

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告
2025 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：二〇二五年八月三十日

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 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55

8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	57
9 开放式基金份额变动	57
10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	62
11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 500ETF
场内简称	广发 500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,045,038,319.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-05-24

注：本基金的扩位证券简称为“中证 500ETF 基金”。

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

客户服务电话	95105828	95588
传真	020-34281105	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	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	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	葛长伟	廖林

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	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	65,036,939.45
本期利润	92,908,738.62
加权平均基金份额本期利润	0.0838
本期加权平均净值利润率	4.64%
本期基金份额净值增长率	4.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	908,220,302.89
期末可供分配基金份额利润	0.8691

期末基金资产净值	1,953,258,621.89
期末基金份额净值	1.8691
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	86.91%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.92%	0.77%	4.31%	0.79%	0.61%	-0.02%
过去三个月	1.95%	1.49%	0.98%	1.50%	0.97%	-0.01%
过去六个月	4.26%	1.35%	3.31%	1.36%	0.95%	-0.01%
过去一年	21.61%	1.71%	19.68%	1.72%	1.93%	-0.01%
过去三年	-3.67%	1.35%	-8.35%	1.35%	4.68%	0.00%
自基金合同生效起至今	86.91%	1.55%	72.10%	1.57%	14.81%	-0.02%

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

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2013 年 4 月 11 日至 2025 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	2014-04-01	-	21 年	刘杰先生，中国籍，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1

	的基金经理； 广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；广发恒生			日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯
--	---	--	--	---

	消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部总经理助理			美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 8 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金经理(自 2023 年 3 月 8 日至 2024 年 3 月 30 日)。
--	---	--	--	--

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，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；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 28 次，均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，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

2025 年上半年，中国经济表现了较强的韧性，整体 A 股市场也总体呈现了震荡向上态势。1 季度春节前后，DeepSeek 横空出世，全世界重新认识了中国科技的实力，进而带动了算力、云计算板块热度，1 季度 AI 产业加速发展与政策暖风共振，市场震荡上行；4 月初美国宣布对全球实施“对

等关税”政策及其升级，造成全球市场 2 季度开局大跌，后续随着日内瓦会谈达成阶段性缓和，市场也同步进行修复；从申万一级行业角度看，上半年表现排名靠前的 5 个行业分别是有色金属、银行、国防军工、传媒和通信，表现排名靠后的是煤炭、食品饮料、房地产、石油石化和建筑装饰。

本基金的标的指数是中证 500 指数，主要采用完全复制法来跟踪标的指数。作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。本基金跟踪误差来源主要是申购赎回和成份股调整等因素。

中证 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。中证 500 指数有着高波动、高收益的特征。就中长期表现而言，中证 500 指数收益相较大部分市场宽基指数存在一定优势；就短期表现而言，其往往被誉为“反弹急先锋”，值得投资者关注。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 4.26%，同期业绩比较基准收益率为 3.31%。

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，整体市场有望在政策支持和经济复苏推动下继续震荡上行，相比港股市场上半年大涨，A 股市场有望逐步追赶。进入下半年后，外部流动性有望逐渐改善，预计美元指数可能延续相对弱势，美债收益率则从高位震荡到下行，下半年美联储降息预期有望逐步落地，将强化美元指数和美债利率下行趋势，从而逐渐有利于市场风险偏好提升和成长风格表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

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的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	42,258,287.80	28,008,110.71
结算备付金		13,665,264.74	13,303,360.47
存出保证金		5,412,279.91	5,358,191.42
交易性金融资产	6.4.7.2	1,905,717,376.64	2,175,992,864.78
其中：股票投资		1,905,694,775.15	2,173,163,167.05
基金投资		-	-
债券投资		22,601.49	2,829,697.73
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		2,172,221.99	23,960,475.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,969,225,431.08	2,246,623,002.72
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		13,540,366.29	20,594,627.56
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		772,821.44	994,046.06

应付托管费		154,564.30	198,809.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22.88	59,567.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,499,034.28	7,197,850.44
负债合计		15,966,809.19	29,044,901.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,045,038,319.00	1,237,038,319.00
未分配利润	6.4.7.9	908,220,302.89	980,539,782.60
净资产合计		1,953,258,621.89	2,217,578,101.60
负债和净资产总计		1,969,225,431.08	2,246,623,002.72

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.8691 元，基金份额总额 1,045,038,319.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		99,116,385.21	-211,960,336.13
1.利息收入		132,623.07	2,654,152.03
其中：存款利息收入	6.4.7.10	132,623.07	180,375.55
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		-	-
其他利息收入		-	2,473,776.48
2.投资收益（损失以“-”填列）		69,640,145.85	-189,063,638.68
其中：股票投资收益	6.4.7.11	50,485,331.86	-227,592,902.81
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	460,570.64	23,228.78
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	1,116,744.74	-595,835.21
股利收益	6.4.7.17	17,577,498.61	39,101,870.56
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	27,871,799.17	-30,971,309.85
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	1,471,817.12	5,420,460.37
减：二、营业总支出		6,207,646.59	9,512,218.02
1. 管理人报酬		4,970,774.76	7,462,874.48
2. 托管费		994,154.94	1,492,574.94
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		6,246.14	12,171.28
8. 其他费用	6.4.7.21	236,470.75	544,597.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		92,908,738.62	-221,472,554.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,908,738.62	-221,472,554.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		92,908,738.62	-221,472,554.15

6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,237,038,319.00	980,539,782.60	2,217,578,101.60
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,237,038,319.00	980,539,782.60	2,217,578,101.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-192,000,000.00	-72,319,479.71	-264,319,479.71
（一）、综合收益总额	-	92,908,738.62	92,908,738.62
（二）、本期基金	-192,000,000.00	-165,228,218.33	-357,228,218.33

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	426,000,000.00	337,027,062.70	763,027,062.70
2. 基金赎回款	-618,000,000.00	-502,255,281.03	-1,120,255,281.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,045,038,319.00	908,220,302.89	1,953,258,621.89
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,763,038,319.00	1,179,003,412.23	2,942,041,731.23
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,763,038,319.00	1,179,003,412.23	2,942,041,731.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	140,000,000.00	-157,220,065.41	-17,220,065.41
（一）、综合收益总额	-	-221,472,554.15	-221,472,554.15
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	140,000,000.00	64,252,488.74	204,252,488.74
其中：1.基金申购款	2,056,000,000.00	1,281,516,471.25	3,337,516,471.25
2.基金赎回款	-1,916,000,000.00	-1,217,263,982.51	-3,133,263,982.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,903,038,319.00	1,021,783,346.82	2,924,821,665.82

产			
---	--	--	--

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：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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》、《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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据国税发明电[2002]47 号《黄金交易增值税征收管理办法》，基金买卖黄金现货实盘合约及黄金现货延期交收合约未发生实物交割的，免征增值税。

