

广发均衡增长混合型证券投资基金
2021 年年度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 27 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
8.6 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	81
8.7 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	81
8.8 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	81
8.9 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	81
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	83
§9 基金份额持有人信息	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	85
§10 开放式基金份额变动	85
§11 重大事件揭示	86
11.1 基金份额持有人大会决议	86
11.2 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	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	87
§12 备查文件目录	88
12.1 备查文件目录	88
12.2 存放地点	88
12.3 查阅方式	89

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发均衡增长混合型证券投资基金	
基金简称	广发均衡增长混合	
基金主代码	010534	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 27 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,541,346,997.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
下属分级基金的交易代码	010534	010535
报告期末下属分级基金的份额总额	3,415,068,627.32 份	126,278,370.49 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		广发基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	罗菲菲
	联系电话	020-83936666	010-58560666
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95568
传真		020-89899158	010-57093382
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		510308	100031
法定代表人		孙树明	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
本期已实现收益	304,050,456.33	10,177,628.79
本期利润	367,066,913.23	12,801,440.66
加权平均基金份额本期利润	0.0616	0.0575
本期加权平均净值利润率	6.03%	5.63%
本期基金份额净值增长率	5.99%	5.74%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
期末可供分配利润	165,840,564.65	5,824,993.62
期末可供分配基金份额利润	0.0486	0.0461
期末基金资产净值	3,619,514,943.23	133,527,969.87
期末基金份额净值	1.0599	1.0574
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
基金份额累计净值增长率	5.99%	5.74%

注：（1）本基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日，至披露时点不满一年。

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发均衡增长混合 A：

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	2.36%	0.35%	1.60%	0.29%	0.76%	0.06%
过去六个月	2.28%	0.43%	0.92%	0.37%	1.36%	0.06%
自基金合同生 效起至今	5.99%	0.35%	0.83%	0.42%	5.16%	-0.07%

广发均衡增长混合 C:

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.29%	0.35%	1.60%	0.29%	0.69%	0.06%
过去六个月	2.14%	0.43%	0.92%	0.37%	1.22%	0.06%
自基金合同生 效起至今	5.74%	0.35%	0.83%	0.42%	4.91%	-0.07%

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

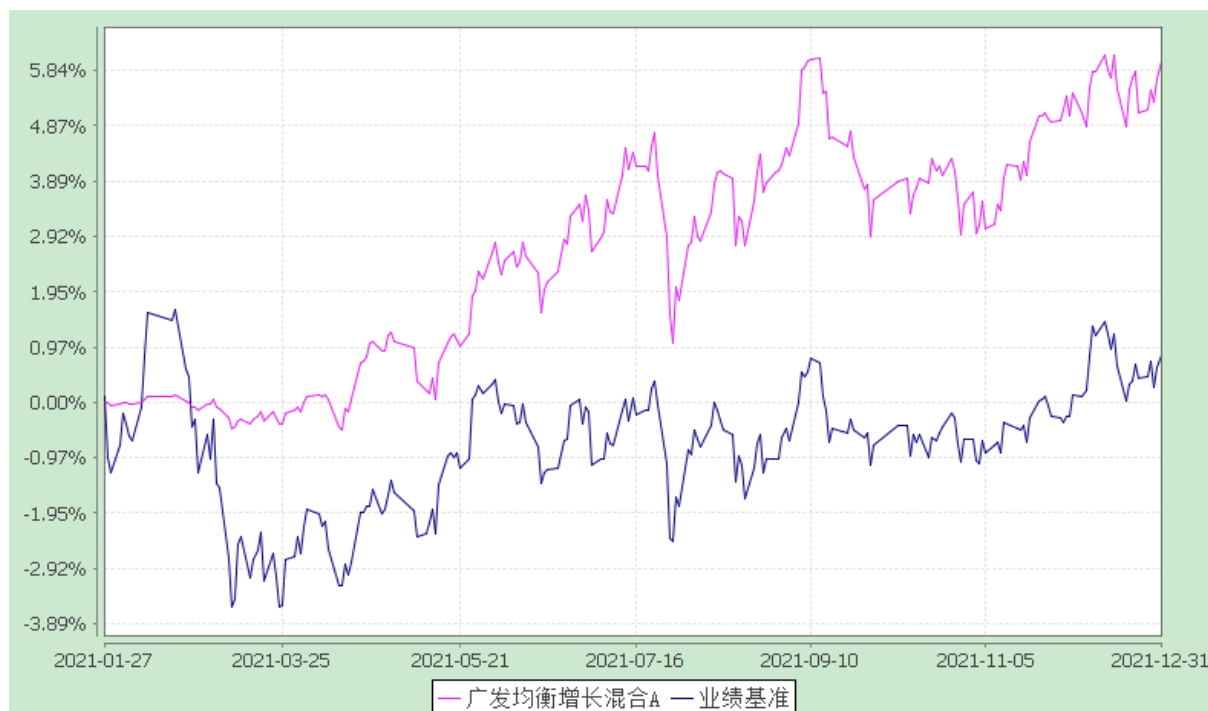
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发均衡增长混合型证券投资基金

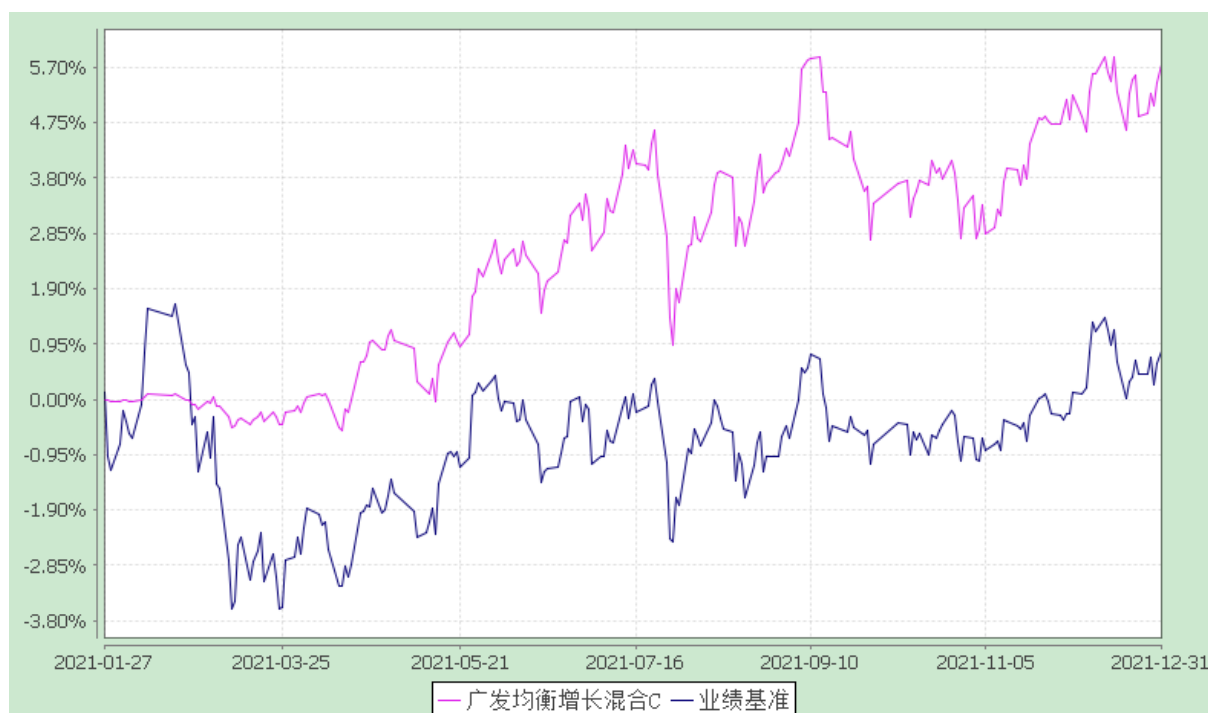
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 1 月 27 日至 2021 年 12 月 31 日)

广发均衡增长混合 A



广发均衡增长混合 C



注：（1）本基金合同生效日期为 2021 年 1 月 27 日，至披露时点未满一年。

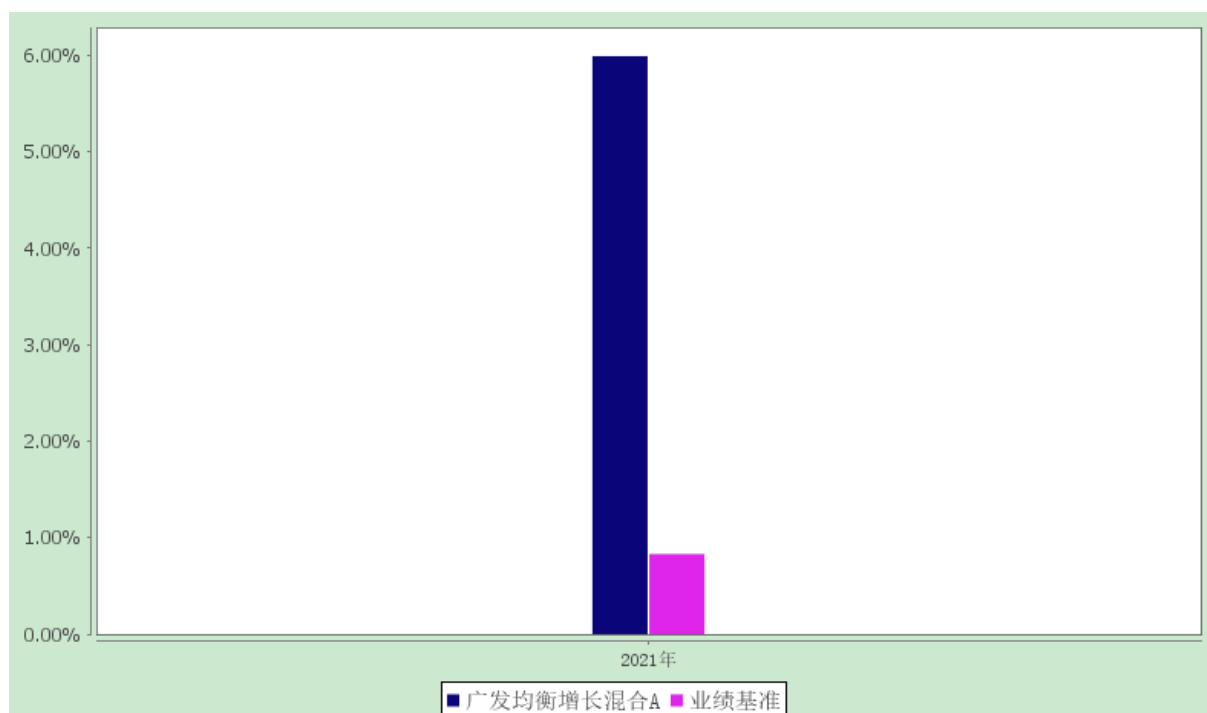
（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

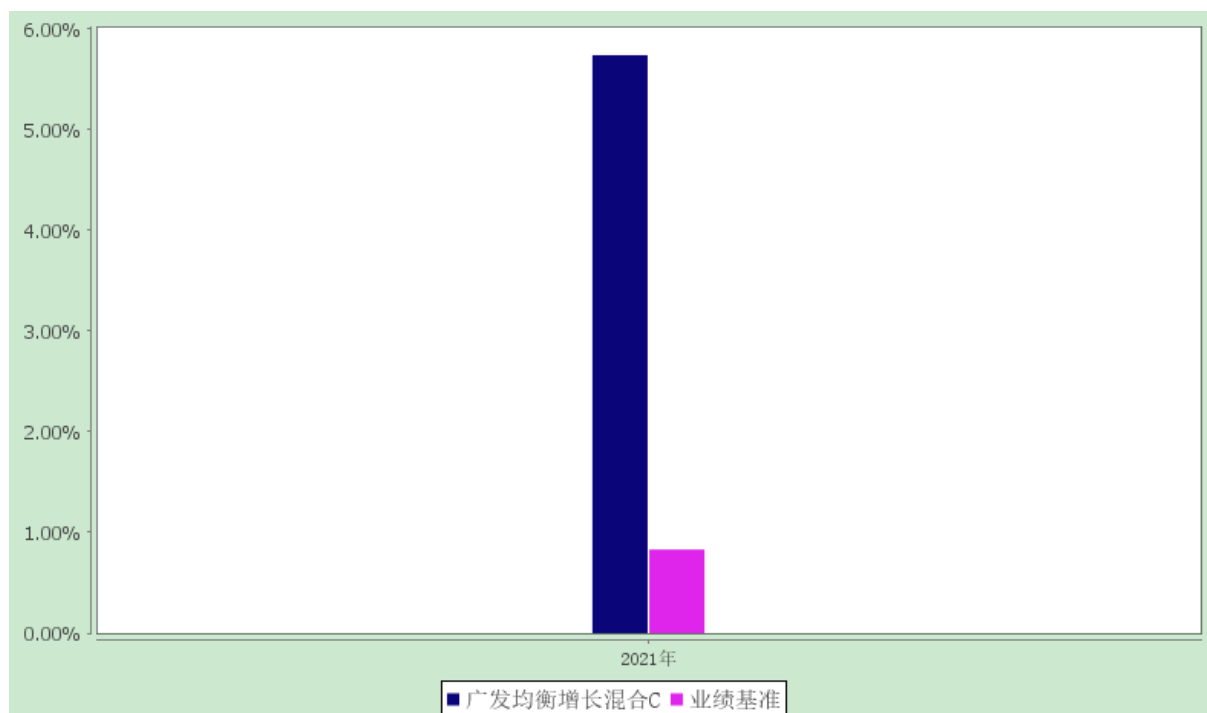
广发均衡增长混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

