

广发中证 A500 指数增强型证券投资基金  
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 17 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	62
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	62

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
7.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
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情况 .....	64
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
10.4 基金投资策略的改变 .....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
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 .....	68
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	广发中证 A500 指数增强	
基金主代码	022686	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 17 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,886,890.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中证 A500 指数增强 A	广发中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022686	022687
报告期末下属分级基金的份额总额	79,781,465.36 份	36,105,424.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法及基本面分析进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，再基于数量化投资分析及基本面研究等方法对投资组合进行优化，以争取实现指数增强型的目标。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票指数增强型基金，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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	项军	王小飞
	联系电话	020-83936666	021-60637103
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828	021-60637228
传真		020-34281105	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510308	100033
法定代表人		葛长伟	张金良

## 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	广发基金管理有限公司	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

# 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17日(基金合同生效日)至2025年6月30日)	
	广发中证 A500 指数增强 A	广发中证 A500 指数增强 C

本期已实现收益	-1,727,998.52	-445,261.10
本期利润	119,852.07	650,855.05
加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.0089
本期加权平均净值利润率	0.06%	0.90%
本期基金份额净值增长率	0.60%	0.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	广发中证 A500 指数增强 A	广发中证 A500 指数增强 C
期末可供分配利润	-766,373.50	-412,340.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0096	-0.0114
期末基金资产净值	80,259,252.45	36,254,421.30
期末基金份额净值	1.0060	1.0041
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	广发中证 A500 指数增强 A	广发中证 A500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	0.60%	0.41%

注：（1）本基金合同生效日为 2025 年 1 月 17 日，至披露时点不满半年。

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

（3）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证 A500 指数增强 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	3.51%	0.55%	2.68%	0.57%	0.83%	-0.02%
过去三个月	2.38%	1.14%	0.83%	1.14%	1.55%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.93%	3.69%	1.01%	-3.09%	-0.08%

广发中证 A500 指数增强 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	3.47%	0.55%	2.68%	0.57%	0.79%	-0.02%
过去三个月	2.28%	1.14%	0.83%	1.14%	1.45%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.41%	0.94%	3.69%	1.01%	-3.28%	-0.07%

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

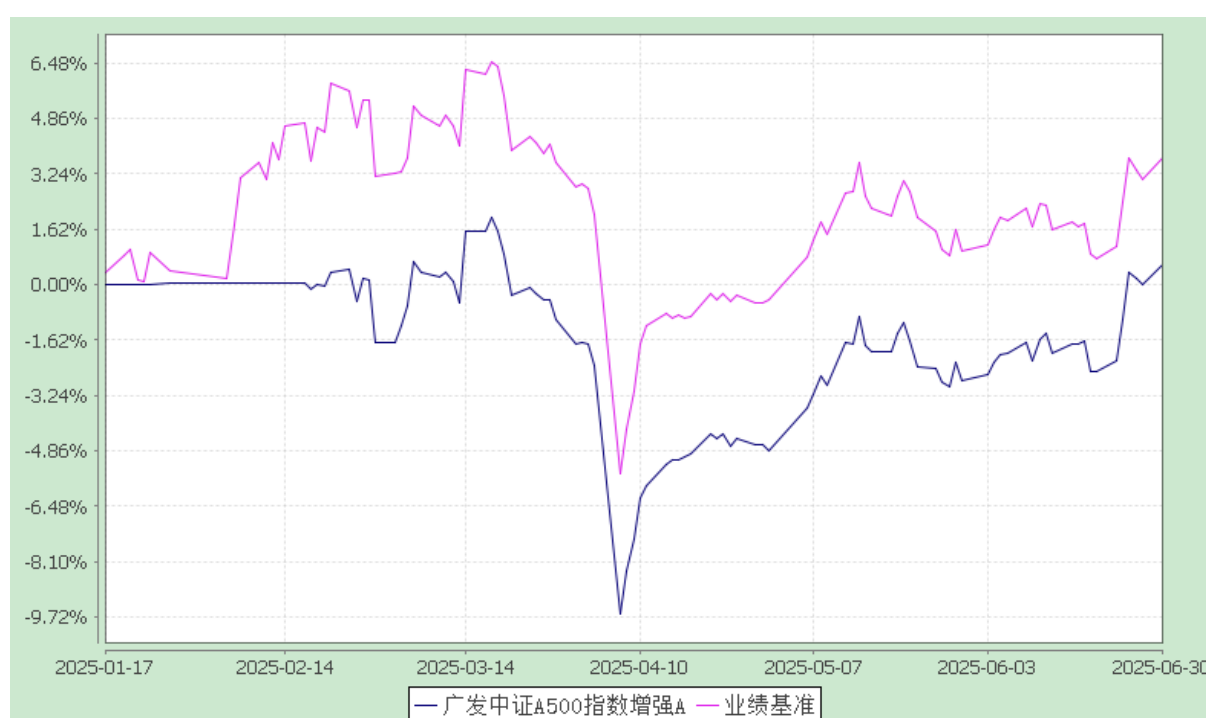
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 A500 指数增强型证券投资基金

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

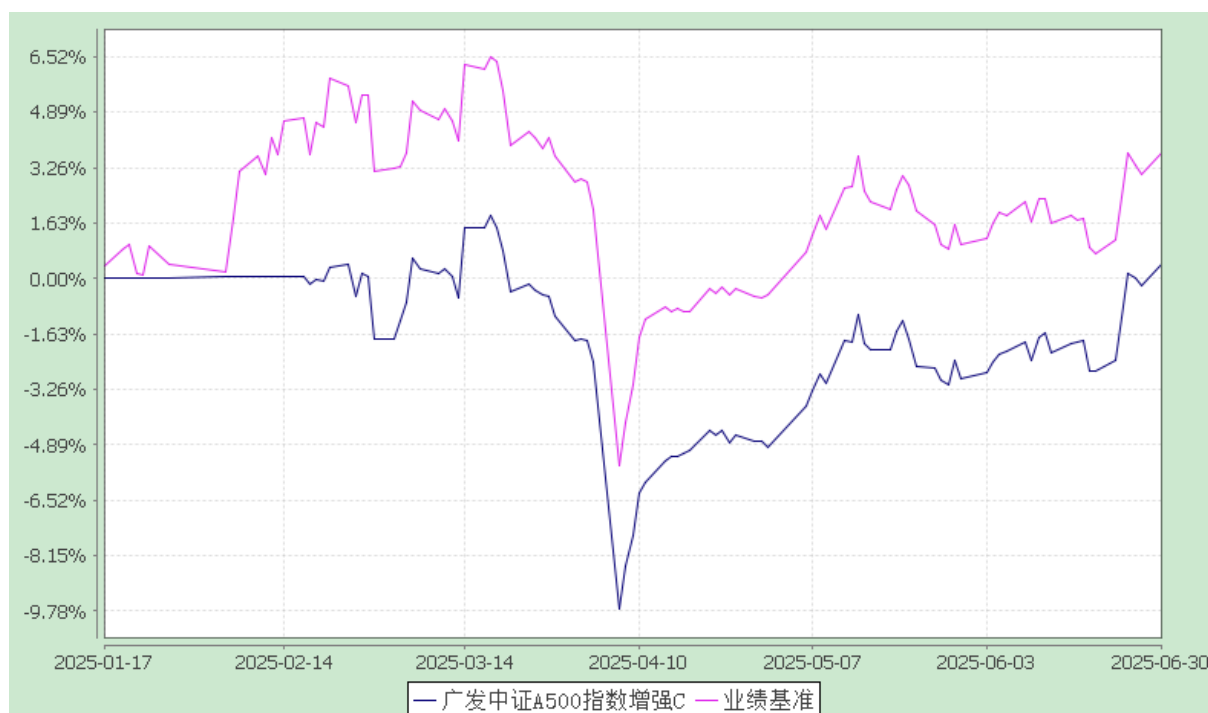
（2025 年 1 月 17 日至 2025 年 6 月 30 日）

广发中证 A500 指数增强 A



广发中证 A500 指数增强 C





注：（1）本基金合同生效日期为 2025 年 1 月 17 日，至披露时点未满一年。  
（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。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		
易威	本基金的基金经 理；广发对冲套利 定期开放混合型发 起式证券投资基金 的基金经理；广发	2025-01-17	-	12 年	易威先生，中国籍，应用统计硕士，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中央交易部股票交易员、量化投资部量化研究员、量化投资部投资经理。