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征增值税试点的通知》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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	42,258,287.80
等于：本金	42,254,473.51
加：应计利息	3,814.29
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	42,258,287.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,823,364,761.38	-	1,905,694,775.15	82,330,013.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	22,600.00	1.49	22,601.49	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,600.00	1.49	22,601.49	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,823,387,361.38	1.49	1,905,717,376.64	82,330,013.77

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 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	38,117,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	38,117,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	38,117,400.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

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
IC2507	IC2507	34.00	39,898,320.00	1,780,920.00
合计	-	-	-	1,780,920.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,780,920.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为国债/股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	134,467.56
其中：交易所市场	134,467.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,211.43
应付指数使用费	140,162.44
应付替代款	1,129,192.85
合计	1,499,034.28

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,237,038,319.00	1,237,038,319.00
本期申购	426,000,000.00	426,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-618,000,000.00	-618,000,000.00
本期末	1,045,038,319.00	1,045,038,319.00

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,306,983,824.41	-1,326,444,041.81	980,539,782.60
本期期初	2,306,983,824.41	-1,326,444,041.81	980,539,782.60
本期利润	65,036,939.45	27,871,799.17	92,908,738.62
本期基金份额交易产生的变动数	-361,086,450.88	195,858,232.55	-165,228,218.33
其中：基金申购款	803,043,429.49	-466,016,366.79	337,027,062.70
基金赎回款	-1,164,129,880.37	661,874,599.34	-502,255,281.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,010,934,312.98	-1,102,714,010.09	908,220,302.89

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	53,977.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	78,054.67
其他	590.67
合计	132,623.07

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,993,091.65
股票投资收益——赎回差价收入	14,492,240.21
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	50,485,331.86

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	748,725,240.81
减：卖出股票成本总额	712,021,789.21
减：交易费用	710,359.95
买卖股票差价收入	35,993,091.65

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,120,255,281.03
减：现金支付赎回款总额	528,815,089.03
减：赎回股票成本总额	576,947,951.79
减：交易费用	-
赎回差价收入	14,492,240.21

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,562.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及	457,008.29

债券到期兑付）差价收入	
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	460,570.64

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,793,139.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,332,600.00
减：应计利息总额	3,379.32
减：交易费用	151.97
买卖债券差价收入	457,008.29

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	1,116,744.74

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,577,498.61
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	17,577,498.61

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
------	----------------------------

1.交易性金融资产	25,691,039.17
——股票投资	26,006,788.87
——债券投资	-315,749.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	2,180,760.00
——权证投资	-
——股指期货投资	2,180,760.00
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	27,871,799.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,471,817.12
合计	1,471,817.12

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

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	411.00
指数使用费	140,162.44
其他	685.88
合计	236,470.75

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	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的子公司
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	771,200.00	16.63%	-	-

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,970,774.76	7,462,874.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	47,136.55	38,241.09
应支付基金管理人的净管理费	4,923,638.21	7,424,633.39

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.50%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	994,154.94	1,492,574.94

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.10%。

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

单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费 率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收利 息余额
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间						
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费 率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收利 息余额
广发证券股 份有限公司	213,649,997. 40	1.30~4.02	1.85	145,924.18	27,941,757.8 0	6,341.00

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发中证 500 交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金(LOF)	829,658,700.00	79.39%	978,018,100.00	79.06%
广发证券股份有 限公司	1,948,446.00	0.19%	6,329,046.00	0.51%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024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	42,258,287.8 0	53,977.73	61,467,520.2 3	92,658.42

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

本基金本报告期末持有 183,654 股基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股（2024 年 12 月 31 日：219,154 股），成本总额为人民币 3,413,482.16 元（2024 年 12 月 31 日：3,772,840.14 元），估值总额为人民币 3,862,243.62 元（2024 年 12 月 31 日：4,264,736.84 元），占本基金资产净值的比例为 0.20%（2024 年 12 月 31 日：0.19%）。

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（2025 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
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701.00	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397.00	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	227.00	5,855.50	18,087.36	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	350.00	9,620.72	15,827.00	-
60320	天有	2025-0	6 个月	新股	93.50	90.66	166.00	15,521	15,049	-

2	为	4-16		流通受限				.00	.56	
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182.00	5,447.00	14,172.34	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536.00	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内 (含)	新股流通受限	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205.00	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-

301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-
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

123257	安克转债	2025-06-16	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	226.00	22,600.00	22,601.49	-
--------	------	------------	----------	--------	--------	--------	--------	-----------	-----------	---

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2025 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
400174	中天 3	2023-05-19	重大事项停牌	0.01	-	-	2,139,042.00	4,535,045.01	21,390.42	-

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 2025 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 2025 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 2025 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，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的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；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计

组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

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，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	22,601.49	2,829,697.73
未评级	-	-
合计	22,601.49	2,829,697.73

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、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行

评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，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标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	42,258,287.80	-	-	-	42,258,287.80
结算备付金	13,665,264.74	-	-	-	13,665,264.74
存出保证金	5,412,279.91	-	-	-	5,412,279.91
交易性金融资产	22,601.49	-	-	1,905,694,775.15	1,905,717,376.64
应收清算款	-	-	-	2,172,221.99	2,172,221.99
资产总计	61,358,433.94	-	-	1,907,866,997.14	1,969,225,431.08

负债					
应付清算款	-	-	-	13,540,366.29	13,540,366.29
应付管理人报酬	-	-	-	772,821.44	772,821.44
应付托管费	-	-	-	154,564.30	154,564.30
应交税费	-	-	-	22.88	22.88
其他负债	-	-	-	1,499,034.28	1,499,034.28
负债总计	-	-	-	15,966,809.19	15,966,809.19
利率敏感度缺口	61,358,433.94	-	-	1,891,900,187.95	1,953,258,621.89
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,008,110.71	-	-	-	28,008,110.71
结算备付金	13,303,360.47	-	-	-	13,303,360.47
存出保证金	5,358,191.42	-	-	-	5,358,191.42
交易性金融资产	2,829,697.73	-	-	2,173,163,167.05	2,175,992,864.78
应收清算款	-	-	-	23,960,475.34	23,960,475.34
资产总计	49,499,360.33	-	-	2,197,123,642.39	2,246,623,002.72
负债					
应付清算款	-	-	-	20,594,627.56	20,594,627.56
应付管理人报酬	-	-	-	994,046.06	994,046.06
应付托管费	-	-	-	198,809.19	198,809.19
应交税费	-	-	-	59,567.87	59,567.87
其他负债	-	-	-	7,197,850.44	7,197,850.44
负债总计	-	-	-	29,044,901.12	29,044,901.12
利率敏感度缺口	49,499,360.33	-	-	2,168,078,741.27	2,217,578,101.60

