

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：二〇二一年八月三十日

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 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
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
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
8 基金份额持有人信息	62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
9 开放式基金份额变动	63
10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	68
11 影响投资者决策的其他重要信息	69
12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发沪深 300ETF
场内简称	广发 300
基金主代码	510360
交易代码	510360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 20 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	1,358,381,165.00 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	2015-09-09

注：本基金的扩位证券简称为“沪深 300ETF 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策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合，但因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。
业绩比较基准	沪深 300 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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

客户服务电话	95105828	95588
传真	020-89899158	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	262,564,256.57
本期利润	62,541,695.31
加权平均基金份额本期利润	0.0458
本期加权平均净值利润率	2.57%
本期基金份额净值增长率	1.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,071,212,447.83
期末可供分配基金份额利润	0.7886
期末基金资产净值	2,429,593,612.83
期末基金份额净值	1.7886
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	78.86%

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	-1.27%	0.80%	-2.02%	0.80%	0.75%	0.00%
过去三个月	4.69%	0.97%	3.48%	0.98%	1.21%	-0.01%
过去六个月	1.53%	1.31%	0.24%	1.31%	1.29%	0.00%
过去一年	29.43%	1.32%	25.46%	1.33%	3.97%	-0.01%
过去三年	60.60%	1.35%	48.79%	1.37%	11.81%	-0.02%
自基金合同生效起至今	78.86%	1.26%	34.43%	1.34%	44.43%	-0.08%

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

广发沪深 300 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

（2015 年 8 月 20 日至 2021 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，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，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；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金	2015-08-20	-	17 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金从业证书。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

	经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF) 的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；广发美国房地产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的基金经理；广发纳斯达克 100 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				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)。
--	--	--	--	--	---

	起式证券投资基金的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；指数投资部总经理助理				
--	--	--	--	--	--

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 13 次，其中 7 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 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合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

本基金的标的指数为沪深 300 指数，主要采用完全复制法来跟踪标的指数。

(1) 投资策略

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。

(2) 运作分析

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。

2021 年上半年，A 股总体呈现震荡上行趋势，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%，创业板指数上涨 17.22%，成长风格相对价值风格占优。

上半年，国内经济运行平稳，海外主要经济体生产恢复，加工贸易持续改善；低碳行动、保供稳价、经济结构升级等政策的推进带来了进口增量，2021 年前 5 个月进出口总值同比增长近 3 成。汽车外销火爆，出口同比数据近乎翻番，同时从汽车制造到消费电子行业，芯片短缺已经演变成全球性重大问题，也带来相关行业投资机会。

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 1.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

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，伴随央行全面降准，企业融资成本将有望下调，叠加监管层保供稳价措施见效，上游通胀压力缓释，下游制造业盈利将逐步好转。此外，内需将加速修复、接棒外需。5 月、6 月社零数据环比修复力度较大，下半年居民消费动能有望持续释放，利好相关行业上市公司。

沪深 300 指数作为市场中核心宽基指数之一，覆盖沪深两个市场的大盘蓝筹股票，是资产配置的重要标的。投资者若看好 A 股市场，可关注沪深 300 指数基金。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的

情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	25,789,024.61	9,795,585.03
结算备付金		19,816,494.44	44,723,000.04
存出保证金		3,569,711.18	7,327,019.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,381,510,298.85	2,532,759,408.98
其中：股票投资		2,377,971,837.77	2,530,373,741.40
基金投资		-	-
债券投资		3,538,461.08	2,385,667.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,171,862.85	1,126,487.11
应收利息	6.4.7.5	70,502.72	92,514.25
应收股利		147,295.12	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,433,075,189.77	2,595,824,015.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		1,131,648.36	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,005,522.47	1,059,750.15
应付托管费		201,104.46	211,949.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	437,836.77	283,389.40

应交税费		4,101.85	76,142.03
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	701,363.03	377,777.45
负债合计		3,481,576.94	2,009,009.02
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,358,381,165.00	1,472,381,165.00
未分配利润	6.4.7.10	1,071,212,447.83	1,121,433,841.02
所有者权益合计		2,429,593,612.83	2,593,815,006.02
负债和所有者权益总计		2,433,075,189.77	2,595,824,015.04

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.7886 元，基金份额总额 1,358,381,165.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		71,757,762.48	132,757,915.96
1.利息收入		1,259,029.00	426,917.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	213,000.05	317,854.53
债券利息收入		1,251.65	580.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		1,044,777.30	108,482.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		269,577,389.35	173,157,539.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	248,493,256.70	128,660,420.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	370,507.61	941,320.37
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	2,723,917.28	7,611,203.88
股利收益	6.4.7.15	17,989,707.76	35,944,594.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-200,022,561.26	-42,407,128.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	943,905.39	1,580,587.42
减：二、费用		9,216,067.17	12,828,187.19
1. 管理人报酬		6,037,352.23	8,371,735.09
2. 托管费		1,207,470.40	1,674,346.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,494,666.33	2,154,584.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		17,634.86	27,793.08
7. 其他费用	6.4.7.19	458,943.35	599,727.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,541,695.31	119,929,728.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,541,695.31	119,929,728.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,472,381,165.00	1,121,433,841.02	2,593,815,006.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,541,695.31	62,541,695.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-114,000,000.00	-112,763,088.50	-226,763,088.50
其中：1.基金申购款	369,000,000.00	286,551,994.25	655,551,994.25
2.基金赎回款	-483,000,000.00	-399,315,082.75	-882,315,082.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,358,381,165.00	1,071,212,447.83	2,429,593,612.83
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	2,870,381,165.00	988,759,769.26	3,859,140,934.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	119,929,728.77	119,929,728.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-249,000,000.00	-107,658,529.49	-356,658,529.49
其中：1.基金申购款	669,000,000.00	190,234,547.88	859,234,547.88
2.基金赎回款	-918,000,000.00	-297,893,077.37	-1,215,893,077.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,621,381,165.00	1,001,030,968.54	3,622,412,133.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发沪深 300 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[2015]985 号文核准，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《广发沪深 300 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 2015 年 8 月 20 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 2015 年 7 月 10 日至 2015 年 8 月 7 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 308,381,165.00 元，有效认购户数为 2,973 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,796.00 元，折合基金份额 1,796.00 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。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会

发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通

知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金

从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	25,789,024.61
定期存款	-
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	-
合计	25,789,024.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,925,091,160.39	2,377,971,837.77	452,880,677.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,891,600.00	3,538,461.08
	银行间市场	-	-
	合计	2,891,600.00	3,538,461.08
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,927,982,760.39	2,381,510,298.85	453,527,538.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	25,973,580.00	-	-	-
其中：股指期货投资	25,973,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,973,580.00	-	-	-

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。本基金本报告期末具体投资情况如下：股指期货 IF2107 买入持仓量 17 手，合约市值人民币 26,475,120.00 元，公允价值变动人民币 501,540.00 元。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,987.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	51.84
应收结算备付金利息	7,412.53
应收债券利息	628.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	60,422.87
其他	-
合计	70,502.72