	东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理				
--	---	--	--	--	--

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，权益市场呈震荡上涨趋势，中证 A500 指数涨 0.47%。行业表现分化明显，有色金属、银行、传媒、国防军工等中信一级行业涨幅超过 10%，而石油石化、食品饮料、房地产、煤炭则跌幅明显；从风格角度来观察，小市值风格的超额收益十分突出，市值较小的中证 2000 指数阶段性领跑市场，涨幅达 15.24%，小盘成长也跑赢大盘成长风格。

期间，产品主要配置基于多因子模型的指数增强策略，因子数据包括个股的基本面信息与量价特征。

##### 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 0.60%，C 类基金份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准收益率为 3.69%。

#### 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，随着市场风险偏好回暖，权益资产的关注度将持续提升，而盈利质量的改善将会是市场的关注焦点。人工智能技术的快速迭代大幅提升了下游行业的创新能力，将有望在传媒、人形机器人、家电、医药等领域孵化出新的产业机会，权益市场将会持续涌现相应的投资主题。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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。

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 A500 指数增强型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	6,386,271.63
结算备付金		1,190,398.41
存出保证金		135,146.36
交易性金融资产	6.4.7.2	110,286,069.67
其中：股票投资		110,280,669.31
基金投资		-
债券投资		5,400.36
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		20,086.04
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		118,017,972.11
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		85.52
应付赎回款		1,040,160.41
应付管理人报酬		121,411.59
应付托管费		22,764.65
应付销售服务费		12,077.36
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	307,798.83
负债合计		1,504,298.36
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.8	115,886,890.15
未分配利润	6.4.7.9	626,783.60
净资产合计		116,513,673.75
负债和净资产总计		118,017,972.11

注：（1）报告截止日 2025 年 6 月 30 日，广发中证 A500 指数增强 A 基金份额净值人民币 1.0060 元，基金份额总额 79,781,465.36 份；广发中证 A500 指数增强 C 基金份额净值人民币 1.0041 元，基金份额总额 36,105,424.79 份；总份额总额 115,886,890.15 份。

（2）本会计期间为 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,109,648.62
1.利息收入		677,007.81
其中：存款利息收入	6.4.7.10	106,159.80
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		570,848.01
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,512,299.14
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-3,122,128.13
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	41,215.65
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	-334,065.59
股利收益	6.4.7.17	1,902,678.93
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	2,943,966.74
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	973.21
减：二、营业总支出		1,338,941.50
1. 管理人报酬		950,930.24
2. 托管费		178,299.41
3. 销售服务费		138,669.71
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.21	71,042.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		770,707.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		770,707.12
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		770,707.12

6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）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	-	-	-

产			
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	432,873,679.42	-	432,873,679.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-316,986,789.27	626,783.60	-316,360,005.67
（一）、综合收益总额	-	770,707.12	770,707.12
（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）	-316,986,789.27	-143,923.52	-317,130,712.79
其中：1.基金申购款	116,587,231.73	-2,028,491.12	114,558,740.61
2.基金赎回款	-433,574,021.00	1,884,567.60	-431,689,453.40
（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	115,886,890.15	626,783.60	116,513,673.75

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 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1595 号文准予，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 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）公开募集，于 2025 年 1 月 2 日向社会公开发行募集并于 2025 年 1 月 17 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。



本基金募集期间为自 2025 年 1 月 2 日至 2025 年 1 月 15 日止，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 432,873,679.42 元，有效认购户数为 2,146 户。其中，本基金 A 类基金（以下简称“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 224,637,827.18 元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币 39,701.36 元，利息结转基金份额 39,701.36 份；本基金 C 类基金（以下简称“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 208,173,695.44 元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币 22,455.44 元，利息结转基金份额 22,455.44 份。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 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

##### 6.4.4.3 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：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要包含货币资金、买入返售金融资产和其他应收科目等。

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主要为股票投资、债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### （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。

本基金持有的以摊余成本计量的金融负债主要包括卖出回购金融资产款和其他应付科目等。

### （3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已经开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金

转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

（2）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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

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

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关

于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

#### 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	6,386,271.63
等于：本金	6,384,577.90
加：应计利息	1,693.73
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	6,386,271.63

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		107,336,702.57	-	110,280,669.31	2,943,966.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,400.00	0.36	5,400.36	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,400.00	0.36	5,400.36	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	107,342,102.57	0.36	110,286,069.67	2,943,966.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	240,663.63
其中：交易所市场	240,663.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,135.20
合计	307,798.83

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发中证 A500 指数增强 A		
项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	224,677,528.54	224,677,528.54
本期申购	108,365,783.05	108,365,783.05
本期赎回（以“-”号填列）	-253,261,846.23	-253,261,846.23
本期末	79,781,465.36	79,781,465.36

金额单位：人民币元

广发中证 A500 指数增强 C		
项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	208,196,150.88	208,196,150.88
本期申购	8,221,448.68	8,221,448.68
本期赎回（以“-”号填列）	-180,312,174.77	-180,312,174.77
本期末	36,105,424.79	36,105,424.79

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

6.4.1“基金基本情况”之说明。

2、申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发中证 A500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-1,727,998.52	1,847,850.59	119,852.07
本期基金份额交易产生的变动数	961,625.02	-603,690.00	357,935.02
其中：基金申购款	-354,643.88	-1,514,173.27	-1,868,817.15
基金赎回款	1,316,268.90	910,483.27	2,226,752.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-766,373.50	1,244,160.59	477,787.09

单位：人民币元

广发中证 A500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-445,261.10	1,096,116.15	650,855.05
本期基金份额交易产生的变动数	32,920.58	-534,779.12	-501,858.54
其中：基金申购款	-44,520.46	-115,153.51	-159,673.97
基金赎回款	77,441.04	-419,625.61	-342,184.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-412,340.52	561,337.03	148,996.51

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	79,855.92

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	22,122.83
其他	4,181.05
合计	106,159.80

#### 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 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,122,128.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-3,122,128.13

##### 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 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	890,430,701.45
减：卖出股票成本总额	892,636,293.63
减：交易费用	916,535.95
买卖股票差价收入	-3,122,128.13

#### 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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	10,605.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	30,609.87
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	41,215.65

##### 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17日（基金合同生效日）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	73,939,100.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	72,489,917.28
减：应计利息总额	1,418,572.37
减：交易费用	1.20
买卖债券差价收入	30,609.87

#### 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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股指期货投资收益	-334,065.59

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,902,678.93
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	1,902,678.93

#### 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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1.交易性金融资产	2,943,966.74
——股票投资	2,943,966.74
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	2,943,966.74

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	116.89
基金转换费收入	856.32
合计	973.21

**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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	15,128.85
信息披露费	52,006.35
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,504.49
其他	402.45
合计	71,042.14

**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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
------------	-----------

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	698,686,528.51	36.96%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	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	129,956,136.29	99.98%

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	2,025,956,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	129,262.39	37.44%	24,823.79	10.31%

注：1、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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。

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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	950,930.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	351,073.53
应支付基金管理人的净管理费	599,856.71

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 0.80%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	178,299.41

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 0.15%。

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 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 A500 指数 增强 A	广发中证 A500 指数增强 C	合计



广发基金管理有限公司	-	504.06	504.06
中国建设银行股份有限公司	-	124,406.79	124,406.79
合计	-	124,910.85	124,910.85

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约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.40%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人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

#### 广发中证 A500 指数增强 A

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 广发中证 A500 指数增强 C

本报告期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 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	6,386,271.63	79,855.92

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	326.00	4,172.80	14,520.04	-
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	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	51.00	4,569.60	7,113.48	-
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	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
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	-
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	54.00	5,400.00	5,400.36	-

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

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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
AAA	-
AAA 以下	5,400.36
未评级	-
合计	5,400.36

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的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性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
<b>资产</b>					
货币资金	6,386,271.63	-	-	-	6,386,271.63
结算备付金	1,190,398.41	-	-	-	1,190,398.41
存出保证金	135,146.36	-	-	-	135,146.36
交易性金融资产	5,400.36	-	-	110,280,669.31	110,286,069.67
应收申购款	-	-	-	20,086.04	20,086.04
资产总计	7,717,216.76	-	-	110,300,755.35	118,017,972.11
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	85.52	85.52
应付赎回款	-	-	-	1,040,160.41	1,040,160.41
应付管理人报酬	-	-	-	121,411.59	121,411.59
应付托管费	-	-	-	22,764.65	22,764.65