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 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2025 年 6 月 30 日		2024 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	1,905,694,775.15	97.56	2,173,163,167.05	98.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	22,601.49	0.00	2,829,697.73	0.13
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	1,905,717,376.64	97.57	2,175,992,864.78	98.12

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	上升 5%	99,891,456.72	112,400,924.52
	下降 5%	-99,891,456.72	-112,400,924.52

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	1,905,303,515.24
第二层次	37,987.03
第三层次	375,874.37
合计	1,905,717,376.64

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	1,905,694,775.15	96.77
	其中：股票	1,905,694,775.15	96.77
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	22,601.49	0.00
	其中：债券	22,601.49	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	55,923,552.54	2.84
8	其他各项资产	7,584,501.90	0.39
9	合计	1,969,225,431.08	100.00

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

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	4,746,729.58	0.24
B	采矿业	68,075,612.57	3.49
C	制造业	1,207,151,993.11	61.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,416,252.61	3.14
E	建筑业	16,731,590.17	0.86
F	批发和零售业	41,809,755.82	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	31,664,385.86	1.62
H	住宿和餐饮业	5,113,315.17	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	176,866,153.40	9.05
J	金融业	187,268,640.51	9.59
K	房地产业	23,618,854.22	1.21
L	租赁和商务服务业	16,373,133.11	0.84
M	科学研究和技术服务业	12,894,273.30	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	7,993,737.54	0.41

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,901,500.00	0.20
Q	卫生和社会工作	8,765,467.72	0.45
R	文化、体育和娱乐业	26,775,460.93	1.37
S	综合	4,527,919.53	0.23
	合计	1,905,694,775.15	97.56

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	300476	胜宏科技	156,300	21,003,594.00	1.08
2	000988	华工科技	260,336	12,238,395.36	0.63
3	600988	赤峰黄金	431,121	10,726,290.48	0.55
4	300339	润和软件	206,100	10,476,063.00	0.54
5	002966	苏州银行	1,156,439	10,153,534.42	0.52
6	600839	四川长虹	955,256	9,285,088.32	0.48
7	601162	天风证券	1,838,786	9,065,214.98	0.46
8	601555	东吴证券	1,028,521	8,999,558.75	0.46
9	689009	九号公司	148,589	8,792,011.13	0.45
10	688521	芯原股份	90,580	8,740,970.00	0.45
11	002517	恺英网络	439,700	8,490,607.00	0.43
12	002340	格林美	1,328,011	8,432,869.85	0.43
13	002195	岩山科技	1,471,651	8,285,395.13	0.42
14	603893	瑞芯微	54,291	8,244,631.26	0.42
15	002558	巨人网络	348,400	8,204,820.00	0.42
16	002156	通富微电	314,150	8,048,523.00	0.41
17	002261	拓维信息	260,000	8,047,000.00	0.41
18	600487	亨通光电	511,100	7,819,830.00	0.40
19	300251	光线传媒	380,297	7,708,620.19	0.39
20	002797	第一创业	1,087,685	7,700,809.80	0.39
21	600157	永泰能源	5,746,025	7,699,673.50	0.39
22	300207	欣旺达	382,000	7,662,920.00	0.39
23	688608	恒玄科技	21,912	7,624,937.76	0.39
24	300803	指南针	92,860	7,490,087.60	0.38
25	688213	思特威-W	72,628	7,424,034.16	0.38

26	000066	中国长城	500,500	7,407,400.00	0.38
27	688777	中控技术	163,802	7,356,347.82	0.38
28	688120	华海清科	43,130	7,276,031.00	0.37
29	600096	云天化	330,709	7,265,676.73	0.37
30	600536	中国软件	154,122	7,208,285.94	0.37
31	601168	西部矿业	432,251	7,188,334.13	0.37
32	002273	水晶光电	359,891	7,187,023.27	0.37
33	600879	航天电子	684,043	7,161,930.21	0.37
34	002465	海格通信	513,610	7,159,723.40	0.37
35	300450	先导智能	283,348	7,041,197.80	0.36
36	688235	百济神州-U	30,049	7,020,648.36	0.36
37	601099	太平洋	1,765,000	6,936,450.00	0.36
38	000831	中国稀土	192,027	6,936,015.24	0.36
39	600352	浙江龙盛	672,933	6,836,999.28	0.35
40	002294	信立泰	144,105	6,820,489.65	0.35
41	300017	网宿科技	634,060	6,797,123.20	0.35
42	000933	神火股份	407,600	6,782,464.00	0.35
43	600885	宏发股份	301,964	6,736,816.84	0.34
44	002185	华天科技	663,270	6,699,027.00	0.34
45	601108	财通证券	840,510	6,648,434.10	0.34
46	688002	睿创微纳	94,287	6,573,689.64	0.34
47	688617	惠泰医疗	22,090	6,560,730.00	0.34
48	601128	常熟银行	857,591	6,320,445.67	0.32
49	002130	沃尔核材	260,800	6,212,256.00	0.32
50	600079	人福医药	295,942	6,208,863.16	0.32
51	601577	长沙银行	624,233	6,204,876.02	0.32
52	688099	晶晨股份	87,159	6,189,160.59	0.32
53	002281	光迅科技	125,488	6,189,068.16	0.32
54	300454	深信服	65,700	6,187,626.00	0.32
55	002595	豪迈科技	103,561	6,132,882.42	0.31
56	688122	西部超导	117,935	6,118,467.80	0.31
57	688469	芯联集成-U	1,281,934	6,114,825.18	0.31
58	000423	东阿阿胶	116,845	6,110,993.50	0.31
59	002085	万丰奥威	384,000	6,101,760.00	0.31
60	000997	新大陆	186,692	6,045,086.96	0.31
61	300223	北京君正	87,300	6,041,160.00	0.31
62	002738	中矿资源	186,866	6,009,610.56	0.31
63	300058	蓝色光标	916,047	6,009,268.32	0.31
64	002532	天山铝业	722,700	6,005,637.00	0.31
65	300002	神州泰岳	508,800	6,003,840.00	0.31
66	603129	春风动力	27,600	5,975,400.00	0.31
67	000783	长江证券	859,074	5,953,382.82	0.30
68	300458	全志科技	149,810	5,945,958.90	0.30
69	300474	景嘉微	81,101	5,920,373.00	0.30

