

广发均衡增长混合型证券投资基金

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	14
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.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
7.12 投资组合报告附注.....	76

8 基金份额持有人信息	78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
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.....	79
9 开放式基金份额变动	79
10 重大事件揭示	80
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4 基金投资策略的改变.....	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
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.....	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
10.8 其他重大事件.....	81
11 备查文件目录	82
11.1 备查文件目录.....	82
11.2 存放地点.....	82
11.3 查阅方式.....	82

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发均衡增长混合型证券投资基金	
基金简称	广发均衡增长混合	
基金主代码	010534	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 27 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,001,671,671.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
下属分级基金的交易代码	010534	010535
报告期末下属分级基金的份额总额	2,893,576,244.10 份	108,095,427.72 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	罗菲菲
	联系电话	020-83936666	010-58560666
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95568
传真		020-89899158	010-57093382

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2号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码	510308	100031
法定代表人	孙树明	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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）	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
本期已实现收益	-207,559,237.58	-7,916,369.12
本期利润	-174,381,241.03	-6,134,537.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0571	-0.0530
本期加权平均净值利润率	-5.75%	-5.35%
本期基金份额净值增长率	-4.96%	-5.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
期末可供分配利润	-61,142,284.44	-2,656,910.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0211	-0.0246
期末基金资产净值	2,914,839,001.02	108,502,469.28
期末基金份额净值	1.0073	1.0038

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
基金份额累计净值增长率	0.73%	0.38%

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

广发均衡增长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.23%	0.44%	3.53%	0.42%	0.70%	0.02%
过去三个月	1.97%	0.77%	2.83%	0.58%	-0.86%	0.19%
过去六个月	-4.96%	0.77%	-2.81%	0.58%	-2.15%	0.19%
过去一年	-2.80%	0.61%	-1.92%	0.49%	-0.88%	0.12%
自基金合同生效起至今	0.73%	0.53%	-2.01%	0.48%	2.74%	0.05%

广发均衡增长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.22%	0.45%	3.53%	0.42%	0.69%	0.03%
过去三个月	1.92%	0.77%	2.83%	0.58%	-0.91%	0.19%
过去六个月	-5.07%	0.77%	-2.81%	0.58%	-2.26%	0.19%
过去一年	-3.03%	0.61%	-1.92%	0.49%	-1.11%	0.12%
自基金合同生效起至今	0.38%	0.53%	-2.01%	0.48%	2.39%	0.05%

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

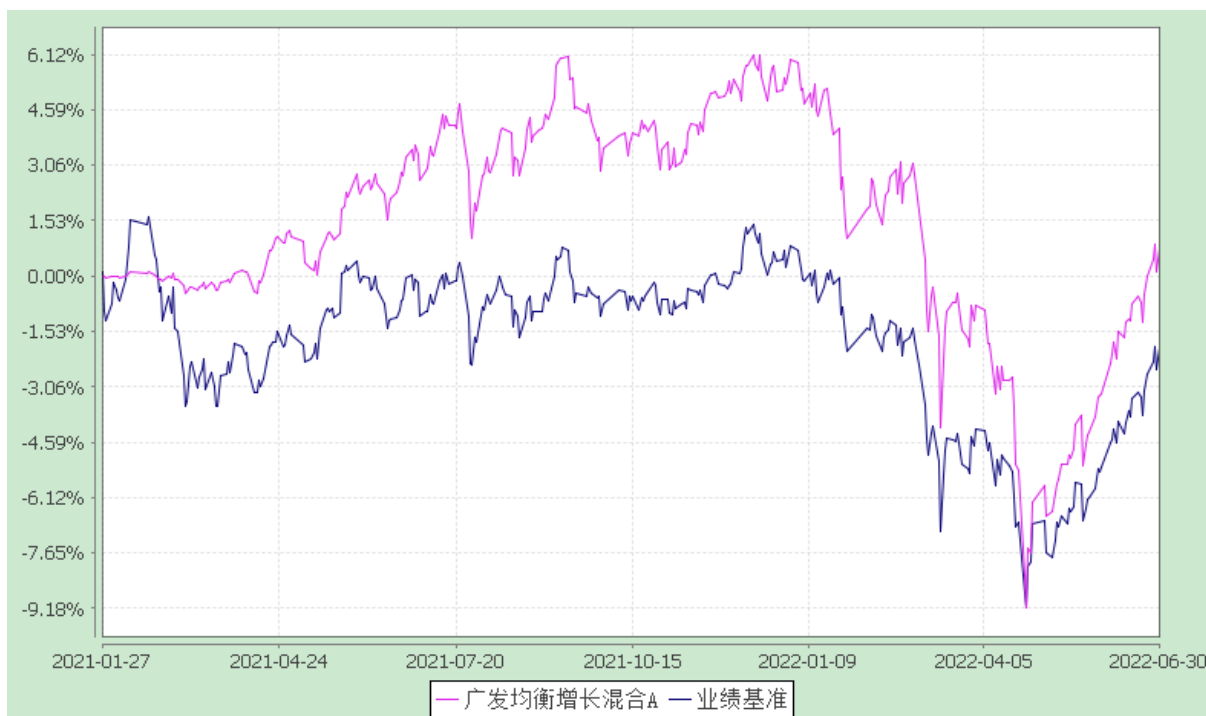
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发均衡增长混合型证券投资基金

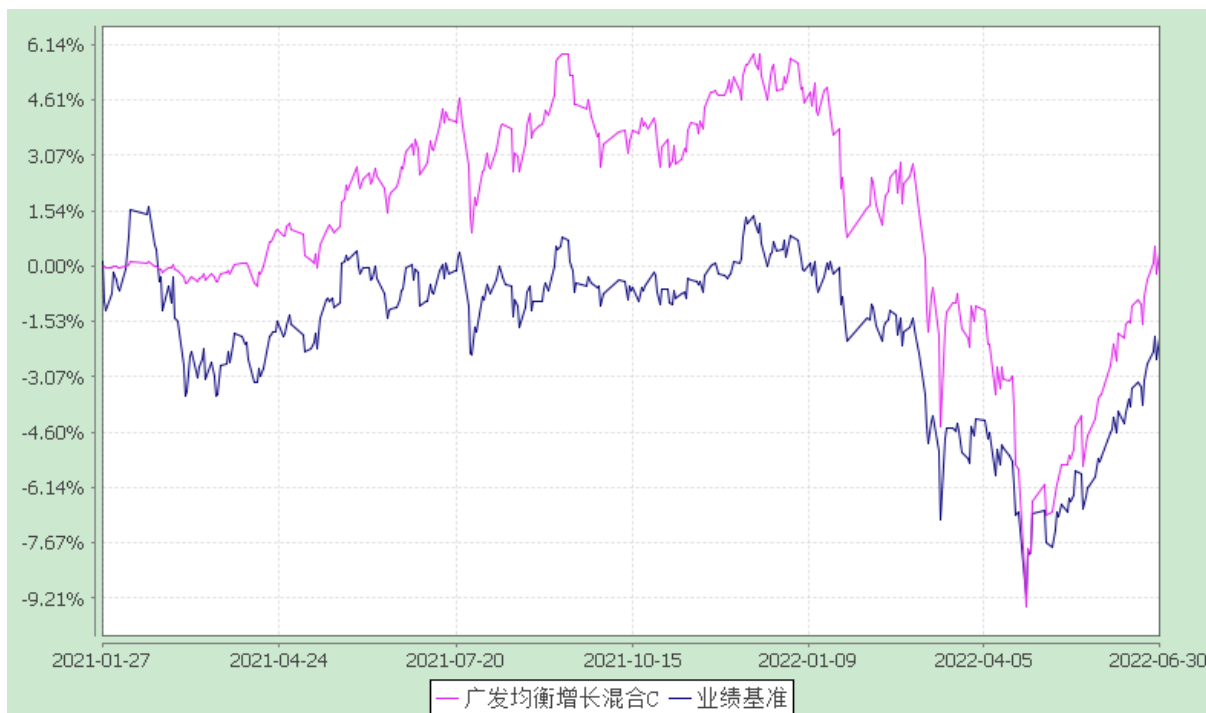
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 1 月 27 日至 2022 年 6 月 30 日)

广发均衡增长混合 A



广发均衡增长混合 C



注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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

					基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)、广发价值回报混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 4 月 29 日至 2021 年 7 月 16 日)。
李阳	本基金的基金经理；广发睿享稳健增利混合型证券投资基金的基金经理	2021-05-20	-	6 年	李阳先生，工程硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国工商银行股份有限公司产品研发中心产品经理，新时代证券股份有限公司资产管理总部量化研究员、量化投资经理，泰康养老保险股份有限公司养老金投资部高级投资经理，广发基金管理有限公司资产配置部研究员。
洪志	本基金的基金经理；广发汇兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇吉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇荣 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发景辉纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发景宏	2021-08-27	-	9 年	洪志先生，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易兼研究员、投资经理、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发集裕债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 1 月 27 日)、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 4 月 8 日)、广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 9 月 22 日)、广发汇宏 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 10 月 14 日)、广发

	债券型证券投资基金的基金经理				汇立定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 10 月 25 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 1 月至 4 月，权益市场下跌幅度较大，伴随 5 月与 6 月的市场反弹，跌幅在一定程度上有所修复。上半年，上证综指跌幅为 6.63%，沪深 300 跌幅为 9.22%，中证 500 跌幅为 12.30%。

上半年，债券市场总体震荡，关键期限利率分化较为明显。其中，长端利率走平的主要影响因素为政策着力于稳增长和宽信用，地产、财政等政策较为宽松；但与此同时，疫情的反复对基本面形成冲击。因此，上半年的基本面预期受到较大扰动。相比较而言，在资金面持续宽松的环境下，中短端的息差和杠杆策略确定性较高，导致中短端利率下行幅度明显更大。总结来看，上半年债市收益率整体震荡，收益率曲线明显陡峭化。

在权益操作层面，本基金运用多种策略进行管理，行业和风格保持均衡配置，个股分散度较高，注重组合整体的收益风险比。在债券操作层面，本组合密切跟踪市场动向，灵活调整持仓券种结构、组合杠杆和久期分布。

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-4.96%，C 类基金份额净值增长率为-5.07%，同期业绩比较基准收益率为-2.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在疫情基本可控的假设下，国内生产和需求或将有一定回补，基本面的渐进修复仍是主基调，但出口面临海外总需求回落的风险，国内地产面临周期下行风险，因此预计经济的向上弹性较为有限。货币政策预期维持稳定观望。综上所述，预计下半年权益市场和债券市场仍难以摆脱震荡格局，我们将注重控制本组合的回撤风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程

序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资

运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发均衡增长混合型证券投资基金

报告截止日：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	18,413,645.43	75,022,562.59
结算备付金		27,340,945.86	93,592,299.88
存出保证金		34,328,000.56	8,106,751.51
交易性金融资产	6.4.7.2	2,411,265,685.30	3,124,392,220.82
其中：股票投资		1,343,165,963.44	1,467,959,651.39
基金投资		-	-
债券投资		1,068,099,721.86	1,426,249,569.43
资产支持证券投资		-	230,183,000.00
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	541,994,558.90	440,030,650.05
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		3,943,702.19	19,780,851.68
应收股利		-	-

应收申购款		22,398.50	58,701.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	22,782,049.62
资产总计		3,037,308,936.74	3,783,766,087.70
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		-	-
应付赎回款		7,900,901.17	22,581,539.18
应付管理人报酬		2,953,764.52	4,003,116.14
应付托管费		492,294.11	667,186.01
应付销售服务费		23,639.83	29,399.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,367.27	261,288.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	2,564,499.54	3,180,645.70
负债合计		13,967,466.44	30,723,174.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	3,001,671,671.82	3,541,346,997.81
未分配利润	6.4.7.9	21,669,798.48	211,695,915.29
净资产合计		3,023,341,470.30	3,753,042,913.10
负债和净资产总计		3,037,308,936.74	3,783,766,087.70

