,100	22,523.00	0.01
995	301180	万祥科技	1,000	20,950.00	0.01
996	688315	诺禾致源	800	20,616.00	0.01
997	605365	立达信	1,200	19,884.00	0.01
998	603511	爱慕股份	1,100	19,217.00	0.01
999	301117	佳缘科技	120	6,532.80	0.00
1,000	301288	清研环境	311	6,213.78	0.00
1,001	301158	德石股份	265	5,400.70	0.00
1,002	301211	亨迪药业	242	5,246.56	0.00
1,003	301200	大族数控	97	5,036.24	0.00
1,004	301221	光庭信息	76	4,927.08	0.00

1,005	301258	富士莱	74	3,084.32	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	600938	中国海油	1,296,054.00	0.70
2	002405	四维图新	807,009.00	0.43
3	002432	九安医疗	598,233.00	0.32
4	688122	西部超导	552,350.34	0.30
5	002176	江特电机	498,542.00	0.27
6	000422	湖北宜化	487,651.00	0.26
7	601099	太平洋	476,370.00	0.26
8	688063	派能科技	420,572.00	0.23
9	300012	华测检测	412,288.00	0.22
10	002472	双环传动	411,991.00	0.22
11	300343	联创股份	410,197.00	0.22
12	300568	星源材质	392,563.00	0.21
13	002497	雅化集团	382,265.00	0.21
14	600872	中炬高新	381,091.00	0.21
15	601677	明泰铝业	364,918.00	0.20
16	002192	融捷股份	358,419.00	0.19
17	600873	梅花生物	335,674.00	0.18
18	002240	盛新锂能	334,384.00	0.18
19	002738	中矿资源	330,474.00	0.18
20	002044	美年健康	328,614.00	0.18

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	002497	雅化集团	1,306,969.06	0.70
2	300012	华测检测	1,263,694.00	0.68

3	300769	德方纳米	1,177,950.00	0.63
4	002240	盛新锂能	1,168,992.00	0.63
5	600096	云天化	1,131,143.00	0.61
6	688122	西部超导	1,100,965.07	0.59
7	002756	永兴材料	959,057.00	0.52
8	300073	当升科技	941,063.00	0.51
9	300390	天华超净	877,325.00	0.47
10	002407	多氟多	849,076.00	0.46
11	600499	科达制造	822,492.00	0.44
12	601058	赛轮轮胎	805,961.30	0.43
13	603026	石大胜华	799,915.00	0.43
14	002625	光启技术	755,326.00	0.41
15	000831	五矿稀土	656,544.00	0.35
16	002326	永太科技	650,863.60	0.35
17	600938	中国海油	508,602.99	0.27
18	002176	江特电机	506,773.00	0.27
19	605117	德业股份	463,418.00	0.25
20	688390	固德威	426,791.00	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	103,413,265.23
卖出股票收入（成交）总额	98,777,014.64

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国海洋石油有限公司在报告编制日前一年内曾受到香港联合交易所有限公司的公开谴责。

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,675.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	643,606.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	676,281.96

### 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	600938	中国海油	1,332,303.44	0.78	新股流通受 限

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
广发中证 1000 指数 A	4,863	10,093.78	13,172,37 1.64	26.84%	35,913,67 2.41	73.16%
广发中证 1000 指数 C	5,570	11,486.57	35,733,26 9.12	55.85%	28,246,90 0.00	44.15%
合计	10,433	10,837.36	48,905,64 0.76	43.25%	64,160,57 2.41	56.75%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持 有本基金	广发中证 1000 指数 A	5,950.71	0.0121%
	广发中证 1000 指数 C	1,735.77	0.0027%
	合计	7,686.48	0.0068%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人	广发中证 1000 指数 A	0
	广发中证 1000 指数 C	0

持有本开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 1000 指数 A	0
	广发中证 1000 指数 C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	8.85%	10,000,800.08	8.85%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	8.85%	10,000,800.08	8.85%	三年

#### 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 2 日）基金份额总额	14,265,879.01	5,410,288.42
本报告期期初基金份额总额	57,289,710.46	51,702,577.48
本报告期基金总申购份额	28,787,839.34	78,873,055.73
减：本报告期基金总赎回份额	36,991,505.75	66,595,464.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,086,044.05	63,980,169.12

## 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	
光大证券	3	200,135,823.07	100.00%	186,391.15	100.00%	-
广发证券	8	8,823.60	0.00%	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-



银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	减少 2 个
信达证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-

中泰证券	5	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

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

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	5,609,483.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

东海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

## 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	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
3	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
4	关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-19

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

### 11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 11.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日