应付销售服务费	-	-	-	12,077.36	12,077.36
其他负债	-	-	-	307,798.83	307,798.83
负债总计	-	-	-	1,504,298.36	1,504,298.36
利率敏感度缺口	7,717,216.76	-	-	108,796,456.99	116,513,673.75

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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	110,280,669.31	94.65
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,400.36	0.00
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	110,286,069.67	94.66

##### 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
	上升 5%	5,717,302.27
	下降 5%	-5,717,302.27

#### 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	110,235,576.77
第二层次	20,785.90
第三层次	29,707.00
合计	110,286,069.67

###### 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	110,280,669.31	93.44
	其中：股票	110,280,669.31	93.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,400.36	0.00
	其中：债券	5,400.36	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	7,576,670.04	6.42
8	其他各项资产	155,232.40	0.13
9	合计	118,017,972.11	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

#### 7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	806,592.00	0.69
B	采矿业	6,313,524.39	5.42
C	制造业	48,485,856.68	41.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,242,279.42	1.92
E	建筑业	1,853,460.37	1.59
F	批发和零售业	1,714,968.82	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,235,022.60	2.78



H	住宿和餐饮业	9,891.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,418,837.09	5.51
J	金融业	13,669,525.32	11.73
K	房地产业	428,250.00	0.37
L	租赁和商务服务业	1,065,386.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	1,151,250.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	107,376.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	375,648.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	708,837.17	0.61
S	综合	-	-
	合计	88,586,704.86	76.03

#### 7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	96,997.00	0.08
B	采矿业	473,216.76	0.41
C	制造业	10,959,850.58	9.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,881,906.00	1.62
E	建筑业	21,575.00	0.02
F	批发和零售业	266,259.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	741,737.00	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,412,793.56	1.21
J	金融业	3,770,282.28	3.24
K	房地产业	504,482.00	0.43
L	租赁和商务服务业	420,042.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	149,287.27	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	550,172.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	54,936.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	390,428.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	21,693,964.45	18.62

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

7.3.1 期末指数投资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	3,400	4,792,368.00	4.11
2	300750	宁德时代	13,500	3,404,970.00	2.92
3	000333	美的集团	33,500	2,418,700.00	2.08
4	601318	中国平安	42,000	2,330,160.00	2.00
5	600036	招商银行	45,600	2,095,320.00	1.80
6	601899	紫金矿业	83,500	1,628,250.00	1.40
7	002594	比亚迪	4,800	1,593,168.00	1.37
8	600919	江苏银行	117,500	1,402,950.00	1.20
9	600276	恒瑞医药	26,400	1,370,160.00	1.18
10	000725	京东方 A	334,500	1,334,655.00	1.15
11	000100	TCL 科技	277,700	1,202,441.00	1.03
12	601668	中国建筑	205,500	1,185,735.00	1.02
13	002475	立讯精密	33,200	1,151,708.00	0.99
14	600050	中国联通	211,400	1,128,876.00	0.97
15	603259	药明康德	16,200	1,126,710.00	0.97
16	601166	兴业银行	48,100	1,122,654.00	0.96
17	688981	中芯国际	12,450	1,097,716.50	0.94
18	601857	中国石油	127,900	1,093,545.00	0.94
19	000063	中兴通讯	31,784	1,032,662.16	0.89
20	688256	寒武纪-U	1,635	983,452.50	0.84
21	002027	分众传媒	130,900	955,570.00	0.82
22	601766	中国中车	133,900	942,656.00	0.81
23	000425	徐工机械	118,900	923,853.00	0.79
24	000001	平安银行	76,200	919,734.00	0.79
25	601600	中国铝业	130,100	915,904.00	0.79

26	002340	格林美	144,067	914,825.45	0.79
27	600011	华能国际	124,800	891,072.00	0.76
28	300502	新易盛	6,738	855,860.76	0.73
29	600482	中国动力	36,700	846,669.00	0.73
30	002414	高德红外	80,430	824,407.50	0.71
31	603993	洛阳钼业	97,500	820,950.00	0.70
32	600018	上港集团	142,800	815,388.00	0.70
33	002714	牧原股份	19,200	806,592.00	0.69
34	600104	上汽集团	49,800	799,290.00	0.69
35	002230	科大讯飞	16,015	766,798.20	0.66
36	601989	中国重工	159,991	742,358.24	0.64
37	600887	伊利股份	26,200	730,456.00	0.63
38	603288	海天味业	18,100	704,271.00	0.60
39	000338	潍柴动力	45,600	701,328.00	0.60
40	600547	山东黄金	21,800	696,074.00	0.60
41	600160	巨化股份	24,200	694,056.00	0.60
42	601319	中国人保	78,300	681,993.00	0.59
43	601816	京沪高铁	118,300	680,225.00	0.58
44	601398	工商银行	86,700	658,053.00	0.56
45	601658	邮储银行	117,700	643,819.00	0.55
46	600795	国电电力	131,100	634,524.00	0.54
47	600998	九州通	121,820	626,154.80	0.54
48	601288	农业银行	105,500	620,340.00	0.53
49	600030	中信证券	22,155	611,921.10	0.53
50	603986	兆易创新	4,800	607,344.00	0.52
51	002384	东山精密	15,600	589,212.00	0.51
52	600000	浦发银行	41,500	576,020.00	0.49
53	002241	歌尔股份	24,400	569,008.00	0.49
54	002739	万达电影	49,500	565,785.00	0.49
55	600570	恒生电子	16,700	560,118.00	0.48
56	300059	东方财富	23,700	548,181.00	0.47
57	000963	华东医药	13,500	544,860.00	0.47
58	000630	铜陵有色	162,900	544,086.00	0.47
59	601728	中国电信	68,400	530,100.00	0.45
60	601328	交通银行	66,100	528,800.00	0.45
61	600166	福田汽车	185,400	502,434.00	0.43
62	600760	中航沈飞	8,200	480,684.00	0.41
63	600704	物产中大	77,600	408,952.00	0.35
64	600674	川投能源	25,200	404,208.00	0.35
65	603501	豪威集团	3,100	395,715.00	0.34
66	300017	网宿科技	36,200	388,064.00	0.33
67	300015	爱尔眼科	30,100	375,648.00	0.32
68	300014	亿纬锂能	8,200	375,642.00	0.32
69	601088	中国神华	9,000	364,860.00	0.31

70	601225	陕西煤业	18,600	357,864.00	0.31
71	600176	中国巨石	31,100	354,540.00	0.30
72	300274	阳光电源	5,217	353,556.09	0.30
73	600019	宝钢股份	51,400	338,726.00	0.29
74	300395	菲利华	6,600	337,260.00	0.29
75	000858	五粮液	2,800	332,920.00	0.29
76	600029	南方航空	55,600	328,040.00	0.28
77	002624	完美世界	21,000	318,570.00	0.27
78	600183	生益科技	10,500	316,575.00	0.27
79	300760	迈瑞医疗	1,400	314,650.00	0.27
80	601601	中国太保	8,300	311,333.00	0.27
81	601117	中国化学	40,400	309,868.00	0.27
82	300308	中际旭创	2,100	306,306.00	0.26
83	000625	长安汽车	24,000	306,240.00	0.26
84	300207	欣旺达	14,900	298,894.00	0.26
85	688111	金山办公	1,062	297,413.10	0.26
86	000157	中联重科	39,050	282,331.50	0.24
87	000975	山金国际	14,900	282,206.00	0.24
88	601988	中国银行	49,400	277,628.00	0.24
89	688235	百济神州-U	1,184	276,629.76	0.24
90	601111	中国国航	34,700	273,783.00	0.23
91	600150	中国船舶	8,400	273,336.00	0.23
92	002352	顺丰控股	5,600	273,056.00	0.23
93	600028	中国石化	48,100	271,284.00	0.23
94	600115	中国东航	67,100	270,413.00	0.23
95	002648	卫星化学	15,400	266,882.00	0.23
96	002179	中航光电	6,500	262,340.00	0.23
97	600143	金发科技	25,300	260,843.00	0.22
98	000651	格力电器	5,800	260,536.00	0.22
99	600489	中金黄金	17,700	258,951.00	0.22
100	601233	桐昆股份	24,300	257,580.00	0.22
101	300496	中科创达	4,500	257,490.00	0.22
102	603486	科沃斯	4,400	256,212.00	0.22
103	603816	顾家家居	10,000	255,200.00	0.22
104	300433	蓝思科技	11,179	249,291.70	0.21
105	601919	中远海控	16,400	246,656.00	0.21
106	300454	深信服	2,600	244,868.00	0.21
107	600690	海尔智家	9,700	240,366.00	0.21
108	600031	三一重工	13,300	238,735.00	0.20
109	002405	四维图新	27,300	233,142.00	0.20
110	600941	中国移动	1,981	222,961.55	0.19
111	002152	广电运通	16,400	220,416.00	0.19
112	600938	中国海油	8,300	216,713.00	0.19
113	002001	新和成	10,100	214,827.00	0.18

