

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：二〇二四年八月三十日

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 2024 年 8 月 28 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 2024 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合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	70

8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
9 开放式基金份额变动	72
10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	77
11 影响投资者决策的其他重要信息	78
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.....	78
12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录.....	79
12.2 存放地点.....	79
12.3 查阅方式.....	79

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	1,903,038,319.00 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（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	-190,501,244.30
本期利润	-221,472,554.15
加权平均基金份额本期利润	-0.1194
本期加权平均净值利润率	-7.39%
本期基金份额净值增长率	-7.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	1,021,783,346.82
期末可供分配基金份额利润	0.5369

期末基金资产净值	2,924,821,665.82
期末基金份额净值	1.5369
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.69%

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	-6.21%	0.95%	-6.89%	0.96%	0.68%	-0.01%
过去三个月	-5.34%	1.13%	-6.50%	1.14%	1.16%	-0.01%
过去六个月	-7.90%	1.59%	-8.96%	1.61%	1.06%	-0.02%
过去一年	-16.24%	1.26%	-17.60%	1.27%	1.36%	-0.01%
过去三年	-23.94%	1.19%	-27.40%	1.20%	3.46%	-0.01%
自基金合同生效起至今	53.69%	1.53%	43.80%	1.56%	9.89%	-0.03%

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

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2013 年 4 月 11 日至 2024 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	-	20 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至

	<p>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</p>				<p>2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业 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</p>
--	---	--	--	--	--

	<p>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；指数投资部总经理助理</p>			<p>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)。</p>
--	---	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 14 次，其中 13 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，A 股市场总体呈现先抑后扬的趋势，2 月以来伴随流动性积极化解，叠加稳市场、稳预期的多项政策密集出台，投资者情绪逐步改善。上半年，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证

500 指数下跌 8.96%，创业板指数下跌 10.99%，北证 50 下跌 34.52%，深证 100 下跌 4.16%。

2024 年上半年，大盘相对占优，表现较优的大盘股包括股息率较高行业、供给端出清行业和制造业出海热潮的相关行业。上半年，行业表现较好的有银行、公用事业、家用电器，与高股息、全球经济呈现修复态势和国内出口增速超预期存在一定关系，表现较弱的行业主要是与内需增速相关性较强以及部分估值水平较高的行业，包括计算机、社会服务、商贸零售、医药生物等行业。

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

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

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

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-7.90%，同期业绩比较基准收益率为-8.96%。

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，随着物价因素边际改善和复苏深化，下半年 A 股企业盈利增速可能好于上半年，同时，A 股企业资产负债表仍相对健康，在稳增长政策支持下，预计内需逐步提升，并且在海外经济景气度较高的背景下，外需有望增速上扬，未来需求侧边际修复有望带动 ROE 周期性改善，并且当前 A 股估值处于历史中低水平，基本面好转有望带动投资者风险偏好回升。同时，下半年美国降息周期或有望开启，在全球资金再配置过程中，部分资金可能会流向包括中国在内的新兴市场，鉴于 A 股市场整体处于估值相对较低位置，届时 A 股有望相对受益。

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的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	61,467,520.23	30,263,999.84
结算备付金		3,558,223.05	6,483,854.01
存出保证金		5,216,408.94	4,008,003.85
交易性金融资产	6.4.7.2	2,858,540,469.00	2,907,560,565.10
其中：股票投资		2,857,511,643.20	2,907,350,558.66
基金投资		-	-
债券投资		1,028,825.80	210,006.44
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		6,432,154.79	16,976,094.71
应收股利		176,282.39	512.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	36,314.34	133,621.47
资产总计		2,935,427,372.74	2,965,426,650.98
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		5,898,146.49	11,609,871.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,235,943.64	1,198,328.74
应付托管费		247,188.73	239,665.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,760.77	20,270.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	3,216,667.29	10,316,782.64
负债合计		10,605,706.92	23,384,919.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,903,038,319.00	1,763,038,319.00
未分配利润	6.4.7.9	1,021,783,346.82	1,179,003,412.23
净资产合计		2,924,821,665.82	2,942,041,731.23
负债和净资产总计		2,935,427,372.74	2,965,426,650.98

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5369 元，基金份额总额 1,903,038,319.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-211,960,336.13	112,058,105.87
1.利息收入		2,654,152.03	4,215,890.50
其中：存款利息收入	6.4.7.10	180,375.55	133,423.31
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	4,082,467.19
2.投资收益（损失以“-”填列）		-189,063,638.68	-3,841,625.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-227,592,902.81	-39,004,174.32
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	23,228.78	68,781.21
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	-595,835.21	102,660.70
股利收益	6.4.7.17	39,101,870.56	34,991,107.39
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	-30,971,309.85	110,834,579.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	5,420,460.37	849,260.72
减：二、营业总支出		9,512,218.02	9,529,546.69
1. 管理人报酬		7,462,874.48	7,472,119.58
2. 托管费		1,492,574.94	1,494,423.91
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		12,171.28	17,242.79
8. 其他费用	6.4.7.21	544,597.32	545,760.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-221,472,554.15	102,528,559.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-221,472,554.15	102,528,559.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-221,472,554.15	102,528,559.18

注：比较数据已根据更新发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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

产			
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
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,607,038,319.00	1,244,812,197.77	2,851,850,516.77
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,607,038,319.00	1,244,812,197.77	2,851,850,516.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	118,000,000.00	195,232,303.26	313,232,303.26
（一）、综合收益总额	-	102,528,559.18	102,528,559.18
（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）	118,000,000.00	92,703,744.08	210,703,744.08

其中：1.基金申购款	434,000,000.00	377,793,580.77	811,793,580.77
2.基金赎回款	-316,000,000.00	-285,089,836.69	-601,089,836.69
（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	1,725,038,319.00	1,440,044,501.03	3,165,082,820.03

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、应用指南、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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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费附加

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

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

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税

所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	61,467,520.23
等于：本金	61,462,570.67
加：应计利息	4,949.56
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	61,467,520.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,197,265,339.25	-	2,857,511,643.20	-339,753,696.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	918,000.00	364.60	1,028,825.80	110,461.20
交易所				

	市场				
	银行间				
	市场	-	-	-	-
	合计	918,000.00	364.60	1,028,825.80	110,461.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,198,183,339.25	364.60	2,858,540,469.00	-339,643,234.85

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 2024 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	39,030,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	39,030,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	39,030,000.00	-	-	-

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
IC2407	IC2407	38.00	37,373,760.00	-1,656,240.00
合计	-	-	-	-1,656,240.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-1,656,240.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	36,314.34
待摊费用	-
合计	36,314.34

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	969,803.53
其中：交易所市场	969,803.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,475.38
应付指数使用费	447,772.45
应付替代款	1,701,538.06
可退替代款	2,077.87
合计	3,216,667.29

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,763,038,319.00	1,763,038,319.00
本期申购	2,056,000,000.00	2,056,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,916,000,000.00	-1,916,000,000.00
本期末	1,903,038,319.00	1,903,038,319.00

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	3,392,923,723.03	-2,213,920,310.80	1,179,003,412.23
本期期初	3,392,923,723.03	-2,213,920,310.80	1,179,003,412.23
本期利润	-190,501,244.30	-30,971,309.85	-221,472,554.15
本期基金份额交易产生的变动数	264,105,071.71	-199,852,582.97	64,252,488.74
其中：基金申购款	3,826,084,446.76	-2,544,567,975.51	1,281,516,471.25
基金赎回款	-3,561,979,375.05	2,344,715,392.54	-1,217,263,982.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,466,527,550.44	-2,444,744,203.62	1,021,783,346.82

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	92,658.42
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	85,657.50
其他	2,059.63
合计	180,375.55

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-147,607,532.63
股票投资收益——赎回差价收入	-79,985,370.18
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	-227,592,902.81

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,930,105,333.80
减：卖出股票成本总额	2,075,089,014.93
减：交易费用	2,623,851.50
买卖股票差价收入	-147,607,532.63

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	3,133,263,982.51
减：现金支付赎回款总额	1,618,471,760.51
减：赎回股票成本总额	1,594,777,592.18
减：交易费用	-
赎回差价收入	-79,985,370.18

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	422.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,806.15
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	23,228.78

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	232,892.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	210,000.00
减：应计利息总额	77.33
减：交易费用	9.30
买卖债券差价收入	22,806.15

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-595,835.21

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	39,101,870.56
其中：证券出借权益补偿收入	2,682,479.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	39,101,870.56

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-29,356,031.85
——股票投资	-29,466,493.05
——债券投资	110,461.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,610,320.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-1,610,320.00
3.其他	-4,958.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-30,971,309.85

注：其他为可退替代款公允价值变动收益。

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	5,420,460.37

合计	5,420,460.37
----	--------------

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	476.48
指数使用费	447,772.45
其他	873.01
合计	544,597.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,462,874.48	7,472,119.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	38,241.09	43,795.16
应支付基金管理人的净管理费	7,424,633.39	7,428,324.42

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,492,574.94	1,494,423.91

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	229,326,015.00	186,955.49	-	-

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 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	27,941,757.80	6,341.00
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	284,925,657.	1.70~3.50	3.07	327,411.64	28,766,568.0	12,194.86

份有限公司	00				0	
-------	----	--	--	--	---	--

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1,426,469,222.00	74.96%	1,429,970,521.00	81.11%
广发证券股份有限公司	14,693,791.00	0.77%	1,774,391.00	0.10%

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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	61,467,520.23	92,658.42	25,558,795.30	29,749.43

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 343,254 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（2023 年 12 月 31 日：325,554 股），成本总额为人民币 5,884,278.92 元（2023 年 12 月 31 日：5,588,086.13 元），估值总额为 5,457,738.60 元（2023 年 12 月 31 日：5,417,218.56 元），占本基金资产净值的比例为 0.19%（2023 年 12 月 31 日：0.18%）。

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（2024 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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244.00	87,680.99	233,884.44	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175.00	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,287.00	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	1,051.00	21,608.56	21,608.56	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258.00	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045.00	16,396.05	19,635.55	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866.00	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通	55.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-

				受限						
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711.00	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202.00	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298.00	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-
301392	汇成真	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306.00	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66.00	4,782.36	4,491.96	-
60338	永臻	2024-0	6 个月	新股	23.35	25.13	178.00	4,156.	4,473.	-