广发均衡增长混合 A



广发均衡增长混合 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 1 月 27 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2021 年 1 月 27 日）至报告期末未进行利润分配。

§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、南京、成都、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、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、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		
王颂	本基金的基金经理；广发稳安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发睿享稳健增利混合型证券投资基金的基金经理；资产配置总监	2021-01-27	-	24 年	王颂先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任平安证券投资管理部投资经理，平安资产基金投资部总经理，广发基金管理有限公司机构投资部总经理、权益投资二部总经理、资产配置部（原另类投资部）总经理、广发聚瑞混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 24 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 24 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 9 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发新动力混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)、广发价值回报混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 4 月 29 日至 2021 年 7 月 16 日)。

李阳	本基金的基金经理；广发睿享稳健增利混合型证券投资基金的基金经理	2021-05-20	-	6 年	李阳先生，工程硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国工商银行股份有限公司产品研发中心产品经理，新时代证券股份有限公司资产管理总部量化研究员、量化投资经理，泰康养老保险股份有限公司养老金投资部高级投资经理，广发基金管理有限公司资产配置部研究员。
洪志	本基金的基金经理；广发汇兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇吉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇荣三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发景辉纯债债券型证券投资基金的基金经理	2021-08-27	-	9 年	洪志先生，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易兼研究员、投资经理、广发集裕债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 1 月 27 日)、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 4 月 8 日)、广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 9 月 22 日)、广发汇宏 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 10 月 14 日)、广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 10 月 25 日)。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《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 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。在本年度本基金与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差专项分析中，未发现存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 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 49 次，其中 41 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 8 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

2021 年全年，上证指数上涨 4.80%，沪深 300 指数下跌 5.20%，中证 500 指数上涨 15.58%。整体而言，权益市场以结构化行情为主，大小盘股票存在较大分化，小盘股表现整体优于大盘股。新能源赛道表现优异，而消费、医药板块遭受重挫。2021 年债券市场呈现震荡慢牛的行情。2021 年上半年，经济受出口和房地产行业的高景气驱动，在“稳增长压力较小的窗口期”，宏观政策总体偏紧，债市在犹豫中温和走牛；下半年，紧信用政策的滞后效应开始显现，房地产行业出现加速恶化，叠加部分行业的供给侧冲击，经济下行压力逐渐加大，央行两次采取了全面降准的宽松操作，债券利率加速下行。

报告期内，本基金对权益、利率债、信用债、期货等各类资产进行合理配置，充分利用不同资产的特性，在追求更高收益的同时控制组合整体的风险。在权益资产操作方面，本基金保持行业的均衡配比，对有业绩支撑、基本面较好的中小盘股票进行了重点配置，个股分散度较高。在固收资产操作方面，本基金总体保持积极的配置策略，灵活调整仓位结构及久期，获得了较为稳健的绝对回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 5.99%，C 类基金份额净值增长率为 5.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

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 2022 年，宏观环境更加复杂。国内面临着经济下行惯性与稳增长政策的博弈，国外面临发达国家加速推进货币政策正常化的扰动。权益市场方面，市场可能继续以结构化行情为主，依然存在阶段性和结构性机会。对于新能源和碳中和等高景气赛道，由于当前估值已经较高，预计未来市场波动增大，需要防范风险。债券市场方面，当前绝对利率处于历史较低分位水平，信用利差及套息利差亦不乐观，总体上需要降低对债券资产的回报预期。在复杂的宏观政策环境下，面对较低的

绝对利率水平，本基金将更加注重资产的安全边际，增加组合操作的灵活性，稳中求胜，争取为持有人带来稳健回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司严格按照法律法规和监管部门要求，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

（1）持续加强制度建设，开展内部制度修订完善工作，积极推进公司内部管理进一步精细化、规范化、科学化。

（2）积极探索合规管理工作模式创新，强化合规考核，增强员工参与合规管理的主动性与积极性；制作并优化各类工作指引，积极防控各项操作风险。

（3）加强运营管理薄弱环节检查力度，全年稽核检查范围覆盖投资、交易、销售、IT 等业务的各个运作环节，及时发现问题并推动解决。

（4）扎实推进反洗钱日常工作，有序推进洗钱风险自评估工作，积极组织专项风险排查，认真开展可疑交易监测分析，丰富反洗钱宣传形式。

（5）加强对专兼合规管理人员的工作指导，明确专兼合规管理人员日常合规管理职责，建立合规管理事项沟通机制并细化绩效考核方案，提高专兼合规管理人员履职积极性。

（6）加强基金产品宣传推介活动管理，明确公司内部宣传推介材料合规口径，加强合规培训，提高合规意识，结合工作实际及时推出有针对性的管理措施。

（7）持续完善信息披露与监管报送工作，不断完善信息披露或监管报送的系统功能建设，提高工作效率，按时、保质、保量完成各类信息披露与监管数据报送工作。

（8）强化投资组合日常合规风险监控，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平，完善对合规风险的闭环监控；通过持续完善系统指标，实现对投资组合更精细化的风险管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 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、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。

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

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60873695_G239 号

广发均衡增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发均衡增长混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 1 月 27 日至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发均衡增长混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发均衡增长混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 27 日至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发均衡增长混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

广发均衡增长混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发均衡增长混合型证券投资基金的持续经营能力，披露

与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发均衡增长混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发均衡增长混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发均衡增长混合型证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2022 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发均衡增长混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资 产：		-
银行存款	7.4.7.1	75,022,562.59
结算备付金		93,592,299.88
存出保证金		8,106,751.51
交易性金融资产	7.4.7.2	3,124,392,220.82
其中：股票投资		1,467,959,651.39
基金投资		-
债券投资		1,426,249,569.43
资产支持证券投资		230,183,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	440,030,650.05
应收证券清算款		19,780,851.68
应收利息	7.4.7.5	22,782,049.62
应收股利		-
应收申购款		58,701.55
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,783,766,087.70

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负 债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		22,581,539.18
应付管理人报酬		4,003,116.14
应付托管费		667,186.01
应付销售服务费		29,399.15
应付交易费用	7.4.7.7	2,987,644.72
应交税费		261,288.42
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	193,000.98
负债合计		30,723,174.60
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	3,541,346,997.81
未分配利润	7.4.7.10	211,695,915.29
所有者权益合计		3,753,042,913.10
负债和所有者权益总计		3,783,766,087.70

注：（1）报告截止日 2021 年 12 月 31 日，广发均衡增长混合 A 基金份额净值人民币 1.0599 元，基金份额总额 3,415,068,627.32 份；广发均衡增长混合 C 基金份额净值人民币 1.0574 元，基金份额总额 126,278,370.49 份；总份额总额 3,541,346,997.81 份。

（2）本会计期间为 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：广发均衡增长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		491,027,901.04
1.利息收入		114,646,074.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	8,654,846.81
债券利息收入		86,122,896.17
资产支持证券利息收入		5,920,355.26
买入返售金融资产收入		13,947,976.39
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		306,746,327.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	240,251,150.97
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	21,781,144.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	9,895,095.15
股利收益	7.4.7.17	34,818,937.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	65,640,268.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	3,995,229.88
减：二、费用		111,159,547.15
1. 管理人报酬		70,288,447.50

2. 托管费		11,714,741.27
3. 销售服务费		528,295.95
4. 交易费用	7.4.7.20	28,118,907.53
5. 利息支出		30,472.61
其中：卖出回购金融资产支出		30,472.61
6. 税金及附加		202,818.89
7. 其他费用	7.4.7.21	275,863.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		379,868,353.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		379,868,353.89

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发均衡增长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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）	7,931,476,515.48	-	7,931,476,515.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	379,868,353.89	379,868,353.89
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）	-4,390,129,517.67	-168,172,438.60	-4,558,301,956.27
其中：1.基金申购款	51,904,410.78	1,481,606.86	53,386,017.64
2.基金赎回款	-4,442,033,928.45	-169,654,045.46	-4,611,687,973.91

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）	3,541,346,997.81	211,695,915.29	3,753,042,913.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发均衡增长混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2020]2629 号《关于准予广发均衡增长混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2021 年 1 月 25 日向社会公开发行募集并于 2021 年 1 月 27 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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

本基金的财务报表于 2022 年 3 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

（2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

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

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法

取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6) 债券投资收益/(损失)

卖出交易所上市债券:于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账;

卖出银行间同业市场交易债券:于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认,并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所

得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	75,022,562.59
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	75,022,562.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,413,828,030.96	1,467,959,651.39	54,131,620.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	578,877,130.82	588,748,569.43	9,871,438.61
	银行间市场	836,379,112.00	837,501,000.00	1,121,888.00
	合计	1,415,256,242.82	1,426,249,569.43	10,993,326.61
资产支持证券		229,994,700.27	230,183,000.00	188,299.73
基金		-	-	-
其他		-	-	-

合计	3,059,078,974.05	3,124,392,220.82	65,313,246.77
----	------------------	------------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-101,476,550.00	-	-	-
其中：国债期货投资	-101,476,550.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	36,179,528.00	-	-	-
其中：股指期货投资	36,179,528.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-65,297,022.00	-	-	-

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 IC2201 买入持仓量 15 手，合约市值人民币 22,133,400.00 元，公允价值变动人民币 265,872.00 元。股指期货 IC2203 买入持仓量 10 手，合约市值人民币 14,611,600.00 元，公允价值变动人民币 299,600.00 元。国债期货 TF2203 卖出持仓量 100 手，合约市值人民币 -101,715,000.00 元，公允价值变动人民币 -238,450.00 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	300,000,000.00	-
银行间市场	140,030,650.05	-
合计	440,030,650.05	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,288.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	526.90
应收结算备付金利息	29,497.70
应收债券利息	19,578,350.52
应收资产支持证券利息	3,064,392.33
应收买入返售证券利息	84,994.10
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孖息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	22,782,049.62

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,962,760.73
银行间市场应付交易费用	24,883.99
合计	2,987,644.72

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.98
应付证券出借违约金	-
预提费用	193,000.00
合计	193,000.98

7.4.7.9 实收基金

广发均衡增长混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,614,158,074.80	7,614,158,074.80
本期申购	44,496,233.38	44,496,233.38
本期赎回（以“-”号填列）	-4,243,585,680.86	-4,243,585,680.86
本期末	3,415,068,627.32	3,415,068,627.32

广发均衡增长混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	317,318,440.68	317,318,440.68
本期申购	7,408,177.40	7,408,177.40
本期赎回（以“-”号填列）	-198,448,247.59	-198,448,247.59
本期末	126,278,370.49	126,278,370.49

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

7.4.1“基金基本情况”之说明。

2、申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

广发均衡增长混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	304,050,456.33	63,016,456.90	367,066,913.23
本期基金份额交易产生的变动数	-138,209,891.68	-24,410,705.64	-162,620,597.32
其中：基金申购款	1,124,176.04	151,026.50	1,275,202.54
基金赎回款	-139,334,067.72	-24,561,732.14	-163,895,799.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,840,564.65	38,605,751.26	204,446,315.91

广发均衡增长混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	10,177,628.79	2,623,811.87	12,801,440.66
本期基金份额交易产生的变动数	-4,352,635.17	-1,199,206.11	-5,551,841.28
其中：基金申购款	200,338.06	6,066.26	206,404.32
基金赎回款	-4,552,973.23	-1,205,272.37	-5,758,245.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,824,993.62	1,424,605.76	7,249,599.38

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,173,588.60
定期存款利息收入	6,598,333.33
其他存款利息收入	19,588.23

结算备付金利息收入	863,336.65
其他	-
合计	8,654,846.81

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	10,146,551,638.00
减：卖出股票成本总额	9,906,300,487.03
买卖股票差价收入	240,251,150.97

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31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	21,781,144.47
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	21,781,144.47

7.4.7.14.2 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27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,376,376,277.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,233,448,837.55
减：应收利息总额	121,146,295.01

买卖债券差价收入	21,781,144.47
----------	---------------

7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	100,055,272.33
减：卖出资产支持证券成本总额	100,000,000.00
减：应收利息总额	55,272.33
资产支持证券投资收益	-