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，广发均衡增长混合 A 基金份额净值人民币 1.0073 元，基金份额总额 2,893,576,244.10 份；广发均衡增长混合 C 基金份额净值人民币 1.0038 元，基金份额总额 108,095,427.72 份；总份额总额 3,001,671,671.82 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：广发均衡增长混合型证券投资基金

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 27 日 (基 金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-158,298,968.90	327,517,217.41
1.利息收入		1,901,012.28	74,333,998.88
其中：存款利息收入	6.4.7.10	678,594.82	7,780,389.67
债券利息收入		-	52,985,509.91
资产支持证券利息收入		-	1,906,361.87
买入返售金融资产收入		1,222,417.46	11,661,737.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-195,236,170.82	142,518,123.74
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-163,054,863.27	112,896,712.26
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	22,203,987.13	1,325,244.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	2,546,994.18	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-72,533,365.28	3,969,116.51
股利收益	6.4.7.17	15,601,076.42	24,327,050.97
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	34,959,828.63	108,048,368.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	76,361.01	2,616,726.28
减：二、营业总支出		22,216,809.17	59,228,179.07
1. 管理人报酬		18,777,979.26	39,235,165.38
2. 托管费		3,129,663.23	6,539,194.22
3. 销售服务费		142,187.52	309,999.64
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	30,472.61
其中：卖出回购金融资产支出		-	30,472.61
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		29,264.48	108,170.02
8. 其他费用	6.4.7.21	137,714.68	13,005,177.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		-180,515,778.07	268,289,038.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-180,515,778.07	268,289,038.34

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-180,515,778.07	268,289,038.34

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：广发均衡增长混合型证券投资基金

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）	3,541,346,997.81	211,695,915.29	3,753,042,913.10
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,541,346,997.81	211,695,915.29	3,753,042,913.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-539,675,325.99	-190,026,116.81	-729,701,442.80
（一）、综合收益总额	-	-180,515,778.07	-180,515,778.07
（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）	-539,675,325.99	-9,510,338.74	-549,185,664.73
其中：1.基金申购款	23,285,998.73	-656,202.11	22,629,796.62
2.基金赎回款	-562,961,324.72	-8,854,136.63	-571,815,461.35
（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）	3,001,671,671.82	21,669,798.48	3,023,341,470.30

项目	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	7,931,476,515.48	-	7,931,476,515.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,012,808,459.92	250,554,970.24	-762,253,489.68
（一）、综合收益总额	-	268,289,038.34	268,289,038.34
（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）	-1,012,808,459.92	-17,734,068.10	-1,030,542,528.02
其中：1.基金申购款	19,750,133.83	254,439.42	20,004,573.25
2.基金赎回款	-1,032,558,593.75	-17,988,507.52	-1,050,547,101.27
（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）	6,918,668,055.56	250,554,970.24	7,169,223,025.80

注：本基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日，上年度可比期间不完整。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发均衡增长混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2020]2629 号《关于准予广发均衡增长混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》

等有关规定和《广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2021 年 1 月 25 日向社会公开发行人募集并于 2021 年 1 月 27 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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

本基金的财务报表于 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 75,022,562.59 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 24,288.07 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 75,046,850.66 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 93,592,299.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 29,497.70 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 93,621,797.58 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 8,106,751.51 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 526.90 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 8,107,278.41 元。

买入返售金融资产于 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 440,030,650.05 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 84,994.10 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，买入返售金融资产于 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 440,115,644.15 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 22,782,049.62 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 24,288.07 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 29,497.70 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 526.90 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 22,642,742.85 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 84,994.10 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。

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 3,124,392,220.82 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 22,642,742.85 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 3,147,034,963.67 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	18,413,645.43

等于：本金	18,402,571.21
加：应计利息	11,074.22
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	18,413,645.43

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	1,241,009,455.41	-	1,343,165,963.44	102,156,508.03	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	243,882,603.65	800,978.57	248,100,190.90	3,416,608.68
	银行间市场	812,175,687.55	6,561,530.96	819,999,530.96	1,262,312.45
	合计	1,056,058,291.20	7,362,509.53	1,068,099,721.86	4,678,921.13
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,297,067,746.61	7,362,509.53	2,411,265,685.30	106,835,429.16	

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-216,504,668.24	-	-	-
其中：股指期货投资	-216,504,668.24	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-216,504,668.24	-	-	-

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
IC2209	IC2209	-175.00	-222,740,000.00	-6,235,331.76
合计	-	-	-	-6,235,331.76
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-6,235,331.76
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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	541,994,558.90	-
合计	541,994,558.90	-

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	293.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,385,002.58
其中：交易所市场	2,359,779.72
银行间市场	25,222.86
应付利息	-
预提费用	179,203.31
合计	2,564,499.54

6.4.7.8 实收基金

广发均衡增长混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	3,415,068,627.32	3,415,068,627.32
本期申购	11,697,127.70	11,697,127.70
本期赎回（以“-”号填列）	-533,189,510.92	-533,189,510.92
本期末	2,893,576,244.10	2,893,576,244.10

广发均衡增长混合 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	126,278,370.49	126,278,370.49
本期申购	11,588,871.03	11,588,871.03
本期赎回（以“-”号填列）	-29,771,813.80	-29,771,813.80
本期末	108,095,427.72	108,095,427.72

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

广发均衡增长混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	165,840,564.65	38,605,751.26	204,446,315.91

本期利润	-207,559,237.58	33,177,996.55	-174,381,241.03
本期基金份额交易产生的变动数	-19,423,611.51	10,621,293.55	-8,802,317.96
其中：基金申购款	314,697.23	-416,671.18	-101,973.95
基金赎回款	-19,738,308.74	11,037,964.73	-8,700,344.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-61,142,284.44	82,405,041.36	21,262,756.92

广发均衡增长混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,824,993.62	1,424,605.76	7,249,599.38
本期利润	-7,916,369.12	1,781,832.08	-6,134,537.04
本期基金份额交易产生的变动数	-565,535.36	-142,485.42	-708,020.78
其中：基金申购款	-144,782.09	-409,446.07	-554,228.16
基金赎回款	-420,753.27	266,960.65	-153,792.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,656,910.86	3,063,952.42	407,041.56

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	356,732.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	9,112.42
结算备付金利息收入	312,750.08
其他	-
合计	678,594.82

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	3,749,869,254.70
减：卖出股票成本总额	3,903,004,957.69
减：交易费用	9,919,160.28
买卖股票差价收入	-163,054,863.27

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	15,685,791.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,518,195.43
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	22,203,987.13

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	2,911,618,055.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,874,103,589.09
减：应计利息总额	30,959,785.51
减：交易费用	36,485.13
买卖债券差价收入	6,518,195.43

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,785,207.97
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	761,786.21
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,546,994.18

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

卖出资产支持证券成交总额	233,535,214.92
减：卖出资产支持证券成本总额	229,994,700.27
减：应计利息总额	2,778,256.02
减：交易费用	472.42
资产支持证券投资收益	761,786.21

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	-72,612,537.28
国债期货投资收益	79,172.00

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	15,601,076.42
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	15,601,076.42

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	41,522,182.39
——股票投资	48,024,887.60
——债券投资	-6,314,405.48
——资产支持证券投资	-188,299.73
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-6,562,353.76
——权证投资	-
——股指期货投资	-6,800,803.76
——国债期货投资	238,450.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-

合计	34,959,828.63
----	---------------

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	73,726.49
基金转换费收入	984.52
其他	1,650.00
合计	76,361.01

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	22,911.37
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	137,714.68

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
中国民生银行股份有限公司	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
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司、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

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股票交易。

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27日（基金合同 生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,777,979.26	39,235,165.38
其中：支付销售机构的客户维护费	9,142,972.92	19,149,976.99

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月27日（基金合同 生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,129,663.23	6,539,194.22

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C	合计
中国民生银行股份有限公司	-	110,807.20	110,807.20
广发基金管理有限公司	-	5,165.91	5,165.91
广发证券股份有限公司	-	436.07	436.07
合计	-	116,409.18	116,409.18
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27日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C	合计
中国民生银行股份有限公司	-	249,975.40	249,975.40
广发基金管理有限公司	-	6,626.64	6,626.64
广发证券股份有限公司	-	549.28	549.28
合计	-	257,151.32	257,151.32

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人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

广发均衡增长混合 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。

广发均衡增长混合 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27日（基金合同生效 日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	18,413,645.4 3	356,732.32	35,881,458.3 7	722,218.08

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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：）	总金额

				股/张)	
广发证券股份有限公司	2205781	22 黑龙江债 15	一级市场 分销	100,000.00	10,000,000.00
上年度可比期间 2021 年 1 月 27 日 (基金合同生效日) 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	-	-	-	-	-

6.4.10.8 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。

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
688261	东微半导体	2022-01-26	6 个月	新股流通受限	130.00	230.70	2,645.00	343,850.00	610,201.50	20220628 除权除息, 派息比例 0.3300 (含税)
688322	奥比中光-UW	2022-06-30	1 个月内 (含)	新股流通受限	30.99	30.99	8,529.00	264,313.71	264,313.71	-
301139	元道通信	2022-06-30	1 个月内 (含)	新股流通受限	38.46	38.46	5,085.00	195,569.10	195,569.10	-
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)
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	新股 流通 受限	163.56	82.76	403.00	43,997.64	33,352.28	20220610 除 权除 息,派 息比 例 2.0000 (含 税),转 增比 例 0.5000
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	1,837.00	42,642.25	29,649.18	20220617 除 权除 息,派 息比 例 0.3800 (含 税),转 增比 例 0.5000
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新股 流通 受限	52.03	56.42	466.00	24,245.98	26,291.72	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6 个月	新股 流通 受限	72.69	71.54	353.00	25,659.57	25,253.62	20220527 除 权除 息,派 息比 例 0.4500 (含税)

30126 6	宇邦 新材	2022-0 5-30	6 个月	新股 流通 受限	26.86	47.07	517.00	13,886 .62	24,335 .19	-
30126 8	铭利 达	2022-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	28.50	34.87	641.00	18,268 .50	22,351 .67	-
30113 9	元道 通信	2022-0 6-30	6 个月	新股 流通 受限	38.46	38.46	566.00	21,768 .36	21,768 .36	-
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	-
30116 2	国能 日新	2022-0 4-19	6 个月	新股 流通 受限	45.13	54.11	334.00	15,073 .42	18,072 .74	20220 614 除 权除 息,派 息比 例 0.4500 (含税)
30115 3	中科 江南	2022-0 5-10	6 个月	新股 流通 受限	33.68	43.98	398.00	13,404 .64	17,504 .04	-
30112 3	奕东 电子	2022-0 1-14	6 个月	新股 流通 受限	37.23	25.39	656.00	24,422 .88	16,655 .84	20220 609 除 权除 息,派 息比 例 0.3000 (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
30123 5	华康 医疗	2022-0 1-21	6 个月	新股 流通 受限	39.30	37.93	418.00	16,427 .40	15,854 .74	2022 518 除 权除 息,派 息比 例 0.1000 (含税)
30116 0	翔楼 新材	2022-0 5-25	6 个月	新股 流通 受限	31.56	37.66	392.00	12,371 .52	14,762 .72	-
301117	佳缘 科技	2022-0 1-07	6 个月	新股 流通 受限	46.80	54.44	262.00	12,261 .60	14,263 .28	2022 517 除 权除 息,派 息比 例 0.4000 (含税)
30124 8	杰创 智能	2022-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	39.07	29.87	472.00	18,441 .04	14,098 .64	2022 617 除 权除 息,派 息比 例 0.2000 (含税)
30121 2	联盛 化学	2022-0 4-07	6 个月	新股 流通 受限	29.67	33.28	416.00	12,342 .72	13,844 .48	2022 629 除 权除 息,派 息比 例 0.2050 (含税)
30129 8	东利 机械	2022-0 5-27	6 个月	新股 流通 受限	12.68	20.83	634.00	8,039. 12	13,206 .22	-
30114	嘉戎	2022-0	6 个月	新股	38.39	23.90	516.00	19,809	12,332	20220