70	600109	国金证券	673,631	5,907,743.87	0.30
71	002472	双环传动	175,703	5,884,293.47	0.30
72	002138	顺络电子	208,652	5,867,294.24	0.30
73	002078	太阳纸业	434,197	5,844,291.62	0.30
74	603596	伯特利	110,051	5,798,587.19	0.30
75	002436	兴森科技	437,400	5,791,176.00	0.30
76	601933	永辉超市	1,173,700	5,751,130.00	0.29
77	002410	广联达	427,200	5,728,752.00	0.29
78	002851	麦格米特	113,200	5,675,848.00	0.29
79	300346	南大光电	178,900	5,660,396.00	0.29
80	600862	中航高科	216,469	5,645,511.52	0.29
81	300765	新诺威	109,200	5,644,548.00	0.29
82	688525	佰维存储	83,557	5,631,741.80	0.29
83	600143	金发科技	545,666	5,625,816.46	0.29
84	002850	科达利	49,635	5,617,192.95	0.29
85	688072	拓荆科技	36,527	5,614,565.17	0.29
86	300136	信维通信	250,060	5,601,344.00	0.29
87	601198	东兴证券	501,799	5,595,058.85	0.29
88	600580	卧龙电驱	282,470	5,584,431.90	0.29
89	002065	东华软件	581,506	5,582,457.60	0.29
90	300024	机器人	324,764	5,579,445.52	0.29
91	300054	鼎龙股份	194,400	5,575,392.00	0.29
92	002353	杰瑞股份	159,234	5,573,190.00	0.29
93	000034	神州数码	147,500	5,551,900.00	0.28
94	002223	鱼跃医疗	155,700	5,542,920.00	0.28
95	600298	安琪酵母	157,400	5,535,758.00	0.28
96	600873	梅花生物	517,532	5,532,417.08	0.28
97	300395	菲利华	108,200	5,529,020.00	0.28
98	603606	东方电缆	106,800	5,522,628.00	0.28
99	002202	金风科技	536,700	5,501,175.00	0.28
100	600363	联创光电	94,000	5,483,020.00	0.28
101	002673	西部证券	693,867	5,467,671.96	0.28
102	300496	中科创达	95,310	5,453,638.20	0.28
103	688578	艾力斯	58,342	5,428,139.68	0.28
104	601615	明阳智能	469,900	5,399,151.00	0.28
105	300857	协创数据	62,400	5,370,144.00	0.27
106	000728	国元证券	677,081	5,342,169.09	0.27
107	002624	完美世界	352,064	5,340,810.88	0.27
108	300383	光环新网	373,015	5,334,114.50	0.27
109	002008	大族激光	218,072	5,314,414.64	0.27
110	000021	深科技	282,432	5,292,775.68	0.27
111	300115	长盈精密	245,500	5,253,700.00	0.27
112	603659	璞泰来	276,400	5,190,792.00	0.27
113	600895	张江高科	200,621	5,155,959.70	0.26

114	600549	厦门钨业	246,343	5,153,495.56	0.26
115	300604	长川科技	114,500	5,142,195.00	0.26
116	603160	汇顶科技	71,998	5,114,017.94	0.26
117	603605	珀莱雅	61,700	5,108,143.00	0.26
118	603087	甘李药业	93,206	5,105,824.68	0.26
119	000426	兴业银锡	322,000	5,087,600.00	0.26
120	688220	翱捷科技-U	64,834	5,076,502.20	0.26
121	300012	华测检测	433,724	5,070,233.56	0.26
122	002155	湖南黄金	282,737	5,046,855.45	0.26
123	000733	振华科技	100,300	5,020,015.00	0.26
124	600171	上海贝岭	145,600	4,986,800.00	0.26
125	300627	华测导航	141,440	4,950,400.00	0.25
126	688361	中科飞测	57,981	4,881,420.39	0.25
127	605589	圣泉集团	175,400	4,867,350.00	0.25
128	601216	君正集团	873,700	4,822,824.00	0.25
129	600392	盛和资源	362,616	4,775,652.72	0.24
130	000750	国海证券	1,158,188	4,771,734.56	0.24
131	300699	光威复材	150,612	4,769,882.04	0.24
132	300037	新宙邦	135,229	4,760,060.80	0.24
133	601665	齐鲁银行	753,038	4,759,200.16	0.24
134	601997	贵阳银行	757,810	4,728,734.40	0.24
135	000932	华菱钢铁	1,073,523	4,723,501.20	0.24
136	002444	巨星科技	185,030	4,720,115.30	0.24
137	688180	君实生物-U	138,878	4,719,074.44	0.24
138	000729	燕京啤酒	364,452	4,712,364.36	0.24
139	300003	乐普医疗	340,885	4,697,395.30	0.24
140	000519	中兵红箭	214,385	4,692,887.65	0.24
141	600060	海信视像	202,791	4,668,248.82	0.24
142	600153	建发股份	450,137	4,667,920.69	0.24
143	601717	中创智领	280,067	4,654,713.54	0.24
144	601696	中银证券	432,539	4,623,841.91	0.24
145	000878	云南铜业	363,508	4,623,821.76	0.24
146	601990	南京证券	571,871	4,620,717.68	0.24
147	601233	桐昆股份	434,781	4,608,678.60	0.24
148	300073	当升科技	104,916	4,602,664.92	0.24
149	300001	特锐德	191,045	4,579,348.65	0.23
150	002821	凯莱英	51,700	4,562,525.00	0.23
151	300142	沃森生物	414,500	4,559,500.00	0.23
152	688052	纳芯微	26,011	4,538,659.39	0.23
153	600673	东阳光	389,331	4,527,919.53	0.23
154	002414	高德红外	441,600	4,526,400.00	0.23
155	600369	西南证券	1,033,425	4,495,398.75	0.23
156	603979	金诚信	96,700	4,490,748.00	0.23
157	002837	英维克	150,660	4,476,108.60	0.23

158	002007	华兰生物	284,100	4,451,847.00	0.23
159	600699	均胜电子	255,137	4,449,589.28	0.23
160	688027	国盾量子	16,123	4,433,986.23	0.23
161	688065	凯赛生物	93,287	4,393,817.70	0.22
162	600118	中国卫星	153,272	4,378,981.04	0.22
163	300373	扬杰科技	84,204	4,370,187.60	0.22
164	600177	雅戈尔	598,153	4,366,516.90	0.22
165	600521	华海药业	233,773	4,355,190.99	0.22
166	600398	海澜之家	623,514	4,339,657.44	0.22
167	002152	广电运通	321,937	4,326,833.28	0.22
168	000893	亚钾国际	143,500	4,325,090.00	0.22
169	603345	安井食品	53,200	4,278,344.00	0.22
170	600704	物产中大	807,748	4,256,831.96	0.22
171	300748	金力永磁	178,087	4,245,594.08	0.22
172	600909	华安证券	726,750	4,236,952.50	0.22
173	600435	北方导航	271,417	4,231,391.03	0.22
174	000738	航发控制	203,912	4,231,174.00	0.22
175	688249	晶合集成	207,831	4,212,734.37	0.22
176	600316	洪都航空	111,416	4,200,383.20	0.22
177	000623	吉林敖东	247,316	4,192,006.20	0.21
178	600497	驰宏锌锗	791,874	4,189,013.46	0.21
179	002318	久立特材	178,300	4,170,437.00	0.21
180	002044	美年健康	810,400	4,165,456.00	0.21
181	002958	青农商行	1,151,793	4,157,972.73	0.21
182	000009	中国宝安	467,625	4,152,510.00	0.21
183	603179	新泉股份	88,300	4,147,451.00	0.21
184	600765	中航重机	244,978	4,135,228.64	0.21
185	600038	中直股份	106,331	4,126,706.11	0.21
186	600141	兴发集团	200,343	4,113,041.79	0.21
187	688385	复旦微电	83,442	4,111,187.34	0.21
188	002409	雅克科技	74,293	4,063,084.17	0.21
189	603228	景旺电子	96,733	4,047,308.72	0.21
190	000528	柳工	419,100	4,027,551.00	0.21
191	002683	广东宏大	118,343	4,016,561.42	0.21
192	600562	国睿科技	127,500	4,014,975.00	0.21
193	000400	许继电气	184,239	4,010,883.03	0.21
194	600155	华创云信	575,512	4,005,563.52	0.21
195	001696	宗申动力	178,000	3,996,100.00	0.20
196	300919	中伟股份	121,200	3,985,056.00	0.20
197	688188	柏楚电子	30,067	3,958,621.22	0.20
198	300724	捷佳伟创	72,347	3,928,442.10	0.20
199	300757	罗博特科	26,100	3,914,217.00	0.20
200	000960	锡业股份	255,706	3,912,301.80	0.20
201	600637	东方明珠	523,075	3,907,370.25	0.20