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 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	437,836.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	437,836.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提费用	96,203.31
应付替代款	425,949.58
可退替代款	3,521.70
应付指数使用费	175,688.44
合计	701,363.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,472,381,165.00	1,472,381,165.00
本期申购	369,000,000.00	369,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-483,000,000.00	-483,000,000.00
本期末	1,358,381,165.00	1,358,381,165.00

6.4.7.10 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	1,061,621,005.61	59,812,835.41	1,121,433,841.02
本期利润	262,564,256.57	-200,022,561.26	62,541,695.31
本期基金份额交易产生的变动数	-86,428,379.76	-26,334,708.74	-112,763,088.50
其中：基金申购款	304,372,685.77	-17,820,691.52	286,551,994.25
基金赎回款	-390,801,065.53	-8,514,017.22	-399,315,082.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,237,756,882.42	-166,544,434.59	1,071,212,447.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	54,808.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,006.29
结算备付金利息收入	157,185.55

其他	-
合计	213,000.05

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	139,012,874.36
股票投资收益——赎回差价收入	109,480,382.34
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	248,493,256.70

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	560,937,768.11
减：卖出股票成本总额	421,924,893.75
买卖股票差价收入	139,012,874.36

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	882,315,082.75
减：现金支付赎回款总额	347,781,472.75
减：赎回股票成本总额	425,053,227.66
赎回差价收入	109,480,382.34

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 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	370,507.61
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	370,507.61

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,509,944.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,138,600.00
减：应收利息总额	836.77
买卖债券差价收入	370,507.61

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	2,723,917.28

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,989,707.76
其中：证券出借权益补偿收入	482,016.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,989,707.76

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-197,718,261.26
——股票投资	-198,271,054.76
——债券投资	552,793.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-2,304,300.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-2,304,300.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-200,022,561.26

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	943,905.39
合计	943,905.39

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）被替代股票的实际买入成本（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股票在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,487,147.77
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	7,518.56
合计	1,494,666.33

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	498.90
指数使用费	362,241.14
合计	458,943.35

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	4,294,478.73	0.40%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	2,453,600.00	26.53%	3,589,500.00	48.89%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	3,999.51	0.49%	3,999.51	0.91%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	-	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

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、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,037,352.23	8,371,735.09
其中：支付销售机构的客户维护费	28,838.49	21,707.93

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,207,470.40	1,674,346.97

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,180,176,965.00	86.88%	1,339,772,665.00	90.99%
广发证券股份有限公司	22,636,500.00	1.67%	5,924,900.00	0.40%

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	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	25,789,024.61	54,808.21	25,897,692.16	173,531.76

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

本基金本报告期末持有 331,406 股基金管理人控股股东广发证券股份有限公司的 A 股普通股（2020 年 6 月 30 日：711,400 股），成本总额为人民币 4,947,806.65 元（2020 年 6 月 30 日：10,329,655.81 元），估值总额为 5,017,486.84 元（2020 年 6 月 30 日：10,044,968.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.21%（2020 年 6 月 30 日：0.28%）。本基金本报告期末未持有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（本基金 2020 年 6 月 30 日持有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 168,860 股，成本总额为人民币 4,750,631.68 元，估值总额为 4,881,742.60 元，占本基金资产净值的比例为 0.13%）。本基金本报告期末持有 3,921,105 股基金托管人中国工商银行股份有限公司的 A 股普通股（2020 年 6 月 30 日：8,424,700 股），成本总额为人民币 20,955,241.51 元（2020 年 6 月 30 日：45,384,348.48 元），估值总额为 20,272,112.85 元（2020 年 6 月 30 日：41,955,006.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.83%（2020 年 6 月 30 日：1.16%）。本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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	可流通日	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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	新股流通受限	36.35	79.48	3,486.00	126,716.10	277,067.28	-
688183	生益电子	2021-02-10	2021-08-25	新股流通受限	12.42	14.19	18,394.00	228,453.48	261,010.86	20210525 除权除息,派息比例 0.3300 (含税)
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853.00	40,372.49	214,921.88	20210624 除权除息,派息比例 0.4500 (含税)
688059	华锐精密	2021-02-01	2021-08-09	新股流通受限	37.09	160.26	1,023.00	37,943.07	163,945.98	20210519 除权除息,派息比例 1.0000 (含税)
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	新股流通受限	11.27	28.01	3,983.00	44,888.41	111,563.83	-
688323	瑞华泰	2021-04-21	2021-10-28	新股流通受限	5.97	22.78	4,513.00	26,942.61	102,806.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股流通	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-

				受限						
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	20210622 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
688597	煜邦电力	2021-06-09	2021-12-17	新股流通受限	5.88	10.16	3,907.00	22,973.16	39,695.12	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	20210617 除权除息,派息比例 0.1400 (含税)
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	20210629 除权除息,派息比例 0.3000

										(含税)
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	20210618 除权除息,派息比例 0.0790 (含税)
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	20210602 除权除息,派息比例 0.0450 (含税)
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	20210618 除权除息,派息比例 0.0300 (含税)

60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	31.56	31.56	349.00	11,014 .44	11,014 .44	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 流通 受限	16.53	46.07	232.00	3,834. 96	10,688 .24	20210 628 除 权除 息,派 息比 例 0.4100 (含税)
30099 6	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	新股 流通 受限	20.81	42.23	241.00	5,015. 21	10,177 .43	-
30095 6	英力 股份	2021-0 3-16	2021-0 9-27	新股 流通 受限	12.85	25.80	371.00	4,767. 35	9,571. 80	20210 527 除 权除 息,派 息比 例 0.3000 (含税)
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 流通 受限	3.40	16.37	576.00	1,958. 40	9,429. 12	20210 610 除 权除 息,派 息比 例 0.1600 (含税)
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	20210 603 除 权除 息,派 息比 例 0.2200 (含税)
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 流通 受限	13.75	32.98	275.00	3,781. 25	9,069. 50	-
30096 6	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	新股 流通 受限	8.24	31.54	286.00	2,356. 64	9,020. 44	-
30094	曼卡	2021-0	2021-0	新股	4.56	18.88	474.00	2,161.	8,949.	20210

5	龙	2-03	8-10	流通受限				44	12	609 除权除息,派息比例 0.0950 (含税)
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-24	新股流通受限	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	20210604 除权除息,派息比例 0.0800 (含税),转增比例 0.5000
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	20210611 除权除息,派息比例 0.0530 (含税)
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	20210601 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股流通受限	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
30098	川网	2021-0	2021-1	新股	6.79	26.81	301.00	2,043.	8,069.	-

7	传媒	4-28	1-11	流通受限				79	81	
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	20210519 除权除息,派息比例 0.0500 (含税)
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	20210528 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股流通受限	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	20210611 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	20210621 除权除息,派息比例 0.2100 (含税)
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	20210608 除权除息,派息比