114	002466	天齐锂业	6,600	211,464.00	0.18
115	003816	中国广核	56,100	204,204.00	0.18
116	600398	海澜之家	28,100	195,576.00	0.17
117	300408	三环集团	5,700	190,380.00	0.16
118	000708	中信特钢	16,100	189,336.00	0.16
119	600406	国电南瑞	8,200	183,762.00	0.16
120	600989	宝丰能源	11,200	180,768.00	0.16
121	600188	兖矿能源	14,267	173,629.39	0.15
122	600862	中航高科	6,400	166,912.00	0.14
123	600048	保利发展	20,400	165,240.00	0.14
124	688041	海光信息	1,147	162,059.63	0.14
125	601006	大秦铁路	24,491	161,640.60	0.14
126	300476	胜宏科技	1,200	161,256.00	0.14
127	605499	东鹏饮料	509	159,851.45	0.14
128	000568	泸州老窖	1,400	158,760.00	0.14
129	002202	金风科技	15,200	155,800.00	0.13
130	002493	荣盛石化	18,600	154,008.00	0.13
131	601628	中国人寿	3,738	153,968.22	0.13
132	600660	福耀玻璃	2,700	153,927.00	0.13
133	000009	中国宝安	17,200	152,736.00	0.13
134	688012	中微公司	832	151,673.60	0.13
135	000960	锡业股份	9,800	149,940.00	0.13
136	603596	伯特利	2,700	142,263.00	0.12
137	601216	君正集团	20,500	113,160.00	0.10
138	000792	盐湖股份	6,600	112,728.00	0.10
139	601615	明阳智能	9,700	111,453.00	0.10
140	002371	北方华创	250	110,552.50	0.09
141	300124	汇川技术	1,700	109,769.00	0.09
142	600418	江淮汽车	2,700	108,243.00	0.09
143	600372	中航机载	8,600	103,716.00	0.09
144	600219	南山铝业	26,000	99,580.00	0.09
145	603605	珀莱雅	1,200	99,348.00	0.09
146	002266	浙富控股	31,700	97,636.00	0.08
147	605589	圣泉集团	3,500	97,125.00	0.08
148	600208	衢州发展	31,600	93,536.00	0.08
149	601168	西部矿业	5,600	93,128.00	0.08
150	000538	云南白药	1,600	89,264.00	0.08
151	601186	中国铁建	10,900	87,309.00	0.07
152	600415	小商品城	4,200	86,856.00	0.07
153	688009	中国通号	16,848	86,598.72	0.07
154	601800	中国交建	9,733	86,526.37	0.07
155	601127	赛力斯	600	80,592.00	0.07
156	002244	滨江集团	8,100	78,975.00	0.07
157	002709	天赐材料	4,300	77,916.00	0.07

158	600637	东方明珠	10,400	77,688.00	0.07
159	601633	长城汽车	3,600	77,328.00	0.07
160	300182	捷成股份	13,967	76,958.17	0.07
161	000408	藏格矿业	1,800	76,806.00	0.07
162	603087	甘李药业	1,400	76,692.00	0.07
163	601390	中国中铁	13,500	75,735.00	0.07
164	002223	鱼跃医疗	2,100	74,760.00	0.06
165	600438	通威股份	4,267	71,472.25	0.06
166	000878	云南铜业	5,500	69,960.00	0.06
167	300001	特锐德	2,900	69,513.00	0.06
168	300442	润泽科技	1,400	69,342.00	0.06
169	300866	安克创新	600	68,160.00	0.06
170	002460	赣锋锂业	2,000	67,540.00	0.06
171	601727	上海电气	9,000	66,510.00	0.06
172	601018	宁波港	17,900	65,514.00	0.06
173	600905	三峡能源	15,267	65,037.42	0.06
174	688126	沪硅产业	3,459	64,752.48	0.06
175	600346	恒力石化	4,533	64,640.58	0.06
176	002078	太阳纸业	4,800	64,608.00	0.06
177	600460	士兰微	2,600	64,532.00	0.06
178	302132	中航成飞	700	61,558.00	0.05
179	603392	万泰生物	1,000	61,000.00	0.05
180	300474	景嘉微	800	58,400.00	0.05
181	601607	上海医药	3,154	56,393.52	0.05
182	000977	浪潮信息	1,100	55,968.00	0.05
183	000807	云铝股份	3,500	55,930.00	0.05
184	002938	鹏鼎控股	1,700	54,451.00	0.05
185	002415	海康威视	1,900	52,687.00	0.05
186	002517	恺英网络	2,600	50,206.00	0.04
187	000423	东阿阿胶	900	47,070.00	0.04
188	000938	紫光股份	1,900	45,581.00	0.04
189	605117	德业股份	860	45,287.60	0.04
190	601872	招商轮船	7,000	43,820.00	0.04
191	002532	天山铝业	5,200	43,212.00	0.04
192	601877	正泰电器	1,900	43,073.00	0.04
193	600820	隧道股份	7,000	42,700.00	0.04
194	688271	联影医疗	332	42,409.68	0.04
195	600118	中国卫星	1,300	37,141.00	0.03
196	688396	华润微	779	36,737.64	0.03
197	002436	兴森科技	2,700	35,748.00	0.03
198	601058	赛轮轮胎	2,700	35,424.00	0.03
199	300394	天孚通信	440	35,129.60	0.03
200	300251	光线传媒	1,700	34,459.00	0.03
201	000547	航天发展	4,100	34,440.00	0.03

202	000999	华润三九	1,090	34,095.20	0.03
203	000563	陕国投 A	9,500	33,915.00	0.03
204	688223	晶科能源	6,500	33,735.00	0.03
205	600325	华发股份	6,900	33,603.00	0.03
206	600089	特变电工	2,800	33,404.00	0.03
207	002456	欧菲光	2,800	33,180.00	0.03
208	601179	中国西电	5,400	33,156.00	0.03
209	002252	上海莱士	4,800	32,976.00	0.03
210	688188	柏楚电子	250	32,915.00	0.03
211	601636	旗滨集团	6,566	32,895.66	0.03
212	601868	中国能建	14,700	32,781.00	0.03
213	600487	亨通光电	2,100	32,130.00	0.03
214	001965	招商公路	2,667	32,004.00	0.03
215	300144	宋城演艺	3,700	31,635.00	0.03
216	688169	石头科技	189	29,587.95	0.03
217	002409	雅克科技	500	27,345.00	0.02
218	002463	沪电股份	600	25,548.00	0.02
219	002841	视源股份	733	25,361.80	0.02
220	688099	晶晨股份	354	25,137.54	0.02
221	688008	澜起科技	303	24,846.00	0.02
222	300759	康龙化成	1,000	24,540.00	0.02
223	600765	中航重机	1,400	23,632.00	0.02
224	002831	裕同科技	1,000	23,420.00	0.02
225	603939	益丰药房	950	23,246.50	0.02
226	002185	华天科技	2,300	23,230.00	0.02
227	300058	蓝色光标	3,500	22,960.00	0.02
228	002410	广联达	1,700	22,797.00	0.02
229	300832	新产业	400	22,688.00	0.02
230	600007	中国国贸	1,100	22,638.00	0.02
231	300285	国瓷材料	1,300	22,555.00	0.02
232	600655	豫园股份	4,000	22,200.00	0.02
233	600886	国投电力	1,500	22,110.00	0.02
234	601155	新城控股	1,600	21,888.00	0.02
235	002028	思源电气	300	21,873.00	0.02
236	600039	四川路桥	2,200	21,780.00	0.02
237	002128	电投能源	1,100	21,758.00	0.02
238	600256	广汇能源	3,600	21,672.00	0.02
239	600426	华鲁恒升	1,000	21,670.00	0.02
240	600177	雅戈尔	2,967	21,659.10	0.02
241	603129	春风动力	100	21,650.00	0.02
242	600085	同仁堂	600	21,636.00	0.02
243	600499	科达制造	2,200	21,560.00	0.02
244	002120	韵达股份	3,200	21,440.00	0.02
245	002064	华峰化学	3,200	21,152.00	0.02