202	002607	中公教育	1,275,000	3,901,500.00	0.20
203	600498	烽火通信	183,654	3,862,243.62	0.20
204	600884	杉杉股份	407,700	3,856,842.00	0.20
205	603939	益丰药房	157,234	3,847,515.98	0.20
206	300623	捷捷微电	128,800	3,838,240.00	0.20
207	300558	贝达药业	65,591	3,800,998.45	0.19
208	600529	山东药玻	171,655	3,800,441.70	0.19
209	600563	法拉电子	34,827	3,799,277.43	0.19
210	688568	中科星图	104,599	3,766,609.99	0.19
211	000039	中集集团	477,345	3,751,931.70	0.19
212	002739	万达电影	327,600	3,744,468.00	0.19
213	002841	视源股份	108,100	3,740,260.00	0.19
214	000415	渤海租赁	1,121,100	3,733,263.00	0.19
215	301358	湖南裕能	117,700	3,671,063.00	0.19
216	600486	扬农化工	63,186	3,664,788.00	0.19
217	002653	海思科	86,798	3,664,611.56	0.19
218	002025	航天电器	71,033	3,651,806.53	0.19
219	002926	华西证券	406,967	3,638,284.98	0.19
220	600901	江苏金租	598,719	3,628,237.14	0.19
221	002385	大北农	892,068	3,603,954.72	0.18
222	000887	中鼎股份	204,842	3,603,170.78	0.18
223	300285	国瓷材料	206,402	3,581,074.70	0.18
224	688017	绿的谐波	28,661	3,579,472.29	0.18
225	300763	锦浪科技	62,100	3,563,919.00	0.18
226	002939	长城证券	418,733	3,508,982.54	0.18
227	688582	芯动联科	52,034	3,496,684.80	0.18
228	688114	华大智造	53,902	3,494,466.66	0.18
229	300679	电连技术	76,800	3,485,184.00	0.18
230	300144	宋城演艺	407,300	3,482,415.00	0.18
231	603486	科沃斯	59,800	3,482,154.00	0.18
232	600820	隧道股份	569,639	3,474,797.90	0.18
233	002568	百润股份	135,653	3,474,073.33	0.18
234	600863	内蒙华电	844,241	3,469,830.51	0.18
235	600132	重庆啤酒	62,900	3,465,790.00	0.18
236	600008	首创环保	1,142,425	3,450,123.50	0.18
237	000723	美锦能源	796,800	3,442,176.00	0.18
238	002064	华峰化学	513,200	3,392,252.00	0.17
239	600516	方大炭素	730,840	3,391,097.60	0.17
240	600390	五矿资本	581,610	3,390,786.30	0.17
241	000513	丽珠集团	93,936	3,385,453.44	0.17
242	002080	中材科技	173,546	3,384,147.00	0.17
243	603568	伟明环保	176,995	3,377,064.60	0.17
244	002312	川发龙蟒	293,600	3,370,528.00	0.17
245	000703	恒逸石化	570,373	3,353,793.24	0.17

246	600998	九州通	652,426	3,353,469.64	0.17
247	688538	和辉光电-U	1,431,429	3,349,543.86	0.17
248	600763	通策医疗	80,924	3,340,542.72	0.17
249	600166	福田汽车	1,230,295	3,334,099.45	0.17
250	688183	生益电子	64,664	3,310,796.80	0.17
251	300487	蓝晓科技	65,770	3,308,231.00	0.17
252	600170	上海建工	1,384,068	3,307,922.52	0.17
253	002262	恩华药业	158,200	3,287,396.00	0.17
254	002500	山西证券	558,498	3,261,628.32	0.17
255	600208	衢州发展	1,101,797	3,261,319.12	0.17
256	601179	中国西电	530,589	3,257,816.46	0.17
257	603816	顾家家居	127,225	3,246,782.00	0.17
258	603589	口子窖	93,238	3,244,682.40	0.17
259	600312	平高电气	210,200	3,234,978.00	0.17
260	605358	立昂微	138,839	3,234,948.70	0.17
261	300676	华大基因	64,993	3,234,701.61	0.17
262	000683	博源化工	672,164	3,219,665.56	0.16
263	600021	上海电力	365,100	3,209,229.00	0.16
264	601155	新城控股	233,900	3,199,752.00	0.16
265	002203	海亮股份	309,652	3,195,608.64	0.16
266	600985	淮北矿业	279,100	3,164,994.00	0.16
267	002244	滨江集团	322,884	3,148,119.00	0.16
268	600126	杭钢股份	349,368	3,144,312.00	0.16
269	000403	派林生物	172,690	3,130,869.70	0.16
270	600380	健康元	283,608	3,128,196.24	0.16
271	002432	九安医疗	85,850	3,127,515.50	0.16
272	603338	浙江鼎力	65,900	3,123,660.00	0.16
273	000591	太阳能	710,924	3,120,956.36	0.16
274	600583	海油工程	570,800	3,116,568.00	0.16
275	601000	唐山港	767,003	3,114,032.18	0.16
276	600348	华阳股份	466,277	3,105,404.82	0.16
277	688728	格科微	201,397	3,101,513.80	0.16
278	000060	中金岭南	677,059	3,100,930.22	0.16
279	000921	海信家电	120,430	3,095,051.00	0.16
280	000629	钒钛股份	1,206,233	3,087,956.48	0.16
281	600872	中炬高新	161,900	3,076,100.00	0.16
282	300567	精测电子	50,700	3,072,927.00	0.16
283	603885	吉祥航空	227,537	3,064,923.39	0.16
284	002603	以岭药业	216,900	3,058,290.00	0.16
285	601991	大唐发电	964,636	3,057,896.12	0.16
286	000830	鲁西化工	296,772	3,056,751.60	0.16
287	688278	特宝生物	42,296	3,049,964.56	0.16
288	603379	三美股份	63,279	3,044,985.48	0.16
289	600535	天士力	193,745	3,032,109.25	0.16