										例 0.0360 (含税)
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 流通 受限	12.13	22.49	283.00	3,432. 79	6,364. 67	20210 611 除 权除 息,派 息比 例 0.1500 (含税)
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	9.79	23.01	255.00	2,496. 45	5,867. 55	20210 617 除 权除 息,派 息比 例 0.1000 (含税)
30097 2	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 流通 受限	7.19	12.65	430.00	3,091. 70	5,439. 50	-
30092 9	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-21	新股 流通 受限	13.87	29.55	183.00	2,538. 21	5,407. 65	20210 618 除 权除 息,派 息比 例 0.1200 (含税)
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 流通 受限	12.08	23.06	234.00	2,826. 72	5,396. 04	20210 623 除 权除 息,派 息比 例 0.4000 (含税)
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191.00	2,811. 52	4,454. 12	-
30100 7	德迈 仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股 流通 受限	5.29	14.44	303.00	1,602. 87	4,375. 32	-
30099	宁波	2021-0	2021-1	新股	6.02	21.32	201.00	1,210.	4,285.	-

8	方正	5-25	2-02	流通受限				02	32	
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
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	可流通日	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
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新债流通受限	100.00	100.00	12,590.00	1,259,000.00	1,259,000.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债流通受限	100.00	100.00	1,290.00	129,000.00	129,000.00	-
113049	长汽转债	2021-06-11	2021-07-08	新债流通受限	100.00	100.00	670.00	67,000.00	67,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新债流通受限	100.00	100.00	413.00	41,300.00	41,300.00	-

注：截至本报告期末 2021 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
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	442,440.00	4,489,465.69	2,473,239.60	-

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 2021 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 2021 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	000858	五粮液	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 21 日	297.89	20,000.00	5,957,800.00
2	000333	美的集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 21 日	71.37	55,900.00	3,989,583.00
3	002352	顺丰控股	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	67.70	55,000.00	3,723,500.00
4	000338	潍柴动力	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 20 日	17.87	165,400.00	2,955,698.00
5	000651	格力电器	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 21 日	52.10	54,700.00	2,849,870.00
6	601919	中远海控	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 28 日	30.54	90,000.00	2,748,600.00
7	601012	隆基股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	88.84	28,000.00	2,487,520.00
8	002415	海康威视	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	64.50	35,000.00	2,257,500.00
9	600309	万华化学	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 21 日	108.82	20,000.00	2,176,400.00
10	601838	成都银行	2021 年 7 月 22 日	12.64	170,000.00	2,148,800.00
11	300122	智飞生物	2021 年 7 月 8 日	186.73	10,000.00	1,867,300.00
12	601633	长城汽车	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 19 日	43.59	40,000.00	1,743,600.00
13	600584	长电科技	2021 年 7 月 16 日	37.68	40,000.00	1,507,200.00
14	000625	长安汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	26.28	56,400.00	1,482,192.00
15	600111	北方稀土	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 20 日	20.70	70,000.00	1,449,000.00
16	600196	复星医药	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	72.13	20,000.00	1,442,600.00

17	000063	中兴通讯	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 13 日	33.23	40,000.00	1,329,200.00
18	600438	通威股份	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 14 日	43.27	30,000.00	1,298,100.00
19	002460	赣锋锂业	2021 年 7 月 2 日	121.09	10,000.00	1,210,900.00
20	000963	华东医药	2021 年 7 月 1 日	46.01	25,000.00	1,150,250.00
21	600010	宝钢股份	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 14 日	1.55	730,000.00	1,131,500.00
22	600893	航发动力	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 22 日	53.19	20,000.00	1,063,800.00
23	603806	福斯特	2021 年 7 月 15 日	105.13	10,000.00	1,051,300.00
24	300014	亿纬锂能	2021 年 7 月 2 日	103.93	10,000.00	1,039,300.00
25	002601	龙佰集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	34.58	30,000.00	1,037,400.00
26	300529	健帆生物	2021 年 7 月 8 日	86.36	12,000.00	1,036,320.00
27	002475	立讯精密	2021 年 7 月 13 日	46.00	21,700.00	998,200.00
28	600703	三安光电	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 7 日	32.05	30,000.00	961,500.00
29	000895	双汇发展	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	31.80	30,000.00	954,000.00
30	002241	歌尔股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	42.74	20,000.00	854,800.00
31	002311	海大集团	2021 年 7 月 2 日	81.60	10,000.00	816,000.00
32	601899	紫金矿业	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 8 日	9.69	83,100.00	805,239.00
33	002142	宁波银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	38.97	20,100.00	783,297.00
34	000002	万科 A	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	23.81	32,400.00	771,444.00
35	601788	光大证券	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 20 日	17.89	43,000.00	769,270.00
36	000776	广发证券	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 21 日	15.14	50,000.00	757,000.00
37	000001	平安银行	2021 年 7 月 1 日	22.62	32,200.00	728,364.00
38	002384	东山精密	2021 年 7 月 1 日	20.84	34,000.00	708,560.00
39	002230	科大讯飞	2021 年 7 月 14 日	67.58	10,000.00	675,800.00
40	600009	上海机场	2021 年 7 月 23 日	48.13	14,000.00	673,820.00
41	601066	中信建投	2021 年 7 月 13 日	31.43	20,000.00	628,600.00
42	601878	浙商证券	2021 年 7 月 5 日	13.08	46,800.00	612,144.00

43	002714	牧原股份	2021 年 7 月 6 日	60.82	10,000.00	608,200.00
44	300433	蓝思科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	29.41	20,600.00	605,846.00
45	000066	中国长城	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	14.60	40,000.00	584,000.00
46	600655	豫园股份	2021 年 7 月 22 日	11.59	50,000.00	579,500.00
47	603939	益丰药房	2021 年 7 月 6 日	56.09	10,000.00	560,900.00
48	601216	君正集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	5.09	110,000.00	559,900.00
49	002271	东方雨虹	2021 年 7 月 7 日	55.32	10,000.00	553,200.00
50	002456	欧菲光	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	8.88	62,000.00	550,560.00
51	603369	今世缘	2021 年 7 月 6 日	54.16	10,000.00	541,600.00
52	600118	中国卫星	2021 年 7 月 8 日	29.26	17,000.00	497,420.00
53	000977	浪潮信息	2021 年 7 月 1 日	28.13	16,800.00	472,584.00
54	300142	沃森生物	2021 年 7 月 8 日	61.70	7,400.00	456,580.00
55	002157	正邦科技	2021 年 7 月 8 日	11.95	38,000.00	454,100.00
56	600848	上海临港	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 15 日	17.90	24,000.00	429,600.00
57	000860	顺鑫农业	2021 年 7 月 14 日	42.18	10,000.00	421,800.00
58	600872	中炬高新	2021 年 7 月 6 日	42.02	10,000.00	420,200.00
59	601696	中银证券	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 16 日	20.59	20,000.00	411,800.00
60	600161	天坛生物	2021 年 7 月 13 日	34.25	12,000.00	411,000.00
61	002129	中环股份	2021 年 7 月 2 日	38.60	10,000.00	386,000.00
62	002007	华兰生物	2021 年 7 月 2 日	36.68	10,000.00	366,800.00
63	000100	TCL 科技	2021 年 7 月 2 日	7.65	46,000.00	351,900.00
64	600150	中国船舶	2021 年 7 月 21 日 -2021 年 7 月 22 日	16.51	20,000.00	330,200.00
65	600048	保利地产	2021 年 7 月 14 日	12.04	23,700.00	285,348.00
66	600079	人福医药	2021 年 7 月 14 日	28.27	10,000.00	282,700.00
67	002414	高德红外	2021 年 7 月 14 日	27.58	10,000.00	275,800.00
68	002600	领益智造	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 22 日	9.19	30,000.00	275,700.00
69	600352	浙江龙盛	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	13.74	20,000.00	274,800.00
70	000768	中航西飞	2021 年 7 月 2 日	26.28	10,000.00	262,800.00
71	002739	万达电影	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 9 日	15.79	14,800.00	233,692.00
72	600362	江西铜业	2021 年 7 月 1 日	22.38	10,000.00	223,800.00
73	002939	长城证券	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	11.13	20,000.00	222,600.00
74	600918	中泰证券	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	10.82	20,000.00	216,400.00