1	股份	6-19		流通受限				30	14	
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184.00	3,199.76	3,790.40	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72.00	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-

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
113685	升 24 转债	2024-06-17	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	4,810.00	481,000.00	481,035.84	-

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 2024 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	300502	新易盛	2024 年 7 月 4 日	105.55	43,600.00	4,601,980.00
2	000933	神火股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	20.23	95,900.00	1,940,057.00
3	601058	赛轮轮胎	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	14.00	138,000.00	1,932,000.00
4	600418	江淮汽车	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	15.84	103,900.00	1,645,776.00
5	002028	思源电气	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	66.90	22,500.00	1,505,250.00
6	600066	宇通客车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	25.80	56,800.00	1,465,440.00
7	000630	铜陵有色	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	3.61	371,000.00	1,339,310.00
8	600988	赤峰黄金	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	16.34	80,700.00	1,318,638.00
9	002625	光启技术	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	17.35	71,700.00	1,243,995.00
10	600536	中国软件	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	29.92	41,000.00	1,226,720.00
11	002353	杰瑞股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	35.08	33,600.00	1,178,688.00
12	002532	天山铝业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	8.11	145,100.00	1,176,761.00
13	002078	太阳纸业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	13.95	81,600.00	1,138,320.00
14	600096	云天化	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	19.42	58,500.00	1,136,070.00
15	601233	桐昆股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	15.96	68,500.00	1,093,260.00
16	002008	大族激光	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	20.80	51,400.00	1,069,120.00
17	600839	四川长虹	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	4.49	220,000.00	987,800.00

18	002384	东山精密	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	20.70	46,600.00	964,620.00
19	601666	平煤股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	11.20	85,700.00	959,840.00
20	002739	万达电影	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	12.09	79,100.00	956,319.00
21	002155	湖南黄金	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	18.10	52,300.00	946,630.00
22	002262	恩华药业	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	23.74	37,900.00	899,746.00
23	603596	伯特利	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	38.90	23,080.00	897,812.00
24	600348	华阳股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	9.96	89,800.00	894,408.00
25	600021	上海电力	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	9.89	89,700.00	887,133.00
26	600398	海澜之家	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	9.24	94,500.00	873,180.00
27	601128	常熟银行	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	7.57	115,090.00	871,231.30
28	600521	华海药业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	17.05	50,000.00	852,500.00
29	002472	双环传动	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	22.02	38,600.00	849,972.00
30	002444	巨星科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	24.70	33,300.00	822,510.00
31	002465	海格通信	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	10.36	79,300.00	821,548.00
32	002385	大北农	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	3.85	211,400.00	813,890.00
33	000703	恒逸石化	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.09	112,300.00	796,207.00
34	000932	华菱钢铁	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.43	179,100.00	793,413.00
35	002517	恺英网络	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.55	82,500.00	787,875.00
36	601168	西部矿业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	17.95	43,600.00	782,620.00
37	601717	郑煤机	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	14.80	52,500.00	777,000.00
38	600673	东阳光	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	7.04	110,000.00	774,400.00
39	688122	西部超导	2024 年 7 月 9 日	38.32	20,000.00	766,400.00
40	000683	远兴能源	2024 年 7 月 1 日	6.91	110,500.00	763,555.00

			-2024 年 7 月 10 日			
41	002299	圣农发展	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	13.64	55,900.00	762,476.00
42	600873	梅花生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	10.02	75,300.00	754,506.00
43	601077	渝农商行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	5.02	147,200.00	738,944.00
44	600699	均胜电子	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	14.82	49,700.00	736,554.00
45	600352	浙江龙盛	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	8.59	84,600.00	726,714.00
46	600546	山煤国际	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	14.62	49,600.00	725,152.00
47	600109	国金证券	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.55	95,500.00	721,025.00
48	603816	顾家家居	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	32.29	22,300.00	720,067.00
49	600985	淮北矿业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	16.74	42,800.00	716,472.00
50	601966	玲珑轮胎	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	18.37	38,800.00	712,756.00
51	603606	东方电缆	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	48.81	14,500.00	707,745.00
52	601555	东吴证券	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	5.90	118,000.00	696,200.00
53	601000	唐山港	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	4.70	148,000.00	695,600.00
54	000519	中兵红箭	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	14.67	46,800.00	686,556.00
55	002624	完美世界	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.60	89,500.00	680,200.00
56	600141	兴发集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	19.08	35,600.00	679,248.00
57	000623	吉林敖东	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	13.40	50,500.00	676,700.00
58	603338	浙江鼎力	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	60.42	11,100.00	670,662.00
59	689009	九号公司-WD	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	36.81	18,200.00	669,942.00
60	000723	美锦能源	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	4.76	140,100.00	666,876.00
61	002195	岩山科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	2.51	264,200.00	663,142.00
62	600177	雅戈尔	2024 年 7 月 9 日	7.12	92,200.00	656,464.00

			-2024 年 7 月 10 日			
63	300058	蓝色光标	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	5.44	117,200.00	637,568.00
64	600155	华创云信	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	5.91	107,100.00	632,961.00
65	600516	方大炭素	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.31	145,600.00	627,536.00
66	002558	巨人网络	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.44	66,000.00	623,040.00
67	000998	隆平高科	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	9.83	62,700.00	616,341.00
68	000738	航发控制	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	20.07	30,700.00	616,149.00
69	600008	首创环保	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	2.68	227,800.00	610,504.00
70	000988	华工科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	29.93	20,100.00	601,593.00
71	000039	中集集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.26	64,900.00	600,974.00
72	603077	和邦生物	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	1.65	363,400.00	599,610.00
73	600153	建发股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	8.93	65,600.00	585,808.00
74	601567	三星医疗	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	35.00	16,700.00	584,500.00
75	300024	机器人	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.74	59,900.00	583,426.00
76	600499	科达制造	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	8.43	69,100.00	582,513.00
77	000960	锡业股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	15.49	37,500.00	580,875.00
78	002568	百润股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	16.83	34,300.00	577,269.00
79	000831	中国稀土	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	25.35	22,600.00	572,910.00
80	601162	天风证券	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	2.18	262,700.00	572,686.00
81	000887	中鼎股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	12.24	46,500.00	569,160.00
82	600157	永泰能源	2024 年 7 月 10 日	1.18	482,000.00	568,760.00
83	600369	西南证券	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	3.58	157,700.00	564,566.00
84	600642	申能股份	2024 年 7 月 10 日	8.83	63,400.00	559,822.00
85	603589	口子窖	2024 年 7 月 9 日	39.19	14,200.00	556,498.00

			-2024 年 7 月 10 日			
86	603568	伟明环保	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	20.58	27,000.00	555,660.00
87	601456	国联证券	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 10 日	9.64	57,000.00	549,480.00
88	600637	东方明珠	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	6.08	89,400.00	543,552.00
89	601156	东航物流	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	20.35	26,700.00	543,345.00
90	002595	豪迈科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	38.17	14,100.00	538,197.00
91	600166	福田汽车	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	2.25	235,800.00	530,550.00
92	603225	新凤鸣	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	15.59	34,000.00	530,060.00
93	002572	索菲亚	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	15.33	34,500.00	528,885.00
94	000563	陕国投 A	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	2.75	192,200.00	528,550.00
95	600498	烽火通信	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	15.90	33,100.00	526,290.00
96	600416	湘电股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	9.94	52,800.00	524,832.00
97	300017	网宿科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.90	66,300.00	523,770.00
98	600580	卧龙电驱	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	12.15	43,100.00	523,665.00
99	688772	珠海冠宇	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	14.90	35,000.00	521,500.00
100	000629	钒钛股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	2.50	208,100.00	520,250.00
101	002430	杭氧股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	22.25	23,300.00	518,425.00
102	600801	华新水泥	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	13.75	37,700.00	518,375.00
103	600765	中航重机	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	20.40	25,100.00	512,040.00
104	000893	亚钾国际	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	16.16	31,100.00	502,576.00
105	002372	伟星新材	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	15.42	32,500.00	501,150.00
106	601991	大唐发电	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	3.01	165,300.00	497,553.00
107	002487	大金重工	2024 年 7 月 4 日	22.88	21,600.00	494,208.00

			-2024 年 7 月 10 日			
108	000729	燕京啤酒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	8.83	55,700.00	491,831.00
109	603927	中科软	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	18.09	26,940.00	487,344.60
110	600399	抚顺特钢	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	5.63	86,500.00	486,995.00
111	000937	冀中能源	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	6.70	72,600.00	486,420.00
112	002138	顺络电子	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	27.46	17,700.00	486,042.00
113	600435	北方导航	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	8.62	56,300.00	485,306.00
114	002409	雅克科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	62.91	7,700.00	484,407.00
115	600373	中文传媒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	14.84	32,500.00	482,300.00
116	603156	养元饮品	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	21.27	22,600.00	480,702.00
117	002120	韵达股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.74	62,100.00	480,654.00
118	603650	彤程新材	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	29.55	16,200.00	478,710.00
119	600258	首旅酒店	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	12.35	38,600.00	476,710.00
120	600862	中航高科	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	18.78	25,300.00	475,134.00
121	600143	金发科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	6.61	71,500.00	472,615.00
122	600859	王府井	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	11.74	40,200.00	471,948.00
123	600704	物产中大	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.34	108,600.00	471,324.00
124	603000	人民网	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	19.99	23,500.00	469,765.00
125	600282	南钢股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.98	94,300.00	469,614.00
126	600737	中粮糖业	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	9.59	48,900.00	468,951.00
127	600497	驰宏锌锗	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	5.34	87,800.00	468,852.00
128	601118	海南橡胶	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.55	103,000.00	468,650.00
129	300118	东方日升	2024 年 7 月 1 日	12.10	38,700.00	468,270.00