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股指期货投资收益	13,745,580.58
国债期货投资收益	-3,850,485.43

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	34,818,937.17
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	34,818,937.17

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	65,313,246.77
——股票投资	54,131,620.43
——债券投资	10,993,326.61
——资产支持证券投资	188,299.73
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	327,022.00
——权证投资	-
——股指期货投资	565,472.00
——国债期货投资	-238,450.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	65,640,268.77

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	3,927,193.68
基金转换费收入	68,036.20
合计	3,995,229.88

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	27,819,710.57
银行间市场交易费用	103,675.00

期货交易费用	195,521.96
合计	28,118,907.53

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	74,000.00
信息披露费	110,000.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	63,863.40
账户维护费	27,000.00
其他	1,000.00
合计	275,863.40

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人全资子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人全资子公司（瑞元资本管理有限公司）的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理（英国）有限公司)	基金管理人全资子公司（GF International Investment Management Limited）的全资子公司
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司

注：根据广发基金管理有限公司于 2021 年 11 月 4 日签订的股权转让协议，广发基金管理有限公司收购子公司瑞元资本管理有限公司 46.61% 的股权，并于 2021 年 12 月 7 日完成变更登记。广发基金管理有限公司完成收购后，瑞元资本管理有限公司成为广发基金管理有限公司的全资子公司。珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）于 2021 年 12 月 21 日向横琴粤澳深度合作区商事服务局申请注销登记，并于 2022 年 1 月 26 日完成注销登记。根据 UK Companies House 于 2021 年 11 月 29 日出具的 Notice of final account prior to dissolution in MVL (停业报告)，GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理（英国）有限公司) 已于 2021 年 11 月 29 日停业。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	70,288,447.50
其中：支付销售机构的客户维护费	34,340,226.89

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,714,741.27

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期		
	2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C	合计
中国民生银行股份有限公司	-	424,185.70	424,185.70
广发基金管理有限公司	-	10,656.67	10,656.67

广发证券股份有限公司	-	1,113.20	1,113.20
合计	-	435,955.57	435,955.57

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

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银 行股份有限 公司	130,031,821.91	-	1,618,514,000.00	171,560.76	-	-

7.4.10.4 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

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发均衡增长混合 A

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发均衡增长混合 C

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	75,022,562.59	1,173,588.60

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
688176	亚虹医药-U	2021-12-29	2022-01-07	新股流通受限	22.98	22.98	37,990.00	873,010.20	873,010.20	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股流通受限	41.98	41.98	7,129.00	299,275.42	299,275.42	-
688800	瑞可达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	15.02	133.53	1,967.00	29,544.34	262,653.51	-
688049	炬芯科技-U	2021-11-22	2022-05-30	新股流通受限	42.98	51.71	3,260.00	140,114.80	168,574.60	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	792.00	92,568.96	91,935.36	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	新股流通受限	93.09	75.34	848.00	78,940.32	63,888.32	-
688272	富吉瑞	2021-10-08	2022-04-18	新股流通受限	22.56	39.09	1,263.00	28,493.28	49,370.67	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644.00	14,193.76	36,244.32	20210923 除权除息,派息比例 0.5400 (含税)
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	967.00	24,948.60	32,539.55	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股流通受限	12.03	17.12	1,685.00	20,270.55	28,847.20	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	新股流通受限	21.99	71.36	351.00	7,718.49	25,047.36	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	新股流通受限	69.89	88.72	280.00	19,569.20	24,841.60	-
301118	奥尼	2021-1	2022-0	新股	66.18	56.62	435.00	28,788	24,629	-

9	电子	2-21	6-28	流通受限				.30	.70	
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	539.00	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	79.60	78.53	272.00	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	409.00	23,754.72	20,388.65	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	26.06	782.00	6,482.78	20,378.92	20210927 除权除息,派息比例 0.1500 (含税)
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股流通受限	10.07	16.76	1,214.00	12,224.98	20,346.64	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股流通受限	15.48	21.53	915.00	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420.00	4,998.00	19,089.00	20211018 除权除息,派息比例 0.3600 (含税)
301110	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	新股流通受限	27.81	31.14	599.00	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股流通受限	4.17	30.94	587.00	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	704.00	23,344.64	17,367.68	-
301116	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	329.00	12,857.32	17,150.77	-

301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股流通受限	36.50	31.31	524.00	19,126.00	16,406.44	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	575.00	16,013.75	15,789.50	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股流通受限	57.27	53.71	280.00	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295.00	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220.00	4,204.20	14,944.60	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	402.00	11,770.56	12,864.00	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	285.00	7,458.45	12,785.10	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	36.31	35.52	323.00	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.96	843.00	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733.00	3,892.23	9,895.50	20210930 除权除息,派息比例 0.1600 (含税)
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股流通受限	5.77	12.14	756.00	4,362.12	9,177.84	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	297.00	9,126.81	8,654.58	-
30106	万事	2021-0	2022-0	新股	5.24	22.84	344.00	1,802.	7,856.	-

6	利	9-13	3-22	流通受限				56	96	
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328.00	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.78	355.00	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	286.00	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262.00	5,701.12	7,650.40	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股流通受限	12.36	22.17	307.00	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196.00	3,790.64	6,452.32	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股流通受限	3.93	11.09	572.00	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股流通受限	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股流通受限	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	153.00	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	-

301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144.00	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.78	155.00	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	-
7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	新债流通受限	100.00	100.00	33,810.00	3,380,957.25	3,380,957.25	-
127052	西子转债	2021-12-24	2022-01-24	新债流通受限	100.00	100.00	1,514.00	151,400.00	151,400.00	-
113052	兴业转债	2021-12-28	2022-01-14	新债流通受限	100.00	100.00	1,350.00	134,998.29	134,998.29	-
123133	佩蒂转债	2021-12-22	2022-01-21	新债流通受限	100.00	100.00	1,125.00	112,500.00	112,500.00	-
12313	泰林	2021-1	2022-0	新债	100.00	100.00	921.00	92,100	92,100	-

5	转债	2-28	1-19	流通受限				.00	.00	
113637	华翔转债	2021-12-23	2022-01-20	新债流通受限	100.00	100.00	800.00	80,000.00	80,000.00	-
113634	珀莱转债	2021-12-09	2022-01-04	新债流通受限	100.00	100.00	40.00	4,000.00	4,000.00	-

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.2 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002683	广东宏大	2021-12-20	重大事项停牌	30.12	2022-01-04	31.00	4,200.00	123,899.00	126,504.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	120,250,000.00
合计	120,250,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	180,143,000.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	180,143,000.00

注：1、资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

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

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日
AAA	789,874,978.30
AAA 以下	285,664,591.13
未评级	230,460,000.00
合计	1,305,999,569.43

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日
AAA	50,040,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	50,040,000.00

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	75,022,562.59	-	-	-	75,022,562.59
结算备付金	93,592,299.88	-	-	-	93,592,299.88
存出保证金	8,106,751.51	-	-	-	8,106,751.51
交易性金融资产	701,745,569.43	819,792,000.00	134,895,000.00	1,467,959,651.39	3,124,392,220.82
买入返售金融资产	440,030,650.05	-	-	-	440,030,650.05
应收证券清算款	-	-	-	19,780,851.68	19,780,851.68
应收利息	-	-	-	22,782,049.62	22,782,049.62
应收申购款	-	-	-	58,701.55	58,701.55
资产总计	1,318,497,833.46	819,792,000.00	134,895,000.00	1,510,581,254.24	3,783,766,087.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,581,539.18	22,581,539.18
应付管理人报酬	-	-	-	4,003,116.14	4,003,116.14
应付托管费	-	-	-	667,186.01	667,186.01
应付销售服务费	-	-	-	29,399.15	29,399.15
应付交易费用	-	-	-	2,987,644.72	2,987,644.72
应交税费	-	-	-	261,288.42	261,288.42
其他负债	-	-	-	193,000.98	193,000.98
负债总计	-	-	-	30,723,174.60	30,723,174.60
利率敏感度缺口	1,318,497,833.46	819,792,000.00	134,895,000.00	1,479,858,079.64	3,753,042,913.10

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 12 月 31 日

	市场利率上升 25 个基点	-7,312,520.66
	市场利率下降 25 个基点	7,370,716.04

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,467,959,651.39	39.11
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	110,278,569.43	2.94
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,578,238,220.82	42.05

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	上升 5%	75,449,774.84
	下降 5%	-75,449,774.84

7.4.14 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 12 月 31 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 1,569,534,017.03 元，属于第二层次的余额为人民币 1,554,858,203.79 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,467,959,651.39	38.80
	其中：普通股	1,467,959,651.39	38.80

	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,656,432,569.43	43.78
	其中：债券	1,426,249,569.43	37.69
	资产支持证券	230,183,000.00	6.08
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	440,030,650.05	11.63
	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	168,614,862.47	4.46
8	其他各项资产	50,728,354.36	1.34
9	合计	3,783,766,087.70	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	9,015,395.16	0.24
B	采矿业	49,300,852.36	1.31
C	制造业	970,797,216.22	25.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,652,973.74	0.84
E	建筑业	11,424,077.99	0.30
F	批发和零售业	31,201,906.52	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	35,794,516.37	0.95
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,681,113.53	2.52
J	金融业	109,665,023.14	2.92
K	房地产业	30,677,163.37	0.82
L	租赁和商务服务业	28,069,180.74	0.75
M	科学研究和技术服务业	23,449,169.18	0.62

N	水利、环境和公共设施管理业	11,921,644.58	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,518,759.00	0.04
Q	卫生和社会工作	7,645,871.70	0.20
R	文化、体育和娱乐业	19,909,615.79	0.53
S	综合	1,230,564.00	0.03
	合计	1,467,959,651.39	39.11

8.2.2 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。

8.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	245,540	18,123,307.40	0.48
2	600519	贵州茅台	7,001	14,352,050.00	0.38
3	300059	东方财富	367,156	13,625,159.16	0.36
4	000887	中鼎股份	494,500	10,785,045.00	0.29
5	600030	中信证券	335,976	8,873,126.16	0.24
6	300750	宁德时代	14,905	8,764,140.00	0.23
7	600690	海尔智家	285,720	8,540,170.80	0.23
8	300327	中颖电子	123,517	8,386,804.30	0.22
9	601318	中国平安	165,000	8,317,650.00	0.22
10	000725	京东方 A	1,583,300	7,995,665.00	0.21
11	000039	中集集团	457,790	7,855,676.40	0.21
12	600019	宝钢股份	1,059,101	7,583,163.16	0.20
13	300037	新宙邦	63,143	7,135,159.00	0.19
14	601688	华泰证券	383,800	6,816,288.00	0.18
15	000651	格力电器	183,600	6,798,708.00	0.18
16	600057	厦门象屿	786,896	6,680,747.04	0.18
17	002396	星网锐捷	283,000	6,670,310.00	0.18
18	603008	喜临门	166,100	6,482,883.00	0.17
19	000858	五粮液	28,970	6,450,460.20	0.17
20	600183	生益科技	268,600	6,325,530.00	0.17
21	002271	东方雨虹	116,200	6,121,416.00	0.16
22	000933	神火股份	673,400	6,121,206.00	0.16

23	300347	泰格医药	47,400	6,057,720.00	0.16
24	600887	伊利股份	146,000	6,053,160.00	0.16
25	601233	桐昆股份	279,200	5,913,456.00	0.16
26	600803	新奥股份	319,940	5,874,098.40	0.16
27	601012	隆基股份	68,020	5,863,324.00	0.16
28	600873	梅花生物	759,400	5,824,598.00	0.16
29	000568	泸州老窖	22,701	5,763,102.87	0.15
30	002129	中环股份	137,423	5,737,410.25	0.15
31	600438	通威股份	121,900	5,480,624.00	0.15
32	300755	华致酒行	105,080	5,262,406.40	0.14
33	300458	全志科技	81,990	5,188,327.20	0.14
34	002430	杭氧股份	170,962	5,130,569.62	0.14
35	002597	金禾实业	99,400	5,104,190.00	0.14
36	600585	海螺水泥	125,600	5,061,680.00	0.13
37	600256	广汇能源	770,800	5,041,032.00	0.13
38	000516	ST 国医	454,300	5,010,929.00	0.13
39	002245	蔚蓝锂芯	181,300	4,987,563.00	0.13
40	300260	新莱应材	104,400	4,924,548.00	0.13
41	601019	山东出版	789,142	4,853,223.30	0.13
42	600309	万华化学	48,000	4,848,000.00	0.13
43	600809	山西汾酒	15,144	4,782,172.32	0.13
44	600089	特变电工	223,300	4,727,261.00	0.13
45	300613	富瀚微	28,400	4,630,620.00	0.12
46	603659	璞泰来	28,488	4,575,457.68	0.12
47	300358	楚天科技	175,200	4,567,464.00	0.12
48	600756	浪潮软件	347,800	4,559,658.00	0.12
49	002314	南山控股	1,454,290	4,537,384.80	0.12
50	300206	理邦仪器	322,200	4,536,576.00	0.12
51	300168	万达信息	341,208	4,442,528.16	0.12
52	300662	科锐国际	70,700	4,398,247.00	0.12
53	603660	苏州科达	635,222	4,376,679.58	0.12
54	603198	迎驾贡酒	62,200	4,319,790.00	0.12
55	600566	济川药业	152,200	4,313,348.00	0.11
56	300604	长川科技	74,000	4,255,000.00	0.11
57	000060	中金岭南	862,779	4,236,244.89	0.11
58	600036	招商银行	86,518	4,214,291.78	0.11
59	300122	智飞生物	33,778	4,208,738.80	0.11
60	002254	泰和新材	214,500	4,206,345.00	0.11
61	601598	中国外运	935,900	4,192,832.00	0.11
62	300171	东富龙	82,600	4,174,604.00	0.11
63	002635	安洁科技	244,800	4,168,944.00	0.11
64	600010	包钢股份	1,487,800	4,150,962.00	0.11
65	600765	中航重机	82,200	4,150,278.00	0.11
66	300450	先导智能	55,660	4,139,434.20	0.11