75	600521	华海药业	2021 年 7 月 2 日	20.88	10,000.00	208,800.00
76	002044	美年健康	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	9.11	20,000.00	182,200.00
77	601698	中国卫通	2021 年 7 月 20 日	16.19	11,100.00	179,709.00
78	601377	兴业证券	2021 年 7 月 2 日	9.66	17,600.00	170,016.00
79	601231	环旭电子	2021 年 7 月 6 日	16.81	10,000.00	168,100.00
80	002673	西部证券	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	8.25	20,000.00	165,000.00
81	600176	中国巨石	2021 年 7 月 13 日	15.51	10,000.00	155,100.00
82	000876	新希望	2021 年 7 月 2 日	14.67	10,000.00	146,700.00
83	601933	永辉超市	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 14 日	4.73	30,000.00	141,900.00
84	600489	中金黄金	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	8.62	16,200.00	139,644.00
85	000157	中联重科	2021 年 7 月 7 日	9.24	14,800.00	136,752.00
86	600233	圆通速递	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	10.01	13,100.00	131,131.00
87	600109	国金证券	2021 年 7 月 6 日	12.69	10,000.00	126,900.00
88	002202	金风科技	2021 年 7 月 2 日	12.16	10,000.00	121,600.00
89	601600	中国铝业	2021 年 7 月 2 日	5.30	21,500.00	113,950.00
90	000938	紫光股份	2021 年 7 月 1 日	21.88	5,200.00	113,776.00
91	601618	中国中冶	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	2.98	38,100.00	113,538.00
92	601162	天风证券	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	4.86	23,300.00	113,238.00
93	000800	一汽解放	2021 年 7 月 2 日	10.82	10,000.00	108,200.00
94	601238	广汽集团	2021 年 7 月 1 日	12.95	8,300.00	107,485.00
95	601990	南京证券	2021 年 7 月 2 日	10.52	10,000.00	105,200.00
96	601108	财通证券	2021 年 7 月 6 日	10.49	10,000.00	104,900.00
97	600383	金地集团	2021 年 7 月 2 日	10.24	10,000.00	102,400.00
98	601901	方正证券	2021 年 7 月 20 日	9.36	10,000.00	93,600.00
99	000728	国元证券	2021 年 7 月 14 日	7.97	10,000.00	79,700.00
100	600019	宝钢股份	2021 年 7 月 2 日	7.64	10,000.00	76,400.00
101	601800	中国交建	2021 年 7 月 2 日	6.48	11,500.00	74,520.00
102	600606	绿地控股	2021 年 7 月 14 日	5.45	12,100.00	65,945.00
103	600011	华能国际	2021 年 7 月 13 日	4.22	14,300.00	60,346.00
104	600340	华夏幸福	2021 年 7 月 2 日	5.24	10,000.00	52,400.00
合计	-	-	-	-	3,494,100.00	81,399,751.00

6.4.13 金融工具风险及管理

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

理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,326,000.00	2,137,006.50
AAA 以下	2,212,461.08	248,661.08
未评级	-	-
合计	3,538,461.08	2,385,667.58

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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	25,789,024.61	-	-	-	25,789,024.61
结算备付金	19,816,494.44	-	-	-	19,816,494.44

存出保证金	3,569,711.18	-	-	-	3,569,711.18
交易性金融资产	3,538,461.08	-	-	2,377,971,837.77	2,381,510,298.85
应收证券清算款	-	-	-	2,171,862.85	2,171,862.85
应收利息	-	-	-	70,502.72	70,502.72
应收股利	-	-	-	147,295.12	147,295.12
资产总计	52,713,691.31	-	-	2,380,361,498.46	2,433,075,189.77
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	1,131,648.36	1,131,648.36
应付管理人报酬	-	-	-	1,005,522.47	1,005,522.47
应付托管费	-	-	-	201,104.46	201,104.46
应付交易费用	-	-	-	437,836.77	437,836.77
应交税费	-	-	-	4,101.85	4,101.85
其他负债	-	-	-	701,363.03	701,363.03
负债总计	-	-	-	3,481,576.94	3,481,576.94
利率敏感度缺口	52,713,691.31	-	-	2,376,879,921.52	2,429,593,612.83
上年度末					
2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	9,795,585.03	-	-	-	9,795,585.03
结算备付金	44,723,000.04	-	-	-	44,723,000.04
存出保证金	7,327,019.63	-	-	-	7,327,019.63
交易性金融资产	2,385,667.58	-	-	2,530,373,741.40	2,532,759,408.98
应收证券清算款	-	-	-	1,126,487.11	1,126,487.11
应收利息	-	-	-	92,514.25	92,514.25
资产总计	64,231,272.28	-	-	2,531,592,742.76	2,595,824,015.04
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	1,059,750.15	1,059,750.15
应付托管费	-	-	-	211,949.99	211,949.99
应付交易费用	-	-	-	283,389.40	283,389.40
应交税费	-	-	-	76,142.03	76,142.03
其他负债	-	-	-	377,777.45	377,777.45

负债总计	-	-	-	2,009,009.02	2,009,009.02
利率敏感度缺口	64,231,272.28	-	-	2,529,583,733.74	2,593,815,006.02

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	2,377,971,837.77	97.88	2,530,373,741.40	97.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,538,461.08	0.15	2,385,667.58	0.09
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	2,381,510,298.85	98.02	2,532,759,408.98	97.65
----	------------------	-------	------------------	-------

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	127,212,643.27	127,172,087.20
	下降 5%	-127,212,643.27	-127,172,087.20