8	技术	4-14		流通受限				.24	.40	621 除权除息,派息比例 0.5200 (含税)
301258	富士莱	2022-03-21	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	295.00	14,248.50	12,295.60	20220608 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新股流通受限	18.39	24.94	483.00	8,882.37	12,046.02	-
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)
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)
30128 8	清研 环境	2022-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	19.09	19.98	452.00	8,628. 68	9,030. 96	-
30112 5	腾亚 精工	2022-0 5-27	6 个月	新股 流通 受限	22.49	27.42	327.00	7,354. 23	8,966. 34	-
30113 0	西点 药业	2022-0 2-16	6 个月	新股 流通 受限	22.55	37.70	237.00	5,344. 35	8,934. 90	20220 630 除 权除 息,派 息比 例 0.1300 (含税)
30113 5	瑞德 智能	2022-0 4-01	6 个月	新股 流通 受限	31.98	26.26	338.00	10,809 .24	8,875. 88	20220 615 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	20220 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	20220 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	41.52	41.52	158.00	6,560. 16	6,560. 16	-

				受限							
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	
149965	22 广金 K1	2022-06-28	1 个月内(含)	新债流通受限	99.99	100.01	300,000.00	29,998,257.53	30,003,484.93	-	
113060	浙 22 转债	2022-06-15	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	780.00	78,000.00	78,005.81	-	

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
000957	中通客车	2022-06-22	重大事项停牌	21.32	2022-07-06	19.19	977,200.00	4,205,719.99	20,833,904.00	-

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	172,035,720.55	120,250,000.00
合计	172,035,720.55	120,250,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	180,143,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	180,143,000.00

注：1、资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	557,273,963.91	789,874,978.30
AAA 以下	78,019,184.25	285,664,591.13
未评级	260,770,853.15	230,460,000.00
合计	896,064,001.31	1,305,999,569.43

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	-	50,040,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	50,040,000.00

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	18,413,645.43	-	-	-	18,413,645.43
结算备付金	27,340,945.86	-	-	-	27,340,945.86
存出保证金	34,328,000.56	-	-	-	34,328,000.56
交易性金融资产	323,933,669.08	723,366,442.37	20,799,610.41	1,343,165,963.44	2,411,265,685.30
买入返售金融资产	541,994,558.90	-	-	-	541,994,558.90
应收清算款	-	-	-	3,943,702.19	3,943,702.19
应收申购款	-	-	-	22,398.50	22,398.50
资产总计	946,010,819.83	723,366,442.37	20,799,610.41	1,347,132,064.13	3,037,308,936.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,900,901.17	7,900,901.17
应付管理人报酬	-	-	-	2,953,764.52	2,953,764.52
应付托管费	-	-	-	492,294.11	492,294.11
应付销售服务费	-	-	-	23,639.83	23,639.83
应交税费	-	-	-	32,367.27	32,367.27

其他负债	-	-	-	2,564,499.54	2,564,499.54
负债总计	-	-	-	13,967,466.44	13,967,466.44
利率敏感度缺口	946,010,819.83	723,366,442.37	20,799,610.41	1,333,164,597.69	3,023,341,470.30
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	75,022,562.59	-	-	-	75,022,562.59
结算备付金	93,592,299.88	-	-	-	93,592,299.88
存出保证金	8,106,751.51	-	-	-	8,106,751.51
交易性金融资产	701,745,569.43	819,792,000.00	134,895,000.00	1,467,959,651.39	3,124,392,220.82
买入返售金融资产	440,030,650.05	-	-	-	440,030,650.05
应收证券清算款	-	-	-	19,780,851.68	19,780,851.68
应收利息	-	-	-	22,782,049.62	22,782,049.62
应收申购款	-	-	-	58,701.55	58,701.55
资产总计	1,318,497,833.46	819,792,000.00	134,895,000.00	1,510,581,254.24	3,783,766,087.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,581,539.18	22,581,539.18
应付管理人报酬	-	-	-	4,003,116.14	4,003,116.14
应付托管费	-	-	-	667,186.01	667,186.01
应付销售服务费	-	-	-	29,399.15	29,399.15
应付交易费用	-	-	-	2,987,644.72	2,987,644.72
应交税费	-	-	-	261,288.42	261,288.42
其他负债	-	-	-	193,000.98	193,000.98
负债总计	-	-	-	30,723,174.60	30,723,174.60
利率敏感度缺口	1,318,497,833.46	819,792,000.00	134,895,000.00	1,479,858,079.64	3,753,042,913.10

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-5,315,598.73	-7,312,520.66
	市场利率下降 25 个基点	5,370,135.03	7,370,716.04

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	1,343,165,963.44	44.43	1,467,959,651.39	39.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	126,101,122.40	4.17	110,278,569.43	2.94
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	1,469,267,085.84	48.60	1,578,238,220.82	42.05

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%	67,081,636.10	75,449,774.84
	下降 5%	-67,081,636.10	-75,449,774.84

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	1,436,429,152.34
第二层次	973,471,561.15
第三层次	1,364,971.81
合计	2,411,265,685.30

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	1,343,165,963.44	44.22
	其中：普通股	1,343,165,963.44	44.22
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,068,099,721.86	35.17
	其中：债券	1,068,099,721.86	35.17
	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	541,994,558.90	17.84
	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	45,754,591.29	1.51
8	其他各项资产	38,294,101.25	1.26
9	合计	3,037,308,936.74	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	11,270,389.57	0.37
B	采矿业	54,693,838.72	1.81
C	制造业	809,757,365.79	26.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,118,705.65	1.36
E	建筑业	20,226,250.40	0.67
F	批发和零售业	21,636,498.84	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	30,751,540.52	1.02
H	住宿和餐饮业	12,580.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,493,008.51	2.07

J	金融业	200,569,906.84	6.63
K	房地产业	25,852,986.58	0.86
L	租赁和商务服务业	19,501,087.39	0.65
M	科学研究和技术服务业	23,667,340.66	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	2,427,278.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,859,041.67	0.19
R	文化、体育和娱乐业	6,438,214.30	0.21
S	综合	6,889,930.00	0.23
	合计	1,343,165,963.44	44.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	15,701	32,108,545.00	1.06
2	000957	中通客车	977,200	20,833,904.00	0.69
3	600036	招商银行	436,425	18,417,135.00	0.61
4	600256	广汇能源	1,361,800	14,353,372.00	0.47
5	000568	泸州老窖	52,101	12,844,980.54	0.42
6	601615	明阳智能	354,900	11,995,620.00	0.40
7	300363	博腾股份	153,000	11,932,470.00	0.39
8	601166	兴业银行	586,300	11,667,370.00	0.39
9	600438	通威股份	184,300	11,032,198.00	0.36
10	000733	振华科技	79,718	10,839,256.46	0.36
11	000333	美的集团	171,440	10,353,261.60	0.34
12	600873	梅花生物	860,000	9,700,800.00	0.32
13	300750	宁德时代	17,905	9,561,270.00	0.32
14	000858	五粮液	42,670	8,616,353.10	0.28
15	600926	杭州银行	543,034	8,134,649.32	0.27
16	000001	平安银行	540,900	8,102,682.00	0.27
17	600887	伊利股份	206,200	8,031,490.00	0.27
18	601128	常熟银行	1,044,500	7,979,980.00	0.26
19	300803	指南针	134,700	7,917,666.00	0.26
20	300482	万孚生物	187,000	7,612,770.00	0.25

21	002384	东山精密	331,700	7,605,881.00	0.25
22	600089	特变电工	273,300	7,485,687.00	0.25
23	603259	药明康德	71,693	7,455,355.07	0.25
24	300896	爱美客	12,400	7,440,124.00	0.25
25	600030	中信证券	339,587	7,355,454.42	0.24
26	600233	圆通速递	359,000	7,320,010.00	0.24
27	300390	天华超净	83,300	7,280,420.00	0.24
28	300059	东方财富	282,207	7,168,057.80	0.24
29	601318	中国平安	151,900	7,092,211.00	0.23
30	000625	长安汽车	408,070	7,067,772.40	0.23
31	300498	温氏股份	331,100	7,049,119.00	0.23
32	600809	山西汾酒	21,444	6,965,011.20	0.23
33	300037	新宙邦	130,417	6,854,717.52	0.23
34	600141	兴发集团	154,700	6,805,253.00	0.23
35	002304	洋河股份	36,500	6,684,975.00	0.22
36	600522	中天科技	284,800	6,578,880.00	0.22
37	601009	南京银行	615,160	6,409,967.20	0.21
38	002191	劲嘉股份	590,700	6,332,304.00	0.21
39	002240	盛新锂能	104,000	6,277,440.00	0.21
40	601398	工商银行	1,299,900	6,200,523.00	0.21
41	600803	新奥股份	327,240	6,083,391.60	0.20
42	601238	广汽集团	393,900	6,003,036.00	0.20
43	000988	华工科技	257,200	5,959,324.00	0.20
44	000970	中科三环	313,930	5,895,605.40	0.20
45	601088	中国神华	173,200	5,767,560.00	0.19
46	600315	上海家化	133,100	5,690,025.00	0.19
47	002142	宁波银行	158,290	5,668,364.90	0.19
48	600380	健康元	445,800	5,505,630.00	0.18
49	605088	冠盛股份	401,500	5,412,220.00	0.18
50	002180	纳思达	106,100	5,370,782.00	0.18
51	600705	中航产融	1,544,400	5,343,624.00	0.18
52	002756	永兴材料	34,900	5,312,129.00	0.18
53	600900	长江电力	229,500	5,306,040.00	0.18
54	600392	盛和资源	233,600	5,279,360.00	0.17
55	601555	东吴证券	750,880	5,203,598.40	0.17
56	601012	隆基绿能	77,828	5,185,679.64	0.17
57	002468	申通快递	432,000	5,149,440.00	0.17
58	601939	建设银行	833,100	5,048,586.00	0.17
59	601456	国联证券	410,800	5,040,516.00	0.17
60	002821	凯莱英	17,200	4,970,800.00	0.16
61	002216	三全食品	250,510	4,907,490.90	0.16
62	688556	高测股份	59,780	4,824,246.00	0.16
63	601872	招商轮船	836,900	4,820,544.00	0.16
64	603392	万泰生物	30,990	4,812,747.00	0.16