67	000063	中兴通讯	122,600	4,107,100.00	0.11
68	601985	中国核电	494,700	4,106,010.00	0.11
69	002286	保龄宝	301,800	4,080,336.00	0.11
70	603995	甬金股份	69,700	4,032,842.00	0.11
71	300639	凯普生物	136,306	4,022,390.06	0.11
72	601009	南京银行	446,860	4,003,865.60	0.11
73	603259	药明康德	33,293	3,947,883.94	0.11
74	002918	蒙娜丽莎	137,845	3,946,502.35	0.11
75	300685	艾德生物	51,999	3,926,444.49	0.10
76	000856	冀东装备	503,760	3,899,102.40	0.10
77	601636	旗滨集团	225,970	3,864,087.00	0.10
78	600426	华鲁恒升	123,143	3,854,375.90	0.10
79	603486	科沃斯	25,400	3,834,130.00	0.10
80	600549	厦门钨业	169,100	3,826,733.00	0.10
81	600958	东方证券	257,700	3,798,498.00	0.10
82	000563	陕国投 A	1,166,500	3,767,795.00	0.10
83	002756	永兴材料	25,400	3,759,708.00	0.10
84	000683	远兴能源	506,100	3,694,530.00	0.10
85	600018	上港集团	673,000	3,688,040.00	0.10
86	300316	晶盛机电	53,028	3,685,446.00	0.10
87	300363	博腾股份	41,200	3,685,340.00	0.10
88	600389	江山股份	89,500	3,680,240.00	0.10
89	600884	杉杉股份	112,130	3,674,500.10	0.10
90	601088	中国神华	162,800	3,666,256.00	0.10
91	002850	科达利	22,712	3,641,642.08	0.10
92	002043	兔宝宝	301,100	3,637,288.00	0.10
93	002106	莱宝高科	315,303	3,629,137.53	0.10
94	601919	中远海控	194,100	3,627,729.00	0.10
95	002555	三七互娱	134,000	3,620,680.00	0.10
96	300766	每日互动	229,300	3,583,959.00	0.10
97	002657	中科金财	283,802	3,578,743.22	0.10
98	600837	海通证券	291,200	3,570,112.00	0.10
99	300633	开立医疗	110,869	3,540,047.17	0.09
100	000830	鲁西化工	230,700	3,520,482.00	0.09
101	601899	紫金矿业	358,500	3,477,450.00	0.09
102	600487	亨通光电	228,100	3,448,872.00	0.09
103	601857	中国石油	694,900	3,411,959.00	0.09
104	000657	中钨高新	211,900	3,407,352.00	0.09
105	002487	大金重工	87,300	3,382,875.00	0.09
106	002648	卫星化学	84,100	3,366,523.00	0.09
107	002206	海利得	378,600	3,361,968.00	0.09
108	600660	福耀玻璃	71,100	3,351,654.00	0.09
109	601888	中国中免	15,200	3,335,032.00	0.09
110	600141	兴发集团	86,800	3,287,984.00	0.09

111	002449	国星光电	301,900	3,254,482.00	0.09
112	601658	邮储银行	637,600	3,251,760.00	0.09
113	601128	常熟银行	488,000	3,225,680.00	0.09
114	600176	中国巨石	176,724	3,216,376.80	0.09
115	002475	立讯精密	64,600	3,178,320.00	0.08
116	002497	雅化集团	110,600	3,169,796.00	0.08
117	000786	北新建材	87,500	3,135,125.00	0.08
118	002466	天齐锂业	29,300	3,135,100.00	0.08
119	601699	潞安环能	276,406	3,126,151.86	0.08
120	002534	西子洁能	98,000	3,105,620.00	0.08
121	002653	海思科	151,600	3,092,640.00	0.08
122	002262	恩华药业	197,187	3,085,976.55	0.08
123	600195	中牧股份	235,162	3,073,567.34	0.08
124	300138	晨光生物	183,100	3,057,770.00	0.08
125	600219	南山铝业	646,200	3,043,602.00	0.08
126	300271	华宇软件	236,600	3,004,820.00	0.08
127	300623	捷捷微电	95,300	2,998,138.00	0.08
128	600329	中新药业	95,059	2,985,803.19	0.08
129	600008	首创环保	875,300	2,984,773.00	0.08
130	601615	明阳智能	114,000	2,975,400.00	0.08
131	000733	振华科技	23,918	2,972,529.04	0.08
132	603039	泛微网络	42,600	2,972,202.00	0.08
133	605222	起帆电缆	113,500	2,949,865.00	0.08
134	600602	云赛智联	448,800	2,917,200.00	0.08
135	603801	志邦家居	95,708	2,911,437.36	0.08
136	688019	安集科技	10,600	2,895,920.00	0.08
137	002636	金安国纪	191,200	2,877,560.00	0.08
138	002801	微光股份	139,800	2,865,900.00	0.08
139	002048	宁波华翔	132,400	2,863,812.00	0.08
140	002326	永太科技	55,600	2,847,276.00	0.08
141	600664	哈药股份	801,400	2,844,970.00	0.08
142	601339	百隆东方	483,000	2,844,870.00	0.08
143	300098	高新兴	540,000	2,835,000.00	0.08
144	300073	当升科技	32,428	2,817,020.36	0.08
145	000999	华润三九	82,200	2,814,528.00	0.07
146	600536	中国软件	56,000	2,796,080.00	0.07
147	603799	华友钴业	25,000	2,757,750.00	0.07
148	000001	平安银行	166,800	2,748,864.00	0.07
149	300672	国科微	14,800	2,745,400.00	0.07
150	603337	杰克股份	116,268	2,726,484.60	0.07
151	000561	烽火电子	323,700	2,715,843.00	0.07
152	600325	华发股份	450,800	2,713,816.00	0.07
153	300636	同和药业	102,560	2,703,481.60	0.07
154	300601	康泰生物	27,400	2,699,996.00	0.07

155	300390	天华超净	33,300	2,697,300.00	0.07
156	300725	药石科技	18,930	2,691,278.10	0.07
157	600635	大众公用	707,250	2,680,477.50	0.07
158	002308	威创股份	574,800	2,649,828.00	0.07
159	002436	兴森科技	188,300	2,636,200.00	0.07
160	600150	中国船舶	105,700	2,620,303.00	0.07
161	603616	韩建河山	432,500	2,616,625.00	0.07
162	000155	川能动力	97,300	2,581,369.00	0.07
163	600874	创业环保	361,276	2,554,221.32	0.07
164	600600	青岛啤酒	25,700	2,544,300.00	0.07
165	300596	利安隆	56,700	2,537,892.00	0.07
166	000519	中兵红箭	94,900	2,530,983.00	0.07
167	600970	中材国际	219,700	2,511,171.00	0.07
168	002156	通富微电	129,200	2,510,356.00	0.07
169	600155	华创阳安	250,600	2,495,976.00	0.07
170	002352	顺丰控股	36,100	2,488,012.00	0.07
171	000732	泰禾集团	1,123,300	2,482,493.00	0.07
172	300130	新国都	168,944	2,480,097.92	0.07
173	600552	凯盛科技	211,600	2,479,952.00	0.07
174	002460	赣锋锂业	17,300	2,471,305.00	0.07
175	300395	菲利华	37,500	2,465,250.00	0.07
176	002371	北方华创	7,100	2,463,842.00	0.07
177	002458	益生股份	217,700	2,462,187.00	0.07
178	002185	华天科技	193,700	2,461,927.00	0.07
179	300398	飞凯材料	101,898	2,461,855.68	0.07
180	002600	领益智造	334,000	2,458,240.00	0.07
181	600596	新安股份	98,200	2,454,018.00	0.07
182	603728	鸣志电器	103,296	2,449,148.16	0.07
183	002240	盛新锂能	42,100	2,439,695.00	0.07
184	603128	华贸物流	177,466	2,427,734.88	0.06
185	600415	小商品城	500,100	2,425,485.00	0.06
186	601225	陕西煤业	198,700	2,424,140.00	0.06
187	000988	华工科技	86,500	2,409,890.00	0.06
188	601877	正泰电器	44,700	2,408,883.00	0.06
189	600808	马钢股份	649,500	2,396,655.00	0.06
190	002268	卫士通	42,500	2,377,450.00	0.06
191	002939	长城证券	183,500	2,376,325.00	0.06
192	000682	东方电子	280,000	2,371,600.00	0.06
193	300404	博济医药	169,438	2,343,327.54	0.06
194	002881	美格智能	54,400	2,332,672.00	0.06
195	002541	鸿路钢构	43,221	2,314,052.34	0.06
196	600399	抚顺特钢	93,400	2,313,518.00	0.06
197	601600	中国铝业	378,500	2,305,065.00	0.06
198	000156	华数传媒	270,628	2,289,512.88	0.06

199	300813	泰林生物	22,800	2,280,000.00	0.06
200	002594	比亚迪	8,500	2,279,020.00	0.06
201	601958	金钼股份	331,000	2,267,350.00	0.06
202	600201	生物股份	138,660	2,267,091.00	0.06
203	600577	精达股份	304,600	2,266,224.00	0.06
204	300207	欣旺达	53,700	2,263,992.00	0.06
205	002183	怡亚通	340,900	2,256,758.00	0.06
206	600206	有研新材	137,700	2,255,526.00	0.06
207	600282	南钢股份	602,600	2,229,620.00	0.06
208	002738	中矿资源	31,600	2,223,376.00	0.06
209	300274	阳光电源	15,249	2,223,304.20	0.06
210	300705	九典制药	63,000	2,213,820.00	0.06
211	600643	爱建集团	326,600	2,207,816.00	0.06
212	601098	中南传媒	230,306	2,204,028.42	0.06
213	002415	海康威视	41,900	2,192,208.00	0.06
214	603323	苏农银行	447,400	2,178,838.00	0.06
215	002859	洁美科技	57,200	2,127,840.00	0.06
216	300299	富春股份	321,700	2,126,437.00	0.06
217	000100	TCL 科技	342,600	2,113,842.00	0.06
218	300294	博雅生物	54,800	2,101,580.00	0.06
219	600926	杭州银行	163,734	2,099,069.88	0.06
220	002407	多氟多	46,300	2,083,037.00	0.06
221	002465	海格通信	189,800	2,072,616.00	0.06
222	601126	四方股份	98,800	2,064,920.00	0.06
223	603588	高能环境	117,472	2,063,983.04	0.05
224	688202	美迪西	4,226	2,052,103.34	0.05
225	300568	星源材质	55,800	2,049,534.00	0.05
226	600111	北方稀土	44,700	2,047,260.00	0.05
227	601801	皖新传媒	393,700	2,043,303.00	0.05
228	603773	沃格光电	99,293	2,037,492.36	0.05
229	600348	华阳股份	170,300	2,018,055.00	0.05
230	600276	恒瑞医药	39,690	2,012,679.90	0.05
231	002066	瑞泰科技	181,500	2,011,020.00	0.05
232	002493	荣盛石化	110,700	2,010,312.00	0.05
233	300683	海特生物	33,700	2,007,172.00	0.05
234	300373	扬杰科技	29,874	2,006,935.32	0.05
235	002906	华阳集团	36,400	2,000,544.00	0.05
236	601058	赛轮轮胎	134,900	1,995,171.00	0.05
237	600755	厦门国贸	275,800	1,988,518.00	0.05
238	603818	曲美家居	139,700	1,982,343.00	0.05
239	000983	山西焦煤	239,300	1,979,011.00	0.05
240	601666	平煤股份	236,400	1,978,668.00	0.05
241	300661	圣邦股份	6,400	1,977,600.00	0.05
242	002791	坚朗五金	10,800	1,961,172.00	0.05