			-2024 年 7 月 9 日			
130	002831	裕同科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	25.59	18,100.00	463,179.00
131	601933	永辉超市	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	2.48	185,800.00	460,784.00
132	603688	石英股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	29.61	15,550.00	460,435.50
133	600885	宏发股份	2024 年 7 月 9 日	27.68	16,500.00	456,720.00
134	002407	多氟多	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	12.23	36,900.00	451,287.00
135	601928	凤凰传媒	2024 年 7 月 3 日 -2024 年 7 月 10 日	10.96	40,800.00	447,168.00
136	002281	光迅科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	37.37	11,900.00	444,703.00
137	002202	金风科技	2024 年 7 月 9 日	6.72	65,600.00	440,832.00
138	600118	中国卫星	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	22.23	19,800.00	440,154.00
139	603379	三美股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	39.14	11,100.00	434,454.00
140	000155	川能动力	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	10.77	40,100.00	431,877.00
141	600755	厦门国贸	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.17	60,000.00	430,200.00
142	600563	法拉电子	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	76.18	5,600.00	426,608.00
143	300748	金力永磁	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	12.96	32,600.00	422,496.00
144	603712	七一二	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	18.19	22,700.00	412,913.00
145	000598	兴蓉环境	2024 年 7 月 9 日	7.52	54,700.00	411,344.00
146	000728	国元证券	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	6.06	67,700.00	410,262.00
147	601615	明阳智能	2024 年 7 月 9 日	9.44	43,200.00	407,808.00
148	002408	齐翔腾达	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	5.60	71,800.00	402,080.00
149	002683	广东宏大	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	20.13	19,900.00	400,587.00
150	600038	中直股份	2024 年 7 月 9 日	41.11	9,700.00	398,767.00
151	601098	中南传媒	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	12.42	32,000.00	397,440.00
152	600598	北大荒	2024 年 7 月 9 日	12.49	31,000.00	387,190.00
153	600863	内蒙华电	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.64	82,900.00	384,656.00
154	601016	节能风电	2024 年 7 月 9 日	2.99	128,500.00	384,215.00

			-2024 年 7 月 10 日			
155	002506	协鑫集成	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	1.94	197,400.00	382,956.00
156	688516	奥特维	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	41.81	9,140.00	382,143.40
157	600486	扬农化工	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	56.45	6,700.00	378,215.00
158	300212	易华录	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	16.83	22,200.00	373,626.00
159	002690	美亚光电	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	16.50	22,000.00	363,000.00
160	600390	五矿资本	2024 年 7 月 10 日	4.05	89,400.00	362,070.00
161	600977	中国电影	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	10.76	33,200.00	357,232.00
162	603345	安井食品	2024 年 7 月 9 日	74.31	4,800.00	356,688.00
163	002507	涪陵榨菜	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	12.25	29,100.00	356,475.00
164	002557	洽洽食品	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	28.19	12,600.00	355,194.00
165	003035	南网能源	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	4.40	80,500.00	354,200.00
166	002531	天顺风能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	8.94	39,500.00	353,130.00
167	601880	辽港股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	1.23	287,000.00	353,010.00
168	301236	软通动力	2024 年 7 月 2 日	35.21	10,000.00	352,100.00
169	600970	中材国际	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	12.06	29,100.00	350,946.00
170	002984	森麒麟	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	24.09	14,500.00	349,305.00
171	000021	深科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	15.12	23,100.00	349,272.00
172	600959	江苏有线	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	2.64	131,300.00	346,632.00
173	300438	鹏辉能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	18.34	18,900.00	346,626.00
174	600500	中化国际	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	3.49	98,800.00	344,812.00
175	002203	海亮股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.98	43,000.00	343,140.00
176	002797	第一创业	2024 年 7 月 9 日	5.09	66,900.00	340,521.00
177	000027	深圳能源	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	7.30	46,500.00	339,450.00
178	000591	太阳能	2024 年 7 月 10 日	4.71	72,000.00	339,120.00

179	002867	周大生	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	13.06	25,800.00	336,948.00
180	600872	中炬高新	2024 年 7 月 9 日	22.69	14,800.00	335,812.00
181	601636	旗滨集团	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	6.45	52,000.00	335,400.00
182	688521	芯原股份	2024 年 7 月 9 日	26.75	12,500.00	334,375.00
183	002966	苏州银行	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	7.50	44,400.00	333,000.00
184	600004	白云机场	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	9.48	34,700.00	328,956.00
185	600481	双良节能	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	4.67	69,800.00	325,966.00
186	000750	国海证券	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	2.91	111,200.00	323,592.00
187	600377	宁沪高速	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	12.60	25,400.00	320,040.00
188	601231	环旭电子	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	16.05	19,700.00	316,185.00
189	002958	青农商行	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	2.68	117,500.00	314,900.00
190	603179	新泉股份	2024 年 7 月 9 日	39.24	8,000.00	313,920.00
191	000709	河钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	1.94	159,600.00	309,624.00
192	000883	湖北能源	2024 年 7 月 10 日	6.01	51,400.00	308,914.00
193	002064	华峰化学	2024 年 7 月 9 日	7.17	42,500.00	304,725.00
194	000066	中国长城	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	8.75	34,300.00	300,125.00
195	003031	中瓷电子	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	46.24	6,480.00	299,635.20
196	603517	绝味食品	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	15.40	19,300.00	297,220.00
197	601992	金隅集团	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	1.37	214,200.00	293,454.00
198	603529	爱玛科技	2024 年 7 月 9 日	27.33	10,700.00	292,431.00
199	600827	百联股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.38	39,400.00	290,772.00
200	002926	华西证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	6.59	44,100.00	290,619.00
201	688779	长远锂科	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	4.63	62,400.00	288,912.00
202	603826	坤彩科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	28.97	9,940.00	287,961.80
203	688200	华峰测控	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	91.75	3,100.00	284,425.00

204	000559	万向钱潮	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.46	63,500.00	283,210.00
205	000818	航锦科技	2024 年 7 月 9 日	22.08	12,800.00	282,624.00
206	000958	电投产融	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	3.66	77,100.00	282,186.00
207	600325	华发股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	6.50	42,600.00	276,900.00
208	600298	安琪酵母	2024 年 7 月 9 日	27.93	9,900.00	276,507.00
209	600316	洪都航空	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	16.63	16,600.00	276,058.00
210	000156	华数传媒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	6.28	43,700.00	274,436.00
211	002607	中公教育	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	1.53	178,400.00	272,952.00
212	601696	中银证券	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	9.08	30,000.00	272,400.00
213	601216	君正集团	2024 年 7 月 9 日	3.69	72,800.00	268,632.00
214	002266	浙富控股	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	2.79	96,000.00	267,840.00
215	000967	盈峰环境	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	4.23	63,100.00	266,913.00
216	600126	杭钢股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.11	64,900.00	266,739.00
217	601108	财通证券	2024 年 7 月 9 日	6.61	40,000.00	264,400.00
218	600968	海油发展	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	4.12	64,100.00	264,092.00
219	600392	盛和资源	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	8.62	30,500.00	262,910.00
220	002563	森马服饰	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.81	44,200.00	256,802.00
221	603786	科博达	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	64.15	4,000.00	256,600.00
222	002423	中粮资本	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	7.49	33,500.00	250,915.00
223	000997	新大陆	2024 年 7 月 4 日	13.91	17,900.00	248,989.00
224	600754	锦江酒店	2024 年 7 月 9 日	22.98	10,800.00	248,184.00
225	601958	金钼股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	10.41	23,800.00	247,758.00
226	603185	弘元绿能	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	17.09	14,400.00	246,096.00
227	000898	鞍钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	2.12	115,600.00	245,072.00
228	603298	杭叉集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	19.64	12,300.00	241,572.00

229	601608	中信重工	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	3.81	63,200.00	240,792.00
230	603707	健友股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	11.88	20,200.00	239,976.00
231	601298	青岛港	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.56	25,100.00	239,956.00
232	300114	中航电测	2024 年 7 月 1 日	45.25	5,300.00	239,825.00
233	603218	日月股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	10.27	23,300.00	239,291.00
234	603305	旭升集团	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	10.56	22,300.00	235,488.00
235	001286	陕西能源	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	11.53	20,200.00	232,906.00
236	688778	厦钨新能	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	31.24	7,400.00	231,176.00
237	603885	吉祥航空	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	10.99	21,000.00	230,790.00
238	002608	江苏国信	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	7.75	29,100.00	225,525.00
239	000778	新兴铸管	2024 年 7 月 10 日	3.48	63,400.00	220,632.00
240	600315	上海家化	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	17.78	12,200.00	216,916.00
241	002414	高德红外	2024 年 7 月 9 日	5.89	36,700.00	216,163.00
242	600528	中铁工业	2024 年 7 月 4 日	7.32	29,000.00	212,280.00
243	000401	冀东水泥	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.06	51,400.00	208,684.00
244	600655	豫园股份	2024 年 7 月 9 日	5.15	40,500.00	208,575.00
245	600095	湘财股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.96	34,900.00	208,004.00
246	600350	山东高速	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	8.85	23,400.00	207,090.00
247	603056	德邦股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	13.10	15,500.00	203,050.00
248	601568	北元集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	3.71	54,600.00	202,566.00
249	688006	杭可科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	17.45	11,600.00	202,420.00
250	603737	三棵树	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	36.27	5,500.00	199,485.00
251	001872	招商港口	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	19.25	10,200.00	196,350.00
252	601212	白银有色	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	2.78	70,500.00	195,990.00
253	600995	南网储能	2024 年 7 月 1 日	9.66	20,200.00	195,132.00

			-2024 年 7 月 10 日			
254	002508	老板电器	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 8 日	22.10	8,800.00	194,480.00
255	002373	千方科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	9.07	20,900.00	189,563.00
256	603317	天味食品	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	11.41	16,200.00	184,842.00
257	601139	深圳燃气	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	6.68	27,400.00	183,032.00
258	300373	扬杰科技	2024 年 7 月 9 日	38.90	4,700.00	182,830.00
259	605358	立昂微	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	23.14	7,900.00	182,806.00
260	000987	越秀资本	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	4.96	36,400.00	180,544.00
261	002518	科士达	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	17.70	10,200.00	180,540.00
262	002240	盛新锂能	2024 年 7 月 9 日	13.42	13,300.00	178,486.00
263	600517	国网英大	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	4.33	40,700.00	176,231.00
264	600022	山东钢铁	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	1.22	143,700.00	175,314.00
265	601019	山东出版	2024 年 7 月 9 日	11.82	14,800.00	174,936.00
266	601106	中国一重	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	2.31	75,700.00	174,867.00
267	002756	永兴材料	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	35.78	4,800.00	171,744.00
268	688032	禾迈股份	2024 年 7 月 4 日	114.78	1,490.00	171,022.20
269	688387	信科移动-U	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.04	33,900.00	170,856.00
270	002791	坚朗五金	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	25.87	6,600.00	170,742.00
271	600060	海信视像	2024 年 7 月 9 日	24.74	6,800.00	168,232.00
272	002939	长城证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.70	24,500.00	164,150.00
273	600884	杉杉股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	8.12	20,100.00	163,212.00
274	600583	海油工程	2024 年 7 月 4 日	5.91	27,400.00	161,934.00
275	601228	广州港	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	3.05	52,800.00	161,040.00
276	003022	联泓新科	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	13.71	11,600.00	159,036.00
277	600909	华安证券	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.21	37,500.00	157,875.00