290	002984	森麒麟	161,160	3,021,750.00	0.15
291	600816	建元信托	1,018,600	3,004,870.00	0.15
292	002439	启明星辰	187,621	3,000,059.79	0.15
293	002056	横店东磁	210,069	2,972,476.35	0.15
294	300146	汤臣倍健	264,157	2,969,124.68	0.15
295	600095	湘财股份	295,981	2,968,689.43	0.15
296	600499	科达制造	298,689	2,927,152.20	0.15
297	600970	中材国际	340,624	2,922,553.92	0.15
298	002423	中粮资本	238,692	2,919,203.16	0.15
299	000062	深圳华强	108,600	2,916,996.00	0.15
300	603927	中科软	150,727	2,915,060.18	0.15
301	601016	节能风电	1,005,607	2,906,204.23	0.15
302	601880	辽港股份	1,937,276	2,905,914.00	0.15
303	600685	中船防务	106,300	2,890,297.00	0.15
304	603000	人民网	143,008	2,890,191.68	0.15
305	000636	风华高科	209,521	2,878,818.54	0.15
306	601611	中国核建	311,857	2,865,965.83	0.15
307	000958	电投产融	418,893	2,865,228.12	0.15
308	300390	天华新能	150,114	2,862,673.98	0.15
309	301308	江波龙	32,600	2,852,174.00	0.15
310	603298	杭叉集团	135,980	2,848,781.00	0.15
311	600511	国药股份	97,672	2,848,115.52	0.15
312	601666	平煤股份	383,604	2,842,505.64	0.15
313	000563	陕国投 A	795,339	2,839,360.23	0.15
314	600859	王府井	204,366	2,838,643.74	0.15
315	300212	易华录	130,307	2,835,480.32	0.15
316	603737	三棵树	76,501	2,819,061.85	0.14
317	601456	国联民生	271,615	2,811,215.25	0.14
318	000155	川能动力	285,844	2,806,988.08	0.14
319	688297	中无人机	52,516	2,804,354.40	0.14
320	600655	豫园股份	504,634	2,800,718.70	0.14
321	603077	和邦生物	1,596,259	2,793,453.25	0.14
322	000598	兴蓉环境	386,194	2,784,458.74	0.14
323	601966	玲珑轮胎	189,774	2,783,984.58	0.14
324	600004	白云机场	305,600	2,780,960.00	0.14
325	600325	华发股份	570,926	2,780,409.62	0.14
326	300677	英科医疗	117,200	2,775,296.00	0.14
327	603899	晨光股份	95,600	2,771,444.00	0.14
328	688520	神州细胞	46,241	2,767,523.85	0.14
329	600483	福能股份	287,078	2,767,431.92	0.14
330	002773	康弘药业	95,500	2,766,635.00	0.14
331	688301	奕瑞科技	31,430	2,753,582.30	0.14
332	603156	养元饮品	130,078	2,752,450.48	0.14
333	600131	国网信通	155,161	2,746,349.70	0.14

334	601958	金钼股份	250,174	2,736,903.56	0.14
335	600663	陆家嘴	306,447	2,715,120.42	0.14
336	000050	深天马 A	318,394	2,712,716.88	0.14
337	600378	昊华科技	99,907	2,704,482.49	0.14
338	002507	涪陵榨菜	211,018	2,698,920.22	0.14
339	600282	南钢股份	639,717	2,686,811.40	0.14
340	300529	健帆生物	124,349	2,682,207.93	0.14
341	000951	中国重汽	152,300	2,677,434.00	0.14
342	000987	越秀资本	388,795	2,667,133.70	0.14
343	600754	锦江酒店	118,800	2,665,872.00	0.14
344	600271	航天信息	288,368	2,664,520.32	0.14
345	002756	永兴材料	83,430	2,648,902.50	0.14
346	601001	晋控煤业	216,700	2,648,074.00	0.14
347	600598	北大荒	183,627	2,647,901.34	0.14
348	300601	康泰生物	173,600	2,636,984.00	0.14
349	301536	星宸科技	43,700	2,635,110.00	0.13
350	000559	万向钱潮	342,826	2,622,618.90	0.13
351	600739	辽宁成大	237,906	2,616,966.00	0.13
352	600737	中粮糖业	276,909	2,616,790.05	0.13
353	688234	天岳先进	44,668	2,615,311.40	0.13
354	601918	新集能源	401,300	2,592,398.00	0.13
355	688363	华熙生物	50,113	2,573,302.55	0.13
356	002429	兆驰股份	585,788	2,565,751.44	0.13
357	600582	天地科技	427,952	2,563,432.48	0.13
358	601333	广深铁路	879,100	2,540,599.00	0.13
359	300070	碧水源	564,531	2,540,389.50	0.13
360	603290	斯达半导	31,023	2,521,239.21	0.13
361	688772	珠海冠宇	176,358	2,520,155.82	0.13
362	601866	中远海发	1,017,440	2,513,076.80	0.13
363	600566	济川药业	95,428	2,512,619.24	0.13
364	002120	韵达股份	374,800	2,511,160.00	0.13
365	300751	迈为股份	36,100	2,511,116.00	0.13
366	600764	中国海防	73,786	2,508,724.00	0.13
367	601231	环旭电子	170,805	2,498,877.15	0.13
368	600867	通化东宝	304,337	2,495,563.40	0.13
369	603728	鸣志电器	43,400	2,494,198.00	0.13
370	300735	光弘科技	99,200	2,489,920.00	0.13
371	300888	稳健医疗	60,213	2,474,754.30	0.13
372	002430	杭氧股份	127,247	2,471,136.74	0.13
373	603688	石英股份	70,042	2,466,879.24	0.13
374	600329	达仁堂	73,872	2,464,369.92	0.13
375	003031	中瓷电子	46,260	2,461,494.60	0.13
376	603341	龙旗科技	60,500	2,458,115.00	0.13
377	688778	厦钨新能	43,901	2,454,943.92	0.13