243	300525	博思软件	83,362	1,949,003.56	0.05
244	603933	睿能科技	127,600	1,936,968.00	0.05
245	000598	兴蓉环境	303,700	1,919,384.00	0.05
246	300291	华录百纳	279,100	1,911,835.00	0.05
247	002191	劲嘉股份	126,000	1,906,380.00	0.05
248	000591	太阳能	169,800	1,901,760.00	0.05
249	002332	仙琚制药	143,829	1,898,542.80	0.05
250	600797	浙大网新	277,850	1,889,380.00	0.05
251	300223	北京君正	14,033	1,880,422.00	0.05
252	002092	中泰化学	196,900	1,878,426.00	0.05
253	000930	中粮科技	172,800	1,878,336.00	0.05
254	000739	普洛药业	53,375	1,872,928.75	0.05
255	002709	天赐材料	16,270	1,865,355.50	0.05
256	002961	瑞达期货	75,166	1,852,090.24	0.05
257	601099	太平洋	563,500	1,848,280.00	0.05
258	000823	超声电子	135,200	1,841,424.00	0.05
259	300775	三角防务	37,100	1,813,819.00	0.05
260	000035	中国天楹	299,000	1,796,990.00	0.05
261	002027	分众传媒	218,400	1,788,696.00	0.05
262	603602	纵横通信	173,400	1,782,552.00	0.05
263	300470	中密控股	39,900	1,782,333.00	0.05
264	600323	瀚蓝环境	84,600	1,774,908.00	0.05
265	000973	佛塑科技	343,600	1,769,540.00	0.05
266	000756	新华制药	157,970	1,767,684.30	0.05
267	603666	亿嘉和	23,400	1,757,808.00	0.05
268	600885	宏发股份	23,500	1,754,040.00	0.05
269	002135	东南网架	151,000	1,745,560.00	0.05
270	600459	贵研铂业	68,520	1,743,834.00	0.05
271	000818	航锦科技	46,400	1,721,904.00	0.05
272	603599	广信股份	44,100	1,719,900.00	0.05
273	600009	上海机场	36,800	1,718,192.00	0.05
274	002376	新北洋	181,283	1,709,498.69	0.05
275	000062	深圳华强	99,100	1,707,493.00	0.05
276	300224	正海磁材	99,900	1,706,292.00	0.05
277	000807	云铝股份	152,700	1,705,659.00	0.05
278	002304	洋河股份	10,300	1,696,719.00	0.05
279	300593	新雷能	31,180	1,695,568.40	0.05
280	600823	世茂股份	516,800	1,695,104.00	0.05
281	002202	金风科技	102,700	1,691,469.00	0.05
282	300696	爱乐达	32,400	1,682,856.00	0.04
283	603677	奇精机械	132,300	1,674,918.00	0.04
284	600782	新钢股份	316,900	1,673,232.00	0.04
285	000917	电广传媒	246,600	1,667,016.00	0.04
286	603833	欧派家居	11,300	1,666,750.00	0.04

287	002050	三花智控	65,323	1,652,671.90	0.04
288	603690	至纯科技	34,200	1,646,730.00	0.04
289	002777	久远银海	58,940	1,629,691.00	0.04
290	002258	利尔化学	48,300	1,629,159.00	0.04
291	002812	恩捷股份	6,500	1,627,600.00	0.04
292	603515	欧普照明	78,200	1,623,432.00	0.04
293	002651	利君股份	122,600	1,621,998.00	0.04
294	603093	南华期货	119,000	1,616,020.00	0.04
295	300582	英飞特	74,700	1,615,761.00	0.04
296	000960	锡业股份	82,700	1,615,131.00	0.04
297	002032	苏泊尔	25,900	1,612,016.00	0.04
298	300855	图南股份	22,800	1,607,172.00	0.04
299	002025	航天电器	19,100	1,603,445.00	0.04
300	300693	盛弘股份	43,700	1,603,353.00	0.04
301	000686	东北证券	182,300	1,600,594.00	0.04
302	300034	钢研高纳	27,700	1,595,520.00	0.04
303	002537	海联金汇	224,203	1,591,841.30	0.04
304	603267	鸿远电子	8,850	1,588,044.00	0.04
305	000415	渤海租赁	544,900	1,585,659.00	0.04
306	603501	韦尔股份	5,095	1,583,373.15	0.04
307	002384	东山精密	58,400	1,582,640.00	0.04
308	603877	太平鸟	56,754	1,582,301.52	0.04
309	603027	千禾味业	65,700	1,582,056.00	0.04
310	601928	凤凰传媒	195,500	1,581,595.00	0.04
311	002948	青岛银行	340,500	1,576,515.00	0.04
312	002222	福晶科技	82,750	1,566,457.50	0.04
313	002601	龙佰集团	54,661	1,562,757.99	0.04
314	600366	宁波韵升	117,300	1,549,533.00	0.04
315	300504	天邑股份	80,100	1,549,134.00	0.04
316	600115	中国东航	300,100	1,548,516.00	0.04
317	300244	迪安诊断	45,900	1,540,863.00	0.04
318	300014	亿纬锂能	13,000	1,536,340.00	0.04
319	002158	汉钟精机	57,403	1,528,641.89	0.04
320	000910	大亚圣象	113,300	1,519,353.00	0.04
321	600455	博通股份	66,700	1,518,759.00	0.04
322	000831	五矿稀土	38,600	1,506,172.00	0.04
323	300573	兴齐眼药	11,000	1,504,800.00	0.04
324	601601	中国太保	55,255	1,498,515.60	0.04
325	601311	骆驼股份	97,700	1,497,741.00	0.04
326	002410	广联达	23,293	1,490,286.14	0.04
327	002204	大连重工	342,100	1,488,135.00	0.04
328	300182	捷成股份	234,503	1,484,403.99	0.04
329	601628	中国人寿	48,900	1,471,401.00	0.04
330	002064	华峰化学	140,834	1,470,306.96	0.04

331	601398	工商银行	317,200	1,468,636.00	0.04
332	603585	苏利股份	76,384	1,465,045.12	0.04
333	000905	厦门港务	193,266	1,453,360.32	0.04
334	002379	宏创控股	453,300	1,446,027.00	0.04
335	605088	冠盛股份	99,300	1,442,829.00	0.04
336	002340	格林美	138,500	1,433,475.00	0.04
337	300081	恒信东方	77,900	1,432,581.00	0.04
338	002649	博彦科技	122,400	1,429,632.00	0.04
339	000937	冀中能源	257,700	1,419,927.00	0.04
340	002293	罗莱生活	98,990	1,418,526.70	0.04
341	000851	高鸿股份	236,300	1,413,074.00	0.04
342	603927	中科软	51,600	1,411,776.00	0.04
343	600315	上海家化	34,800	1,406,268.00	0.04
344	601717	郑煤机	121,300	1,405,867.00	0.04
345	002727	一心堂	36,400	1,401,764.00	0.04
346	000990	诚志股份	88,600	1,401,652.00	0.04
347	002714	牧原股份	26,206	1,398,352.16	0.04
348	002069	獐子岛	424,300	1,395,947.00	0.04
349	600380	健康元	108,600	1,394,424.00	0.04
350	002759	天际股份	47,300	1,385,890.00	0.04
351	000011	深物业 A	117,900	1,374,714.00	0.04
352	601117	中国化学	114,100	1,369,200.00	0.04
353	600360	华微电子	149,500	1,357,460.00	0.04
354	603898	好莱客	110,700	1,357,182.00	0.04
355	605058	澳弘电子	53,300	1,357,018.00	0.04
356	002408	齐翔腾达	127,900	1,342,950.00	0.04
357	600007	中国国贸	93,100	1,340,640.00	0.04
358	002120	韵达股份	65,400	1,338,084.00	0.04
359	003013	地铁设计	66,177	1,328,834.16	0.04
360	000932	华菱钢铁	259,800	1,327,578.00	0.04
361	000042	中洲控股	164,500	1,325,870.00	0.04
362	600123	兰花科创	140,700	1,318,359.00	0.04
363	002041	登海种业	51,100	1,317,869.00	0.04
364	300737	科顺股份	80,900	1,314,625.00	0.04
365	300322	硕贝德	94,300	1,308,884.00	0.03
366	601101	昊华能源	176,100	1,303,140.00	0.03
367	688169	石头科技	1,600	1,300,800.00	0.03
368	603612	索通发展	63,331	1,299,552.12	0.03
369	002423	中粮资本	159,900	1,295,190.00	0.03
370	000822	山东海化	186,200	1,294,090.00	0.03
371	002539	云图控股	96,177	1,276,268.79	0.03
372	000762	西藏矿业	24,000	1,275,120.00	0.03
373	002345	潮宏基	230,714	1,271,234.14	0.03
374	002174	游族网络	83,400	1,271,016.00	0.03

375	603986	兆易创新	7,200	1,266,120.00	0.03
376	600063	皖维高新	206,400	1,265,232.00	0.03
377	603566	普莱柯	57,200	1,264,120.00	0.03
378	603300	华铁应急	93,900	1,262,955.00	0.03
379	601918	新集能源	277,800	1,261,212.00	0.03
380	002315	焦点科技	73,937	1,255,450.26	0.03
381	000918	嘉凯城	503,400	1,253,466.00	0.03
382	688122	西部超导	12,900	1,250,526.00	0.03
383	002818	富森美	99,370	1,243,118.70	0.03
384	688036	传音控股	7,900	1,239,510.00	0.03
385	000513	丽珠集团	30,400	1,222,384.00	0.03
386	002815	崇达技术	72,400	1,219,940.00	0.03
387	002110	三钢闽光	179,100	1,217,880.00	0.03
388	300566	激智科技	42,700	1,213,534.00	0.03
389	002978	安宁股份	28,700	1,213,436.00	0.03
390	000708	中信特钢	59,000	1,208,320.00	0.03
391	300124	汇川技术	17,598	1,207,222.80	0.03
392	600985	淮北矿业	107,800	1,205,204.00	0.03
393	300203	聚光科技	42,400	1,198,224.00	0.03
394	002706	良信股份	67,130	1,196,256.60	0.03
395	601827	三峰环境	133,400	1,189,928.00	0.03
396	603108	润达医疗	88,457	1,186,208.37	0.03
397	600760	中航沈飞	17,400	1,183,896.00	0.03
398	603095	越剑智能	46,940	1,180,071.60	0.03
399	002997	瑞鹄模具	67,100	1,178,276.00	0.03
400	603208	江山欧派	18,600	1,173,288.00	0.03
401	000825	太钢不锈	166,400	1,171,456.00	0.03
402	600705	中航产融	294,900	1,170,753.00	0.03
403	300833	浩洋股份	14,400	1,166,832.00	0.03
404	603127	昭衍新药	10,100	1,165,843.00	0.03
405	600376	首开股份	205,500	1,163,130.00	0.03
406	002736	国信证券	101,300	1,162,924.00	0.03
407	603301	振德医疗	22,600	1,160,962.00	0.03
408	002212	天融信	60,500	1,159,785.00	0.03
409	002402	和而泰	42,200	1,157,546.00	0.03
410	300745	欣锐科技	18,000	1,155,600.00	0.03
411	002091	江苏国泰	84,100	1,154,693.00	0.03
412	002955	鸿合科技	52,901	1,154,299.82	0.03
413	600738	丽尚国潮	189,200	1,150,336.00	0.03
414	300078	思创医惠	154,500	1,140,210.00	0.03
415	600740	山西焦化	182,400	1,132,704.00	0.03
416	002985	北摩高科	9,400	1,132,324.00	0.03
417	000088	盐田港	213,500	1,131,550.00	0.03
418	300118	东方日升	34,800	1,129,956.00	0.03