278	688248	南网科技	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	29.63	5,300.00	157,039.00
279	600906	财达证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.73	26,900.00	154,137.00
280	002850	科达利	2024 年 7 月 9 日	76.38	2,000.00	152,760.00
281	688276	百克生物	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	28.37	5,300.00	150,361.00
282	600956	新天绿能	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 10 日	8.17	18,000.00	147,060.00
283	600208	新湖中宝	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	1.58	90,000.00	142,200.00
284	600848	上海临港	2024 年 7 月 10 日	9.11	15,600.00	142,116.00
285	601828	美凯龙	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	2.55	55,700.00	142,035.00
286	688538	和辉光电-U	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	1.98	70,600.00	139,788.00
287	000537	中绿电	2024 年 7 月 10 日	9.53	14,600.00	139,138.00
288	600299	安迪苏	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.70	14,100.00	136,770.00
289	688520	神州细胞-U	2024 年 7 月 4 日	39.35	3,400.00	133,790.00
290	600928	西安银行	2024 年 7 月 9 日	3.27	39,900.00	130,473.00
291	002500	山西证券	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	4.70	27,700.00	130,190.00
292	603160	汇顶科技	2024 年 7 月 9 日	68.75	1,800.00	123,750.00
293	688536	思瑞浦	2024 年 7 月 9 日	97.81	1,200.00	117,372.00
294	688281	华秦科技	2024 年 7 月 4 日	83.32	1,400.00	116,648.00
295	002244	滨江集团	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	7.26	15,900.00	115,434.00
296	688017	绿的谐波	2024 年 7 月 9 日	82.10	1,400.00	114,940.00
297	002429	兆驰股份	2024 年 7 月 9 日	4.81	23,400.00	112,554.00
298	002497	雅化集团	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	8.92	12,600.00	112,392.00
299	300390	天华新能	2024 年 7 月 9 日	17.18	6,500.00	111,670.00
300	300888	稳健医疗	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	25.30	4,400.00	111,320.00
301	600901	江苏金租	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	5.05	21,200.00	107,060.00
302	601158	重庆水务	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.80	22,000.00	105,600.00
303	688390	固德威	2024 年 7 月 4 日	56.12	1,820.00	102,138.40
304	688107	安路科技	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	25.42	4,000.00	101,680.00
305	600612	老凤祥	2024 年 7 月 9 日	58.19	1,700.00	98,923.00
306	300394	天孚通信	2024 年 7 月 18 日	88.42	1,100.00	97,262.00

307	002153	石基信息	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	5.73	16,500.00	94,545.00
308	002025	航天电器	2024 年 7 月 9 日	46.38	2,000.00	92,760.00
309	600663	陆家嘴	2024 年 7 月 9 日	8.82	10,300.00	90,846.00
310	002936	郑州银行	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 4 日	1.73	51,800.00	89,614.00
311	688063	派能科技	2024 年 7 月 4 日	39.71	2,240.00	88,950.40
312	688375	国博电子	2024 年 7 月 9 日	70.64	1,200.00	84,768.00
313	000959	首钢股份	2024 年 7 月 10 日	2.72	30,400.00	82,688.00
314	300861	美畅股份	2024 年 7 月 4 日 -2024 年 7 月 9 日	19.35	4,100.00	79,335.00
315	301029	怡合达	2024 年 7 月 5 日	19.66	4,000.00	78,640.00
316	600378	昊华科技	2024 年 7 月 4 日	28.90	2,400.00	69,360.00
317	300776	帝尔激光	2024 年 7 月 9 日	45.96	1,500.00	68,940.00
318	601858	中国科传	2024 年 7 月 9 日	19.12	3,600.00	68,832.00
319	688385	复旦微电	2024 年 7 月 9 日	31.38	2,100.00	65,898.00
320	688348	昱能科技	2024 年 7 月 4 日	59.00	1,100.00	64,900.00
321	600129	太极集团	2024 年 7 月 9 日	28.92	2,200.00	63,624.00
322	002019	亿帆医药	2024 年 7 月 10 日	12.36	4,900.00	60,564.00
323	603883	老百姓	2024 年 7 月 9 日	18.36	3,250.00	59,670.00
324	002738	中矿资源	2024 年 7 月 1 日	26.80	2,200.00	58,960.00
325	002156	通富微电	2024 年 7 月 1 日	22.39	2,600.00	58,214.00
326	688331	荣昌生物	2024 年 7 月 10 日	43.20	1,300.00	56,160.00
327	688153	唯捷创芯	2024 年 7 月 4 日	37.00	1,500.00	55,500.00
328	688425	铁建重工	2024 年 7 月 9 日	3.68	14,000.00	51,520.00
329	600707	彩虹股份	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 9 日	6.81	7,100.00	48,351.00
330	300395	菲利华	2024 年 7 月 1 日	30.75	1,500.00	46,125.00
331	300677	英科医疗	2024 年 7 月 10 日	26.81	1,600.00	42,896.00
332	000400	许继电气	2024 年 7 月 1 日	34.41	1,200.00	41,292.00
333	603939	益丰药房	2024 年 7 月 1 日	24.55	1,680.00	41,244.00
334	600032	浙江新能	2024 年 7 月 10 日	7.28	5,400.00	39,312.00
335	601665	齐鲁银行	2024 年 7 月 1 日 -2024 年 7 月 10 日	4.91	8,000.00	39,280.00
336	601598	中国外运	2024 年 7 月 1 日	5.63	6,400.00	36,032.00
337	600511	国药股份	2024 年 7 月 1 日	30.79	1,000.00	30,790.00
338	002439	启明星辰	2024 年 7 月 1 日	17.26	1,600.00	27,616.00
339	002368	太极股份	2024 年 7 月 1 日	22.55	1,200.00	27,060.00
340	000539	粤电力 A	2024 年 7 月 9 日	5.08	5,300.00	26,924.00
341	000636	风华高科	2024 年 7 月 10 日	13.06	1,800.00	23,508.00
342	603858	步长制药	2024 年 7 月 1 日	15.15	1,500.00	22,725.00
343	002268	电科网安	2024 年 7 月 1 日	14.23	1,500.00	21,345.00
344	600056	中国医药	2024 年 7 月 1 日	10.12	1,800.00	18,216.00
345	000031	大悦城	2024 年 7 月 9 日	2.34	7,600.00	17,784.00

346	601155	新城控股	2024 年 7 月 2 日	8.87	1,400.00	12,418.00
347	601577	长沙银行	2024 年 7 月 1 日	8.18	1,300.00	10,634.00
348	601990	南京证券	2024 年 7 月 1 日	7.68	1,300.00	9,984.00
349	600871	石化油服	2024 年 7 月 1 日	1.74	3,700.00	6,438.00
350	600339	中油工程	2024 年 7 月 1 日	3.12	1,800.00	5,616.00
合计	-	-	-	-	17,404,800.00	145,647,098.80

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金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。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

AAA	-	-
AAA 以下	1,028,825.80	210,006.44
未评级	-	-
合计	1,028,825.80	210,006.44

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	61,467,520.23	-	-	-	61,467,520.23
结算备付金	3,558,223.05	-	-	-	3,558,223.05
存出保证金	5,216,408.94	-	-	-	5,216,408.94
交易性金融资产	1,028,825.80	-	-	2,857,511,643.20	2,858,540,469.00
应收清算款	-	-	-	6,432,154.79	6,432,154.79
应收股利	-	-	-	176,282.39	176,282.39
其他资产	-	-	-	36,314.34	36,314.34
资产总计	71,270,978.02	-	-	2,864,156,394.72	2,935,427,372.74
负债					
应付清算款	-	-	-	5,898,146.49	5,898,146.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,235,943.64	1,235,943.64
应付托管费	-	-	-	247,188.73	247,188.73
应交税费	-	-	-	7,760.77	7,760.77
其他负债	-	-	-	3,216,667.29	3,216,667.29
负债总计	-	-	-	10,605,706.92	10,605,706.92
利率敏感度缺口	71,270,978.02	-	-	2,853,550,687.80	2,924,821,665.82
上年度末 2023 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	30,263,999.84	-	-	-	30,263,999.84
结算备付金	6,483,854.01	-	-	-	6,483,854.01
存出保证金	4,008,003.85	-	-	-	4,008,003.85
交易性金融资产	210,006.44	-	-	2,907,350,558.66	2,907,560,565.10
应收清算款	-	-	-	16,976,094.71	16,976,094.71
应收股利	-	-	-	512.00	512.00
其他资产	-	-	-	133,621.47	133,621.47
资产总计	40,965,864.14	-	-	2,924,460,786.84	2,965,426,650.98

					98
负债					
应付清算款	-	-	-	11,609,871.98	11,609,871.98
应付管理人报酬	-	-	-	1,198,328.74	1,198,328.74
应付托管费	-	-	-	239,665.74	239,665.74
应交税费	-	-	-	20,270.65	20,270.65
其他负债	-	-	-	10,316,782.64	10,316,782.64
负债总计	-	-	-	23,384,919.75	23,384,919.75
利率敏感度缺口	40,965,864.14			-2,901,075,867.09	2,942,041,731.23

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,857,511,643.20	97.70	2,907,350,558.66	98.82

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,028,825.80	0.04	210,006.44	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,858,540,469.00	97.73	2,907,560,565.10	98.83