246	603019	中科曙光	300	21,120.00	0.02
247	002180	纳思达	900	20,646.00	0.02
248	688072	拓荆科技	122	18,752.62	0.02
249	002821	凯莱英	200	17,650.00	0.02
250	300661	圣邦股份	220	16,009.40	0.01
251	300604	长川科技	350	15,718.50	0.01
252	603606	东方电缆	300	15,513.00	0.01
253	002025	航天电器	300	15,423.00	0.01
254	600893	航发动力	400	15,416.00	0.01
255	601100	恒立液压	200	14,400.00	0.01
256	601689	拓普集团	300	14,175.00	0.01
257	002353	杰瑞股份	400	14,000.00	0.01
258	002050	三花智控	500	13,190.00	0.01
259	000400	许继电气	600	13,062.00	0.01
260	002318	久立特材	550	12,864.50	0.01
261	002738	中矿资源	400	12,864.00	0.01
262	000768	中航西飞	467	12,767.78	0.01
263	300568	星源材质	1,000	12,680.00	0.01
264	000426	兴业银锡	800	12,640.00	0.01
265	000738	航发控制	600	12,450.00	0.01
266	600066	宇通客车	500	12,430.00	0.01
267	600131	国网信通	700	12,390.00	0.01
268	001914	招商积余	1,000	12,370.00	0.01
269	600699	均胜电子	700	12,208.00	0.01
270	002008	大族激光	500	12,185.00	0.01
271	002459	晶澳科技	1,216	12,135.68	0.01
272	603885	吉祥航空	900	12,123.00	0.01
273	002555	三七互娱	700	12,103.00	0.01
274	002273	水晶光电	600	11,982.00	0.01
275	603806	福斯特	900	11,664.00	0.01
276	600038	中直股份	300	11,643.00	0.01
277	002245	蔚蓝锂芯	900	11,547.00	0.01
278	002508	老板电器	600	11,406.00	0.01
279	002497	雅化集团	1,000	11,400.00	0.01
280	000034	神州数码	300	11,292.00	0.01
281	603833	欧派家居	200	11,290.00	0.01
282	002603	以岭药业	800	11,280.00	0.01
283	002138	顺络电子	400	11,248.00	0.01
284	600497	驰宏锌锗	2,100	11,109.00	0.01
285	600529	山东药玻	500	11,070.00	0.01
286	601618	中国中冶	3,700	11,026.00	0.01
287	000683	博源化工	2,300	11,017.00	0.01
288	000039	中集集团	1,400	11,004.00	0.01
289	600096	云天化	500	10,985.00	0.01



290	300296	利亚德	1,800	10,980.00	0.01
291	002007	华兰生物	700	10,969.00	0.01
292	600335	国机汽车	1,700	10,965.00	0.01
293	600004	白云机场	1,200	10,920.00	0.01
294	002091	江苏国泰	1,500	10,905.00	0.01
295	600008	首创环保	3,600	10,872.00	0.01
296	600196	复星医药	433	10,863.97	0.01
297	002145	中核钛白	2,600	10,790.00	0.01
298	600585	海螺水泥	500	10,735.00	0.01
299	002271	东方雨虹	1,000	10,730.00	0.01
300	000932	华菱钢铁	2,400	10,560.00	0.01
301	000887	中鼎股份	600	10,554.00	0.01
302	600392	盛和资源	800	10,536.00	0.01
303	601238	广汽集团	1,400	10,486.00	0.01
304	600839	四川长虹	1,067	10,371.24	0.01
305	000830	鲁西化工	1,000	10,300.00	0.01
306	601985	中国核电	1,100	10,252.00	0.01
307	002444	巨星科技	400	10,204.00	0.01
308	000933	神火股份	600	9,984.00	0.01
309	600111	北方稀土	400	9,960.00	0.01
310	601677	明泰铝业	800	9,936.00	0.01
311	600258	首旅酒店	700	9,891.00	0.01
312	600885	宏发股份	440	9,816.40	0.01
313	002572	索菲亚	700	9,807.00	0.01
314	600323	瀚蓝环境	400	9,740.00	0.01
315	002601	龙佰集团	600	9,726.00	0.01
316	601567	三星医疗	416	9,326.72	0.01
317	300627	华测导航	260	9,100.00	0.01
318	600741	华域汽车	500	8,825.00	0.01
319	002432	九安医疗	233	8,488.19	0.01
320	688036	传音控股	86	6,854.20	0.01
321	002920	德赛西威	33	3,370.29	0.00
322	603799	华友钴业	50	1,851.00	0.00
323	002294	信立泰	33	1,561.89	0.00
324	300346	南大光电	40	1,265.60	0.00
325	002065	东华软件	67	643.20	0.00
326	600867	通化东宝	33	270.60	0.00

7.3.2 期末积极投资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	601138	工业富联	27,600	590,088.00	0.51

2	600179	安通控股	195,500	539,580.00	0.46
3	688685	迈信林	8,544	477,182.40	0.41
4	301165	锐捷网络	7,700	473,242.00	0.41
5	000166	申万宏源	92,300	463,346.00	0.40
6	600016	民生银行	97,500	463,125.00	0.40
7	600809	山西汾酒	2,600	458,614.00	0.39
8	688692	达梦数据	2,051	457,147.39	0.39
9	688082	盛美上海	4,009	456,785.46	0.39
10	600926	杭州银行	26,517	446,015.94	0.38
11	300185	通裕重工	153,700	439,582.00	0.38
12	300232	洲明科技	60,700	439,468.00	0.38
13	601568	北元集团	103,681	430,276.15	0.37
14	002314	南山控股	162,500	427,375.00	0.37
15	600517	国网英大	83,700	426,870.00	0.37
16	600662	外服控股	82,200	420,042.00	0.36
17	600576	祥源文旅	50,300	405,921.00	0.35
18	603858	步长制药	24,200	393,008.00	0.34
19	600063	皖维高新	85,800	392,964.00	0.34
20	600685	中船防务	14,300	388,817.00	0.33
21	603296	华勤技术	3,900	314,652.00	0.27
22	601898	中煤能源	26,454	289,406.76	0.25
23	600163	中闽能源	52,700	269,824.00	0.23
24	601991	大唐发电	83,900	265,963.00	0.23
25	601336	新华保险	4,100	239,850.00	0.21
26	600288	大恒科技	23,300	239,524.00	0.21
27	600578	京能电力	52,100	233,929.00	0.20
28	300369	绿盟科技	28,900	224,553.00	0.19
29	000987	越秀资本	32,500	222,950.00	0.19
30	600429	三元股份	48,400	218,284.00	0.19
31	600236	桂冠电力	32,900	206,283.00	0.18
32	600682	南京新百	30,400	204,288.00	0.18
33	301060	兰卫医学	20,600	198,790.00	0.17
34	601801	皖新传媒	28,900	197,387.00	0.17
35	300057	万顺新材	34,700	189,115.00	0.16
36	600643	爱建集团	25,100	186,242.00	0.16
37	301419	阿莱德	6,460	178,296.00	0.15
38	601901	方正证券	22,100	174,811.00	0.15
39	600435	北方导航	11,100	173,049.00	0.15
40	600348	华阳股份	25,800	171,828.00	0.15
41	000750	国海证券	41,600	171,392.00	0.15
42	301380	挖金客	4,320	158,457.60	0.14
43	300772	运达股份	11,800	151,984.00	0.13
44	600098	广州发展	23,100	144,375.00	0.12
45	002701	奥瑞金	24,000	142,800.00	0.12