419	600285	羚锐制药	71,300	1,126,540.00	0.03
420	600372	中航电子	50,300	1,126,217.00	0.03
421	000666	经纬纺机	129,300	1,123,617.00	0.03
422	002960	青鸟消防	23,056	1,119,368.80	0.03
423	002425	凯撒文化	116,100	1,119,204.00	0.03
424	600048	保利发展	71,600	1,119,108.00	0.03
425	600875	东方电气	52,200	1,118,124.00	0.03
426	600820	隧道股份	207,100	1,114,198.00	0.03
427	603299	苏盐井神	116,012	1,109,074.72	0.03
428	688201	信安世纪	17,700	1,108,905.00	0.03
429	000902	新洋丰	65,600	1,107,984.00	0.03
430	000629	攀钢钒钛	284,800	1,107,872.00	0.03
431	603290	斯达半导	2,900	1,104,900.00	0.03
432	002028	思源电气	22,300	1,097,383.00	0.03
433	300408	三环集团	24,500	1,092,700.00	0.03
434	600177	雅戈尔	158,500	1,092,065.00	0.03
435	000560	我爱我家	347,785	1,092,044.90	0.03
436	601678	滨化股份	136,924	1,091,284.28	0.03
437	002573	清新环境	149,900	1,091,272.00	0.03
438	000425	徐工机械	182,000	1,090,180.00	0.03
439	603883	老百姓	22,000	1,086,360.00	0.03
440	601006	大秦铁路	169,400	1,084,160.00	0.03
441	600570	恒生电子	17,420	1,082,653.00	0.03
442	002610	爱康科技	228,000	1,071,600.00	0.03
443	002020	京新药业	112,118	1,066,242.18	0.03
444	601166	兴业银行	56,000	1,066,240.00	0.03
445	600267	海正药业	76,200	1,066,038.00	0.03
446	002302	西部建设	131,500	1,055,945.00	0.03
447	300703	创源股份	92,400	1,052,436.00	0.03
448	688039	当虹科技	13,600	1,044,752.00	0.03
449	600383	金地集团	80,500	1,044,085.00	0.03
450	000656	金科股份	231,183	1,035,699.84	0.03
451	600919	江苏银行	177,600	1,035,408.00	0.03
452	600428	中远海特	205,200	1,034,208.00	0.03
453	300760	迈瑞医疗	2,709	1,031,587.20	0.03
454	603987	康德莱	47,300	1,027,829.00	0.03
455	002130	沃尔核材	124,200	1,024,650.00	0.03
456	002142	宁波银行	26,690	1,021,693.20	0.03
457	601816	京沪高铁	211,400	1,021,062.00	0.03
458	002007	华兰生物	34,900	1,016,986.00	0.03
459	601588	北辰实业	407,200	1,009,856.00	0.03
460	000998	隆平高科	43,400	1,009,484.00	0.03
461	688363	华熙生物	6,500	1,009,450.00	0.03
462	000002	万科 A	50,900	1,005,784.00	0.03

463	600436	片仔癀	2,300	1,005,445.00	0.03
464	002145	中核钛白	79,600	1,002,164.00	0.03
465	600066	宇通客车	90,400	996,208.00	0.03
466	000875	吉电股份	109,000	990,810.00	0.03
467	002375	亚厦股份	132,100	989,429.00	0.03
468	300065	海兰信	64,650	986,559.00	0.03
469	300324	旋极信息	256,900	986,496.00	0.03
470	300263	隆华科技	96,400	983,280.00	0.03
471	601168	西部矿业	71,700	975,837.00	0.03
472	000544	中原环保	151,451	969,286.40	0.03
473	300047	天源迪科	122,900	965,994.00	0.03
474	600088	中视传媒	84,446	962,684.40	0.03
475	601966	玲珑轮胎	26,300	961,265.00	0.03
476	000498	山东路桥	155,500	960,990.00	0.03
477	600682	南京新百	81,500	958,440.00	0.03
478	603421	鼎信通讯	112,430	956,779.30	0.03
479	002372	伟星新材	39,325	956,384.00	0.03
480	002833	弘亚数控	29,700	955,746.00	0.03
481	002292	奥飞娱乐	150,279	951,266.07	0.03
482	300674	宇信科技	39,700	948,830.00	0.03
483	600742	一汽富维	79,000	944,840.00	0.03
484	002609	捷顺科技	96,554	941,401.50	0.03
485	600031	三一重工	41,200	939,360.00	0.03
486	300498	温氏股份	48,600	936,036.00	0.02
487	002182	云海金属	40,800	935,952.00	0.02
488	600516	方大炭素	86,400	934,848.00	0.02
489	300036	超图软件	31,100	934,555.00	0.02
490	300219	鸿利智汇	58,900	931,209.00	0.02
491	000810	创维数字	94,300	928,855.00	0.02
492	600422	昆药集团	83,700	924,885.00	0.02
493	002311	海大集团	12,611	924,386.30	0.02
494	300285	国瓷材料	21,600	919,512.00	0.02
495	300763	锦浪科技	3,929	909,759.95	0.02
496	002223	鱼跃医疗	23,800	899,640.00	0.02
497	603113	金能科技	55,000	896,500.00	0.02
498	600460	士兰微	16,500	894,300.00	0.02
499	600779	水井坊	7,453	894,285.47	0.02
500	600096	云天化	45,500	892,710.00	0.02
501	002230	科大讯飞	17,000	892,670.00	0.02
502	002192	融捷股份	6,800	885,020.00	0.02
503	688516	奥特维	3,600	884,592.00	0.02
504	300577	开润股份	38,598	882,350.28	0.02
505	002582	好想你	101,400	882,180.00	0.02
506	002979	雷赛智能	34,071	881,416.77	0.02

507	600557	康缘药业	71,900	880,056.00	0.02
508	688176	亚虹医药-U	37,990	873,010.20	0.02
509	002063	远光软件	87,600	870,744.00	0.02
510	000008	神州高铁	294,900	867,006.00	0.02
511	002941	新疆交建	71,300	862,017.00	0.02
512	600869	远东股份	125,100	860,688.00	0.02
513	002517	恺英网络	147,719	859,724.58	0.02
514	002416	爱施德	75,300	856,914.00	0.02
515	002320	海峡股份	141,875	851,250.00	0.02
516	600563	法拉电子	3,662	851,048.80	0.02
517	300102	乾照光电	94,600	850,454.00	0.02
518	603568	伟明环保	23,164	846,180.92	0.02
519	603385	惠达卫浴	76,100	844,710.00	0.02
520	300653	正海生物	12,607	841,769.39	0.02
521	601633	长城汽车	17,300	839,742.00	0.02
522	300114	中航电测	47,400	838,032.00	0.02
523	300465	高伟达	68,700	836,079.00	0.02
524	600479	千金药业	66,446	833,897.30	0.02
525	002139	拓邦股份	44,572	833,050.68	0.02
526	002049	紫光国微	3,700	832,500.00	0.02
527	002568	百润股份	13,900	831,637.00	0.02
528	002935	天奥电子	22,500	828,225.00	0.02
529	603018	华设集团	98,900	826,804.00	0.02
530	300015	爱尔眼科	19,389	819,766.92	0.02
531	300687	赛意信息	28,000	817,040.00	0.02
532	300298	三诺生物	27,300	816,543.00	0.02
533	300463	迈克生物	27,849	812,912.31	0.02
534	002353	杰瑞股份	20,300	812,000.00	0.02
535	300673	佩蒂股份	39,600	811,008.00	0.02
536	002074	国轩高科	15,800	809,750.00	0.02
537	002035	华帝股份	127,100	808,356.00	0.02
538	601333	广深铁路	360,200	806,848.00	0.02
539	000836	富通信息	285,000	806,550.00	0.02
540	001965	招商公路	104,931	804,820.77	0.02
541	601828	美凯龙	90,900	800,829.00	0.02
542	300821	东岳硅材	43,800	800,664.00	0.02
543	300266	兴源环境	204,900	799,110.00	0.02
544	002348	高乐股份	365,900	797,662.00	0.02
545	002236	大华股份	33,900	795,972.00	0.02
546	002698	博实股份	61,000	795,440.00	0.02
547	601211	国泰君安	44,400	794,316.00	0.02
548	002614	奥佳华	61,600	793,408.00	0.02
549	600398	海澜之家	123,500	791,635.00	0.02
550	002318	久立特材	44,200	790,296.00	0.02

551	603613	国联股份	7,350	790,125.00	0.02
552	300655	晶瑞电材	18,900	789,642.00	0.02
553	000555	神州信息	62,068	789,504.96	0.02
554	000778	新兴铸管	181,700	786,761.00	0.02
555	603727	博迈科	38,300	785,916.00	0.02
556	600981	汇鸿集团	222,300	784,719.00	0.02
557	600704	物产中大	132,100	782,032.00	0.02
558	600888	新疆众和	94,100	778,207.00	0.02
559	600718	东软集团	57,200	775,632.00	0.02
560	002643	万润股份	32,800	775,392.00	0.02
561	603192	汇得科技	14,100	773,526.00	0.02
562	002867	周大生	43,500	773,430.00	0.02
563	001914	招商积余	38,100	771,906.00	0.02
564	600029	南方航空	113,200	770,892.00	0.02
565	600863	内蒙华电	194,900	767,906.00	0.02
566	000829	天音控股	41,504	765,333.76	0.02
567	000913	钱江摩托	53,900	764,841.00	0.02
568	300101	振芯科技	34,382	762,592.76	0.02
569	002545	东方铁塔	83,600	762,432.00	0.02
570	300428	立中集团	28,900	760,070.00	0.02
571	600894	广日股份	100,800	760,032.00	0.02
572	002746	仙坛股份	72,400	759,476.00	0.02
573	300249	依米康	105,300	759,213.00	0.02
574	600502	安徽建工	182,800	758,620.00	0.02
575	603260	合盛硅业	5,700	752,229.00	0.02
576	603053	成都燃气	72,108	749,202.12	0.02
577	000950	重药控股	146,600	747,660.00	0.02
578	603165	荣晟环保	38,724	746,211.48	0.02
579	300012	华测检测	27,754	745,749.98	0.02
580	000712	锦龙股份	47,300	744,975.00	0.02
581	300770	新媒股份	12,400	744,000.00	0.02
582	000799	酒鬼酒	3,500	743,750.00	0.02
583	000811	冰轮环境	48,300	743,337.00	0.02
584	002322	理工能科	61,900	742,181.00	0.02
585	300921	南凌科技	34,400	741,320.00	0.02
586	603283	赛腾股份	25,125	738,675.00	0.02
587	600523	贵航股份	30,202	736,928.80	0.02
588	002498	汉缆股份	141,700	732,589.00	0.02
589	000031	大悦城	195,400	728,842.00	0.02
590	002036	联创电子	30,000	727,800.00	0.02
591	300379	东方通	24,500	723,485.00	0.02
592	002153	石基信息	25,160	723,098.40	0.02
593	002014	永新股份	84,050	721,149.00	0.02
594	002421	达实智能	186,300	719,118.00	0.02

595	000709	河钢股份	291,800	717,828.00	0.02
596	600022	山东钢铁	400,600	717,074.00	0.02
597	002662	京威股份	168,200	716,532.00	0.02
598	000012	南玻 A	72,000	714,960.00	0.02
599	600386	北巴传媒	158,800	708,248.00	0.02
600	300781	因赛集团	29,600	703,888.00	0.02
601	300146	汤臣倍健	26,000	700,960.00	0.02
602	002531	天顺风能	36,100	699,979.00	0.02
603	300791	仙乐健康	16,725	697,432.50	0.02
604	601858	中国科传	78,340	690,958.80	0.02
605	000863	三湘印象	195,700	690,821.00	0.02
606	603026	石大胜华	3,486	690,193.14	0.02
607	300454	深信服	3,600	687,600.00	0.02
608	000963	华东医药	17,000	683,400.00	0.02
609	603387	基蛋生物	34,000	682,040.00	0.02
610	000720	新能泰山	139,300	681,177.00	0.02
611	300891	惠云钛业	42,200	675,622.00	0.02
612	002075	沙钢股份	115,600	673,948.00	0.02
613	600838	上海九百	102,700	672,685.00	0.02
614	603279	景津装备	14,500	672,510.00	0.02
615	002155	湖南黄金	64,900	672,364.00	0.02
616	300835	龙磁科技	9,300	670,995.00	0.02
617	300474	景嘉微	4,400	669,680.00	0.02
618	603808	歌力思	45,800	668,222.00	0.02
619	002285	世联行	170,200	667,184.00	0.02
620	600805	悦达投资	151,100	666,351.00	0.02
621	300394	天孚通信	18,200	666,120.00	0.02
622	600406	国电南瑞	16,640	666,099.20	0.02
623	002365	永安药业	62,700	665,247.00	0.02
624	603915	国茂股份	17,100	665,190.00	0.02
625	002080	中材科技	19,500	663,390.00	0.02
626	600629	华建集团	100,464	663,062.40	0.02
627	002266	浙富控股	92,800	660,736.00	0.02
628	002010	传化智联	75,800	659,460.00	0.02
629	600909	华安证券	121,800	658,938.00	0.02
630	002238	天威视讯	104,392	657,669.60	0.02
631	300232	洲明科技	73,300	655,302.00	0.02
632	601456	国联证券	46,900	655,193.00	0.02
633	002128	电投能源	44,100	654,885.00	0.02
634	300307	慈星股份	82,700	650,849.00	0.02
635	603357	设计总院	70,500	650,010.00	0.02
636	002585	双星新材	23,900	647,212.00	0.02
637	002674	兴业科技	57,400	644,602.00	0.02
638	603656	泰禾智能	51,800	644,392.00	0.02