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）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。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,370,401,662.63 元，属于第二层次的余额为人民币 11,108,636.22 元，无属于第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 2,520,539,582.65 元，属于第二层次的余额为人民币 12,219,826.33 元，无属于第三层次的金额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	2,377,971,837.77	97.74
	其中：股票	2,377,971,837.77	97.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,538,461.08	0.15
	其中：债券	3,538,461.08	0.15
	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	45,605,519.05	1.87
8	其他各项资产	5,959,371.87	0.24
9	合计	2,433,075,189.77	100.00

注：（1）上表中的股票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 81,399,751.00 元，占基金资产净值比例 3.35%。

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	25,068,219.52	1.03
B	采矿业	50,542,531.71	2.08
C	制造业	1,313,130,358.45	54.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,099,703.56	1.94
E	建筑业	28,974,794.09	1.19

F	批发和零售业	17,355,005.22	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	64,720,387.51	2.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,340,032.99	3.14
J	金融业	562,566,533.82	23.15
K	房地产业	49,097,426.32	2.02
L	租赁和商务服务业	43,684,856.59	1.80
M	科学研究和技术服务业	34,147,802.30	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,339,187.24	0.18
Q	卫生和社会工作	50,886,830.23	2.09
R	文化、体育和娱乐业	9,981,895.89	0.41
S	综合	-	-
	合计	2,377,971,837.77	97.88

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	69,364	142,660,938.80	5.87
2	601318	中国平安	1,212,022	77,908,774.16	3.21
3	600036	招商银行	1,384,747	75,039,439.93	3.09
4	000858	五粮液	217,035	64,652,556.15	2.66
5	601012	隆基股份	484,843	43,073,452.12	1.77
6	000333	美的集团	551,982	39,394,955.34	1.62
7	600276	恒瑞医药	501,164	34,064,117.08	1.40
8	601166	兴业银行	1,627,108	33,437,069.40	1.38
9	002415	海康威视	516,502	33,314,379.00	1.37
10	601888	中国中免	109,530	32,869,953.00	1.35

11	603259	药明康德	200,790	31,441,706.10	1.29
12	300059	东方财富	924,867	30,326,388.93	1.25
13	000651	格力电器	538,457	28,053,609.70	1.15
14	600900	长江电力	1,260,064	26,007,720.96	1.07
15	002594	比亚迪	101,614	25,505,114.00	1.05
16	002475	立讯精密	546,907	25,157,722.00	1.04
17	600887	伊利股份	680,672	25,069,149.76	1.03
18	000001	平安银行	1,085,753	24,559,732.86	1.01
19	600030	中信证券	953,291	23,775,077.54	0.98
20	000725	京东方 A	3,502,400	21,854,976.00	0.90
21	300015	爱尔眼科	303,996	21,577,636.08	0.89
22	601398	工商银行	3,921,105	20,272,112.85	0.83
23	600031	三一重工	664,426	19,314,863.82	0.79
24	000568	泸州老窖	81,820	19,304,610.80	0.79
25	600309	万华化学	175,586	19,107,268.52	0.79
26	603501	韦尔股份	58,700	18,901,400.00	0.78
27	603288	海天味业	141,503	18,246,811.85	0.75
28	000002	万科 A	761,576	18,133,124.56	0.75
29	002714	牧原股份	294,122	17,888,500.04	0.74
30	600809	山西汾酒	38,912	17,432,576.00	0.72
31	601919	中远海控	541,511	16,537,745.94	0.68
32	300122	智飞生物	88,280	16,484,524.40	0.68
33	601328	交通银行	3,073,769	15,061,468.10	0.62
34	600436	片仔癀	33,578	15,053,017.40	0.62
35	601899	紫金矿业	1,545,353	14,974,470.57	0.62
36	002304	洋河股份	67,096	13,902,291.20	0.57
37	002352	顺丰控股	203,600	13,783,720.00	0.57
38	002230	科大讯飞	199,384	13,474,370.72	0.55
39	002812	恩捷股份	56,300	13,179,830.00	0.54
40	300014	亿纬锂能	126,652	13,162,942.36	0.54
41	300274	阳光电源	114,300	13,151,358.00	0.54
42	600000	浦发银行	1,313,820	13,138,200.00	0.54
43	600438	通威股份	302,008	13,067,886.16	0.54
44	300124	汇川技术	173,072	12,852,326.72	0.53
45	002142	宁波银行	323,960	12,624,721.20	0.52
46	600837	海通证券	1,063,136	12,226,064.00	0.50
47	000661	长春高新	31,492	12,187,404.00	0.50
48	000100	TCL 科技	1,569,827	12,009,176.55	0.49
49	002241	歌尔股份	267,539	11,434,616.86	0.47
50	300347	泰格医药	58,904	11,386,143.20	0.47
51	000063	中兴通讯	336,889	11,194,821.47	0.46
52	601601	中国太保	382,603	11,084,008.91	0.46
53	600585	海螺水泥	268,493	11,021,637.65	0.45
54	600690	海尔智家	423,607	10,975,657.37	0.45

55	002271	东方雨虹	197,928	10,949,376.96	0.45
56	601668	中国建筑	2,346,297	10,910,281.05	0.45
57	603986	兆易创新	58,032	10,904,212.80	0.45
58	002460	赣锋锂业	90,010	10,899,310.90	0.45
59	002027	分众传媒	1,149,299	10,814,903.59	0.45
60	300142	沃森生物	175,167	10,807,803.90	0.44
61	603799	华友钴业	91,960	10,501,832.00	0.43
62	600016	民生银行	2,380,649	10,498,662.09	0.43
63	600763	通策医疗	24,804	10,194,444.00	0.42
64	601288	农业银行	3,214,431	9,739,725.93	0.40
65	600196	复星医药	135,004	9,737,838.52	0.40
66	600703	三安光电	301,981	9,678,491.05	0.40
67	600048	保利地产	803,460	9,673,658.40	0.40
68	000338	潍柴动力	531,170	9,492,007.90	0.39
69	600919	江苏银行	1,321,624	9,383,530.40	0.39
70	601229	上海银行	1,112,507	9,122,557.40	0.38
71	601688	华泰证券	576,134	9,102,917.20	0.37
72	002129	中环股份	235,600	9,094,160.00	0.37
73	600660	福耀玻璃	156,520	8,741,642.00	0.36
74	600570	恒生电子	93,513	8,720,087.25	0.36
75	601211	国泰君安	504,771	8,651,774.94	0.36
76	600104	上汽集团	391,980	8,611,800.60	0.35
77	601766	中国中车	1,361,091	8,275,433.28	0.34
78	688111	金山办公	20,653	8,153,804.40	0.34
79	601169	北京银行	1,655,843	8,063,955.41	0.33
80	600999	招商证券	415,383	7,900,584.66	0.33
81	002371	北方华创	27,506	7,629,614.28	0.31
82	600019	宝钢股份	996,757	7,615,223.48	0.31
83	002311	海大集团	92,982	7,587,331.20	0.31
84	601816	京沪高铁	1,422,200	7,523,438.00	0.31
85	601838	成都银行	592,777	7,492,701.28	0.31
86	002049	紫光国微	47,567	7,334,355.73	0.30
87	002410	广联达	106,505	7,263,641.00	0.30
88	601988	中国银行	2,357,841	7,262,150.28	0.30
89	600406	国电南瑞	310,087	7,206,421.88	0.30
90	601088	中国神华	369,177	7,206,335.04	0.30
91	300498	温氏股份	499,254	7,174,279.98	0.30
92	601818	光大银行	1,850,199	6,993,752.22	0.29
93	600050	中国联通	1,609,267	6,952,033.44	0.29
94	300450	先导智能	114,000	6,855,960.00	0.28
95	600745	闻泰科技	69,600	6,744,240.00	0.28
96	000625	长安汽车	253,605	6,664,739.40	0.27
97	000538	云南白药	57,361	6,637,814.92	0.27
98	600028	中国石化	1,496,460	6,524,565.60	0.27