46	600483	福能股份	14,600	140,744.00	0.12
47	603466	风语筑	13,700	138,233.00	0.12
48	301018	申菱环境	3,600	136,584.00	0.12
49	688512	慧智微-U	12,287	134,051.17	0.12
50	601002	晋亿实业	27,100	133,603.00	0.11
51	603225	新凤鸣	12,400	132,060.00	0.11
52	601311	骆驼股份	14,400	130,032.00	0.11
53	002142	宁波银行	4,400	120,384.00	0.10
54	002893	京能热力	10,400	111,176.00	0.10
55	300358	楚天科技	14,200	110,760.00	0.10
56	601998	中信银行	12,567	106,819.50	0.09
57	601169	北京银行	15,600	106,548.00	0.09
58	300363	博腾股份	6,100	104,188.00	0.09
59	688509	正元地信	23,213	99,583.77	0.09
60	601995	中金公司	2,800	99,008.00	0.08
61	600995	南网储能	10,100	98,778.00	0.08
62	300539	横河精密	7,200	98,568.00	0.08
63	000027	深圳能源	15,400	98,252.00	0.08
64	603267	鸿远电子	1,900	95,513.00	0.08
65	300414	中光防雷	6,100	94,428.00	0.08
66	300565	科信技术	7,400	93,832.00	0.08
67	300081	恒信东方	13,100	92,748.00	0.08
68	002048	宁波华翔	4,900	90,209.00	0.08
69	300271	华宇软件	10,900	88,944.00	0.08
70	600299	安迪苏	9,100	87,815.00	0.08
71	601298	青岛港	9,700	84,293.00	0.07
72	300168	万达信息	10,300	79,001.00	0.07
73	300774	倍杰特	8,800	77,000.00	0.07
74	601211	国泰海通	4,000	76,640.00	0.07
75	601118	海南橡胶	16,200	76,464.00	0.07
76	002676	顺威股份	10,500	75,915.00	0.07
77	600125	铁龙物流	13,400	75,844.00	0.07
78	600025	华能水电	7,800	74,490.00	0.06
79	300830	金现代	7,400	67,562.00	0.06
80	603071	物产环能	5,300	67,469.00	0.06
81	002455	百川股份	8,900	66,572.00	0.06
82	688387	信科移动-U	11,776	66,534.40	0.06
83	000783	长江证券	9,600	66,528.00	0.06
84	000690	宝新能源	14,600	66,430.00	0.06
85	601688	华泰证券	3,700	65,897.00	0.06
86	000537	中绿电	7,800	65,208.00	0.06
87	000543	皖能电力	9,200	64,400.00	0.06
88	601818	光大银行	15,400	63,910.00	0.05
89	688331	荣昌生物	1,002	60,621.00	0.05

90	603601	再升科技	14,800	60,088.00	0.05
91	600816	建元信托	20,100	59,295.00	0.05
92	300765	新诺威	1,100	56,859.00	0.05
93	000050	深天马 A	6,600	56,232.00	0.05
94	300999	金龙鱼	1,900	56,107.00	0.05
95	002736	国信证券	4,867	56,067.84	0.05
96	000978	桂林旅游	9,000	55,170.00	0.05
97	000031	大悦城	20,800	55,120.00	0.05
98	002659	凯文教育	10,900	54,936.00	0.05
99	601881	中国银河	3,200	54,880.00	0.05
100	601921	浙版传媒	6,800	54,808.00	0.05
101	300241	瑞丰光电	9,600	54,720.00	0.05
102	301349	信德新材	1,400	54,698.00	0.05
103	301526	国际复材	15,000	54,600.00	0.05
104	688597	煜邦电力	6,962	54,512.46	0.05
105	600500	中化国际	14,200	54,386.00	0.05
106	601968	宝钢包装	11,400	54,378.00	0.05
107	601096	宏盛华源	13,100	54,234.00	0.05
108	600295	鄂尔多斯	6,200	54,002.00	0.05
109	600688	上海石化	18,900	53,865.00	0.05
110	688538	和辉光电-U	22,854	53,478.36	0.05
111	600808	马钢股份	15,500	53,475.00	0.05
112	688419	耐科装备	1,288	48,016.64	0.04
113	688589	力合微	2,153	46,052.67	0.04
114	300984	金沃股份	800	45,800.00	0.04
115	688258	卓易信息	942	45,621.06	0.04
116	603987	康德莱	5,900	45,430.00	0.04
117	300219	鸿利智汇	6,700	45,024.00	0.04
118	300365	恒华科技	6,800	44,812.00	0.04
119	301395	仁信新材	3,300	44,517.00	0.04
120	002011	盾安环境	3,800	44,080.00	0.04
121	000895	双汇发展	1,800	43,938.00	0.04
122	600909	华安证券	7,500	43,725.00	0.04
123	002695	煌上煌	4,600	43,240.00	0.04
124	001331	胜通能源	4,300	42,054.00	0.04
125	603565	中谷物流	4,400	42,020.00	0.04
126	689009	九号公司	694	41,063.98	0.04
127	688517	金冠电气	2,457	35,331.66	0.03
128	603919	金徽酒	1,900	34,390.00	0.03
129	300320	海达股份	3,400	33,796.00	0.03
130	002997	瑞鹄模具	900	33,165.00	0.03
131	002706	良信股份	3,700	32,967.00	0.03
132	600582	天地科技	5,500	32,945.00	0.03
133	000553	安道麦 A	4,500	32,490.00	0.03

134	603700	宁水集团	2,700	32,346.00	0.03
135	600518	康美药业	17,100	32,319.00	0.03
136	688469	芯联集成-U	6,770	32,292.90	0.03
137	301327	华宝新能	500	25,680.00	0.02
138	688046	药康生物	1,601	24,079.04	0.02
139	300389	艾比森	2,000	23,160.00	0.02
140	002636	金安国纪	2,400	22,752.00	0.02
141	300155	安居宝	4,500	22,590.00	0.02
142	688190	云路股份	244	22,584.64	0.02
143	603328	依顿电子	2,300	22,563.00	0.02
144	605567	春雪食品	2,200	22,506.00	0.02
145	600197	伊力特	1,500	22,380.00	0.02
146	600420	国药现代	2,100	22,365.00	0.02
147	002296	辉煌科技	2,000	22,300.00	0.02
148	000153	丰原药业	3,600	22,212.00	0.02
149	301002	崧盛股份	1,000	22,110.00	0.02
150	002139	拓邦股份	1,600	22,096.00	0.02
151	000728	国元证券	2,800	22,092.00	0.02
152	300405	科隆股份	3,900	22,035.00	0.02
153	301555	惠柏新材	800	22,024.00	0.02
154	000720	新能泰山	6,300	21,987.00	0.02
155	688055	龙腾光电	5,920	21,904.00	0.02
156	002051	中工国际	2,500	21,575.00	0.02
157	603456	九洲药业	1,400	21,294.00	0.02
158	688278	特宝生物	294	21,200.34	0.02
159	002723	小崧股份	2,800	20,916.00	0.02
160	688252	天德钰	845	20,601.10	0.02
161	688385	复旦微电	387	19,067.49	0.02
162	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
163	301678	新恒汇	326	14,520.04	0.01
164	002929	润建股份	300	14,178.00	0.01
165	301117	佳缘科技	600	13,590.00	0.01
166	600079	人福医药	600	12,588.00	0.01
167	688562	航天软件	671	12,574.54	0.01
168	603203	快克智能	500	12,435.00	0.01
169	688315	诺禾致源	875	12,355.00	0.01
170	300888	稳健医疗	300	12,330.00	0.01
171	601519	大智慧	1,200	12,228.00	0.01
172	688620	安凯微	976	12,209.76	0.01
173	300401	花园生物	800	12,168.00	0.01
174	002322	理工能科	1,000	12,100.00	0.01
175	300859	西域旅游	300	12,081.00	0.01
176	600301	华锡有色	600	11,982.00	0.01
177	688238	和元生物	1,925	11,935.00	0.01