65	603868	飞科电器	63,500	4,810,125.00	0.16
66	000553	安道麦 A	393,000	4,759,230.00	0.16
67	600282	南钢股份	1,493,400	4,704,210.00	0.16
68	002182	云海金属	187,000	4,689,960.00	0.16
69	601288	农业银行	1,544,600	4,664,692.00	0.15
70	002841	视源股份	61,800	4,654,776.00	0.15
71	600325	华发股份	614,700	4,653,279.00	0.15
72	601838	成都银行	279,600	4,635,768.00	0.15
73	600919	江苏银行	646,100	4,600,232.00	0.15
74	600348	华阳股份	295,100	4,562,246.00	0.15
75	300170	汉得信息	503,900	4,540,139.00	0.15
76	003019	宸展光电	177,685	4,484,769.40	0.15
77	300347	泰格医药	39,100	4,474,995.00	0.15
78	601233	桐昆股份	279,200	4,433,696.00	0.15
79	300615	欣天科技	401,086	4,419,967.72	0.15
80	000627	天茂集团	1,294,100	4,412,881.00	0.15
81	300196	长海股份	232,300	4,388,147.00	0.15
82	300373	扬杰科技	61,574	4,387,147.50	0.15
83	300639	凯普生物	205,159	4,386,299.42	0.15
84	300445	康斯特	382,000	4,377,720.00	0.14
85	002422	科伦药业	231,700	4,332,790.00	0.14
86	000519	中兵红箭	148,082	4,316,590.30	0.14
87	603599	广信股份	152,900	4,304,135.00	0.14
88	003000	劲仔食品	477,100	4,246,190.00	0.14
89	002555	三七互娱	198,700	4,218,401.00	0.14
90	600566	济川药业	155,100	4,212,516.00	0.14
91	000415	渤海租赁	1,938,600	4,206,762.00	0.14
92	688303	大全能源	60,200	4,112,864.00	0.14
93	605358	立昂微	60,748	4,093,200.24	0.14
94	300138	晨光生物	258,200	4,020,174.00	0.13
95	000738	航发控制	141,900	3,987,390.00	0.13
96	002085	万丰奥威	740,700	3,977,559.00	0.13
97	002475	立讯精密	117,700	3,977,083.00	0.13
98	601117	中国化学	418,800	3,940,908.00	0.13
99	002405	四维图新	260,600	3,927,242.00	0.13
100	300308	中际旭创	126,400	3,924,720.00	0.13
101	000983	山西焦煤	291,600	3,904,524.00	0.13
102	002273	水晶光电	320,000	3,875,200.00	0.13
103	000060	中金岭南	868,100	3,871,726.00	0.13
104	300244	迪安诊断	124,300	3,865,730.00	0.13
105	002594	比亚迪	11,500	3,835,135.00	0.13
106	002643	万润股份	183,400	3,825,724.00	0.13
107	002966	苏州银行	624,300	3,808,230.00	0.13
108	600765	中航重机	118,100	3,800,458.00	0.13

109	300268	佳沃食品	127,300	3,787,175.00	0.13
110	003004	声迅股份	178,700	3,727,682.00	0.12
111	000513	丽珠集团	101,800	3,686,178.00	0.12
112	300662	科锐国际	70,700	3,668,623.00	0.12
113	003033	征和工业	134,800	3,612,640.00	0.12
114	603605	珀莱雅	21,864	3,611,495.52	0.12
115	000778	新兴铸管	743,900	3,585,598.00	0.12
116	601689	拓普集团	51,500	3,524,145.00	0.12
117	000090	天健集团	501,800	3,457,402.00	0.11
118	000009	中国宝安	254,700	3,435,903.00	0.11
119	600673	东阳光	377,200	3,391,028.00	0.11
120	600690	海尔智家	123,286	3,385,433.56	0.11
121	600639	浦东金桥	247,900	3,368,961.00	0.11
122	300418	昆仑万维	208,900	3,342,400.00	0.11
123	000598	兴蓉环境	650,900	3,326,099.00	0.11
124	600970	中材国际	342,700	3,320,763.00	0.11
125	300316	晶盛机电	48,228	3,259,730.52	0.11
126	300124	汇川技术	49,398	3,253,846.26	0.11
127	601328	交通银行	651,200	3,242,976.00	0.11
128	600660	福耀玻璃	77,000	3,219,370.00	0.11
129	000883	湖北能源	629,300	3,215,723.00	0.11
130	000987	越秀金控	456,510	3,209,265.30	0.11
131	601988	中国银行	975,800	3,181,108.00	0.11
132	600570	恒生电子	72,620	3,161,874.80	0.10
133	000651	格力电器	93,300	3,146,076.00	0.10
134	600176	中国巨石	179,024	3,116,807.84	0.10
135	601231	环旭电子	216,600	3,110,376.00	0.10
136	600153	建发股份	236,700	3,093,669.00	0.10
137	600863	内蒙华电	835,500	3,049,575.00	0.10
138	600415	小商品城	546,300	3,042,891.00	0.10
139	300637	扬帆新材	402,600	3,031,578.00	0.10
140	000402	金融街	505,900	3,010,105.00	0.10
141	000563	陕国投 A	963,500	3,006,120.00	0.10
142	603337	杰克股份	138,915	2,983,894.20	0.10
143	002010	传化智联	459,700	2,955,871.00	0.10
144	601225	陕西煤业	137,700	2,916,486.00	0.10
145	600389	江山股份	47,400	2,878,602.00	0.10
146	000631	顺发恒业	760,620	2,859,931.20	0.09
147	600050	中国联通	823,000	2,847,580.00	0.09
148	300012	华测检测	121,454	2,818,947.34	0.09
149	000999	华润三九	62,500	2,812,500.00	0.09
150	002487	大金重工	67,200	2,804,256.00	0.09
151	000552	靖远煤电	650,400	2,803,224.00	0.09
152	002352	顺丰控股	49,500	2,762,595.00	0.09

153	600383	金地集团	203,200	2,731,008.00	0.09
154	601098	中南传媒	287,406	2,713,112.64	0.09
155	002839	张家港行	509,340	2,694,408.60	0.09
156	000559	万向钱潮	451,108	2,679,581.52	0.09
157	002042	华孚时尚	706,300	2,669,814.00	0.09
158	000997	新大陆	201,100	2,656,531.00	0.09
159	601717	郑煤机	182,800	2,634,148.00	0.09
160	000063	中兴通讯	102,600	2,619,378.00	0.09
161	002807	江阴银行	568,200	2,573,946.00	0.09
162	600499	科达制造	124,500	2,569,680.00	0.08
163	600968	海油发展	994,600	2,566,068.00	0.08
164	601298	青岛港	462,500	2,529,875.00	0.08
165	600120	浙江东方	628,800	2,521,488.00	0.08
166	600563	法拉电子	12,200	2,502,952.00	0.08
167	300957	贝泰妮	11,500	2,501,595.00	0.08
168	000725	京东方 A	632,400	2,491,656.00	0.08
169	300523	辰安科技	88,950	2,480,815.50	0.08
170	002268	卫士通	57,600	2,471,616.00	0.08
171	600967	内蒙一机	267,900	2,443,248.00	0.08
172	002404	嘉欣丝绸	424,400	2,440,300.00	0.08
173	600155	华创阳安	287,500	2,438,000.00	0.08
174	603127	昭衍新药	21,326	2,426,898.80	0.08
175	600039	四川路桥	229,800	2,419,794.00	0.08
176	002258	利尔化学	100,480	2,373,337.60	0.08
177	601066	中信建投	80,500	2,327,255.00	0.08
178	688019	安集科技	10,920	2,325,086.40	0.08
179	603288	海天味业	25,460	2,300,565.60	0.08
180	600486	扬农化工	17,100	2,279,088.00	0.08
181	601933	永辉超市	530,400	2,270,112.00	0.08
182	601958	金钼股份	256,100	2,263,924.00	0.07
183	002597	金禾实业	51,900	2,248,827.00	0.07
184	002080	中材科技	81,000	2,227,500.00	0.07
185	002709	天赐材料	35,440	2,199,406.40	0.07
186	002050	三花智控	79,823	2,193,536.04	0.07
187	000709	河钢股份	968,700	2,189,262.00	0.07
188	603198	迎驾贡酒	33,600	2,188,704.00	0.07
189	300118	东方日升	74,600	2,188,018.00	0.07
190	000581	威孚高科	113,200	2,179,100.00	0.07
191	600728	佳都科技	336,100	2,171,206.00	0.07
192	002008	大族激光	65,400	2,166,702.00	0.07
193	600000	浦发银行	267,600	2,143,476.00	0.07
194	603456	九洲药业	41,400	2,140,380.00	0.07
195	600497	驰宏锌锗	395,700	2,053,683.00	0.07
196	601688	华泰证券	144,600	2,053,320.00	0.07

197	002505	鹏都农牧	591,500	2,005,185.00	0.07
198	002938	鹏鼎控股	66,300	2,002,923.00	0.07
199	300182	捷成股份	362,703	1,994,866.50	0.07
200	600302	标准股份	398,800	1,994,000.00	0.07
201	000723	美锦能源	161,500	1,970,300.00	0.07
202	603986	兆易创新	13,800	1,962,498.00	0.06
203	002556	辉隆股份	163,800	1,916,460.00	0.06
204	600642	申能股份	335,800	1,907,344.00	0.06
205	002648	卫星化学	73,018	1,887,515.30	0.06
206	300630	普利制药	53,400	1,877,010.00	0.06
207	603995	甬金股份	55,605	1,871,664.30	0.06
208	601666	平煤股份	137,700	1,871,343.00	0.06
209	002815	崇达技术	145,100	1,858,731.00	0.06
210	603987	康德莱	93,200	1,857,476.00	0.06
211	300474	景嘉微	27,050	1,849,949.50	0.06
212	601888	中国中免	7,900	1,840,147.00	0.06
213	300760	迈瑞医疗	5,809	1,819,378.80	0.06
214	603089	正裕工业	215,300	1,817,132.00	0.06
215	002146	荣盛发展	598,900	1,814,667.00	0.06
216	601319	中国人保	357,600	1,809,456.00	0.06
217	002129	TCL 中环	30,623	1,803,388.47	0.06
218	603019	中科曙光	61,800	1,793,436.00	0.06
219	601169	北京银行	390,600	1,773,324.00	0.06
220	600022	山东钢铁	1,017,700	1,770,798.00	0.06
221	603565	中谷物流	111,492	1,769,378.04	0.06
222	600206	有研新材	91,300	1,765,742.00	0.06
223	300661	圣邦股份	9,600	1,747,392.00	0.06
224	600096	云天化	54,900	1,728,252.00	0.06
225	300453	三鑫医疗	173,400	1,723,596.00	0.06
226	600582	天地科技	360,200	1,721,756.00	0.06
227	002920	德赛西威	11,600	1,716,800.00	0.06
228	002294	信立泰	60,900	1,711,290.00	0.06
229	601881	中国银河	176,600	1,707,722.00	0.06
230	002415	海康威视	46,800	1,694,160.00	0.06
231	000960	锡业股份	100,800	1,690,416.00	0.06
232	600597	光明乳业	133,000	1,679,790.00	0.06
233	603659	璞泰来	19,876	1,677,534.40	0.06
234	002416	爱施德	179,800	1,672,140.00	0.06
235	002091	江苏国泰	154,700	1,663,025.00	0.06
236	000810	创维数字	102,300	1,658,283.00	0.05
237	601985	中国核电	241,400	1,656,004.00	0.05
238	603708	家家悦	116,200	1,654,688.00	0.05
239	600048	保利发展	93,900	1,639,494.00	0.05
240	000895	双汇发展	55,700	1,632,010.00	0.05

241	000887	中鼎股份	89,100	1,625,184.00	0.05
242	603387	基蛋生物	113,102	1,612,834.52	0.05
243	600276	恒瑞医药	43,290	1,605,626.10	0.05
244	603300	华铁应急	201,320	1,604,520.40	0.05
245	002738	中矿资源	17,240	1,596,596.40	0.05
246	002850	科达利	10,012	1,591,908.00	0.05
247	300533	冰川网络	60,000	1,578,000.00	0.05
248	002056	横店东磁	59,200	1,575,904.00	0.05
249	603979	金诚信	81,000	1,564,110.00	0.05
250	000836	富通信息	527,000	1,554,650.00	0.05
251	600741	华域汽车	67,300	1,547,900.00	0.05
252	603927	中科软	65,700	1,532,124.00	0.05
253	300395	菲利华	33,100	1,489,500.00	0.05
254	300900	广联航空	55,500	1,481,850.00	0.05
255	002662	京威股份	407,700	1,479,951.00	0.05
256	600885	宏发股份	35,280	1,476,468.00	0.05
257	603933	睿能科技	134,300	1,466,556.00	0.05
258	600373	中文传媒	145,700	1,455,543.00	0.05
259	002271	东方雨虹	28,165	1,449,652.55	0.05
260	000629	攀钢钒钛	380,800	1,447,040.00	0.05
261	300759	康龙化成	15,150	1,442,583.00	0.05
262	688202	美迪西	4,236	1,438,587.96	0.05
263	002340	格林美	158,000	1,437,800.00	0.05
264	002399	海普瑞	81,700	1,436,286.00	0.05
265	002714	牧原股份	25,791	1,425,468.57	0.05
266	600320	振华重工	423,000	1,421,280.00	0.05
267	601601	中国太保	60,055	1,413,094.15	0.05
268	605177	东亚药业	66,500	1,385,860.00	0.05
269	600958	东方证券	133,400	1,362,014.00	0.05
270	600905	三峡能源	216,000	1,358,640.00	0.04
271	002961	瑞达期货	75,166	1,355,994.64	0.04
272	002410	广联达	24,793	1,349,730.92	0.04
273	002375	亚厦股份	269,300	1,349,193.00	0.04
274	300826	测绘股份	102,080	1,340,310.40	0.04
275	600901	江苏租赁	260,800	1,337,904.00	0.04
276	000155	川能动力	60,200	1,333,430.00	0.04
277	600704	物产中大	259,700	1,332,261.00	0.04
278	000998	隆平高科	79,700	1,327,802.00	0.04
279	300384	三联虹普	71,100	1,322,460.00	0.04
280	600549	厦门钨业	60,900	1,316,658.00	0.04
281	601818	光大银行	435,000	1,309,350.00	0.04
282	601229	上海银行	197,400	1,292,970.00	0.04
283	300224	正海磁材	84,300	1,289,790.00	0.04
284	601211	国泰君安	83,300	1,266,160.00	0.04