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	144,413,069.75	148,323,362.38
	下降 5%	-144,413,069.75	-148,323,362.38

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	2,857,510,679.20
第二层次	526,646.95
第三层次	503,142.85
合计	2,858,540,469.00

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	2,857,511,643.20	97.35
	其中：普通股	2,848,624,494.47	97.04
	存托凭证	8,887,148.73	0.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,028,825.80	0.04
	其中：债券	1,028,825.80	0.04
	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	65,025,743.28	2.22
8	其他各项资产	11,861,160.46	0.40
9	合计	2,935,427,372.74	100.00

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

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 145,647,098.80 元，占基金资产净值比例 4.98%。

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	17,940,582.61	0.61
B	采矿业	133,586,432.91	4.57
C	制造业	1,807,140,036.59	61.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	114,819,363.14	3.93
E	建筑业	29,103,627.16	1.00
F	批发和零售业	60,667,560.28	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	57,564,874.12	1.97
H	住宿和餐饮业	9,039,102.15	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	203,088,698.76	6.94
J	金融业	265,537,735.19	9.08
K	房地产业	32,338,751.52	1.11
L	租赁和商务服务业	21,819,171.60	0.75
M	科学研究和技术服务业	22,892,196.41	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	12,981,566.89	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,190,815.00	0.11
Q	卫生和社会工作	17,736,628.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	42,944,294.63	1.47
S	综合	5,120,410.24	0.18
	合计	2,857,511,847.20	97.70

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	342,100	36,108,655.00	1.23
2	002028	思源电气	296,484	19,834,779.60	0.68
3	601058	赛轮轮胎	1,267,174	17,740,436.00	0.61
4	688169	石头科技	44,002	17,275,185.20	0.59
5	600066	宇通客车	639,677	16,503,666.60	0.56
6	002340	格林美	2,476,511	15,775,375.07	0.54
7	000933	神火股份	758,505	15,344,556.15	0.52
8	601077	渝农商行	2,983,631	14,977,827.62	0.51
9	000988	华工科技	484,436	14,499,169.48	0.50
10	601168	西部矿业	803,251	14,418,355.45	0.49
11	300394	天孚通信	160,400	14,182,568.00	0.48
12	002384	东山精密	658,058	13,621,800.60	0.47
13	000423	东阿阿胶	216,945	13,580,757.00	0.46
14	000630	铜陵有色	3,699,638	13,355,693.18	0.46
15	600418	江淮汽车	841,831	13,334,603.04	0.46
16	600988	赤峰黄金	800,721	13,083,781.14	0.45
17	601233	桐昆股份	812,981	12,975,176.76	0.44
18	002625	光启技术	726,101	12,597,852.35	0.43
19	600157	永泰能源	10,484,225	12,371,385.50	0.42
20	600096	云天化	618,009	12,001,734.78	0.41
21	601567	三星医疗	340,100	11,903,500.00	0.41
22	000400	许继电气	343,639	11,824,617.99	0.40
23	688777	中控技术	304,271	11,471,016.70	0.39
24	002156	通富微电	510,350	11,426,736.50	0.39
25	002128	电投能源	539,863	11,391,109.30	0.39
26	002273	水晶光电	670,291	11,381,541.18	0.39
27	601555	东吴证券	1,916,621	11,308,063.90	0.39
28	002078	太阳纸业	807,197	11,260,398.15	0.38
29	600885	宏发股份	401,117	11,102,918.56	0.38
30	601128	常熟银行	1,452,242	10,993,471.94	0.38
31	002532	天山铝业	1,345,200	10,909,572.00	0.37
32	002223	鱼跃医疗	289,800	10,896,480.00	0.37
33	300207	欣旺达	718,000	10,892,060.00	0.37
34	600352	浙江龙盛	1,253,633	10,768,707.47	0.37
35	600398	海澜之家	1,157,214	10,692,657.36	0.37
36	002138	顺络电子	387,552	10,642,177.92	0.36
37	002966	苏州银行	1,414,439	10,608,292.50	0.36
38	002353	杰瑞股份	296,034	10,384,872.72	0.36
39	601108	财通证券	1,564,810	10,343,394.10	0.35
40	600765	中航重机	500,178	10,203,631.20	0.35
41	688617	惠泰医疗	22,164	10,109,000.40	0.35

42	002185	华天科技	1,233,670	10,054,410.50	0.34
43	002517	恺英网络	1,037,100	9,904,305.00	0.34
44	600879	航天电子	1,270,843	9,874,450.11	0.34
45	301236	软通动力	275,475	9,699,474.75	0.33
46	603606	东方电缆	198,600	9,693,666.00	0.33
47	600873	梅花生物	960,732	9,626,534.64	0.33
48	688099	晶晨股份	161,363	9,572,053.16	0.33
49	601577	长沙银行	1,163,433	9,516,881.94	0.33
50	600177	雅戈尔	1,336,553	9,516,257.36	0.33
51	600109	国金证券	1,252,531	9,456,609.05	0.32
52	600079	人福医药	550,142	9,445,938.14	0.32
53	002738	中矿资源	351,566	9,421,968.80	0.32
54	300003	乐普医疗	634,585	9,417,241.40	0.32
55	600060	海信视像	376,691	9,319,335.34	0.32
56	300017	网宿科技	1,176,060	9,290,874.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	1,716,874	9,168,107.16	0.31
58	300136	信维通信	466,360	9,131,328.80	0.31
59	603160	汇顶科技	131,898	9,067,987.50	0.31
60	603979	金诚信	178,600	9,024,658.00	0.31
61	002202	金风科技	1,331,100	8,944,992.00	0.31
62	689009	九号公司	241,433	8,887,148.73	0.30
63	002739	万达电影	734,300	8,877,687.00	0.30
64	000932	华菱钢铁	1,996,423	8,844,153.89	0.30
65	600985	淮北矿业	519,308	8,693,215.92	0.30
66	000683	远兴能源	1,256,964	8,685,621.24	0.30
67	600536	中国软件	289,922	8,674,466.24	0.30
68	002409	雅克科技	137,793	8,668,557.63	0.30
69	002465	海格通信	836,710	8,668,315.60	0.30
70	600348	华阳股份	869,747	8,662,680.12	0.30
71	688120	华海清科	45,476	8,621,340.08	0.29
72	002281	光迅科技	229,888	8,590,914.56	0.29
73	002444	巨星科技	347,730	8,588,931.00	0.29
74	000009	中国宝安	994,025	8,548,615.00	0.29
75	002008	大族激光	405,872	8,442,137.60	0.29
76	000878	云南铜业	676,808	8,433,027.68	0.29
77	002436	兴森科技	814,600	8,406,672.00	0.29
78	688122	西部超导	218,773	8,383,381.36	0.29
79	300474	景嘉微	132,301	8,365,392.23	0.29
80	600642	申能股份	942,977	8,326,486.91	0.28
81	601615	明阳智能	876,700	8,276,048.00	0.28
82	002797	第一创业	1,617,785	8,234,525.65	0.28
83	000039	中集集团	886,045	8,204,776.70	0.28
84	300054	鼎龙股份	361,700	8,203,356.00	0.28
85	600298	安琪酵母	293,100	8,186,283.00	0.28

86	601990	南京证券	1,065,571	8,183,585.28	0.28
87	300012	华测检测	810,724	8,155,883.44	0.28
88	600529	山东药玻	319,455	8,094,989.70	0.28
89	000066	中国长城	924,400	8,088,500.00	0.28
90	601666	平煤股份	715,504	8,013,644.80	0.27
91	002673	西部证券	1,293,567	8,007,179.73	0.27
92	688525	佰维存储	124,819	8,007,138.85	0.27
93	600839	四川长虹	1,778,456	7,985,267.44	0.27
94	601179	中国西电	988,489	7,947,451.56	0.27
95	603596	伯特利	204,171	7,942,251.90	0.27
96	000831	中国稀土	306,327	7,765,389.45	0.27
97	000783	长江证券	1,595,974	7,708,554.42	0.26
98	601717	郑煤机	520,767	7,707,351.60	0.26
99	300395	菲利华	250,300	7,696,725.00	0.26
100	603816	顾家家居	237,625	7,672,911.25	0.26
101	300002	神州泰岳	944,600	7,670,152.00	0.26
102	000728	国元证券	1,263,381	7,656,088.86	0.26
103	002432	九安医疗	188,850	7,655,979.00	0.26
104	000738	航发控制	380,412	7,634,868.84	0.26
105	600862	中航高科	402,469	7,558,367.82	0.26
106	000703	恒逸石化	1,060,973	7,522,298.57	0.26
107	688180	君实生物-U	258,563	7,511,255.15	0.26
108	601198	东兴证券	932,199	7,420,304.04	0.25
109	601997	贵阳银行	1,407,310	7,416,523.70	0.25
110	000960	锡业股份	475,806	7,370,234.94	0.25
111	603345	安井食品	98,800	7,341,828.00	0.25
112	002595	豪迈科技	192,308	7,340,396.36	0.25
113	603338	浙江鼎力	121,400	7,334,988.00	0.25
114	002155	湖南黄金	404,713	7,325,305.30	0.25
115	600863	内蒙华电	1,569,441	7,282,206.24	0.25
116	601162	天风证券	3,338,986	7,278,989.48	0.25
117	601696	中银证券	801,639	7,278,882.12	0.25
118	300037	新宙邦	254,329	7,263,636.24	0.25
119	300866	安克创新	101,760	7,246,329.60	0.25
120	688188	柏楚电子	39,248	7,243,218.40	0.25
121	600521	华海药业	424,673	7,240,674.65	0.25
122	600038	中直股份	175,931	7,232,523.41	0.25
123	300724	捷佳伟创	133,747	7,223,675.47	0.25
124	000921	海信家电	223,130	7,193,711.20	0.25
125	002472	双环传动	326,403	7,187,394.06	0.25
126	300001	特锐德	356,145	7,165,637.40	0.24
127	603939	益丰药房	291,874	7,165,506.70	0.24
128	002294	信立泰	268,205	7,142,299.15	0.24
129	002984	森麒麟	296,460	7,141,721.40	0.24