178	688207	格灵深瞳	787	11,883.70	0.01
179	688496	清越科技	1,274	11,848.20	0.01
180	600875	东方电气	700	11,718.00	0.01
180	002311	海大集团	200	11,718.00	0.01
181	002080	中材科技	600	11,700.00	0.01
182	688031	星环科技-U	250	11,657.50	0.01
183	300306	远方信息	900	11,628.00	0.01
184	603890	春秋电子	1,000	11,600.00	0.01
185	688208	道通科技	379	11,597.40	0.01
186	601279	英利汽车	2,900	11,571.00	0.01
187	603161	科华控股	900	11,556.00	0.01
188	002675	东诚药业	800	11,512.00	0.01
189	000788	北大医药	1,800	11,430.00	0.01
190	002795	永和智控	2,200	11,418.00	0.01
191	301503	智迪科技	300	11,415.00	0.01
192	601555	东吴证券	1,300	11,375.00	0.01
193	300324	旋极信息	2,600	11,310.00	0.01
194	688429	时创能源	770	11,195.80	0.01
195	002249	大洋电机	1,700	11,186.00	0.01
196	601399	国机重装	3,700	11,100.00	0.01
197	601777	千里科技	1,300	11,037.00	0.01
198	600151	航天机电	1,500	10,935.00	0.01
199	300206	理邦仪器	900	10,818.00	0.01
200	603866	桃李面包	2,000	10,800.00	0.01
201	603730	岱美股份	1,880	10,697.20	0.01
202	300194	福安药业	2,500	10,575.00	0.01
203	000951	中国重汽	600	10,548.00	0.01
204	600230	沧州大化	1,000	10,530.00	0.01
205	002004	华邦健康	2,500	10,425.00	0.01
206	000729	燕京啤酒	800	10,344.00	0.01
207	300848	美瑞新材	600	10,308.00	0.01
208	002240	盛新锂能	800	10,304.00	0.01
209	600975	新五丰	1,700	10,285.00	0.01
210	600015	华夏银行	1,300	10,283.00	0.01
211	300498	温氏股份	600	10,248.00	0.01
212	002745	木林森	1,300	10,244.00	0.01
213	601231	环旭电子	700	10,241.00	0.01
214	603811	诚意药业	1,100	10,153.00	0.01
215	002957	科瑞技术	600	9,864.00	0.01
216	688273	麦澜德	307	9,274.47	0.01
217	600060	海信视像	400	9,208.00	0.01
218	688408	中信博	189	8,822.52	0.01
219	301590	优优绿能	51	7,113.48	0.01
220	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00

221	688138	清溢光电	112	3,045.28	0.00
222	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
223	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
224	688697	纽威数控	165	2,201.10	0.00
225	688073	毕得医药	23	1,334.46	0.00
226	688230	芯导科技	22	1,219.46	0.00
227	301187	欧圣电气	40	1,104.00	0.00
228	603067	振华股份	20	304.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	14,684,742.00	12.60
2	600519	贵州茅台	13,521,401.00	11.60
3	601398	工商银行	10,275,649.00	8.82
4	000333	美的集团	10,161,982.00	8.72
5	601318	中国平安	9,265,736.00	7.95
6	000725	京东方 A	7,672,946.00	6.59
7	600036	招商银行	7,650,615.00	6.57
8	002027	分众传媒	7,558,564.00	6.49
9	601899	紫金矿业	7,122,716.00	6.11
10	002475	立讯精密	7,119,981.00	6.11
11	601728	中国电信	6,760,430.00	5.80
12	002594	比亚迪	6,277,006.00	5.39
13	601658	邮储银行	6,092,615.00	5.23
14	601601	中国太保	5,993,397.00	5.14
15	300433	蓝思科技	5,985,304.00	5.14
16	000338	潍柴动力	5,959,390.00	5.11
17	600050	中国联通	5,842,018.00	5.01
18	601766	中国中车	5,691,930.00	4.89
19	603501	豪威集团	5,632,726.00	4.83
20	688256	寒武纪-U	5,538,101.05	4.75
21	601857	中国石油	5,536,960.00	4.75
22	601288	农业银行	5,454,419.00	4.68
23	600919	江苏银行	5,439,824.00	4.67
24	002230	科大讯飞	5,410,229.40	4.64
25	601600	中国铝业	5,165,726.20	4.43
26	600011	华能国际	5,145,500.00	4.42

27	601328	交通银行	5,052,861.00	4.34
28	601319	中国人保	5,016,972.00	4.31
29	600406	国电南瑞	4,971,745.00	4.27
30	300502	新易盛	4,952,370.97	4.25
31	000001	平安银行	4,891,622.00	4.20
32	601127	赛力斯	4,881,631.00	4.19
33	600219	南山铝业	4,878,178.00	4.19
34	603993	洛阳钼业	4,814,541.00	4.13
35	603259	药明康德	4,786,435.00	4.11
36	600160	巨化股份	4,740,834.00	4.07
37	600941	中国移动	4,727,792.00	4.06
38	601225	陕西煤业	4,643,652.00	3.99
39	002414	高德红外	4,587,236.70	3.94
40	600276	恒瑞医药	4,478,138.30	3.84
41	600031	三一重工	4,456,005.00	3.82
42	000100	TCL 科技	4,437,409.00	3.81
43	002266	浙富控股	4,357,193.00	3.74
44	002179	中航光电	4,315,950.00	3.70
45	600998	九州通	4,304,257.00	3.69
46	000166	申万宏源	4,165,637.00	3.58
47	601989	中国重工	4,150,959.00	3.56
48	603986	兆易创新	4,058,721.00	3.48
49	600887	伊利股份	4,038,569.00	3.47
50	300476	胜宏科技	3,959,428.00	3.40
51	600989	宝丰能源	3,877,647.00	3.33
52	000568	泸州老窖	3,847,759.00	3.30
53	600489	中金黄金	3,839,780.00	3.30
54	600029	南方航空	3,800,743.00	3.26
55	600570	恒生电子	3,787,662.00	3.25
56	003816	中国广核	3,775,756.00	3.24
57	688041	海光信息	3,772,781.11	3.24
58	000651	格力电器	3,772,613.00	3.24
59	000063	中兴通讯	3,768,771.00	3.23
60	600115	中国东航	3,760,665.00	3.23
61	300059	东方财富	3,731,141.00	3.20
62	000039	中集集团	3,717,475.00	3.19
63	300033	同花顺	3,716,799.00	3.19
64	601166	兴业银行	3,714,664.00	3.19
65	600690	海尔智家	3,671,537.00	3.15
66	002714	牧原股份	3,667,045.00	3.15
67	002001	新和成	3,620,018.00	3.11
68	601179	中国西电	3,588,982.00	3.08
69	688012	中微公司	3,561,115.62	3.06
70	601006	大秦铁路	3,552,256.26	3.05



71	600415	小商品城	3,465,000.00	2.97
72	601689	拓普集团	3,462,177.00	2.97
73	600018	上港集团	3,392,488.00	2.91
74	601138	工业富联	3,370,364.00	2.89
75	600183	生益科技	3,358,211.55	2.88
76	688008	澜起科技	3,350,371.97	2.88
77	002648	卫星化学	3,309,044.00	2.84
78	300274	阳光电源	3,296,667.00	2.83
79	600482	中国动力	3,285,120.00	2.82
80	601607	上海医药	3,257,880.00	2.80
81	601919	中远海控	3,252,991.00	2.79
82	000425	徐工机械	3,233,197.00	2.77
83	601988	中国银行	3,225,604.00	2.77
84	600066	宇通客车	3,197,642.00	2.74
85	601668	中国建筑	3,188,422.00	2.74
86	601111	中国国航	3,187,483.00	2.74
87	600547	山东黄金	3,130,769.00	2.69
88	601018	宁波港	3,126,558.00	2.68
89	600517	国网英大	3,123,375.00	2.68
90	000977	浪潮信息	3,105,547.00	2.67
91	600905	三峡能源	3,070,738.00	2.64
92	600460	士兰微	3,038,173.00	2.61
93	688009	中国通号	3,037,771.05	2.61
94	000625	长安汽车	3,023,560.00	2.60
95	300015	爱尔眼科	2,937,484.00	2.52
96	688981	中芯国际	2,892,760.67	2.48
97	000157	中联重科	2,875,863.00	2.47
98	601998	中信银行	2,858,132.00	2.45
99	600438	通威股份	2,842,125.00	2.44
100	600688	上海石化	2,831,361.00	2.43
101	301165	锐捷网络	2,814,781.00	2.42
102	000858	五粮液	2,805,278.00	2.41
103	300241	瑞丰光电	2,798,211.00	2.40
104	601898	中煤能源	2,786,447.00	2.39
105	300408	三环集团	2,778,499.00	2.38
106	601216	君正集团	2,767,313.00	2.38
107	600019	宝钢股份	2,742,442.00	2.35
108	000538	云南白药	2,732,455.00	2.35
109	600150	中国船舶	2,713,630.00	2.33
110	000895	双汇发展	2,600,871.00	2.23
111	601985	中国核电	2,591,655.00	2.22
112	300308	中际旭创	2,572,102.00	2.21
113	600584	长电科技	2,554,080.00	2.19
114	601800	中国交建	2,551,920.00	2.19

115	601238	广汽集团	2,538,107.00	2.18
116	002340	格林美	2,484,028.00	2.13
117	002241	歌尔股份	2,455,573.44	2.11
118	600000	浦发银行	2,431,920.00	2.09
119	002625	光启技术	2,427,108.00	2.08
120	688538	和辉光电-U	2,402,485.85	2.06
121	600188	兖矿能源	2,364,612.00	2.03
122	301236	软通动力	2,353,722.00	2.02
123	600685	中船防务	2,350,816.00	2.02