285	600150	中国船舶	66,500	1,262,170.00	0.04
286	000968	蓝焰控股	119,000	1,243,550.00	0.04
287	002459	晶澳科技	15,680	1,237,152.00	0.04
288	603801	志邦家居	45,800	1,235,684.00	0.04
289	600795	国电电力	311,400	1,217,574.00	0.04
290	002511	中顺洁柔	97,000	1,214,440.00	0.04
291	300015	爱尔眼科	27,089	1,212,774.53	0.04
292	603688	石英股份	9,100	1,206,751.00	0.04
293	600459	贵研铂业	66,620	1,206,488.20	0.04
294	601390	中国中铁	196,300	1,205,282.00	0.04
295	600782	新钢股份	238,400	1,201,536.00	0.04
296	002466	天齐锂业	9,600	1,198,080.00	0.04
297	300633	开立医疗	39,569	1,188,257.07	0.04
298	000002	万科 A	57,600	1,180,800.00	0.04
299	002230	科大讯飞	28,600	1,178,892.00	0.04
300	002497	雅化集团	36,000	1,175,400.00	0.04
301	000921	海信家电	82,700	1,172,686.00	0.04
302	003816	中国广核	413,100	1,156,680.00	0.04
303	300682	朗新科技	45,900	1,156,221.00	0.04
304	601899	紫金矿业	121,800	1,136,394.00	0.04
305	300582	英飞特	74,700	1,130,958.00	0.04
306	002831	裕同科技	38,252	1,130,346.60	0.04
307	002534	西子洁能	69,300	1,128,897.00	0.04
308	688533	上声电子	15,800	1,128,752.00	0.04
309	601138	工业富联	114,500	1,126,680.00	0.04
310	600718	东软集团	97,800	1,125,678.00	0.04
311	300357	我武生物	21,400	1,113,442.00	0.04
312	300674	宇信科技	70,400	1,103,872.00	0.04
313	002212	天融信	107,800	1,094,170.00	0.04
314	002138	顺络电子	39,900	1,087,275.00	0.04
315	002460	赣锋锂业	7,300	1,085,510.00	0.04
316	600216	浙江医药	79,500	1,085,175.00	0.04
317	002286	保龄宝	94,200	1,078,590.00	0.04
318	002478	常宝股份	233,500	1,064,760.00	0.04
319	002439	启明星辰	53,300	1,062,269.00	0.04
320	600702	舍得酒业	5,200	1,060,748.00	0.04
321	603027	千禾味业	60,720	1,050,456.00	0.03
322	601857	中国石油	198,000	1,049,400.00	0.03
323	000630	铜陵有色	320,500	1,044,830.00	0.03
324	603589	口子窖	17,700	1,037,397.00	0.03
325	603093	南华期货	97,600	1,033,584.00	0.03
326	300775	三角防务	21,000	1,011,150.00	0.03
327	300171	东富龙	29,300	993,563.00	0.03
328	002572	索菲亚	36,000	990,000.00	0.03

329	603906	龙蟠科技	26,500	978,910.00	0.03
330	000830	鲁西化工	56,400	975,156.00	0.03
331	600309	万华化学	10,000	969,900.00	0.03
332	601658	邮储银行	179,400	966,966.00	0.03
333	603687	大胜达	103,300	962,756.00	0.03
334	601877	正泰电器	26,900	962,482.00	0.03
335	300346	南大光电	26,600	957,068.00	0.03
336	002747	埃斯顿	38,900	953,050.00	0.03
337	300274	阳光电源	9,649	948,014.25	0.03
338	600662	外服控股	137,600	928,800.00	0.03
339	600160	巨化股份	70,600	928,390.00	0.03
340	000708	中信特钢	45,800	922,870.00	0.03
341	002939	长城证券	90,800	922,528.00	0.03
342	300685	艾德生物	28,778	920,896.00	0.03
343	300789	唐源电气	45,600	919,752.00	0.03
344	300233	金城医药	32,200	918,666.00	0.03
345	002120	韵达股份	53,700	916,122.00	0.03
346	600487	亨通光电	62,900	914,566.00	0.03
347	300782	卓胜微	6,720	907,200.00	0.03
348	603128	华贸物流	90,066	903,361.98	0.03
349	600157	永泰能源	568,100	903,279.00	0.03
350	300777	中简科技	18,700	901,340.00	0.03
351	601058	赛轮轮胎	79,600	897,092.00	0.03
352	603301	振德医疗	21,300	895,665.00	0.03
353	600031	三一重工	46,600	888,196.00	0.03
354	300628	亿联网络	11,600	883,340.00	0.03
355	002353	杰瑞股份	21,900	882,570.00	0.03
356	603866	桃李面包	53,300	882,115.00	0.03
357	002032	苏泊尔	15,400	867,636.00	0.03
358	600219	南山铝业	235,000	867,150.00	0.03
359	600941	中国移动	14,300	865,150.00	0.03
360	000933	神火股份	66,100	864,588.00	0.03
361	300294	博雅生物	24,000	862,800.00	0.03
362	002326	永太科技	26,200	862,766.00	0.03
363	600511	国药股份	31,800	851,604.00	0.03
364	603712	七一二	26,800	844,200.00	0.03
365	601628	中国人寿	27,100	842,268.00	0.03
366	601998	中信银行	177,000	840,750.00	0.03
367	600123	兰花科创	51,100	840,595.00	0.03
368	300613	富瀚微	9,860	836,128.00	0.03
369	002851	麦格米特	31,800	835,068.00	0.03
370	000567	海德股份	56,345	833,906.00	0.03
371	601699	潞安环能	57,006	833,427.72	0.03
372	300751	迈为股份	1,680	824,712.00	0.03

373	002396	星网锐捷	36,300	821,832.00	0.03
374	300604	长川科技	18,000	812,700.00	0.03
375	000875	吉电股份	116,500	809,675.00	0.03
376	603283	赛腾股份	37,625	803,293.75	0.03
377	688169	石头科技	1,300	801,710.00	0.03
378	300737	科顺股份	60,500	797,390.00	0.03
379	300401	花园生物	45,800	794,172.00	0.03
380	300054	鼎龙股份	37,400	791,758.00	0.03
381	300888	稳健医疗	11,900	791,350.00	0.03
382	300696	爱乐达	17,940	788,463.00	0.03
383	600295	鄂尔多斯	43,283	781,258.15	0.03
384	002241	歌尔股份	23,100	776,160.00	0.03
385	002493	荣盛石化	50,000	769,500.00	0.03
386	600332	白云山	24,300	767,637.00	0.03
387	002126	银轮股份	67,000	767,150.00	0.03
388	603713	密尔克卫	5,595	764,836.50	0.03
389	300525	博思软件	35,445	760,295.25	0.03
390	600004	白云机场	50,700	755,937.00	0.03
391	000507	珠海港	118,600	753,110.00	0.02
392	002372	伟星新材	31,325	753,053.00	0.02
393	000498	山东路桥	77,900	752,514.00	0.02
394	002541	鸿路钢构	22,267	743,717.80	0.02
395	002484	江海股份	31,859	743,589.06	0.02
396	300327	中颖电子	14,900	742,169.00	0.02
397	001979	招商蛇口	55,100	739,993.00	0.02
398	601901	方正证券	109,200	732,732.00	0.02
399	603236	移远通信	5,460	729,783.60	0.02
400	000591	太阳能	86,400	721,440.00	0.02
401	002436	兴森科技	63,500	715,645.00	0.02
402	000035	中国天楹	136,200	715,050.00	0.02
403	600546	山煤国际	36,700	714,182.00	0.02
404	603737	三棵树	5,500	711,865.00	0.02
405	600850	电科数字	38,080	710,572.80	0.02
406	002332	仙琚制药	72,000	707,040.00	0.02
407	300398	飞凯材料	30,898	706,328.28	0.02
408	300653	正海生物	12,600	705,600.00	0.02
409	002036	联创电子	45,900	705,024.00	0.02
410	603718	海利生物	61,100	701,428.00	0.02
411	002567	唐人神	81,500	693,565.00	0.02
412	600585	海螺水泥	19,500	687,960.00	0.02
413	000027	深圳能源	107,300	687,793.00	0.02
414	002039	黔源电力	46,780	686,262.60	0.02
415	600177	雅戈尔	103,400	685,542.00	0.02
416	601728	中国电信	183,600	684,828.00	0.02

417	300566	激智科技	37,700	682,370.00	0.02
418	601222	林洋能源	81,400	679,690.00	0.02
419	001914	招商积余	37,200	668,484.00	0.02
420	688363	华熙生物	4,700	668,246.00	0.02
421	300787	海能实业	23,060	667,356.40	0.02
422	300447	全信股份	32,600	664,062.00	0.02
423	002244	滨江集团	76,600	662,590.00	0.02
424	002192	融捷股份	4,300	660,910.00	0.02
425	002312	川发龙蟒	38,100	657,606.00	0.02
426	000034	神州数码	43,100	655,982.00	0.02
427	300596	利安隆	14,700	648,417.00	0.02
428	600483	福能股份	45,800	644,406.00	0.02
429	002262	恩华药业	47,287	643,103.20	0.02
430	300755	华致酒行	14,580	639,333.00	0.02
431	300121	阳谷华泰	59,400	637,362.00	0.02
432	300073	当升科技	7,028	634,909.52	0.02
433	000969	安泰科技	70,800	631,536.00	0.02
434	300130	新国都	51,444	630,703.44	0.02
435	300122	智飞生物	5,678	630,314.78	0.02
436	002299	圣农发展	32,700	627,186.00	0.02
437	600273	嘉化能源	57,500	624,450.00	0.02
438	002741	光华科技	30,886	615,557.98	0.02
439	300740	水羊股份	44,800	615,552.00	0.02
440	603869	新智认知	75,400	611,494.00	0.02
441	002768	国恩股份	23,800	611,184.00	0.02
442	688261	东微半导	2,645	610,201.50	0.02
443	002318	久立特材	38,000	607,620.00	0.02
444	002649	博彦科技	59,400	606,474.00	0.02
445	300232	洲明科技	93,000	606,360.00	0.02
446	300999	金龙鱼	11,200	605,024.00	0.02
447	300666	江丰电子	9,900	603,900.00	0.02
448	300568	星源材质	20,725	601,854.00	0.02
449	000902	新洋丰	35,300	596,217.00	0.02
450	000683	远兴能源	56,600	594,866.00	0.02
451	300055	万邦达	63,100	590,616.00	0.02
452	600787	中储股份	103,500	588,915.00	0.02
453	600060	海信视像	47,100	588,750.00	0.02
454	002204	大连重工	134,400	587,328.00	0.02
455	002697	红旗连锁	115,400	582,770.00	0.02
456	001696	宗申动力	92,000	582,360.00	0.02
457	002545	东方铁塔	51,000	580,380.00	0.02
458	002041	登海种业	27,500	579,975.00	0.02
459	603290	斯达半导	1,500	578,850.00	0.02
460	300394	天孚通信	21,300	576,591.00	0.02