130	600141	兴发集团	371,443	7,087,132.44	0.24
131	600549	厦门钨业	410,743	7,085,316.75	0.24
132	600699	均胜电子	474,937	7,038,566.34	0.24
133	002407	多氟多	574,580	7,027,113.40	0.24
134	600546	山煤国际	478,120	6,990,114.40	0.24
135	300699	光威复材	280,392	6,962,133.36	0.24
136	002850	科达利	90,935	6,945,615.30	0.24
137	600820	隧道股份	1,059,539	6,918,789.67	0.24
138	002262	恩华药业	291,000	6,908,340.00	0.24
139	600895	张江高科	372,821	6,889,732.08	0.24
140	600369	西南证券	1,921,325	6,878,343.50	0.24
141	301358	湖南裕能	218,600	6,877,156.00	0.24
142	002064	华峰化学	957,600	6,865,992.00	0.23
143	002195	岩山科技	2,732,751	6,859,205.01	0.23
144	600872	中炬高新	302,100	6,854,649.00	0.23
145	300285	国瓷材料	383,502	6,845,510.70	0.23
146	603589	口子窖	173,738	6,808,792.22	0.23
147	000021	深科技	450,032	6,804,483.84	0.23
148	603087	甘李药业	145,006	6,716,677.92	0.23
149	600021	上海电力	678,400	6,709,376.00	0.23
150	300073	当升科技	195,216	6,697,860.96	0.23
151	601000	唐山港	1,425,003	6,697,514.10	0.23
152	300146	汤臣倍健	491,757	6,663,307.35	0.23
153	600486	扬农化工	117,086	6,609,504.70	0.23
154	000513	丽珠集团	177,136	6,591,230.56	0.23
155	600704	物产中大	1,500,648	6,512,812.32	0.22
156	601966	玲珑轮胎	354,374	6,509,850.38	0.22
157	300058	蓝色光标	1,196,262	6,507,665.28	0.22
158	002756	永兴材料	181,830	6,505,877.40	0.22
159	600153	建发股份	722,637	6,453,148.41	0.22
160	600155	华创云信	1,090,912	6,447,289.92	0.22
161	603179	新泉股份	164,300	6,447,132.00	0.22
162	300114	中航电测	142,200	6,434,550.00	0.22
163	000830	鲁西化工	554,572	6,427,489.48	0.22
164	688065	凯赛生物	140,996	6,399,808.44	0.22
165	300529	健帆生物	233,749	6,360,310.29	0.22
166	600118	中国卫星	283,872	6,310,474.56	0.22
167	600583	海油工程	1,065,900	6,299,469.00	0.22
168	002558	巨人网络	665,700	6,284,208.00	0.21
169	002152	广电运通	597,637	6,251,283.02	0.21
170	601156	东航物流	305,853	6,224,108.55	0.21
171	000591	太阳能	1,320,624	6,220,139.04	0.21
172	000623	吉林敖东	460,416	6,169,574.40	0.21
173	600970	中材国际	508,324	6,130,387.44	0.21

174	300373	扬杰科技	156,904	6,103,565.60	0.21
175	002025	航天电器	131,533	6,100,500.54	0.21
176	002385	大北农	1,582,668	6,093,271.80	0.21
177	300144	宋城演艺	758,200	6,088,346.00	0.21
178	002439	启明星辰	352,421	6,082,786.46	0.21
179	601216	君正集团	1,627,800	6,006,582.00	0.21
180	600380	健康元	537,108	5,999,496.36	0.21
181	605358	立昂微	259,039	5,994,162.46	0.20
182	000729	燕京啤酒	677,852	5,985,433.16	0.20
183	600143	金发科技	901,666	5,960,012.26	0.20
184	000723	美锦能源	1,251,100	5,955,236.00	0.20
185	300251	光线传媒	706,897	5,945,003.77	0.20
186	600998	九州通	1,214,507	5,926,794.16	0.20
187	600282	南钢股份	1,189,917	5,925,786.66	0.20
188	600637	东方明珠	973,075	5,916,296.00	0.20
189	000519	中兵红箭	401,585	5,891,251.95	0.20
190	300383	光环新网	693,915	5,863,581.75	0.20
191	600516	方大炭素	1,358,340	5,854,445.40	0.20
192	300677	英科医疗	217,700	5,836,537.00	0.20
193	600392	盛和资源	676,116	5,828,119.92	0.20
194	000636	风华高科	445,921	5,823,728.26	0.20
195	300024	机器人	596,764	5,812,481.36	0.20
196	600763	通策医疗	107,500	5,810,375.00	0.20
197	000818	航锦科技	262,000	5,784,960.00	0.20
198	002958	青农商行	2,137,193	5,727,677.24	0.20
199	600909	华安证券	1,359,050	5,721,600.50	0.20
200	002044	美年健康	1,511,000	5,711,580.00	0.20
201	601665	齐鲁银行	1,162,738	5,709,043.58	0.20
202	600008	首创环保	2,119,225	5,679,523.00	0.19
203	000883	湖北能源	943,287	5,669,154.87	0.19
204	688213	思特威-W	116,482	5,649,377.00	0.19
205	600566	济川药业	177,328	5,623,070.88	0.19
206	600867	通化东宝	669,037	5,599,839.69	0.19
207	000629	钒钛股份	2,238,433	5,596,082.50	0.19
208	600511	国药股份	181,672	5,593,680.88	0.19
209	601016	节能风电	1,867,607	5,584,144.93	0.19
210	300088	长信科技	1,185,233	5,570,595.10	0.19
211	601456	国联证券	575,415	5,547,000.60	0.19
212	000997	新大陆	397,992	5,536,068.72	0.19
213	600170	上海建工	2,570,768	5,527,151.20	0.19
214	600582	天地科技	797,852	5,497,200.28	0.19
215	600498	烽火通信	343,254	5,457,738.60	0.19
216	600499	科达制造	645,689	5,443,158.27	0.19
217	600535	天士力	432,045	5,435,126.10	0.19

218	000598	兴蓉环境	720,694	5,419,618.88	0.19
219	601933	永辉超市	2,185,100	5,419,048.00	0.19
220	601991	大唐发电	1,795,036	5,403,058.36	0.18
221	002120	韵达股份	697,700	5,400,198.00	0.18
222	600004	白云机场	569,000	5,394,120.00	0.18
223	000750	国海证券	1,846,588	5,373,571.08	0.18
224	600129	太极集团	185,768	5,372,410.56	0.18
225	600580	卧龙电驱	441,392	5,362,912.80	0.18
226	000060	中金岭南	1,262,359	5,352,402.16	0.18
227	002261	拓维信息	482,200	5,337,954.00	0.18
228	603000	人民网	266,708	5,331,492.92	0.18
229	300118	东方日升	439,000	5,311,900.00	0.18
230	300567	精测电子	93,900	5,306,289.00	0.18
231	300568	星源材质	646,200	5,298,840.00	0.18
232	002430	杭氧股份	236,747	5,267,620.75	0.18
233	002429	兆驰股份	1,089,988	5,242,842.28	0.18
234	603486	科沃斯	110,900	5,232,262.00	0.18
235	002939	长城证券	777,433	5,208,801.10	0.18
236	600166	福田汽车	2,314,195	5,206,938.75	0.18
237	603658	安图生物	112,950	5,203,606.50	0.18
238	603156	养元饮品	244,578	5,202,174.06	0.18
239	603228	景旺电子	162,033	5,152,649.40	0.18
240	600325	华发股份	792,026	5,148,169.00	0.18
241	600816	建元信托	1,897,000	5,140,870.00	0.18
242	601231	环旭电子	319,443	5,127,060.15	0.18
243	600673	东阳光	727,331	5,120,410.24	0.18
244	300765	新诺威	202,700	5,114,121.00	0.17
245	603927	中科软	280,747	5,078,713.23	0.17
246	603568	伟明环保	246,295	5,068,751.10	0.17
247	002508	老板电器	229,118	5,063,507.80	0.17
248	000893	亚钾国际	313,100	5,059,696.00	0.17
249	300487	蓝晓科技	121,070	5,055,883.20	0.17
250	600754	锦江酒店	219,700	5,048,706.00	0.17
251	300601	康泰生物	322,800	5,038,908.00	0.17
252	601636	旗滨集团	777,491	5,014,816.95	0.17
253	000027	深圳能源	686,412	5,010,807.60	0.17
254	603290	斯达半导	58,043	4,998,082.73	0.17
255	002926	华西证券	757,667	4,993,025.53	0.17
256	000998	隆平高科	507,095	4,984,743.85	0.17
257	002624	完美世界	655,264	4,980,006.40	0.17
258	600563	法拉电子	65,227	4,968,992.86	0.17
259	603298	杭叉集团	252,580	4,960,671.20	0.17
260	002497	雅化集团	555,657	4,956,460.44	0.17
261	600737	中粮糖业	514,809	4,937,018.31	0.17