378	600258	首旅酒店	173,209	2,447,443.17	0.13
379	601098	中南传媒	186,213	2,443,114.56	0.13
380	600995	南网储能	247,200	2,417,616.00	0.12
381	688561	奇安信-U	70,866	2,408,026.68	0.12
382	600707	彩虹股份	372,363	2,405,464.98	0.12
383	601212	白银有色	766,900	2,400,397.00	0.12
384	688676	金盘科技	71,487	2,391,240.15	0.12
385	000032	深桑达 A	117,900	2,385,117.00	0.12
386	000027	深圳能源	368,112	2,348,554.56	0.12
387	603858	步长制药	143,573	2,331,625.52	0.12
388	600578	京能电力	518,300	2,327,167.00	0.12
389	002508	老板电器	122,418	2,327,166.18	0.12
390	603529	爱玛科技	67,055	2,306,692.00	0.12
391	688318	财富趋势	20,069	2,306,329.48	0.12
392	000709	河钢股份	1,065,985	2,302,527.60	0.12
393	600906	财达证券	336,825	2,297,146.50	0.12
394	300573	兴齐眼药	44,340	2,296,368.60	0.12
395	002299	圣农发展	160,662	2,295,859.98	0.12
396	301498	乖宝宠物	20,900	2,285,833.00	0.12
397	000883	湖北能源	506,287	2,283,354.37	0.12
398	000967	盈峰环境	328,100	2,280,295.00	0.12
399	600517	国网英大	445,076	2,269,887.60	0.12
400	600848	上海临港	248,542	2,254,275.94	0.12
401	002670	国盛金控	149,713	2,253,180.65	0.12
402	002831	裕同科技	95,919	2,246,422.98	0.12
403	600546	山煤国际	256,920	2,242,911.60	0.11
404	601399	国机重装	745,900	2,237,700.00	0.11
405	600959	江苏有线	645,585	2,220,812.40	0.11
406	601928	凤凰传媒	197,012	2,200,624.04	0.11
407	601156	东航物流	165,053	2,160,543.77	0.11
408	600968	海油发展	528,035	2,154,382.80	0.11
409	600808	马钢股份	622,109	2,146,276.05	0.11
410	300595	欧普康视	139,531	2,130,638.37	0.11
411	600528	中铁工业	288,484	2,129,011.92	0.11
412	000825	太钢不锈	592,294	2,126,335.46	0.11
413	000739	普洛药业	151,810	2,125,340.00	0.11
414	002572	索菲亚	150,223	2,104,624.23	0.11
415	601118	海南橡胶	444,667	2,098,828.24	0.11
416	603225	新凤鸣	196,996	2,098,007.40	0.11
417	601636	旗滨集团	417,391	2,091,128.91	0.11
418	301301	川宁生物	173,600	2,090,144.00	0.11
419	603565	中谷物流	218,200	2,083,810.00	0.11
420	002266	浙富控股	674,118	2,076,283.44	0.11
421	601608	中信重工	474,126	2,071,930.62	0.11

422	600977	中国电影	193,000	2,068,960.00	0.11
423	600801	华新水泥	174,055	2,060,811.20	0.11
424	600871	石化油服	1,055,974	2,059,149.30	0.11
425	000543	皖能电力	293,400	2,053,800.00	0.11
426	601598	中国外运	407,729	2,010,103.97	0.10
427	600062	华润双鹤	107,285	2,001,938.10	0.10
428	688387	信科移动-U	353,828	1,999,128.20	0.10
429	603650	彤程新材	62,112	1,996,900.80	0.10
430	600056	中国医药	193,067	1,996,312.78	0.10
431	688563	航材股份	35,242	1,995,754.46	0.10
432	601106	中国一重	706,841	1,979,154.80	0.10
433	000582	北部湾港	239,834	1,978,630.50	0.10
434	688702	盛科通信-U	32,222	1,968,119.76	0.10
435	000785	居然智家	643,502	1,962,681.10	0.10
436	300957	贝泰妮	43,900	1,941,258.00	0.10
437	603233	大参林	118,515	1,931,794.50	0.10
438	600925	苏能股份	356,400	1,863,972.00	0.10
439	600373	中文传媒	180,982	1,858,685.14	0.10
440	601965	中国汽研	104,100	1,847,775.00	0.09
441	002153	石基信息	212,911	1,843,809.26	0.09
442	000429	粤高速 A	135,100	1,800,883.00	0.09
443	000537	中绿电	215,191	1,798,996.76	0.09
444	600606	绿地控股	1,089,100	1,775,233.00	0.09
445	688281	华秦科技	28,423	1,719,875.73	0.09
446	002372	伟星新材	165,418	1,713,730.48	0.09
447	601568	北元集团	411,911	1,709,430.65	0.09
448	600098	广州发展	271,500	1,696,875.00	0.09
449	001286	陕西能源	194,567	1,692,732.90	0.09
450	600361	创新新材	424,200	1,692,558.00	0.09
451	688425	铁建重工	413,375	1,686,570.00	0.09
452	603658	安图生物	44,450	1,666,875.00	0.09
453	003022	联泓新科	104,400	1,652,652.00	0.08
454	600612	老凤祥	32,700	1,626,825.00	0.08
455	600688	上海石化	568,000	1,618,800.00	0.08
456	688349	三一重能	63,748	1,589,875.12	0.08
457	000937	冀中能源	273,495	1,572,596.25	0.08
458	601019	山东出版	163,100	1,544,557.00	0.08
459	301165	锐捷网络	24,880	1,529,124.80	0.08
460	002608	江苏国信	196,582	1,440,946.06	0.07
461	000898	鞍钢股份	618,337	1,434,541.84	0.07
462	688100	威胜信息	38,662	1,432,427.10	0.07
463	601139	深圳燃气	225,070	1,431,445.20	0.07
464	600339	中油工程	434,056	1,419,363.12	0.07
465	600032	浙江新能	187,100	1,414,476.00	0.07

466	603707	健友股份	124,660	1,389,959.00	0.07
467	688248	南网科技	43,937	1,382,258.02	0.07
468	000959	首钢股份	405,629	1,379,138.60	0.07
469	600720	中交设计	178,200	1,377,486.00	0.07
470	600928	西安银行	343,406	1,346,151.52	0.07
471	600295	鄂尔多斯	154,400	1,344,824.00	0.07
472	003035	南网能源	292,479	1,342,478.61	0.07
473	002461	珠江啤酒	114,900	1,297,221.00	0.07
474	603556	海兴电力	50,500	1,286,235.00	0.07
475	688475	萤石网络	40,785	1,285,543.20	0.07
476	688032	禾迈股份	12,853	1,283,500.58	0.07
477	601228	广州港	390,175	1,260,265.25	0.06
478	301267	华夏眼科	65,700	1,259,469.00	0.06
479	688375	国博电子	20,341	1,220,663.41	0.06
480	688172	燕东微	62,032	1,219,549.12	0.06
481	603786	科博达	21,204	1,174,913.64	0.06
482	600927	永安期货	76,080	1,126,744.80	0.06
483	601061	中信金属	138,700	1,097,117.00	0.06
484	002563	森马服饰	207,843	1,093,254.18	0.06
485	600007	中国国贸	52,600	1,082,508.00	0.06
486	000539	粤电力 A	232,100	1,053,734.00	0.05
487	600299	安迪苏	103,629	1,000,019.85	0.05
488	300140	节能环境	162,000	999,540.00	0.05
489	002945	华林证券	69,525	999,074.25	0.05
490	603826	坤彩科技	50,565	989,557.05	0.05
491	688819	天能股份	35,637	989,283.12	0.05
492	001213	中铁特货	231,400	939,484.00	0.05
493	601921	浙版传媒	115,200	928,512.00	0.05
494	601858	中国科传	40,900	795,505.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	22,502	697,787.02	0.04
496	601158	重庆水务	150,200	696,928.00	0.04
497	600956	新天绿能	80,519	621,606.68	0.03
498	001389	广合科技	10,200	599,454.00	0.03
499	688295	中复神鹰	26,107	543,025.60	0.03
500	603868	飞科电器	12,328	442,205.36	0.02
501	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
502	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
503	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
504	400174	中天 3	2,139,042	21,390.42	0.00
505	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
506	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
507	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
508	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
509	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00