461	300238	冠昊生物	39,600	575,388.00	0.02
462	601668	中国建筑	108,100	575,092.00	0.02
463	601919	中远海控	41,200	572,680.00	0.02
464	002698	博实股份	48,100	569,023.00	0.02
465	000783	长江证券	95,700	567,501.00	0.02
466	002025	航天电器	8,100	565,542.00	0.02
467	002035	华帝股份	96,800	563,376.00	0.02
468	300735	光弘科技	53,800	562,210.00	0.02
469	002013	中航机电	45,400	560,690.00	0.02
470	002100	天康生物	57,600	559,872.00	0.02
471	600395	盘江股份	63,700	558,649.00	0.02
472	002472	双环传动	17,500	557,200.00	0.02
473	603888	新华网	32,300	553,945.00	0.02
474	000682	东方电子	83,100	553,446.00	0.02
475	603773	沃格光电	34,393	550,288.00	0.02
476	300709	精研科技	18,560	549,190.40	0.02
477	300601	康泰生物	12,120	547,581.60	0.02
478	002984	森麒麟	17,600	547,536.00	0.02
479	300207	欣旺达	17,300	546,680.00	0.02
480	600908	无锡银行	96,600	543,858.00	0.02
481	000928	中钢国际	86,700	543,609.00	0.02
482	002027	分众传媒	80,600	542,438.00	0.02
483	300476	胜宏科技	29,500	541,620.00	0.02
484	300145	中金环境	196,000	539,000.00	0.02
485	000989	九芝堂	59,200	538,720.00	0.02
486	603026	石大胜华	3,686	535,760.10	0.02
487	002929	润建股份	14,900	534,910.00	0.02
488	002573	清新环境	91,400	531,034.00	0.02
489	603363	傲农生物	28,600	529,386.00	0.02
490	000767	晋控电力	141,500	527,795.00	0.02
491	300712	永福股份	9,200	527,528.00	0.02
492	300101	振芯科技	25,500	526,320.00	0.02
493	601001	晋控煤业	29,500	523,625.00	0.02
494	300765	新诺威	36,300	518,001.00	0.02
495	600729	重庆百货	23,800	513,366.00	0.02
496	300590	移为通信	37,650	510,910.50	0.02
497	002243	力合科创	52,716	508,709.40	0.02
498	603915	国茂股份	23,940	502,500.60	0.02
499	300451	创业慧康	69,600	501,120.00	0.02
500	688383	新益昌	4,400	500,500.00	0.02
501	603486	科沃斯	4,100	499,749.00	0.02
502	603008	喜临门	13,507	495,706.90	0.02
503	688575	亚辉龙	23,680	495,385.60	0.02
504	000031	大悦城	123,700	494,800.00	0.02

505	002202	金风科技	33,400	494,320.00	0.02
506	000848	承德露露	51,000	493,680.00	0.02
507	300673	佩蒂股份	28,500	492,480.00	0.02
508	688201	信安世纪	14,800	492,248.00	0.02
509	300408	三环集团	16,300	490,630.00	0.02
510	300687	赛意信息	21,300	489,261.00	0.02
511	601600	中国铝业	103,000	489,250.00	0.02
512	002539	云图控股	30,577	488,926.23	0.02
513	600596	新安股份	22,460	486,259.00	0.02
514	601808	中海油服	34,600	482,670.00	0.02
515	002960	青鸟消防	17,498	479,270.22	0.02
516	300389	艾比森	45,700	474,823.00	0.02
517	002054	德美化工	58,800	472,752.00	0.02
518	002371	北方华创	1,700	471,104.00	0.02
519	000661	长春高新	2,000	466,840.00	0.02
520	000739	普洛药业	22,575	465,948.00	0.02
521	002517	恺英网络	83,419	465,478.02	0.02
522	002004	华邦健康	82,800	462,024.00	0.02
523	300836	佰奥智能	18,920	461,648.00	0.02
524	300573	兴齐眼药	3,000	459,960.00	0.02
525	300432	富临精工	20,900	459,800.00	0.02
526	603613	国联股份	5,148	456,112.80	0.02
527	002293	罗莱生活	34,400	453,048.00	0.01
528	002001	新和成	19,840	452,550.40	0.01
529	603690	至纯科技	11,200	451,360.00	0.01
530	000656	金科股份	157,783	451,259.38	0.01
531	002044	美年健康	80,900	450,613.00	0.01
532	600339	中油工程	155,000	447,950.00	0.01
533	605168	三人行	4,139	447,550.07	0.01
534	002048	宁波华翔	27,800	445,356.00	0.01
535	688520	神州细胞-U	8,600	444,878.00	0.01
536	300627	华测导航	12,920	444,318.80	0.01
537	002583	海能达	91,800	444,312.00	0.01
538	600886	国投电力	42,100	442,050.00	0.01
539	300450	先导智能	6,960	439,732.80	0.01
540	000963	华东医药	9,700	438,052.00	0.01
541	601108	财通证券	54,850	431,669.50	0.01
542	300332	天壕环境	38,200	427,840.00	0.01
543	603444	吉比特	1,100	426,800.00	0.01
544	002812	恩捷股份	1,700	425,765.00	0.01
545	300813	泰林生物	10,440	424,803.60	0.01
546	603929	亚翔集成	39,500	420,675.00	0.01
547	601828	美凯龙	68,900	417,534.00	0.01
548	002867	周大生	26,600	413,098.00	0.01

549	000157	中联重科	66,900	412,104.00	0.01
550	600985	淮北矿业	28,300	412,048.00	0.01
551	002311	海大集团	6,811	408,728.11	0.01
552	600600	青岛啤酒	3,900	405,288.00	0.01
553	603279	景津装备	12,960	401,889.60	0.01
554	688036	传音控股	4,500	401,535.00	0.01
555	300850	新强联	4,500	400,635.00	0.01
556	600881	亚泰集团	149,800	395,472.00	0.01
557	000039	中集集团	28,190	390,431.50	0.01
558	300856	科思股份	8,950	388,251.00	0.01
559	300298	三诺生物	13,700	384,970.00	0.01
560	600028	中国石化	94,100	383,928.00	0.01
561	600777	新潮能源	143,400	382,878.00	0.01
562	300638	广和通	14,400	381,456.00	0.01
563	600674	川投能源	32,000	381,440.00	0.01
564	688050	爱博医疗	1,700	381,140.00	0.01
565	002049	紫光国微	2,000	379,440.00	0.01
566	603018	华设集团	39,700	379,135.00	0.01
567	600481	双良节能	22,500	379,125.00	0.01
568	002791	坚朗五金	2,900	376,188.00	0.01
569	300382	斯莱克	23,700	371,379.00	0.01
570	002601	龙佰集团	18,461	370,143.05	0.01
571	600285	羚锐制药	29,500	369,635.00	0.01
572	002651	利君股份	46,800	367,380.00	0.01
573	600063	皖维高新	48,300	366,114.00	0.01
574	603501	韦尔股份	2,095	362,497.85	0.01
575	600845	宝信软件	6,600	360,360.00	0.01
576	002368	太极股份	18,600	357,306.00	0.01
577	300324	旋极信息	104,000	355,680.00	0.01
578	002128	电投能源	24,600	352,272.00	0.01
579	002463	沪电股份	23,700	349,812.00	0.01
580	002066	瑞泰科技	30,700	349,059.00	0.01
581	300502	新易盛	13,200	345,840.00	0.01
582	002558	巨人网络	37,700	344,955.00	0.01
583	000917	电广传媒	64,700	343,557.00	0.01
584	000425	徐工机械	62,000	334,180.00	0.01
585	600621	华鑫股份	23,000	333,960.00	0.01
586	600352	浙江龙盛	32,800	333,904.00	0.01
587	603212	赛伍技术	12,500	332,625.00	0.01
588	603588	高能环境	28,800	332,064.00	0.01
589	600011	华能国际	46,300	325,952.00	0.01
590	002060	粤水电	37,500	325,875.00	0.01
591	002209	达意隆	47,000	321,480.00	0.01
592	601137	博威合金	18,100	320,370.00	0.01

593	000517	荣安地产	100,600	319,908.00	0.01
594	002916	深南电路	3,400	318,614.00	0.01
595	603728	鸣志电器	15,000	318,450.00	0.01
596	600995	文山电力	20,800	318,448.00	0.01
597	300315	掌趣科技	95,000	317,300.00	0.01
598	002544	普天科技	13,900	316,225.00	0.01
599	000799	酒鬼酒	1,700	315,877.00	0.01
600	603882	金城医学	3,800	313,690.00	0.01
601	600057	厦门象屿	34,996	307,614.84	0.01
602	002314	南山控股	73,600	304,704.00	0.01
603	601077	渝农商行	82,200	304,140.00	0.01
604	002736	国信证券	31,700	303,369.00	0.01
605	603876	鼎胜新材	6,700	302,840.00	0.01
606	601099	太平洋	100,200	299,598.00	0.01
607	600025	华能水电	42,700	298,473.00	0.01
608	600993	马应龙	12,800	298,240.00	0.01
609	003036	泰坦股份	27,700	296,667.00	0.01
610	300184	力源信息	53,800	295,900.00	0.01
611	300867	圣元环保	14,000	292,880.00	0.01
612	000601	韶能股份	58,100	292,824.00	0.01
613	300014	亿纬锂能	3,000	292,500.00	0.01
614	600557	康缘药业	19,900	292,331.00	0.01
615	600837	海通证券	29,600	290,376.00	0.01
616	603267	鸿远电子	2,150	288,809.50	0.01
617	688123	聚辰股份	2,700	287,604.00	0.01
618	601886	江河集团	34,000	287,300.00	0.01
619	603369	今世缘	5,600	285,600.00	0.01
620	000932	华菱钢铁	55,200	280,968.00	0.01
621	300504	天邑股份	15,800	280,608.00	0.01
622	603043	广州酒家	11,100	279,942.00	0.01
623	601016	节能风电	58,300	279,840.00	0.01
624	300769	德方纳米	680	277,902.40	0.01
625	300593	新雷能	6,672	276,954.72	0.01
626	300349	金卡智能	28,244	275,096.56	0.01
627	002832	比音勒芬	10,900	274,680.00	0.01
628	000596	古井贡酒	1,100	274,626.00	0.01
629	603348	文灿股份	5,100	273,360.00	0.01
630	002818	富森美	21,670	272,825.30	0.01
631	603323	苏农银行	53,300	271,830.00	0.01
632	600366	宁波韵升	21,300	268,380.00	0.01
633	603317	天味食品	9,400	267,618.00	0.01
634	600732	爱旭股份	8,100	267,462.00	0.01
635	000826	启迪环境	87,400	267,444.00	0.01
636	002123	梦网科技	22,900	266,556.00	0.01