262	002653	海思科	160,798	4,936,498.60	0.17
263	601866	中远海发	1,912,640	4,934,611.20	0.17
264	300604	长川科技	181,500	4,931,355.00	0.17
265	300253	卫宁健康	833,404	4,917,083.60	0.17
266	002299	圣农发展	359,862	4,908,517.68	0.17
267	603077	和邦生物	2,968,759	4,898,452.35	0.17
268	002065	东华软件	1,083,706	4,898,351.12	0.17
269	002056	横店东磁	392,369	4,892,841.43	0.17
270	688052	纳芯微	47,579	4,890,169.62	0.17
271	002500	山西证券	1,037,698	4,877,180.60	0.17
272	600131	国网信通	289,061	4,876,459.07	0.17
273	688772	珠海冠宇	327,123	4,874,132.70	0.17
274	688385	复旦微电	154,853	4,859,287.14	0.17
275	300390	天华新能	282,714	4,857,026.52	0.17
276	002414	高德红外	824,200	4,854,538.00	0.17
277	601958	金钼股份	466,274	4,853,912.34	0.17
278	600373	中文传媒	326,782	4,849,444.88	0.17
279	600655	豫园股份	939,234	4,837,055.10	0.17
280	300009	安科生物	565,389	4,828,422.06	0.17
281	688002	睿创微纳	172,539	4,825,915.83	0.16
282	300763	锦浪科技	115,300	4,801,092.00	0.16
283	688114	华大智造	100,624	4,770,583.84	0.16
284	002507	涪陵榨菜	388,718	4,761,795.50	0.16
285	603893	瑞芯微	80,391	4,756,735.47	0.16
286	002368	太极股份	210,005	4,735,612.75	0.16
287	600707	彩虹股份	693,463	4,722,483.03	0.16
288	601611	中国核建	582,957	4,716,122.13	0.16
289	002372	伟星新材	305,718	4,714,171.56	0.16
290	603885	吉祥航空	426,637	4,688,740.63	0.16
291	000887	中鼎股份	381,042	4,663,954.08	0.16
292	002203	海亮股份	577,952	4,612,056.96	0.16
293	603379	三美股份	117,579	4,602,042.06	0.16
294	002831	裕同科技	179,319	4,588,773.21	0.16
295	603225	新凤鸣	293,796	4,580,279.64	0.16
296	600755	厦门国贸	636,995	4,567,254.15	0.16
297	688390	固德威	80,921	4,541,286.52	0.16
298	688521	芯原股份	168,866	4,517,165.50	0.15
299	600859	王府井	382,866	4,494,846.84	0.15
300	600329	达仁堂	138,072	4,472,152.08	0.15
301	600801	华新水泥	324,955	4,468,131.25	0.15
302	601880	辽港股份	3,630,576	4,465,608.48	0.15
303	600995	南网储能	460,900	4,452,294.00	0.15
304	600416	湘电股份	447,200	4,445,168.00	0.15
305	600884	杉杉股份	544,700	4,422,964.00	0.15

306	002683	广东宏大	219,043	4,409,335.59	0.15
307	600390	五矿资本	1,086,010	4,398,340.50	0.15
308	300296	利亚德	977,286	4,397,787.00	0.15
309	002019	亿帆医药	354,857	4,386,032.52	0.15
310	300070	碧水源	1,045,631	4,381,193.89	0.15
311	002506	协鑫集成	2,250,413	4,365,801.22	0.15
312	600435	北方导航	505,217	4,354,970.54	0.15
313	002244	滨江集团	599,384	4,351,527.84	0.15
314	600483	福能股份	370,678	4,322,105.48	0.15
315	600739	辽宁成大	516,306	4,321,481.22	0.15
316	000050	深天马 A	592,994	4,316,996.32	0.15
317	300748	金力永磁	331,687	4,298,663.52	0.15
318	600598	北大荒	343,627	4,291,901.23	0.15
319	601098	中南传媒	345,313	4,288,787.46	0.15
320	300803	指南针	117,700	4,285,457.00	0.15
321	600399	抚顺特钢	759,391	4,275,371.33	0.15
322	601598	中国外运	758,629	4,271,081.27	0.15
323	002572	索菲亚	278,423	4,268,224.59	0.15
324	002568	百润股份	253,553	4,267,296.99	0.15
325	600901	江苏金租	840,319	4,243,610.95	0.15
326	000155	川能动力	392,044	4,222,313.88	0.14
327	002487	大金重工	183,742	4,204,016.96	0.14
328	300676	华大基因	119,993	4,200,954.93	0.14
329	600848	上海临港	460,942	4,199,181.62	0.14
330	002080	中材科技	324,346	4,184,063.40	0.14
331	002240	盛新锂能	311,031	4,174,036.02	0.14
332	001286	陕西能源	360,267	4,153,878.51	0.14
333	002557	洽洽食品	146,613	4,133,020.47	0.14
334	002373	千方科技	455,548	4,131,820.36	0.14
335	002936	郑州银行	2,379,383	4,116,332.59	0.14
336	002268	电科网安	285,416	4,061,469.68	0.14
337	300595	欧普康视	258,831	4,058,470.08	0.14
338	000563	陕国投 A	1,475,539	4,057,732.25	0.14
339	603712	七一二	222,968	4,055,787.92	0.14
340	603883	老百姓	219,664	4,033,031.04	0.14
341	601928	凤凰传媒	367,612	4,029,027.52	0.14
342	600968	海油发展	977,235	4,026,208.20	0.14
343	603858	步长制药	265,573	4,023,430.95	0.14
344	000778	新兴铸管	1,149,374	3,999,821.52	0.14
345	600258	首旅酒店	323,109	3,990,396.15	0.14
346	601212	白银有色	1,430,600	3,977,068.00	0.14
347	688017	绿的谐波	48,350	3,969,535.00	0.14
348	688538	和辉光电-U	1,999,573	3,959,154.54	0.14
349	600271	航天信息	536,968	3,952,084.48	0.14

350	300558	贝达药业	120,791	3,931,747.05	0.13
351	688234	天岳先进	83,634	3,924,107.28	0.13
352	688301	奕瑞科技	34,053	3,923,927.19	0.13
353	600062	华润双鹤	200,085	3,917,664.30	0.13
354	600528	中铁工业	533,884	3,908,030.88	0.13
355	002531	天顺风能	434,236	3,882,069.84	0.13
356	601155	新城控股	437,100	3,877,077.00	0.13
357	600977	中国电影	358,700	3,859,612.00	0.13
358	000709	河钢股份	1,985,085	3,851,064.90	0.13
359	603688	石英股份	129,792	3,843,141.12	0.13
360	002408	齐翔腾达	684,947	3,835,703.20	0.13
361	000739	普洛药业	282,510	3,833,660.70	0.13
362	688220	翱捷科技-U	101,813	3,813,914.98	0.13
363	600959	江苏有线	1,442,085	3,807,104.40	0.13
364	688005	容百科技	163,442	3,804,929.76	0.13
365	600378	昊华科技	131,507	3,800,552.30	0.13
366	601118	海南橡胶	825,367	3,755,419.85	0.13
367	000825	太钢不锈	1,102,194	3,725,415.72	0.13
368	688331	荣昌生物	86,236	3,725,395.20	0.13
369	688536	思瑞浦	38,054	3,722,061.74	0.13
370	603882	金域医学	135,900	3,695,121.00	0.13
371	603444	吉比特	20,629	3,672,168.29	0.13
372	603737	三棵树	101,201	3,670,560.27	0.13
373	600056	中国医药	360,967	3,652,986.04	0.12
374	601399	国机重装	1,393,400	3,594,972.00	0.12
375	000987	越秀资本	722,295	3,582,583.20	0.12
376	600517	国网英大	826,876	3,580,373.08	0.12
377	600906	财达证券	623,225	3,571,079.25	0.12
378	603456	九洲药业	260,060	3,568,023.20	0.12
379	600612	老凤祥	61,300	3,567,047.00	0.12
380	601019	山东出版	301,100	3,559,002.00	0.12
381	688200	华峰测控	38,679	3,548,798.25	0.12
382	002266	浙富控股	1,258,618	3,511,544.22	0.12
383	300212	易华录	208,407	3,507,489.81	0.12
384	600316	洪都航空	207,616	3,452,654.08	0.12
385	000937	冀中能源	512,395	3,433,046.50	0.12
386	603650	彤程新材	115,612	3,416,334.60	0.12
387	600871	石化油服	1,958,574	3,407,918.76	0.12
388	688063	派能科技	85,706	3,403,385.26	0.12
389	688567	孚能科技	353,574	3,394,310.40	0.12
390	603529	爱玛科技	123,955	3,387,690.15	0.12
391	600925	苏能股份	662,300	3,344,615.00	0.11
392	002423	中粮资本	444,492	3,329,245.08	0.11
393	000032	深桑达 A	218,900	3,279,122.00	0.11

394	601965	中国汽研	193,100	3,261,459.00	0.11
395	603728	鸣志电器	80,900	3,254,607.00	0.11
396	001227	兰州银行	1,366,714	3,252,779.32	0.11
397	600098	广州发展	507,900	3,250,560.00	0.11
398	688297	中无人机	98,297	3,246,749.91	0.11
399	600208	新湖中宝	2,049,297	3,237,889.26	0.11
400	601298	青岛港	338,269	3,233,851.64	0.11
401	002607	中公教育	2,085,500	3,190,815.00	0.11
402	601608	中信重工	835,826	3,184,497.06	0.11
403	600663	陆家嘴	358,147	3,158,856.54	0.11
404	002670	国盛金控	372,513	3,155,185.11	0.11
405	688561	奇安信-U	132,932	3,139,853.84	0.11
406	688516	奥特维	75,087	3,139,387.47	0.11
407	600578	京能电力	968,700	3,138,588.00	0.11
408	603233	大参林	218,715	3,127,624.50	0.11
409	300438	鹏辉能源	170,500	3,126,970.00	0.11
410	600022	山东钢铁	2,548,660	3,109,365.20	0.11
411	300357	我武生物	151,330	3,059,892.60	0.10
412	601106	中国一重	1,317,441	3,043,288.71	0.10
413	300776	帝尔激光	66,059	3,036,071.64	0.10
414	003031	中瓷电子	65,560	3,031,494.40	0.10
415	600377	宁沪高速	240,323	3,028,069.80	0.10
416	600500	中化国际	863,898	3,015,004.02	0.10
417	002865	钧达股份	77,300	2,966,774.00	0.10
418	600967	内蒙一机	411,485	2,962,692.00	0.10
419	000785	居然之家	1,219,202	2,962,660.86	0.10
420	600315	上海家化	163,568	2,908,239.04	0.10
421	688349	三一重能	116,585	2,895,971.40	0.10
422	600350	山东高速	327,051	2,894,401.35	0.10
423	300888	稳健医疗	113,113	2,861,758.90	0.10
424	000537	中绿电	299,491	2,854,149.23	0.10
425	000559	万向钱潮	639,226	2,850,947.96	0.10
426	000958	电投产融	776,993	2,843,794.38	0.10
427	601568	北元集团	766,211	2,842,642.81	0.10
428	600827	百联股份	384,610	2,838,421.80	0.10
429	688425	铁建重工	767,625	2,824,860.00	0.10
430	002608	江苏国信	363,382	2,816,210.50	0.10
431	002690	美亚光电	170,631	2,815,411.50	0.10
432	000156	华数传媒	447,669	2,811,361.32	0.10
433	603517	绝味食品	181,315	2,792,251.00	0.10
434	603707	健友股份	233,386	2,772,625.68	0.09
435	688029	南微医学	44,905	2,764,351.80	0.09
436	601992	金隅集团	2,009,229	2,752,643.73	0.09
437	002867	周大生	210,128	2,744,271.68	0.09