99	300601	康泰生物	42,980	6,404,020.00	0.26
100	600893	航发动力	119,057	6,332,641.83	0.26
101	601628	中国人寿	186,495	6,320,315.55	0.26
102	600346	恒力石化	236,457	6,204,631.68	0.26
103	002821	凯莱英	16,342	6,089,029.20	0.25
104	600588	用友网络	183,016	6,087,112.16	0.25
105	601390	中国中铁	1,139,260	5,969,722.40	0.25
106	300595	欧普康视	57,500	5,954,125.00	0.25
107	601633	长城汽车	136,544	5,951,952.96	0.24
108	601009	南京银行	559,452	5,885,435.04	0.24
109	002493	荣盛石化	339,571	5,864,391.17	0.24
110	601377	兴业证券	599,657	5,792,686.62	0.24
111	601857	中国石油	1,087,158	5,751,065.82	0.24
112	601658	邮储银行	1,115,400	5,599,308.00	0.23
113	600009	上海机场	114,288	5,500,681.44	0.23
114	300413	芒果超媒	79,522	5,455,209.20	0.22
115	600132	重庆啤酒	26,900	5,324,855.00	0.22
116	601225	陕西煤业	447,522	5,303,135.70	0.22
117	002601	龙佰集团	150,593	5,207,505.94	0.21
118	300408	三环集团	121,774	5,165,653.08	0.21
119	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.21
120	600426	华鲁恒升	166,180	5,143,271.00	0.21
121	600584	长电科技	135,600	5,109,408.00	0.21
122	688012	中微公司	30,541	5,067,362.72	0.21
123	600111	北方稀土	244,196	5,054,857.20	0.21
124	000776	广发证券	331,406	5,017,486.84	0.21
125	601939	建设银行	751,193	4,995,433.45	0.21
126	002001	新和成	172,991	4,961,381.88	0.20
127	601100	恒立液压	57,679	4,955,779.68	0.20
128	688036	传音控股	23,622	4,948,809.00	0.20
129	603882	金域医学	30,900	4,936,893.00	0.20
130	300433	蓝思科技	166,742	4,903,882.22	0.20
131	600926	杭州银行	332,026	4,897,383.50	0.20
132	002179	中航光电	61,794	4,882,961.88	0.20
133	000895	双汇发展	152,000	4,833,600.00	0.20
134	002050	三花智控	200,558	4,809,380.84	0.20
135	000166	申万宏源	1,008,209	4,718,418.12	0.19
136	600958	东方证券	467,590	4,671,224.10	0.19
137	600741	华域汽车	176,323	4,632,005.21	0.19
138	002841	视源股份	37,254	4,630,299.66	0.19
139	600600	青岛啤酒	39,605	4,580,318.25	0.19
140	300003	乐普医疗	141,439	4,543,020.68	0.19
141	000963	华东医药	98,016	4,509,716.16	0.19
142	002007	华兰生物	122,282	4,485,303.76	0.18

143	000786	北新建材	113,088	4,438,704.00	0.18
144	000157	中联重科	474,527	4,384,629.48	0.18
145	601006	大秦铁路	665,229	4,377,206.82	0.18
146	603806	福斯特	41,400	4,352,382.00	0.18
147	002607	中公教育	207,716	4,339,187.24	0.18
148	601901	方正证券	460,709	4,312,236.24	0.18
149	601336	新华保险	93,388	4,287,443.08	0.18
150	600015	华夏银行	688,884	4,264,191.96	0.18
151	002236	大华股份	201,034	4,241,817.40	0.17
152	600143	金发科技	202,200	4,217,892.00	0.17
153	601155	新城控股	101,349	4,216,118.40	0.17
154	601989	中国重工	1,020,303	4,203,648.36	0.17
155	600176	中国巨石	268,727	4,167,955.77	0.17
156	000768	中航西飞	155,201	4,078,682.28	0.17
157	603993	洛阳钼业	790,349	4,078,200.84	0.17
158	601877	正泰电器	120,051	4,007,302.38	0.16
159	600352	浙江龙盛	290,842	3,996,169.08	0.16
160	600760	中航沈飞	65,933	3,975,759.90	0.16
161	600010	包钢股份	2,550,027	3,952,541.85	0.16
162	601788	光大证券	218,460	3,908,249.40	0.16
163	300529	健帆生物	45,038	3,889,481.68	0.16
164	001979	招商蛇口	354,487	3,881,632.65	0.16
165	600547	山东黄金	201,856	3,879,672.32	0.16
166	601600	中国铝业	731,871	3,878,916.30	0.16
167	002008	大族激光	95,602	3,861,364.78	0.16
168	601186	中国铁建	514,448	3,822,348.64	0.16
169	603369	今世缘	69,875	3,784,430.00	0.16
170	688169	石头科技	3,000	3,783,000.00	0.16
171	002202	金风科技	308,856	3,755,688.96	0.15
172	000876	新希望	251,765	3,693,392.55	0.15
173	601138	工业富联	289,336	3,590,659.76	0.15
174	002555	三七互娱	149,110	3,581,622.20	0.15
175	003816	中国广核	1,319,997	3,524,391.99	0.15
176	603899	晨光文具	41,468	3,506,534.08	0.14
177	601799	星宇股份	15,500	3,498,660.00	0.14
178	000938	紫光股份	159,696	3,494,148.48	0.14
179	002736	国信证券	322,780	3,469,885.00	0.14
180	601066	中信建投	109,316	3,435,801.88	0.14
181	600109	国金证券	270,728	3,435,538.32	0.14
182	000069	华侨城 A	458,987	3,414,863.28	0.14
183	600989	宝丰能源	247,000	3,378,960.00	0.14
184	000425	徐工机械	525,687	3,348,626.19	0.14
185	601669	中国电建	855,919	3,312,406.53	0.14
186	603160	汇顶科技	25,316	3,281,713.08	0.14