639	600352	浙江龙盛	50,900	642,867.00	0.02
640	000797	中国武夷	245,300	640,233.00	0.02
641	002779	中坚科技	37,600	639,200.00	0.02
642	300857	协创数据	22,000	637,120.00	0.02
643	601021	春秋航空	11,200	636,160.00	0.02
644	300226	上海钢联	15,642	635,847.30	0.02
645	300177	中海达	67,000	633,820.00	0.02
646	601111	中国国航	69,200	631,796.00	0.02
647	000792	盐湖股份	17,800	629,942.00	0.02
648	300413	芒果超媒	11,000	629,420.00	0.02
649	603803	瑞斯康达	79,300	628,056.00	0.02
650	603360	百傲化学	47,900	624,616.00	0.02
651	600777	新潮能源	273,200	622,896.00	0.02
652	600821	金开新能	65,400	620,646.00	0.02
653	601369	陕鼓动力	47,600	619,752.00	0.02
654	300852	四会富仕	10,600	619,252.00	0.02
655	603112	华翔股份	46,900	619,080.00	0.02
656	601901	方正证券	78,800	617,792.00	0.02
657	000785	居然之家	119,600	617,136.00	0.02
658	000034	神州数码	38,900	615,787.00	0.02
659	600425	青松建化	162,200	614,738.00	0.02
660	300793	佳禾智能	29,000	614,510.00	0.02
661	002672	东江环保	83,200	612,352.00	0.02
662	300369	绿盟科技	38,601	612,211.86	0.02
663	002003	伟星股份	47,569	609,834.58	0.02
664	300455	康拓红外	56,100	609,807.00	0.02
665	603993	洛阳钼业	109,200	609,336.00	0.02
666	002821	凯莱英	1,400	609,000.00	0.02
667	600278	东方创业	74,867	605,674.03	0.02
668	603129	春风动力	3,500	605,500.00	0.02
669	601965	中国汽研	32,500	604,825.00	0.02
670	603101	汇嘉时代	102,136	604,645.12	0.02
671	600679	上海凤凰	51,500	599,975.00	0.02
672	002986	宇新股份	16,600	597,268.00	0.02
673	600626	申达股份	149,900	596,602.00	0.02
674	603089	正裕工业	63,500	591,185.00	0.02
675	002988	豪美新材	28,600	589,446.00	0.02
676	600693	东百集团	145,700	588,628.00	0.02
677	603099	长白山	53,700	588,552.00	0.02
678	002125	湘潭电化	51,600	588,240.00	0.02
679	600153	建发股份	64,800	587,736.00	0.02
680	003018	金富科技	52,967	585,285.35	0.02
681	000650	仁和药业	62,400	581,568.00	0.02
682	600429	三元股份	96,600	580,566.00	0.02

683	601607	上海医药	29,000	576,230.00	0.02
684	002273	水晶光电	33,100	575,609.00	0.02
685	601866	中远海发	176,700	574,275.00	0.02
686	300432	富临精工	19,500	573,300.00	0.02
687	603587	地素时尚	29,900	572,884.00	0.02
688	000728	国元证券	74,300	572,110.00	0.02
689	300747	锐科激光	9,671	571,652.81	0.02
690	000630	铜陵有色	163,200	567,936.00	0.02
691	002612	朗姿股份	17,900	567,609.00	0.02
692	002880	卫光生物	17,570	565,402.60	0.02
693	300863	卡倍亿	6,300	564,921.00	0.02
694	300339	润和软件	24,800	564,696.00	0.02
695	000009	中国宝安	39,100	564,213.00	0.02
696	002479	富春环保	94,400	560,736.00	0.01
697	300723	一品红	15,600	560,040.00	0.01
698	300083	创世纪	39,200	559,776.00	0.01
699	600908	无锡银行	98,600	559,062.00	0.01
700	300829	金丹科技	12,200	557,540.00	0.01
701	600583	海油工程	120,800	556,888.00	0.01
702	601668	中国建筑	110,700	553,500.00	0.01
703	300609	汇纳科技	31,700	552,531.00	0.01
704	002602	世纪华通	65,800	552,062.00	0.01
705	002060	粤水电	99,200	550,560.00	0.01
706	000921	海信家电	36,300	549,945.00	0.01
707	600801	华新水泥	28,400	548,120.00	0.01
708	002970	锐明技术	13,300	547,428.00	0.01
709	603288	海天味业	5,200	546,572.00	0.01
710	000025	特力 A	36,400	544,544.00	0.01
711	688186	广大特材	12,149	541,966.89	0.01
712	601838	成都银行	45,000	540,000.00	0.01
713	000517	荣安地产	219,100	538,986.00	0.01
714	600210	紫江企业	58,700	538,866.00	0.01
715	000877	天山股份	35,000	535,850.00	0.01
716	600028	中国石化	126,200	533,826.00	0.01
717	300055	万邦达	40,900	532,518.00	0.01
718	300748	金力永磁	11,800	529,702.00	0.01
719	300557	理工光科	17,000	525,980.00	0.01
720	300346	南大光电	11,300	524,772.00	0.01
721	002117	东港股份	62,700	522,291.00	0.01
722	002167	东方锆业	65,400	516,660.00	0.01
723	603848	好太太	37,300	516,605.00	0.01
724	002847	盐津铺子	6,000	513,600.00	0.01
725	601999	出版传媒	73,200	512,400.00	0.01
726	300667	必创科技	22,400	511,392.00	0.01

727	300797	钢研纳克	29,100	510,414.00	0.01
728	600630	龙头股份	91,000	509,600.00	0.01
729	300441	鲍斯股份	45,100	509,179.00	0.01
730	300615	欣天科技	41,800	509,124.00	0.01
731	002572	索菲亚	22,900	508,380.00	0.01
732	002312	川发龙蟒	38,644	505,463.52	0.01
733	601108	财通证券	45,400	504,848.00	0.01
734	600999	招商证券	28,600	504,790.00	0.01
735	002745	木林森	33,200	502,316.00	0.01
736	601808	中海油服	33,400	501,000.00	0.01
737	600710	苏美达	76,200	498,348.00	0.01
738	300546	雄帝科技	27,900	497,736.00	0.01
739	002138	顺络电子	13,000	496,340.00	0.01
740	300087	荃银高科	16,300	495,520.00	0.01
741	000783	长江证券	65,600	494,624.00	0.01
742	600075	新疆天业	59,900	492,378.00	0.01
743	600881	亚泰集团	149,600	486,200.00	0.01
744	000898	鞍钢股份	129,600	486,000.00	0.01
744	002079	苏州固锝	36,000	486,000.00	0.01
745	600547	山东黄金	25,800	485,556.00	0.01
746	600362	江西铜业	21,700	484,561.00	0.01
747	002508	老板电器	13,400	482,668.00	0.01
748	002819	东方中科	14,500	482,270.00	0.01
749	002544	杰赛科技	20,300	481,922.00	0.01
750	688023	安恒信息	1,918	480,919.32	0.01
751	600586	金晶科技	51,800	479,668.00	0.01
752	600104	上汽集团	23,200	478,616.00	0.01
753	600233	圆通速递	28,600	477,048.00	0.01
754	000895	双汇发展	15,100	476,405.00	0.01
755	601992	金隅集团	167,000	474,280.00	0.01
756	300897	山科智能	13,800	469,338.00	0.01
757	002054	德美化工	49,800	469,116.00	0.01
758	603298	杭叉集团	27,297	468,143.55	0.01
759	600377	宁沪高速	54,200	467,204.00	0.01
760	002895	川恒股份	18,900	466,641.00	0.01
761	600839	四川长虹	140,600	465,386.00	0.01
762	600196	复星医药	9,500	464,930.00	0.01
763	603992	松霖科技	23,700	464,757.00	0.01
764	002617	露笑科技	30,500	463,600.00	0.01
765	300590	移为通信	16,040	462,754.00	0.01
766	600628	新世界	59,500	461,125.00	0.01
767	300826	测绘股份	22,300	459,826.00	0.01
768	600711	盛屯矿业	42,600	457,098.00	0.01
769	600307	酒钢宏兴	205,400	451,880.00	0.01

770	300861	美畅股份	5,800	451,066.00	0.01
771	000166	申万宏源	88,000	450,560.00	0.01
772	002034	旺能环境	26,049	449,866.23	0.01
773	000897	津滨发展	165,100	449,072.00	0.01
774	600900	长江电力	19,700	447,190.00	0.01
775	603289	泰瑞机器	46,200	446,754.00	0.01
776	002233	塔牌集团	42,200	446,476.00	0.01
777	002444	巨星科技	14,500	442,395.00	0.01
778	600737	中粮糖业	46,900	440,860.00	0.01
779	002757	南兴股份	28,700	437,675.00	0.01
780	688617	惠泰医疗	1,560	436,800.00	0.01
781	601618	中国中冶	112,100	429,343.00	0.01
782	603976	正川股份	12,500	426,500.00	0.01
783	000090	天健集团	72,600	426,162.00	0.01
784	603220	中贝通信	26,800	423,172.00	0.01
785	603948	建业股份	15,100	421,290.00	0.01
786	300783	三只松鼠	10,600	413,082.00	0.01
787	603979	金诚信	19,200	412,416.00	0.01
788	601799	星宇股份	2,000	408,500.00	0.01
789	600004	白云机场	33,600	405,216.00	0.01
790	600062	华润双鹤	30,300	405,111.00	0.01
791	002294	信立泰	14,800	404,336.00	0.01
792	600511	国药股份	12,800	403,584.00	0.01
793	002088	鲁阳节能	15,400	400,400.00	0.01
794	000883	湖北能源	76,100	398,764.00	0.01
795	688111	金山办公	1,500	397,500.00	0.01
796	603605	珀莱雅	1,903	396,413.93	0.01
797	002839	张家港行	68,300	393,408.00	0.01
798	600546	山煤国际	47,600	390,796.00	0.01
799	300787	海能实业	14,460	390,420.00	0.01
800	601028	玉龙股份	20,500	390,320.00	0.01
801	600497	驰宏锌锗	78,200	390,218.00	0.01
802	600116	三峡水利	33,400	389,444.00	0.01
803	001979	招商蛇口	29,000	386,860.00	0.01
804	002977	天箭科技	4,800	384,288.00	0.01
805	603610	麒盛科技	14,800	382,728.00	0.01
806	000636	风华高科	12,800	381,440.00	0.01
807	600392	盛和资源	19,200	376,704.00	0.01
808	600336	澳柯玛	52,700	376,278.00	0.01
809	601677	明泰铝业	8,500	374,765.00	0.01
810	000938	紫光股份	16,400	374,740.00	0.01
811	002967	广电计量	13,838	374,733.04	0.01
812	600060	海信视像	27,300	367,185.00	0.01
813	002624	完美世界	17,900	363,549.00	0.01

814	300768	迪普科技	8,800	363,000.00	0.01
815	600346	恒力石化	15,800	362,926.00	0.01
816	601066	中信建投	12,400	362,700.00	0.01
817	603156	养元饮品	12,700	360,807.00	0.01
818	601388	怡球资源	81,000	360,450.00	0.01
819	002163	海南发展	30,200	354,850.00	0.01
820	600778	友好集团	78,600	350,556.00	0.01
821	603408	建霖家居	24,631	349,760.20	0.01
822	605399	晨光新材	8,800	349,448.00	0.01
823	300406	九强生物	17,600	348,832.00	0.01
824	002131	利欧股份	141,800	348,828.00	0.01
825	002042	华孚时尚	76,100	347,777.00	0.01
826	000546	金圆股份	25,800	346,494.00	0.01
827	600675	中华企业	114,283	343,991.83	0.01
828	601288	农业银行	116,900	343,686.00	0.01
829	601872	招商轮船	83,200	341,120.00	0.01
830	300093	金刚玻璃	9,000	341,100.00	0.01
831	603589	口子窖	4,800	340,176.00	0.01
832	600989	宝丰能源	19,400	336,784.00	0.01
833	601880	辽港股份	194,000	335,620.00	0.01
834	000750	国海证券	81,600	335,376.00	0.01
835	000703	恒逸石化	31,500	334,530.00	0.01
836	600993	马应龙	11,600	333,616.00	0.01
837	600968	海油发展	113,400	332,262.00	0.01
838	601016	节能风电	50,700	330,057.00	0.01
839	605117	德业股份	1,200	328,548.00	0.01
840	600741	华域汽车	11,600	328,280.00	0.01
841	600489	中金黄金	39,800	327,554.00	0.01
842	601336	新华保险	8,419	327,330.72	0.01
843	002244	滨江集团	69,500	323,870.00	0.01
844	601011	宝泰隆	61,200	323,748.00	0.01
845	000157	中联重科	44,400	318,348.00	0.01
846	601555	东吴证券	35,880	317,896.80	0.01
847	002180	纳思达	6,600	315,216.00	0.01
848	603505	金石资源	8,600	311,578.00	0.01
849	300058	蓝色光标	29,000	311,170.00	0.01
850	603118	共进股份	32,200	307,832.00	0.01
851	601015	陕西黑猫	47,400	307,152.00	0.01
852	600026	中远海能	51,800	306,656.00	0.01
853	000935	四川双马	12,600	306,180.00	0.01
854	601139	深圳燃气	34,500	304,635.00	0.01
855	002008	大族激光	5,600	302,400.00	0.01
856	600295	鄂尔多斯	12,800	301,952.00	0.01
857	601788	光大证券	20,200	301,586.00	0.01