438	603826	坤彩科技	94,425	2,735,492.25	0.09
439	688032	禾迈股份	23,514	2,698,936.92	0.09
440	300682	朗新集团	315,889	2,688,215.39	0.09
441	600126	杭钢股份	649,768	2,670,546.48	0.09
442	003022	联泓新科	193,600	2,654,256.00	0.09
443	000967	盈峰环境	614,000	2,597,220.00	0.09
444	688475	萤石网络	74,845	2,552,962.95	0.09
445	603218	日月股份	247,432	2,541,126.64	0.09
446	600339	中油工程	811,556	2,532,054.72	0.09
447	600481	双良节能	541,760	2,530,019.20	0.09
448	600361	创新新材	626,500	2,524,795.00	0.09
449	688778	厦钨新能	80,695	2,520,911.80	0.09
450	301267	华夏眼科	121,600	2,519,552.00	0.09
451	600032	浙江新能	345,900	2,518,152.00	0.09
452	688520	神州细胞-U	63,694	2,506,358.90	0.09
453	688248	南网科技	83,188	2,464,860.44	0.08
454	600095	湘财股份	412,781	2,460,174.76	0.08
455	603786	科博达	38,304	2,457,201.60	0.08
456	000898	鞍钢股份	1,149,237	2,436,382.44	0.08
457	603127	昭衍新药	181,300	2,405,851.00	0.08
458	003035	南网能源	546,179	2,403,187.60	0.08
459	600808	马钢股份	1,155,209	2,333,522.18	0.08
460	688281	华秦科技	27,976	2,330,960.32	0.08
461	002153	石基信息	395,811	2,267,997.03	0.08
462	002563	森马服饰	387,043	2,248,719.83	0.08
463	603185	弘元绿能	130,040	2,222,383.60	0.08
464	601228	广州港	726,875	2,216,968.75	0.08
465	000539	粤电力 A	430,100	2,184,908.00	0.07
466	001872	招商港口	112,219	2,160,215.75	0.07
467	688779	长远锂科	461,768	2,137,985.84	0.07
468	600928	西安银行	639,406	2,090,857.62	0.07
469	001203	大中矿业	216,909	2,084,495.49	0.07
470	000401	冀东水泥	509,782	2,069,714.92	0.07
471	688006	杭可科技	117,408	2,048,769.60	0.07
472	000959	首钢股份	748,229	2,035,182.88	0.07
473	002518	科士达	113,009	2,000,259.30	0.07
474	600764	中国海防	101,886	2,000,022.18	0.07
475	603056	德邦股份	149,266	1,955,384.60	0.07
476	603305	旭升集团	180,200	1,902,912.00	0.07
477	600299	安迪苏	195,129	1,892,751.30	0.06
478	688172	燕东微	115,979	1,876,540.22	0.06
479	601139	深圳燃气	275,170	1,838,135.60	0.06
480	300861	美畅股份	92,229	1,784,631.15	0.06
481	603317	天味食品	155,185	1,770,660.85	0.06

482	688276	百克生物	58,970	1,672,978.90	0.06
483	688387	信科移动-U	328,058	1,653,412.32	0.06
484	301029	怡合达	83,861	1,648,707.26	0.06
485	688375	国博电子	22,746	1,606,777.44	0.05
486	002791	坚朗五金	61,818	1,599,231.66	0.05
487	600927	永安期货	140,280	1,564,122.00	0.05
488	688819	天能股份	64,416	1,536,965.76	0.05
489	688153	唯捷创芯	39,872	1,475,264.00	0.05
490	000031	大悦城	621,764	1,454,927.76	0.05
491	601858	中国科传	75,700	1,447,384.00	0.05
492	688107	安路科技	56,935	1,447,287.70	0.05
493	601158	重庆水务	278,800	1,338,240.00	0.05
494	601828	美凯龙	520,958	1,328,442.90	0.05
495	002945	华林证券	129,025	1,287,669.50	0.04
496	688348	昱能科技	21,226	1,252,334.00	0.04
497	600956	新天绿能	148,119	1,210,132.23	0.04
498	301165	锐捷网络	32,800	978,752.00	0.03
499	688295	中复神鹰	47,028	954,668.40	0.03
500	603868	飞科电器	23,028	884,275.20	0.03
501	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
502	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
503	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
504	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
505	400174	中天 3	2,139,042	21,390.42	0.00
506	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
507	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
508	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
509	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
510	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
511	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
512	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
513	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
514	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
515	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
516	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
517	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
518	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
519	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
520	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
521	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
522	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
523	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
524	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
525	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00

526	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
527	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
528	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
529	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
530	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	300502	新易盛	28,892,901.01	0.98
2	300394	天孚通信	21,912,797.21	0.74
3	002463	沪电股份	20,813,244.24	0.71
4	300418	昆仑万维	19,530,051.73	0.66
5	002028	思源电气	18,958,907.32	0.64
6	000933	神火股份	18,957,673.32	0.64
7	000975	山金国际	18,834,932.80	0.64
8	002422	科伦药业	18,143,435.40	0.62
9	002340	格林美	17,344,431.00	0.59
10	000988	华工科技	16,789,174.00	0.57
11	000630	铜陵有色	16,136,787.00	0.55
12	002966	苏州银行	14,623,201.13	0.50
13	002625	光启技术	14,098,269.83	0.48
14	002517	恺英网络	13,958,937.94	0.47
15	301236	软通动力	13,918,611.74	0.47
16	002156	通富微电	13,782,476.00	0.47
17	002078	太阳纸业	13,485,830.55	0.46
18	002738	中矿资源	13,419,966.20	0.46
19	688777	中控技术	13,152,415.22	0.45
20	000423	东阿阿胶	12,832,511.00	0.44

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	002463	沪电股份	41,778,211.01	1.42
2	002422	科伦药业	35,981,191.30	1.22
3	000975	山金国际	34,449,066.59	1.17
4	300418	昆仑万维	32,855,722.73	1.12
5	300502	新易盛	28,065,154.20	0.95
6	300394	天孚通信	23,181,891.05	0.79
7	000933	神火股份	18,259,335.14	0.62
8	002028	思源电气	18,090,906.83	0.61
9	002340	格林美	16,821,397.87	0.57
10	002966	苏州银行	16,402,952.00	0.56
11	000988	华工科技	16,002,227.07	0.54
12	000630	铜陵有色	15,415,889.00	0.52
13	600160	巨化股份	14,957,363.85	0.51
14	002600	领益智造	14,825,858.60	0.50
15	002625	光启技术	13,697,247.00	0.47
16	300144	宋城演艺	13,610,812.00	0.46
17	301236	软通动力	13,430,965.76	0.46
18	002517	恺英网络	13,359,902.00	0.45
19	002156	通富微电	13,280,447.77	0.45
20	002532	天山铝业	13,277,513.00	0.45

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	2,064,525,521.36
卖出股票收入（成交）总额	1,930,105,333.80

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）	1,028,825.80	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,028,825.80	0.04

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	113685	升 24 转债	4,810	481,035.84	0.02
2	113682	益丰转债	4,010	475,418.57	0.02
3	113683	伟 24 转债	360	72,371.39	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，思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海事局的处罚。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,216,408.94
2	应收清算款	6,432,154.79
3	应收股利	176,282.39
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	36,314.34
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,861,160.46

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300502	新易盛	4,601,980.00	0.16	转融通流通受限
2	000933	神火股份	1,940,057.00	0.07	转融通流通受限
3	601058	赛轮轮胎	1,932,000.00	0.07	转融通流通受限
4	002028	思源电气	1,505,250.00	0.05	转融通流通受限
5	600066	宇通客车	1,465,440.00	0.05	转融通流通受限

6	601168	西部矿业	782,620.00	0.03	转融通流通受限
7	601077	渝农商行	738,944.00	0.03	转融通流通受限
8	000988	华工科技	601,593.00	0.02	转融通流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金(LOF)	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
13,479	141,185.4 2	1,739,1 97,176. 00	91.39%	163,841 ,143.00	8.61%	1,426,469, 222.00	74.96%

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-分红-个险分红	178,645,500.00	9.39%
2	新华人寿保险股份有限公司	31,118,800.00	1.64%
3	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	23,123,300.00	1.22%
4	广发证券股份有限公司	14,693,791.00	0.77%
5	东方证券股份有限公司	11,588,618.00	0.61%
6	国投证券股份有限公司	7,353,000.00	0.39%
7	申万宏源证券有限公司	6,520,000.00	0.34%
8	中信建投证券股份有限公司	6,239,100.00	0.33%

	司		
9	黄飞龙	5,392,300.00	0.28%
10	招商证券股份有限公司	4,855,700.00	0.26%
11	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,426,469,222.00	74.96%

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	1,763,038,319.00
本报告期基金总申购份额	2,056,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,916,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,903,038,319.00

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

本基金管理人于 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，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，本基金管理人及其相关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	
万联证券	4	3,296,390,977.06	82.56%	810,600.06	57.79%	-
华泰证券	5	205,579,202.35	5.15%	153,341.56	10.93%	-
华创证券	2	187,486,179.56	4.70%	177,339.33	12.64%	-
招商证券	4	176,215,930.04	4.41%	166,701.74	11.88%	-
国盛证券	2	126,992,658.32	3.18%	94,723.17	6.75%	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	新增 1 个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	8	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

国新证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	减少 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	减少 2 个

注：1、交易单元选择标准：

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

2、交易单元选择流程：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
万联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	437,000.00	37.97%	-	-	-	-
招商证券	481,000.00	41.79%	-	-	-	-
国盛证券	232,892.78	20.24%	-	-	-	-

国投证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加华宝证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-11
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
3	关于增加民生证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-31
4	关于增加山西证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-18
5	关于增加华创证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
8	关于增加联储证券为旗下部分 ETF 一级交易	中国证监会规定报刊及	2024-04-24

	商的公告	网站	
9	关于增加渤海证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-17

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1	20240101-20240630	1,429,970,521.00	1,973,357,601.00	1,976,858,900.00	1,426,469,222.00	74.96%

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

- 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

二〇二四年八月三十日