510	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
511	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
512	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
513	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
514	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
515	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
516	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
517	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
518	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
519	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
520	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
521	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
522	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
523	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
524	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
525	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
526	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
527	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
528	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
529	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
530	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
531	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
532	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
533	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
534	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
535	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	688608	恒玄科技	8,216,172.16	0.37
2	688235	百济神州-U	7,815,014.40	0.35
3	000933	神火股份	7,035,108.00	0.32
4	002625	光启技术	6,622,940.00	0.30
5	300450	先导智能	6,336,191.00	0.29
6	002130	沃尔核材	6,054,124.00	0.27
7	300454	深信服	6,009,667.00	0.27
8	300458	全志科技	5,891,471.70	0.27
9	600363	联创光电	5,697,382.00	0.26

10	300346	南大光电	5,517,386.40	0.25
11	002851	麦格米特	5,385,862.00	0.24
12	002966	苏州银行	5,263,196.00	0.24
13	300115	长盈精密	5,253,581.00	0.24
14	300857	协创数据	5,223,323.20	0.24
15	605589	圣泉集团	4,733,868.00	0.21
16	600171	上海贝岭	4,712,044.00	0.21
17	002007	华兰生物	4,673,747.00	0.21
18	603659	璞泰来	4,560,773.00	0.21
19	300627	华测导航	4,555,530.32	0.21
20	300476	胜宏科技	4,549,880.00	0.21

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002625	光启技术	24,872,898.79	1.12
2	600418	江淮汽车	19,385,105.22	0.87
3	002384	东山精密	17,915,749.74	0.81
4	301236	软通动力	13,373,113.08	0.60
5	300866	安克创新	9,294,490.35	0.42
6	302132	中航成飞	8,949,461.00	0.40
7	002128	电投能源	8,847,509.01	0.40
8	300339	润和软件	6,827,229.00	0.31
9	000988	华工科技	6,713,409.00	0.30
10	300476	胜宏科技	6,386,372.00	0.29
11	002202	金风科技	5,782,805.00	0.26
12	002407	多氟多	5,758,740.00	0.26
13	300207	欣旺达	5,381,448.00	0.24
14	000818	航锦科技	5,333,044.00	0.24
15	002340	格林美	5,330,521.00	0.24
16	002966	苏州银行	5,227,539.90	0.24
17	688047	龙芯中科	5,129,044.71	0.23
18	002797	第一创业	5,025,024.00	0.23
19	300395	菲利华	4,984,740.00	0.22

20	002273	水晶光电	4,893,680.90	0.22
----	--------	------	--------------	------

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	601,472,964.32
卖出股票收入（成交）总额	748,725,240.81

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	22,601.49	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,601.49	0.00

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	123257.SZ	安克转债	226	22,601.49	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 基金，主要投资标的指数的成份股及备选成份股，同时可以投资股指期货。本基金投资股指期货，可以更好地进行流动性管理。本基金尽量选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本和跟踪误差，力争更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚。胜宏科技（惠州）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。天风证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方人社局的处罚。

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，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	5,412,279.91
2	应收清算款	2,172,221.99
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,584,501.90

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金(LOF)	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
11,490	90,951.99	900,186 ,341.00	86.14%	144,851 ,978.00	13.86%	829,658,70 0.00	79.39%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	13,417,200.00	1.28%
2	香港中央结算有限公司	7,730,400.00	0.74%
3	中国平安人寿保险股份有限公司-万能-个险万能	6,321,700.00	0.60%
4	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	6,319,600.00	0.60%
5	中国人寿保险(集团)公司	4,442,700.00	0.43%
6	简街香港有限公司-JSQB 有限公司(R)	3,231,400.00	0.31%
7	兴宝国际信托有限责任公司	2,904,000.00	0.28%
8	冉启兵	2,501,100.00	0.24%
9	光大理财有限责任公司-阳光橙优选科创	2,382,600.00	0.23%
10	中信建投证券股份有限公司	2,311,000.00	0.22%
11	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	829,658,700.00	79.39%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 4 月 11 日）基金份额总额	425,038,319.00
本报告期期初基金份额总额	1,237,038,319.00
本报告期基金总申购份额	426,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	618,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,045,038,319.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理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。

10.6.2 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，本基金托管人及其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	
申万宏源证券	3	893,006,154.59	66.21%	165,215.31	66.21%	-
华泰证券	5	431,973,725.12	32.03%	79,916.40	32.03%	-

光大证券	3	23,718,949.17	1.76%	4,388.03	1.76%	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
中金财富	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
德邦证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	8	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
高盛中国	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
国都证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
太平洋	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
国泰海通	4	-	-	-	-	-

中天证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
国投证券	5	-	-	-	-	-

注：1、选择标准

- （1）经营行为稳健规范，合规内控制度健全，财务状况良好，在业内具有良好声誉；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；
- （3）具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

（4）具有较强的综合研究能力，拥有独立的研究部门及相当规模的研究团队，有完善的研究报告质量和合规保障机制，能及时向公司提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告，可以根据公司管理基金的特定要求，提供专门研究报告；

（5）公司证券研究报告业务、内控管理、合规风控等方面未受到重大行政处罚或重大行政监管措施；

- （6）中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

（1）对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

（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。

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				比例		
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,793,139.58	81.81%	-	-	-	-
光大证券	72,000.00	1.55%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	771,200.00	16.63%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
2	关于广发基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-19
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-29
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21
5	关于增加甬兴证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-22
6	关于增加华西证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-09
7	关于增加瑞银证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-13

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广 发 中 证 500	1	20250101-20250630	978,018,100.0	309,000,000.00	457,359,400.0	829,658,700.00	79.39%

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担，本基金管理人相应修订了基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金指数使用费均由基金管理人承担。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日