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	10,766,971.60	9.24
2	601398	工商银行	9,773,483.00	8.39
3	600519	贵州茅台	8,567,378.00	7.35
4	000333	美的集团	7,808,414.10	6.70
5	601318	中国平安	7,316,061.00	6.28
6	002027	分众传媒	6,909,421.00	5.93
7	601728	中国电信	6,086,643.00	5.22
8	600036	招商银行	5,947,471.00	5.10
9	601601	中国太保	5,870,000.00	5.04
10	000725	京东方 A	5,841,081.00	5.01
11	002475	立讯精密	5,771,026.00	4.95
12	601899	紫金矿业	5,611,367.00	4.82
13	601658	邮储银行	5,433,098.00	4.66
14	000338	潍柴动力	5,232,881.00	4.49
15	603501	豪威集团	5,147,311.00	4.42
16	601288	农业银行	5,080,808.00	4.36
17	601127	赛力斯	5,006,591.00	4.30
18	300433	蓝思科技	4,972,210.79	4.27
19	601319	中国人保	4,830,842.00	4.15
20	300476	胜宏科技	4,719,186.00	4.05
21	600219	南山铝业	4,711,457.00	4.04
22	688256	寒武纪-U	4,677,983.41	4.01
23	601328	交通银行	4,634,032.00	3.98
24	600406	国电南瑞	4,626,793.00	3.97
25	601766	中国中车	4,607,539.00	3.95

26	601857	中国石油	4,591,597.00	3.94
27	002594	比亚迪	4,566,520.00	3.92
28	600919	江苏银行	4,556,000.00	3.91
29	600941	中国移动	4,517,723.69	3.88
30	002230	科大讯飞	4,432,254.00	3.80
31	600031	三一重工	4,430,565.00	3.80
32	600050	中国联通	4,363,841.00	3.75
33	300502	新易盛	4,337,918.90	3.72
34	600011	华能国际	4,307,435.00	3.70
35	002266	浙富控股	4,243,028.00	3.64
36	601225	陕西煤业	4,212,134.00	3.62
37	603993	洛阳钼业	4,211,564.00	3.61
38	600160	巨化股份	4,211,022.00	3.61
39	601600	中国铝业	4,060,063.00	3.48
40	000001	平安银行	4,052,175.00	3.48
41	002179	中航光电	3,992,288.00	3.43
42	002414	高德红外	3,984,434.00	3.42
43	000039	中集集团	3,864,594.82	3.32
44	600489	中金黄金	3,709,245.00	3.18
45	600989	宝丰能源	3,695,085.00	3.17
46	603259	药明康德	3,658,820.00	3.14
47	000166	申万宏源	3,653,437.00	3.14
48	688041	海光信息	3,606,136.67	3.10
49	600998	九州通	3,599,539.40	3.09
50	000568	泸州老窖	3,596,810.00	3.09
51	603986	兆易创新	3,550,359.00	3.05
52	300033	同花顺	3,544,379.00	3.04
53	600115	中国东航	3,535,760.00	3.03
54	600415	小商品城	3,503,096.00	3.01
55	003816	中国广核	3,499,603.00	3.00
56	600029	南方航空	3,490,018.00	3.00
57	600690	海尔智家	3,489,678.00	3.00
58	000651	格力电器	3,466,225.00	2.97
59	601989	中国重工	3,431,514.35	2.95
60	002001	新和成	3,402,718.80	2.92
61	601006	大秦铁路	3,362,516.00	2.89
62	688008	澜起科技	3,331,139.79	2.86
63	601179	中国西电	3,329,934.00	2.86
64	688012	中微公司	3,326,396.63	2.85
65	600887	伊利股份	3,291,623.00	2.83
66	600066	宇通客车	3,264,729.00	2.80
67	300059	东方财富	3,198,591.00	2.75
68	000100	TCL 科技	3,193,485.00	2.74
69	601919	中远海控	3,157,944.00	2.71

70	601689	拓普集团	3,136,024.00	2.69
71	601607	上海医药	3,121,429.34	2.68
72	601018	宁波港	3,107,148.00	2.67
73	600570	恒生电子	3,101,169.00	2.66
74	600276	恒瑞医药	3,063,933.00	2.63
75	300274	阳光电源	3,038,642.92	2.61
76	600905	三峡能源	3,012,691.58	2.59
77	601111	中国国航	2,984,750.00	2.56
78	601998	中信银行	2,961,070.28	2.54
79	601988	中国银行	2,954,543.00	2.54
80	600547	山东黄金	2,924,928.00	2.51
81	002714	牧原股份	2,917,674.60	2.50
82	600460	士兰微	2,912,672.30	2.50
83	688009	中国通号	2,883,782.97	2.48
84	000977	浪潮信息	2,856,602.00	2.45
85	600183	生益科技	2,827,718.53	2.43
86	601166	兴业银行	2,778,998.00	2.39
87	300241	瑞丰光电	2,730,082.82	2.34
88	000625	长安汽车	2,725,479.00	2.34
89	000063	中兴通讯	2,722,964.83	2.34
90	600688	上海石化	2,694,114.38	2.31
91	601138	工业富联	2,678,296.00	2.30
92	000538	云南白药	2,672,186.00	2.29
93	600517	国网英大	2,657,711.00	2.28
94	002648	卫星化学	2,653,459.00	2.28
95	600018	上港集团	2,619,397.00	2.25
96	000157	中联重科	2,592,108.50	2.22
97	601898	中煤能源	2,534,158.24	2.17
98	000895	双汇发展	2,533,459.00	2.17
99	600438	通威股份	2,521,116.40	2.16
100	601216	君正集团	2,511,550.00	2.16
101	600482	中国动力	2,483,800.00	2.13
102	002625	光启技术	2,480,655.00	2.13
103	601985	中国核电	2,476,832.00	2.13
104	300408	三环集团	2,455,343.00	2.11
105	600584	长电科技	2,422,815.02	2.08
106	600019	宝钢股份	2,421,460.16	2.08
107	601800	中国交建	2,420,918.42	2.08
108	600150	中国船舶	2,406,998.00	2.07
109	300015	爱尔眼科	2,396,473.00	2.06
110	601238	广汽集团	2,393,443.00	2.05
111	301165	锐捷网络	2,392,481.80	2.05
112	300308	中际旭创	2,375,403.00	2.04
113	000858	五粮液	2,369,004.00	2.03

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	999,972,996.20
卖出股票收入（成交）总额	890,430,701.45

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）	5,400.36	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,400.36	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	54	5,400.36	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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，提高流动性管理效率以辅助指数增强策略的稳健运行。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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方交通运输局的处罚。

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	135,146.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,086.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,232.40

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发中证 A500 指数增强 A	822	97,057.74	0.00	0.00%	79,781,465.36	100.00%
广发中证 A500 指	711	50,781.19	3,004,375.47	8.32%	33,101,049.32	91.68%

数增强 C						
合计	1,533	75,594.84	3,004,375.47	2.59%	112,882,514.68	97.41%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发中证 A500 指数增强 A	1,000.04	0.0013%
	广发中证 A500 指数增强 C	10,090.03	0.0279%
	合计	11,090.07	0.0096%

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	广发中证 A500 指数增强 A	0
	广发中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 A500 指数增强 A	0
	广发中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 A500 指数增强 A	广发中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 17 日）基金份额总额	224,677,528.54	208,196,150.88
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	108,365,783.05	8,221,448.68
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	253,261,846.23	180,312,174.77
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	79,781,465.36	36,105,424.79

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2025 年 1 月 17 日。



## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	1,122,877,274.63	59.40%	207,737.29	60.17%	-
广发证券	6	698,686,528.51	36.96%	129,262.39	37.44%	-
国泰海通	3	68,692,329.43	3.63%	8,242.89	2.39%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

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比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	29,993.86	0.02%	-	-	-	-
广发证券	129,956,136.29	99.98%	2,025,956,000.00	100.00%	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

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	广发中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-18
2	关于广发中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-13
3	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

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
机构	1	20250304-20250619	-	101,738,732.32	101,738,732.32	-	-
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。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予广发中证 A500 指数增强型证券投资基金注册募集的文件
- （二）《广发中证 A500 指数增强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）《广发中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书

### 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二五年八月三十日