187	600795	国电电力	1,319,132	3,205,490.76	0.13
188	000977	浪潮信息	113,531	3,193,627.03	0.13
189	300136	信维通信	103,300	3,189,904.00	0.13
190	601238	广汽集团	244,993	3,172,659.35	0.13
191	000783	长江证券	432,859	3,168,527.88	0.13
192	603659	璞泰来	23,000	3,141,800.00	0.13
193	000596	古井贡酒	13,077	3,131,941.50	0.13
194	603019	中科曙光	113,293	3,128,019.73	0.13
195	688008	澜起科技	50,008	3,119,499.04	0.13
196	002624	完美世界	130,164	3,112,221.24	0.13
197	002384	东山精密	149,100	3,107,244.00	0.13
198	600085	同仁堂	75,655	3,090,506.75	0.13
199	600183	生益科技	128,086	2,998,493.26	0.12
200	600886	国投电力	311,714	2,995,571.54	0.12
201	300558	贝达药业	27,600	2,987,424.00	0.12
202	600029	南方航空	493,736	2,972,290.72	0.12
203	601985	中国核电	585,961	2,964,962.66	0.12
204	601360	三六零	241,940	2,954,087.40	0.12
205	601108	财通证券	281,274	2,950,564.26	0.12
206	300144	宋城演艺	175,466	2,947,828.80	0.12
207	000703	恒逸石化	245,850	2,937,907.50	0.12
208	002414	高德红外	105,256	2,902,960.48	0.12
209	002600	领益智造	315,828	2,902,459.32	0.12
210	603833	欧派家居	20,399	2,895,842.04	0.12
211	601555	东吴证券	347,156	2,895,281.04	0.12
212	603517	绝味食品	34,300	2,891,147.00	0.12
213	000066	中国长城	196,839	2,873,849.40	0.12
214	002044	美年健康	306,445	2,791,713.95	0.11
215	002252	上海莱士	371,802	2,784,796.98	0.11
216	002938	鹏鼎控股	77,395	2,776,932.60	0.11
217	600522	中天科技	274,527	2,745,270.00	0.11
218	601607	上海医药	129,008	2,725,939.04	0.11
219	688396	华润微	29,751	2,707,936.02	0.11
220	300676	华大基因	22,817	2,706,096.20	0.11
221	002602	世纪华通	417,119	2,677,903.98	0.11
222	300033	同花顺	23,735	2,676,833.30	0.11
223	600872	中炬高新	62,666	2,633,225.32	0.11
224	000728	国元证券	330,225	2,631,893.25	0.11
225	600161	天坛生物	76,617	2,624,132.25	0.11
226	601111	中国国航	334,201	2,600,083.78	0.11
227	600362	江西铜业	115,806	2,591,738.28	0.11
228	600383	金地集团	252,297	2,583,521.28	0.11
229	601800	中国交建	394,154	2,554,117.92	0.11
230	600115	中国东航	501,489	2,547,564.12	0.10

231	601916	浙商银行	638,480	2,534,765.60	0.10
232	300628	亿联网络	30,082	2,520,871.60	0.10
233	600332	白云山	73,610	2,491,698.50	0.10
234	002508	老板电器	53,219	2,474,683.50	0.10
235	002024	苏宁易购	442,440	2,473,239.60	0.10
236	000860	顺鑫农业	58,301	2,459,136.18	0.10
237	002916	深南电路	22,040	2,449,305.20	0.10
238	600061	国投资本	287,836	2,443,727.64	0.10
239	601618	中国中冶	798,841	2,380,546.18	0.10
240	601727	上海电气	557,704	2,364,664.96	0.10
241	600150	中国船舶	143,153	2,363,456.03	0.10
242	000708	中信特钢	112,602	2,346,625.68	0.10
243	601021	春秋航空	40,955	2,330,339.50	0.10
244	600705	中航产融	599,049	2,318,319.63	0.10
245	600845	宝信软件	45,000	2,290,500.00	0.09
246	688363	华熙生物	8,223	2,284,842.78	0.09
247	601878	浙商证券	173,471	2,269,000.68	0.09
248	603939	益丰药房	40,300	2,260,427.00	0.09
249	600606	绿地控股	408,502	2,226,335.90	0.09
250	601162	天风证券	448,610	2,180,244.60	0.09
251	002456	欧菲光	241,464	2,144,200.32	0.09
252	002157	正邦科技	176,046	2,103,749.70	0.09
253	002463	沪电股份	135,060	2,089,378.20	0.09
254	600011	华能国际	492,170	2,076,957.40	0.09
255	000656	金科股份	358,453	2,075,442.87	0.09
256	600521	华海药业	98,200	2,050,416.00	0.08
257	600655	豫园股份	173,714	2,013,345.26	0.08
258	601933	永辉超市	425,536	2,012,785.28	0.08
259	601990	南京证券	190,800	2,007,216.00	0.08
260	603392	万泰生物	7,588	1,966,657.84	0.08
261	600118	中国卫星	66,483	1,945,292.58	0.08
262	601696	中银证券	93,700	1,929,283.00	0.08
263	601216	君正集团	377,827	1,923,139.43	0.08
264	600489	中金黄金	216,821	1,868,997.02	0.08
265	600018	上港集团	388,686	1,854,032.22	0.08
266	601077	渝农商行	460,800	1,838,592.00	0.08
267	002558	巨人网络	136,585	1,816,580.50	0.07
268	601995	中金公司	29,300	1,801,950.00	0.07
269	603195	公牛集团	8,800	1,777,600.00	0.07
270	002120	韵达股份	129,672	1,754,462.16	0.07
271	600848	上海临港	97,833	1,751,210.70	0.07
272	601998	中信银行	342,648	1,747,504.80	0.07
273	002673	西部证券	200,352	1,652,904.00	0.07
274	601319	中国人保	277,900	1,647,947.00	0.07

275	688009	中国通号	289,283	1,646,020.27	0.07
276	600079	人福医药	56,900	1,608,563.00	0.07
277	603338	浙江鼎力	27,000	1,584,630.00	0.07
278	002739	万达电影	99,991	1,578,857.89	0.06
279	601881	中国银河	144,399	1,556,621.22	0.06
280	601872	招商轮船	329,480	1,522,197.60	0.06
281	603658	安图生物	19,786	1,499,185.22	0.06
282	600233	圆通速递	141,521	1,416,625.21	0.06
283	300677	英科医疗	11,200	1,397,760.00	0.06
284	688126	沪硅产业-U	47,234	1,378,288.12	0.06
285	603233	大参林	26,300	1,344,193.00	0.06
286	600482	中国动力	72,256	1,258,699.52	0.05
287	601231	环旭电子	73,924	1,242,662.44	0.05
288	002153	石基信息	50,419	1,185,350.69	0.05
289	002032	苏泊尔	18,364	1,171,439.56	0.05
290	600025	华能水电	201,135	1,164,571.65	0.05
291	002939	长城证券	104,393	1,161,894.09	0.05
292	600340	华夏幸福	217,847	1,141,518.28	0.05
293	000800	一汽解放	104,800	1,133,936.00	0.05
294	601236	红塔证券	81,173	1,100,705.88	0.05
295	601808	中海油服	66,580	956,088.80	0.04
296	002773	康弘药业	41,092	950,457.96	0.04
297	600918	中泰证券	85,703	927,306.46	0.04
298	601698	中国卫通	49,297	798,118.43	0.03
299	603087	甘李药业	7,019	748,085.02	0.03
300	600299	安迪苏	45,200	540,592.00	0.02
301	002945	华林证券	29,980	414,323.60	0.02
302	000723	美锦能源	40,000	302,400.00	0.01
303	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.01
304	688183	生益电子	18,394	261,010.86	0.01
305	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
306	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.01
307	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
308	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.00
309	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
310	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
311	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
312	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
313	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
314	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
315	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
316	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
317	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
318	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00