637	688598	金博股份	900	265,230.00	0.01
638	603896	寿仙谷	6,820	264,479.60	0.01
639	688322	奥比中光-UW	8,529	264,313.71	0.01
640	600129	太极集团	12,000	263,640.00	0.01
640	603338	浙江鼎力	5,200	263,640.00	0.01
641	600098	广州发展	41,900	262,294.00	0.01
642	002174	游族网络	26,700	260,859.00	0.01
643	603766	隆鑫通用	56,400	260,004.00	0.01
644	600649	城投控股	59,500	254,660.00	0.01
645	688385	复旦微电	3,900	254,241.00	0.01
646	000584	哈工智能	34,300	254,163.00	0.01
647	688196	卓越新能	3,300	254,100.00	0.01
648	600372	中航电子	13,100	254,009.00	0.01
649	601369	陕鼓动力	26,400	253,440.00	0.01
650	688800	瑞可达	2,000	252,620.00	0.01
651	603959	百利科技	20,800	252,096.00	0.01
652	601636	旗滨集团	19,470	248,242.50	0.01
653	600027	华电国际	63,000	247,590.00	0.01
654	688107	安路科技-U	3,600	247,320.00	0.01
655	002617	露笑科技	21,800	246,994.00	0.01
656	002281	光迅科技	13,900	244,362.00	0.01
657	301031	中熔电气	1,700	243,746.00	0.01
658	603601	再升科技	38,200	242,952.00	0.01
659	600971	恒源煤电	30,500	240,950.00	0.01
660	002603	以岭药业	9,900	240,570.00	0.01
661	002801	微光股份	8,000	238,800.00	0.01
662	002383	合众思壮	39,700	237,009.00	0.01
663	300393	中来股份	13,900	236,300.00	0.01
664	300378	鼎捷软件	14,300	235,521.00	0.01
665	300739	明阳电路	14,700	235,494.00	0.01
666	600559	老白干酒	8,200	235,258.00	0.01
667	002991	甘源食品	3,400	234,566.00	0.01
668	601827	三峰环境	32,900	234,248.00	0.01
669	600916	中国黄金	19,900	232,830.00	0.01
670	002124	天邦食品	34,100	229,152.00	0.01
671	603180	金牌厨柜	7,360	227,865.60	0.01
672	300326	凯利泰	27,400	226,324.00	0.01
673	000728	国元证券	36,300	225,786.00	0.01
674	002932	明德生物	3,278	224,739.68	0.01
675	603383	顶点软件	9,100	224,679.00	0.01
676	000823	超声电子	21,600	223,344.00	0.01
677	600406	国电南瑞	8,208	221,616.00	0.01
678	600489	中金黄金	29,900	220,961.00	0.01
679	601778	晶科科技	40,800	220,320.00	0.01

680	002701	奥瑞金	42,200	219,440.00	0.01
681	603115	海星股份	8,900	218,673.00	0.01
682	603429	集友股份	17,000	218,620.00	0.01
683	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
684	601908	京运通	26,800	214,936.00	0.01
685	300481	濮阳惠成	9,100	213,850.00	0.01
686	600888	新疆众和	23,200	213,440.00	0.01
687	600021	上海电力	20,800	213,200.00	0.01
688	601686	友发集团	27,500	210,100.00	0.01
689	605099	共创草坪	7,900	210,061.00	0.01
690	600874	创业环保	31,200	209,976.00	0.01
691	603179	新泉股份	7,200	208,800.00	0.01
692	300328	宜安科技	24,500	208,250.00	0.01
693	300339	润和软件	11,600	208,220.00	0.01
694	000786	北新建材	6,000	207,720.00	0.01
695	603606	东方电缆	2,700	206,820.00	0.01
696	603053	成都燃气	21,977	205,265.18	0.01
697	600330	天通股份	17,100	203,661.00	0.01
698	600783	鲁信创投	15,300	202,878.00	0.01
699	600643	爱建集团	34,000	201,620.00	0.01
700	300772	运达股份	7,920	201,484.80	0.01
701	600710	苏美达	34,100	201,190.00	0.01
702	002646	天佑德酒	10,500	201,075.00	0.01
703	600064	南京高科	18,200	200,200.00	0.01
704	002028	思源电气	5,600	199,696.00	0.01
705	600008	首创环保	67,800	196,620.00	0.01
706	600023	浙能电力	56,600	196,402.00	0.01
707	300381	溢多利	18,800	195,708.00	0.01
708	002078	太阳纸业	15,700	193,267.00	0.01
709	000818	航锦科技	5,700	193,230.00	0.01
710	600648	外高桥	14,200	193,120.00	0.01
711	688099	晶晨股份	1,900	191,900.00	0.01
712	002419	天虹股份	26,900	191,797.00	0.01
713	603919	金徽酒	5,600	190,344.00	0.01
714	600758	辽宁能源	43,000	189,200.00	0.01
715	000690	宝新能源	43,100	188,778.00	0.01
716	002407	多氟多	3,800	185,858.00	0.01
717	300496	中科创达	1,400	182,672.00	0.01
718	002645	华宏科技	8,300	181,106.00	0.01
719	603181	皇马科技	12,000	181,080.00	0.01
720	300072	海新能科	35,500	179,630.00	0.01
721	300149	睿智医药	15,900	179,352.00	0.01
722	601882	海天精工	8,700	179,307.00	0.01
723	603517	绝味食品	3,100	179,242.00	0.01

724	601607	上海医药	9,900	178,992.00	0.01
725	600604	市北高新	30,600	178,704.00	0.01
726	600391	航发科技	9,300	178,653.00	0.01
727	600208	新潮中宝	63,900	176,364.00	0.01
728	603305	旭升股份	5,800	175,276.00	0.01
729	300058	蓝色光标	26,700	174,351.00	0.01
730	603997	继峰股份	15,900	172,992.00	0.01
731	000851	高鸿股份	36,100	172,197.00	0.01
732	002015	协鑫能科	9,700	172,078.00	0.01
733	003031	中瓷电子	2,660	171,836.00	0.01
734	002467	二六三	41,500	171,810.00	0.01
735	002104	恒宝股份	20,600	167,684.00	0.01
736	600780	通宝能源	31,700	166,742.00	0.01
737	600535	天士力	15,800	166,058.00	0.01
738	600116	三峡水利	16,500	165,660.00	0.01
739	600999	招商证券	11,300	162,833.00	0.01
740	600516	方大炭素	21,400	162,640.00	0.01
741	605169	洪通燃气	14,400	162,144.00	0.01
742	601208	东材科技	12,500	161,500.00	0.01
743	003035	南网能源	25,300	160,655.00	0.01
744	000032	深桑达 A	10,700	160,286.00	0.01
745	603520	司太立	5,600	157,472.00	0.01
746	600776	东方通信	13,900	156,375.00	0.01
747	688005	容百科技	1,200	155,328.00	0.01
748	002936	郑州银行	57,500	154,675.00	0.01
749	688617	惠泰医疗	700	153,356.00	0.01
750	601997	贵阳银行	25,900	150,479.00	0.00
751	300841	康华生物	1,300	150,072.00	0.00
752	601377	兴业证券	21,200	149,460.00	0.00
753	000166	申万宏源	34,800	149,292.00	0.00
754	600362	江西铜业	8,300	147,989.00	0.00
755	600825	新华传媒	36,900	146,493.00	0.00
756	600452	涪陵电力	12,607	146,367.27	0.00
757	600635	大众公用	44,150	145,695.00	0.00
758	600821	金开新能	22,600	145,544.00	0.00
759	300142	沃森生物	3,000	145,170.00	0.00
760	600587	新华医疗	7,100	143,775.00	0.00
761	600007	中国国贸	9,700	143,075.00	0.00
762	002897	意华股份	3,200	141,120.00	0.00
763	603816	顾家家居	2,470	139,876.10	0.00
764	600167	联美控股	18,600	139,314.00	0.00
765	300292	吴通控股	39,100	138,805.00	0.00
766	600062	华润双鹤	5,400	138,564.00	0.00
767	300285	国瓷材料	3,800	136,496.00	0.00

768	603833	欧派家居	900	135,612.00	0.00
769	002491	通鼎互联	25,300	131,813.00	0.00
770	601991	大唐发电	53,400	129,762.00	0.00
771	600775	南京熊猫	13,200	129,360.00	0.00
772	000070	特发信息	18,500	128,575.00	0.00
773	300594	朗进科技	7,400	125,800.00	0.00
774	002413	雷科防务	22,500	124,875.00	0.00
775	601869	长飞光纤	3,900	120,588.00	0.00
776	603393	新天然气	5,600	119,616.00	0.00
777	600105	永鼎股份	32,900	118,769.00	0.00
778	601619	嘉泽新能	28,300	116,030.00	0.00
779	603118	共进股份	15,300	113,526.00	0.00
780	300260	新莱应材	2,200	111,914.00	0.00
781	600163	中闽能源	13,200	111,540.00	0.00
782	603939	益丰药房	2,060	108,829.80	0.00
783	603313	梦百合	9,000	108,000.00	0.00
784	002507	涪陵榨菜	3,100	107,012.00	0.00
785	601336	新华保险	3,319	106,838.61	0.00
786	002017	东信和平	8,700	104,835.00	0.00
787	688248	南网科技	4,500	104,040.00	0.00
788	300413	芒果超媒	3,100	103,416.00	0.00
789	000543	皖能电力	25,000	99,750.00	0.00
790	002557	洽洽食品	1,700	96,781.00	0.00
791	002891	中宠股份	3,800	96,596.00	0.00
792	601156	东航物流	4,800	95,040.00	0.00
793	600416	湘电股份	4,900	92,904.00	0.00
794	000423	东阿阿胶	2,500	92,375.00	0.00
795	601162	天风证券	28,900	91,902.00	0.00
796	300810	中科海讯	4,750	89,442.50	0.00
797	600109	国金证券	9,800	88,200.00	0.00
798	002531	天顺风能	5,300	87,397.00	0.00
799	002797	第一创业	13,600	87,176.00	0.00
800	688200	华峰测控	236	84,110.40	0.00
801	601878	浙商证券	7,200	81,936.00	0.00
802	002690	美亚光电	3,770	81,733.60	0.00
803	601995	中金公司	1,800	80,082.00	0.00
804	603489	八方股份	400	77,796.00	0.00
805	605376	博迁新材	1,300	75,790.00	0.00
806	600918	中泰证券	9,200	70,380.00	0.00
807	000935	四川双马	2,900	70,238.00	0.00
808	600529	山东药玻	2,500	69,875.00	0.00
809	002947	恒铭达	3,760	69,184.00	0.00
810	600552	凯盛科技	5,800	65,714.00	0.00
811	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00

812	300263	隆华科技	7,200	64,512.00	0.00
813	605133	嵘泰股份	2,800	64,064.00	0.00
814	603022	新通联	7,000	63,910.00	0.00
815	603968	醋化股份	3,100	63,860.00	0.00
816	601696	中银证券	4,800	63,840.00	0.00
817	601669	中国电建	8,100	63,747.00	0.00
818	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
819	002724	海洋王	5,100	63,393.00	0.00
820	000551	创元科技	7,300	62,999.00	0.00
821	600760	中航沈飞	1,040	62,868.00	0.00
822	603799	华友钴业	650	62,153.00	0.00
823	300643	万通智控	4,200	62,034.00	0.00
824	600061	国投资本	9,700	61,692.00	0.00
825	300773	拉卡拉	3,200	60,992.00	0.00
826	603993	洛阳钼业	10,500	60,165.00	0.00
827	603197	保隆科技	1,200	59,028.00	0.00
828	600862	中航高科	2,100	59,010.00	0.00
829	301177	迪阿股份	792	58,766.40	0.00
830	603607	京华激光	4,300	56,674.00	0.00
831	603017	中衡设计	6,100	56,425.00	0.00
832	000657	中钨高新	3,700	55,500.00	0.00
833	600210	紫江企业	8,600	54,954.00	0.00
834	603985	恒润股份	1,950	54,873.00	0.00
835	002088	鲁阳节能	2,600	54,730.00	0.00
836	002847	盐津铺子	600	52,764.00	0.00
837	300833	浩洋股份	600	52,296.00	0.00
838	002930	宏川智慧	2,600	51,402.00	0.00
839	603867	新化股份	1,500	50,955.00	0.00
840	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
841	300558	贝达药业	800	48,640.00	0.00
842	000975	银泰黄金	4,900	47,726.00	0.00
843	301129	瑞纳智能	800	47,064.00	0.00
844	605050	福然德	3,200	44,896.00	0.00
845	603899	晨光股份	800	44,864.00	0.00
846	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
847	002245	蔚蓝锂芯	1,900	44,099.00	0.00
848	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
849	603982	泉峰汽车	1,700	41,463.00	0.00
850	603385	惠达卫浴	5,300	40,121.00	0.00
851	688186	广大特材	1,249	39,843.10	0.00
852	300487	蓝晓科技	650	39,650.00	0.00
853	300007	汉威科技	2,200	39,578.00	0.00
854	603656	泰禾智能	2,640	39,019.20	0.00
855	605058	澳弘电子	2,000	38,600.00	0.00