858	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
859	601162	天风证券	73,800	298,890.00	0.01
860	600637	东方明珠	31,600	298,620.00	0.01
861	600795	国电电力	93,600	296,712.00	0.01
862	600409	三友化工	34,000	295,800.00	0.01
863	603444	吉比特	700	295,295.00	0.01
864	600522	中天科技	17,400	295,104.00	0.01
865	300769	德方纳米	600	294,696.00	0.01
866	001872	招商港口	17,314	293,472.30	0.01
867	002929	润建股份	8,100	292,734.00	0.01
868	600624	复旦复华	41,800	289,674.00	0.01
869	601018	宁波港	72,000	285,840.00	0.01
870	000923	河钢资源	19,805	283,211.50	0.01
871	601000	唐山港	102,800	282,700.00	0.01
872	603713	密尔克卫	2,095	282,364.10	0.01
873	600668	尖峰集团	15,400	281,512.00	0.01
874	600918	中泰证券	28,200	281,154.00	0.01
875	601216	君正集团	53,400	279,282.00	0.01
876	002832	比音勒芬	10,900	277,405.00	0.01
877	002739	万达电影	17,900	277,092.00	0.01
878	600109	国金证券	24,400	276,452.00	0.01
879	002930	宏川智慧	10,600	274,010.00	0.01
880	002002	鸿达兴业	45,200	273,912.00	0.01
881	000826	启迪环境	61,300	272,785.00	0.01
882	300618	寒锐钴业	3,400	272,612.00	0.01
883	300343	联创股份	15,800	268,916.00	0.01
884	600988	赤峰黄金	18,000	268,200.00	0.01
885	600720	祁连山	25,600	266,240.00	0.01
886	601377	兴业证券	26,900	265,772.00	0.01
887	002429	兆驰股份	54,600	265,356.00	0.01
888	300724	捷佳伟创	2,300	262,890.00	0.01
889	688800	瑞可达	1,967	262,653.51	0.01
890	600223	鲁商发展	19,700	261,025.00	0.01
891	600166	福田汽车	75,700	260,408.00	0.01
892	002946	新乳业	16,100	256,634.00	0.01
893	603882	金域医学	2,300	256,151.00	0.01
894	600867	通化东宝	23,200	254,272.00	0.01
895	600339	中油工程	82,200	253,176.00	0.01
896	300418	昆仑万维	10,900	252,335.00	0.01
897	603185	上机数控	1,500	250,470.00	0.01
898	002797	第一创业	33,800	247,416.00	0.01
899	600871	石化油服	115,600	247,384.00	0.01
900	600535	天士力	15,600	247,260.00	0.01
901	000789	万年青	20,200	246,844.00	0.01

902	600645	中源协和	9,600	242,304.00	0.01
903	002056	横店东磁	12,800	241,536.00	0.01
904	300144	宋城演艺	16,700	239,144.00	0.01
905	003012	东鹏控股	17,400	238,728.00	0.01
906	600486	扬农化工	1,800	236,160.00	0.01
907	600862	中航高科	6,600	236,016.00	0.01
908	603685	晨丰科技	18,800	235,376.00	0.01
909	603939	益丰药房	4,260	234,768.60	0.01
910	000301	东方盛虹	12,000	232,080.00	0.01
911	600326	西藏天路	35,800	230,910.00	0.01
912	300251	光线传媒	17,900	230,015.00	0.01
913	600499	科达制造	9,200	228,344.00	0.01
914	601619	嘉泽新能	43,700	225,492.00	0.01
915	603236	移远通信	1,100	224,290.00	0.01
916	600143	金发科技	17,800	223,924.00	0.01
917	300523	辰安科技	10,100	223,210.00	0.01
918	601689	拓普集团	4,200	222,600.00	0.01
919	601878	浙商证券	16,800	221,424.00	0.01
920	000975	银泰黄金	25,200	221,256.00	0.01
921	300476	胜宏科技	7,300	220,825.00	0.01
922	688002	睿创微纳	2,800	219,996.00	0.01
923	300699	光威复材	2,600	219,648.00	0.01
924	600529	山东药玻	5,000	219,500.00	0.01
925	002660	茂硕电源	27,100	218,155.00	0.01
926	601995	中金公司	4,400	215,732.00	0.01
927	000089	深圳机场	29,200	213,744.00	0.01
928	688049	炬芯科技-U	3,260	168,574.60	0.00
929	002683	广东宏大	4,200	126,504.00	0.00
930	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
931	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
932	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
933	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
934	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
935	688608	恒玄科技	100	30,500.00	0.00
936	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
937	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
938	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
939	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
940	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
941	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
942	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
943	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
944	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
945	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00

946	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
947	688699	明微电子	100	18,720.00	0.00
948	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
949	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
950	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
951	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
952	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
953	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
954	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
955	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
956	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
957	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
958	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
959	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
960	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
961	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
962	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
963	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
964	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
965	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
966	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
967	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
968	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
969	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
970	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
971	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
972	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
973	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
974	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
975	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
976	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
977	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
978	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
979	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
980	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
981	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
982	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
983	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
984	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
985	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
986	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
987	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
988	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	134,673,122.04	3.59
2	600036	招商银行	96,131,368.40	2.56
3	000333	美的集团	82,826,519.87	2.21
4	601166	兴业银行	70,335,635.00	1.87
5	000725	京东方 A	68,779,576.00	1.83
6	000001	平安银行	67,182,456.36	1.79
7	000858	五粮液	62,843,271.88	1.67
8	601318	中国平安	58,445,519.16	1.56
9	002714	牧原股份	56,930,457.06	1.52
10	000039	中集集团	56,748,827.62	1.51
11	300122	智飞生物	53,771,683.64	1.43
12	002727	一心堂	48,551,225.00	1.29
13	002027	分众传媒	44,794,456.07	1.19
14	300059	东方财富	44,563,170.81	1.19
15	300633	开立医疗	44,505,064.35	1.19
16	000933	神火股份	44,439,961.51	1.18
17	002541	鸿路钢构	44,242,622.03	1.18
18	000100	TCL 科技	43,125,086.92	1.15
19	600426	华鲁恒升	43,111,306.31	1.15
20	601636	旗滨集团	41,280,759.93	1.10

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	105,884,713.62	2.82

2	600036	招商银行	87,074,733.35	2.32
3	601166	兴业银行	62,721,885.24	1.67
4	000333	美的集团	59,958,413.26	1.60
5	000001	平安银行	59,360,307.52	1.58
6	000725	京东方 A	56,065,403.40	1.49
7	000039	中集集团	53,495,744.23	1.43
8	000858	五粮液	48,715,559.04	1.30
9	002714	牧原股份	48,403,942.34	1.29
10	300633	开立医疗	46,904,133.73	1.25
11	601636	旗滨集团	46,852,616.99	1.25
12	601919	中远海控	44,055,458.77	1.17
13	600438	通威股份	43,207,269.44	1.15
14	300122	智飞生物	42,800,269.04	1.14
15	000012	南玻 A	42,629,053.41	1.14
16	600426	华鲁恒升	42,570,782.92	1.13
17	601318	中国平安	42,219,081.47	1.12
18	300124	汇川技术	41,859,598.92	1.12
19	002139	拓邦股份	41,629,385.98	1.11
20	002027	分众传媒	41,473,159.00	1.11

8.4.3 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	11,320,128,517.99
卖出股票收入（成交）总额	10,146,551,638.00

8.5 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	351,311,000.00	9.36
	其中：政策性金融债	230,460,000.00	6.14
4	企业债券	561,630,000.00	14.96
5	企业短期融资券	120,250,000.00	3.20
6	中期票据	282,780,000.00	7.53

7	可转债（可交换债）	110,278,569.43	2.94
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,426,249,569.43	38.00

8.6 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	175987	21 国君 G1	2,500,000	253,700,000.00	6.76
2	190403	19 农发 03	2,300,000	230,460,000.00	6.14
3	188363	21 中证 10	1,000,000	102,020,000.00	2.72
4	2080296	20 雨花城投 01	800,000	83,160,000.00	2.22
5	175062	20 光证 G5	700,000	71,015,000.00	1.89

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	189342	光信 11A	600,000	60,042,000.00	1.60
2	193199	华能 23 优	500,000	50,040,000.00	1.33
3	189078	GC 晓 12A2	500,000	50,025,000.00	1.33
4	189310	21 信易 2A	500,000	49,960,000.00	1.33
5	137928	天铭优 03	200,000	20,116,000.00	0.54

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2201	IC2201	15.00	22,133,400.00	265,872.00	买入股指期货多头合约是为了更有效地进行流动性管理。
IC2203	IC2203	10.00	14,611,600.00	299,600.00	买入股指期货多头合约是为了更有效地进行流动性管理。
公允价值变动总额合计					565,472.00
股指期货投资本期收益					13,745,580.58
股指期货投资本期公允价值变动					565,472.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
TF2203	TF2203	-100.00	-101,715,000.00	-238,450.00	本基金关于国债期货的投资符合基金合同及相关规定的要求。
公允价值变动总额合计（元）					-238,450.00
国债期货投资本期收益（元）					-3,850,485.43
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-238,450.00

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，光大兴陇信托有限责任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。中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	8,106,751.51
2	应收证券清算款	19,780,851.68
3	应收股利	-
4	应收利息	22,782,049.62
5	应收申购款	58,701.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,728,354.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	113011	光大转债	28,005,000.00	0.75

2	113044	大秦转债	21,888,000.00	0.58
3	110043	无锡转债	11,977,000.00	0.32
4	127012	招路转债	5,949,000.00	0.16
5	128145	日丰转债	2,858,200.00	0.08
6	113588	润达转债	2,519,800.00	0.07
7	110057	现代转债	2,483,400.00	0.07
8	127020	中金转债	2,481,800.00	0.07
9	127032	苏行转债	2,278,222.76	0.06
10	113532	海环转债	2,225,400.00	0.06
11	113033	利群转债	2,212,800.00	0.06
12	110034	九州转债	2,124,000.00	0.06
13	110080	东湖转债	1,018,108.00	0.03
14	123111	东财转 3	793,136.88	0.02
15	123113	仙乐转债	455,245.77	0.01
16	113047	旗滨转债	417,676.00	0.01
17	113622	杭叉转债	117,090.40	0.00
18	123117	健帆转债	102,514.86	0.00
19	127036	三花转债	69,261.84	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发均衡增长混合 A	30,570	111,713.07	4,904,368.76	0.14%	3,410,164,258.56	99.86%
广发均衡增长混合 C	2,474	51,042.19	0.00	0.00%	126,278,370.49	100.00%
合计	33,044	107,170.65	4,904,368.76	0.14%	3,536,442,629.	99.86%

					05	
--	--	--	--	--	----	--

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发均衡增长混合 A	29.32	0.0000%
	广发均衡增长混合 C	9,980.18	0.0079%
	合计	10,009.50	0.0003%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发均衡增长混合 A	广发均衡增长混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 27 日）基金份额总额	7,614,158,074.80	317,318,440.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	44,496,233.38	7,408,177.40
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,243,585,680.86	198,448,247.59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,415,068,627.32	126,278,370.49

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2021 年 7 月 23 日发布公告，易阳方先生自 2021 年 7 月 21 日起不再担任公司常务副总经理；于 2021 年 9 月 17 日发布公告，刘格菰先生、傅友兴先生自 2021 年 9 月 17 日起任公司副总经理。

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 74,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	11,218,225,534.50	52.32%	8,203,651.22	52.32%	新增 2 个
国联证券	2	6,947,492,512.75	32.40%	5,080,653.52	32.40%	新增 2 个
申万宏源	2	2,812,625,452.42	13.12%	2,056,901.21	13.12%	新增 2 个
招商证券	2	463,015,366.66	2.16%	338,616.40	2.16%	新增 2 个
光大证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

渤海证券	2	-	-	-	-	新增 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	3,353,260,895.47	92.91%	17,614,000,000.00	62.68%	-	-
国联证券	193,848,788.36	5.37%	9,554,400,000.00	34.00%	-	-
申万宏源	62,116,999.40	1.72%	935,000,000.00	3.33%	-	-
招商证券	46,000.00	0.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-06
2	关于广发均衡增长混合型证券投资基金设置募集规模上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-19
3	关于广发均衡增长混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-25
4	关于广发均衡增长混合型证券投资基金认购申请确认比例结果的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-26
5	关于广发均衡增长混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-28
6	关于广发均衡增长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-25
7	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
8	关于广发均衡增长混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-20
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-20
10	关于广发均衡增长混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-08-27
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-08-30
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-10-26

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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

二〇二二年三月三十日