319	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
320	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
321	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
322	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
323	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
324	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
325	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
326	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
327	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
328	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
329	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
330	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
331	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
332	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
333	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
334	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
335	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
336	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
337	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
338	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
339	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
340	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
341	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
342	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
343	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
344	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
345	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
346	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
347	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
348	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
349	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
350	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
351	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
352	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
353	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
354	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
355	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
356	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
357	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
358	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
359	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
360	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
361	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
362	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

363	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
364	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
365	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
366	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
367	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	600519	贵州茅台	19,227,515.00	0.74
2	000858	五粮液	17,622,925.70	0.68
3	000333	美的集团	14,147,687.69	0.55
4	002415	海康威视	11,712,395.00	0.45
5	300274	阳光电源	10,947,889.00	0.42
6	000651	格力电器	9,605,913.94	0.37
7	688111	金山办公	8,715,249.25	0.34
8	300059	东方财富	8,217,360.00	0.32
9	002475	立讯精密	7,933,295.32	0.31
10	000725	京东方 A	7,419,872.20	0.29
11	300122	智飞生物	7,237,433.00	0.28
12	000001	平安银行	7,233,130.66	0.28
13	300450	先导智能	6,952,238.60	0.27
14	002714	牧原股份	6,845,260.06	0.26
15	000002	万科 A	6,581,102.00	0.25
16	000661	长春高新	6,509,588.54	0.25
17	300015	爱尔眼科	6,442,173.95	0.25
18	002594	比亚迪	6,328,104.80	0.24
19	601816	京沪高铁	6,270,581.00	0.24
20	300595	欧普康视	6,111,699.20	0.24

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	000858	五粮液	29,587,281.73	1.14
2	000333	美的集团	21,886,940.74	0.84
3	000651	格力电器	14,381,360.08	0.55
4	300059	东方财富	12,055,656.71	0.46
5	000001	平安银行	11,604,281.34	0.45
6	000568	泸州老窖	10,150,254.68	0.39
7	000002	万科 A	9,982,012.36	0.38
8	002415	海康威视	9,791,067.77	0.38
9	002714	牧原股份	9,397,776.55	0.36
10	002594	比亚迪	9,040,391.25	0.35
11	002475	立讯精密	8,529,769.61	0.33
12	000661	长春高新	8,232,659.84	0.32
13	002352	顺丰控股	7,851,563.07	0.30
14	002142	宁波银行	7,830,624.00	0.30
15	000725	京东方 A	7,441,245.00	0.29
16	002304	洋河股份	7,408,067.32	0.29
17	000100	TCL 科技	6,181,144.47	0.24
18	002027	分众传媒	5,832,323.12	0.22
19	300122	智飞生物	5,754,550.58	0.22
20	300014	亿纬锂能	5,482,210.72	0.21

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	518,150,424.39
卖出股票收入（成交）总额	560,937,768.11

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）	3,538,461.08	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,538,461.08	0.15

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	123111	东财转 3	13,953	2,042,161.08	0.08
2	113050	南银转债	12,590	1,259,000.00	0.05
3	127038	国微转债	1,290	129,000.00	0.01
4	113049	长汽转债	670	67,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	413	41,300.00	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
----	----	-----	------	--------	------

IF2107	IF2107	17.00	26,475,120.00	501,540.00	买入的股指期货是现货股票指数的对应期货品种，相关性较高，用期货进行较小比例的现货股票替代，能够较好地实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
公允价值变动总额合计					501,540.00
股指期货投资本期收益					2,723,917.28
股指期货投资本期公允价值变动					-2,304,300.00

7.10.2 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

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

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，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚。江苏恒瑞医药股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国财政部的处罚。

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	3,569,711.18
2	应收证券清算款	2,171,862.85
3	应收股利	147,295.12
4	应收利息	70,502.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,959,371.87

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	000858	五粮液	5,957,800.00	0.25	转融通流通受限
2	000333	美的集团	3,989,583.00	0.16	转融通流通受限
3	601012	隆基股份	2,487,520.00	0.10	转融通流通受限
4	002415	海康威视	2,257,500.00	0.09	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		广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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
4,915	276,374.60	1,293,696,065.00	95.24%	64,685,100.00	4.76%	1,180,176,965.00	86.88%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金”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	长江养老保险股份有限公司-中国太平洋人寿权益基金型投资产品(财富管家)委托专户	47,000,000.00	3.46%
2	长江养老保险股份有限公司-中国太平洋人寿权益基金型投资产品(万能险(金诚利))	23,600,000.00	1.74%
3	广发证券股份有限公司	22,636,500.00	1.67%
4	长江养老保险股份有限公司-中国太平洋人寿权益基金型投资产品(寿自营)委托专户	8,090,000.00	0.60%
5	方正证券股份有限公司	5,854,200.00	0.43%
6	威威	2,385,300.00	0.18%
7	中国建设银行股份有限公司	2,364,800.00	0.17%

	司-广发均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)		
8	林夏蕊	1,377,800.00	0.10%
9	吴藩顺	1,087,200.00	0.08%
10	国泰君安证券股份有限公司	1,013,400.00	0.07%
11	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,180,176,965.00	86.88%

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（2015 年 8 月 20 日）基金份额总额	308,381,165.00
本报告期期初基金份额总额	1,472,381,165.00
本报告期基金总申购份额	369,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	483,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,358,381,165.00

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。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

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

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	7	4,294,478.73	0.40%	3,999.51	0.49%	-
方正证券	5	16,086,676.92	1.51%	11,764.25	1.45%	-
华泰证券	5	117,409,521.84	10.99%	85,862.98	10.59%	-
中泰证券	5	145,293,762.41	13.60%	135,312.49	16.69%	-
华林证券	1	180,002,971.02	16.85%	131,633.36	16.23%	-
安信证券	5	604,911,504.12	56.64%	442,373.89	54.55%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
长江证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

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

2、交易单元选择流程：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	2,453,600.00	26.53%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,361,432.00	14.72%	-	-	-	-
中泰证券	1,053,504.28	11.39%	-	-	-	-
华林证券	4,380,008.10	47.36%	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
3	关于增加第一创业证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
4	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
6	关于广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金做市商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-23

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
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20210101-20210630	1,339,772,665.00	180,974,700.00	340,570,400.00	1,180,176,965.00	86.88%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： ① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； ② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； ③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； ④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； ⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自2021年3月31日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

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 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日