856	603633	徕木股份	2,600	37,908.00	0.00
857	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
858	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
859	301150	中一科技	403	33,352.28	0.00
860	300982	苏文电能	700	32,872.00	0.00
861	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
862	603819	神力股份	1,800	31,464.00	0.00
863	300454	深信服	300	31,134.00	0.00
864	001201	东瑞股份	800	30,864.00	0.00
865	300763	锦浪科技	143	30,459.00	0.00
866	600195	中牧股份	2,462	30,184.12	0.00
867	002014	永新股份	4,500	30,105.00	0.00
868	603938	三孚股份	600	29,658.00	0.00
869	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
870	002003	伟星股份	2,950	28,025.00	0.00
871	002967	广电计量	1,438	27,235.72	0.00
872	002895	川恒股份	800	27,048.00	0.00
873	300767	震安科技	458	26,646.44	0.00
874	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
875	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
876	601952	苏垦农发	1,800	25,182.00	0.00
877	601816	京沪高铁	4,900	24,598.00	0.00
878	300144	宋城演艺	1,600	24,560.00	0.00
879	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
880	300003	乐普医疗	1,300	24,141.00	0.00
881	300545	联得装备	1,300	23,543.00	0.00
882	688267	中触媒	700	23,401.00	0.00
883	300433	蓝思科技	2,100	23,247.00	0.00
884	300703	创源股份	2,525	23,179.50	0.00
885	688639	华恒生物	173	22,780.64	0.00
886	002401	中远海科	2,500	22,525.00	0.00
887	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
888	300146	汤臣倍健	1,000	21,650.00	0.00
889	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
890	603668	天马科技	1,000	20,490.00	0.00
891	002009	天奇股份	1,100	20,350.00	0.00
892	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
893	300033	同花顺	200	19,230.00	0.00
894	300211	亿通科技	2,100	18,081.00	0.00
895	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
896	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
897	300595	欧普康视	300	17,157.00	0.00
898	688100	威胜信息	800	16,792.00	0.00
899	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00

900	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
901	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
902	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
903	300676	华大基因	200	14,340.00	0.00
904	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
905	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
906	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
907	688608	恒玄科技	100	13,760.00	0.00
908	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
909	600071	凤凰光学	600	12,816.00	0.00
910	605080	浙江自然	200	12,778.00	0.00
911	600754	锦江酒店	200	12,580.00	0.00
912	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
913	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
914	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
915	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
916	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
917	002154	报喜鸟	2,600	11,232.00	0.00
918	601788	光大证券	700	11,032.00	0.00
919	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
920	688699	明微电子	100	10,846.00	0.00
921	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
922	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
923	003012	东鹏控股	1,100	9,614.00	0.00
924	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
925	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
926	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
927	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
928	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
929	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
930	603308	应流股份	300	4,884.00	0.00
931	688023	安恒信息	18	2,657.88	0.00
932	603005	晶方科技	80	2,271.20	0.00
933	603806	福斯特	20	1,310.40	0.00
934	003013	地铁设计	77	1,298.22	0.00
935	601965	中国汽研	79	1,280.59	0.00
936	002946	新乳业	80	1,039.20	0.00
937	002414	高德红外	80	1,029.60	0.00
938	300897	山科智能	35	1,020.25	0.00
939	300828	锐新科技	50	840.00	0.00
940	300087	荃银高科	50	823.00	0.00
941	600502	安徽建工	97	698.40	0.00
942	300812	易天股份	40	675.60	0.00
943	002376	新北洋	83	641.59	0.00

944	002985	北摩高科	10	585.80	0.00
945	600201	生物股份	60	549.60	0.00
946	300388	节能国祯	80	530.40	0.00
947	002706	良信股份	30	495.90	0.00
948	603610	麒盛科技	36	486.36	0.00
949	600479	千金药业	46	443.44	0.00
950	002292	奥飞娱乐	79	370.51	0.00
951	601515	东风股份	80	368.80	0.00
952	300872	天阳科技	20	266.60	0.00
953	300607	拓斯达	20	264.40	0.00
954	000156	华数传媒	28	223.16	0.00
955	603299	苏盐井神	12	150.36	0.00
956	000829	天音控股	4	47.64	0.00
957	000920	沃顿科技	1	8.91	0.00
958	600019	宝钢股份	1	6.02	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	600036	招商银行	29,346,456.00	0.78
2	601318	中国平安	29,331,655.64	0.78
3	300750	宁德时代	28,642,138.47	0.76
4	600519	贵州茅台	25,252,509.00	0.67
5	601166	兴业银行	21,561,059.28	0.57
6	300059	东方财富	17,465,958.00	0.47
7	600030	中信证券	16,360,997.73	0.44
8	000333	美的集团	14,910,415.00	0.40
9	000733	振华科技	14,781,629.00	0.39
10	002240	盛新锂能	13,462,116.00	0.36
11	601088	中国神华	12,808,150.00	0.34
12	600873	梅花生物	12,662,798.00	0.34
13	600256	广汇能源	12,609,906.00	0.34
14	002405	四维图新	11,973,184.00	0.32
15	600141	兴发集团	11,929,475.00	0.32
16	603986	兆易创新	11,916,923.00	0.32
17	300363	博腾股份	11,654,836.00	0.31
18	000001	平安银行	11,555,108.00	0.31
19	601128	常熟银行	10,845,675.14	0.29
20	300498	温氏股份	10,814,061.30	0.29

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	601318	中国平安	28,925,085.00	0.77
2	300750	宁德时代	24,184,342.00	0.64
3	300059	东方财富	20,160,708.33	0.54
4	000333	美的集团	19,035,477.85	0.51
5	600030	中信证券	16,423,331.80	0.44
6	600036	招商银行	14,717,446.06	0.39
7	601088	中国神华	13,291,967.04	0.35
8	000039	中集集团	12,517,785.92	0.33
9	601339	百隆东方	12,222,980.00	0.33
10	603008	喜临门	12,137,028.57	0.32
11	600546	山煤国际	12,025,831.00	0.32
12	600873	梅花生物	11,940,847.00	0.32
13	000887	中鼎股份	11,802,755.99	0.31
14	300327	中颖电子	11,494,284.02	0.31
15	002240	盛新锂能	11,385,198.00	0.30
16	601166	兴业银行	10,521,829.00	0.28
17	601688	华泰证券	10,358,222.00	0.28
18	002466	天齐锂业	10,283,590.55	0.27
19	600596	新安股份	10,140,740.40	0.27
20	600141	兴发集团	10,069,798.00	0.27

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	3,730,186,382.14
卖出股票收入（成交）总额	3,749,869,254.70

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	130,186,424.66	4.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	333,862,603.84	11.04
	其中：政策性金融债	182,385,898.63	6.03
4	企业债券	121,999,068.50	4.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	355,950,502.46	11.77
7	可转债（可交换债）	126,101,122.40	4.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,068,099,721.86	35.33

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	220201	22 国开 01	1,300,000	131,375,008.22	4.35
2	102280747	22 泸州窖 MTN002	1,000,000	100,893,561.64	3.34
3	220007	22 附息国债 07	1,000,000	99,853,178.08	3.30
4	2028013	20 农业银行二级 01	800,000	80,592,394.52	2.67
5	175987	21 国君 G1	700,000	71,451,753.98	2.36

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过股指期货的运用可降低本基金频繁调整股票仓位的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,328,000.56
2	应收清算款	3,943,702.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	22,398.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,294,101.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113042	上银转债	21,057,087.65	0.70
2	127018	本钢转债	11,846,502.17	0.39
3	113011	光大转债	10,633,465.75	0.35
4	110059	浦发转债	6,508,324.30	0.22
5	113044	大秦转债	6,478,050.08	0.21
6	110072	广汇转债	6,445,083.87	0.21
7	132011	17 浙报 EB	4,721,106.39	0.16
8	110063	鹰 19 转债	3,981,631.12	0.13
9	113052	兴业转债	3,926,371.14	0.13
10	128034	江银转债	3,086,868.22	0.10
11	110064	建工转债	2,784,440.55	0.09
12	120002	18 中原 EB	2,435,671.13	0.08
13	113596	城地转债	2,253,288.24	0.07
14	128095	恩捷转债	2,143,482.90	0.07
15	128127	文科转债	2,033,720.64	0.07
16	123049	维尔转债	1,916,745.39	0.06
17	113599	嘉友转债	1,769,255.23	0.06
18	127043	川恒转债	1,722,037.46	0.06
19	123096	思创转债	1,678,357.38	0.06
20	127034	绿茵转债	1,476,953.52	0.05
21	128074	游族转债	1,435,458.99	0.05
22	128063	未来转债	1,425,131.89	0.05
23	123056	雪榕转债	1,213,019.84	0.04
24	113589	天创转债	1,124,898.90	0.04
25	113591	胜达转债	1,082,151.00	0.04
26	113636	甬金转债	1,043,012.97	0.03
27	113569	科达转债	1,039,582.66	0.03
28	113047	旗滨转债	1,033,410.12	0.03
29	128117	道恩转债	1,009,791.06	0.03

30	128138	侨银转债	928,537.64	0.03
31	123126	瑞丰转债	778,509.27	0.03
32	123127	耐普转债	690,307.89	0.02
33	128118	瀛通转债	653,245.10	0.02
34	113573	纵横转债	583,336.30	0.02
35	127045	牧原转债	422,732.46	0.01
36	123113	仙乐转债	418,474.90	0.01
37	127052	西子转债	175,918.13	0.01
38	123133	佩蒂转债	143,637.13	0.00
39	128133	奇正转债	141,473.93	0.00
40	123117	健帆转债	99,065.15	0.00
41	113627	太平转债	73,646.93	0.00
42	127036	三花转债	69,128.28	0.00
43	113633	科沃转债	54,611.23	0.00
44	113634	珀莱转债	5,591.79	0.00

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	000957	中通客车	20,833,904.00	0.69	重大事项停牌

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
广发均衡增长 混合 A	26,512	109,142.13	4,904,368 .76	0.17%	2,888,671, 875.34	99.83%
广发均衡增长 混合 C	2,124	50,892.39	0.00	0.00%	108,095,4 27.72	100.00%

合计	28,636	104,821.61	4,904,368 .76	0.16%	2,996,767, 303.06	99.84%
----	--------	------------	------------------	-------	----------------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发均衡增长混合 A	30.32	0.0000%
	广发均衡增长混合 C	9.83	0.0000%
	合计	40.15	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发均衡增长混合 A	0
	广发均衡增长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发均衡增长混合 A	0
	广发均衡增长混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 27 日）基金份额总额	7,614,158,074.80	317,318,440.68
本报告期期初基金份额总额	3,415,068,627.32	126,278,370.49
本报告期基金总申购份额	11,697,127.70	11,588,871.03
减：本报告期基金总赎回份额	533,189,510.92	29,771,813.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,893,576,244.10	108,095,427.72

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，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	2	3,684,953,382.01	49.43%	2,694,770.14	49.45%	-
国联证券	2	2,408,783,829.14	32.31%	1,760,522.32	32.30%	-
中信证券	2	892,404,537.96	11.97%	652,328.79	11.97%	-
申万宏源	2	468,169,160.40	6.28%	342,352.70	6.28%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
招商证券	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	536,505,587.86	35.52%	440,000,000.00	100.00%	-	-
国联证券	321,032,249.65	21.25%	-	-	-	-
中信证券	620,140,876.30	41.05%	-	-	-	-
申万宏源	32,963,274.99	2.18%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	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

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

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日