

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2022 年年度报告
2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。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 2022 年 1 月 1 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.....	6
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.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 其他信息.....	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	109
8.1 期末基金资产组合情况.....	109
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	110
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.....	111

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	123
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	125
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	125
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	125
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	125
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	125
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	125
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	126
8.12	投资组合报告附注	126
§9	基金份额持有人信息	127
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	127
9.2	期末上市基金前十名持有人	128
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	128
9.4	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情况	128
§10	开放式基金份额变动	128
§11	重大事件揭示	129
11.1	基金份额持有人大会决议	129
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	129
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	129
11.4	基金投资策略的改变	129
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	129
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	129
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	129
11.8	其他重大事件	133
§12	影响投资者决策的其他重要信息	134
12.1	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	134
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	135
§13	备查文件目录	135
13.1	备查文件目录	135
13.2	存放地点	135
13.3	查阅方式	135

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 500ETF
场内简称	广发 500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,607,038,319.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-05-24

注：本基金的扩位证券简称为“中证 500ETF 基金”。

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	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环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广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	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	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、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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-105,352,246.54	461,453,895.70	974,637,874.65
本期利润	-558,985,693.94	471,651,320.89	1,018,626,079.91
加权平均基金份额本期利润	-0.3826	0.3492	0.4266
本期加权平均净值利润率	-20.38%	17.35%	25.41%
本期基金份额净值增长率	-19.15%	17.82%	23.60%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	1,244,812,197.77	1,697,968,496.81	1,574,939,796.90
期末可供分配基金份额利润	0.7746	1.1949	0.8630
期末基金资产净值	2,851,850,516.77	3,119,006,815.81	3,399,978,115.90
期末基金份额净值	1.7746	2.1949	1.8630
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	77.46%	119.49%	86.30%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.67%	1.02%	2.63%	1.03%	0.04%	-0.01%
过去六个月	-8.54%	1.09%	-9.14%	1.10%	0.60%	-0.01%

过去一年	-19.15%	1.36%	-20.31%	1.38%	1.16%	-0.02%
过去三年	17.73%	1.34%	11.33%	1.35%	6.40%	-0.01%
过去五年	2.04%	1.39%	-6.18%	1.41%	8.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	77.46%	1.59%	70.61%	1.62%	6.85%	-0.03%

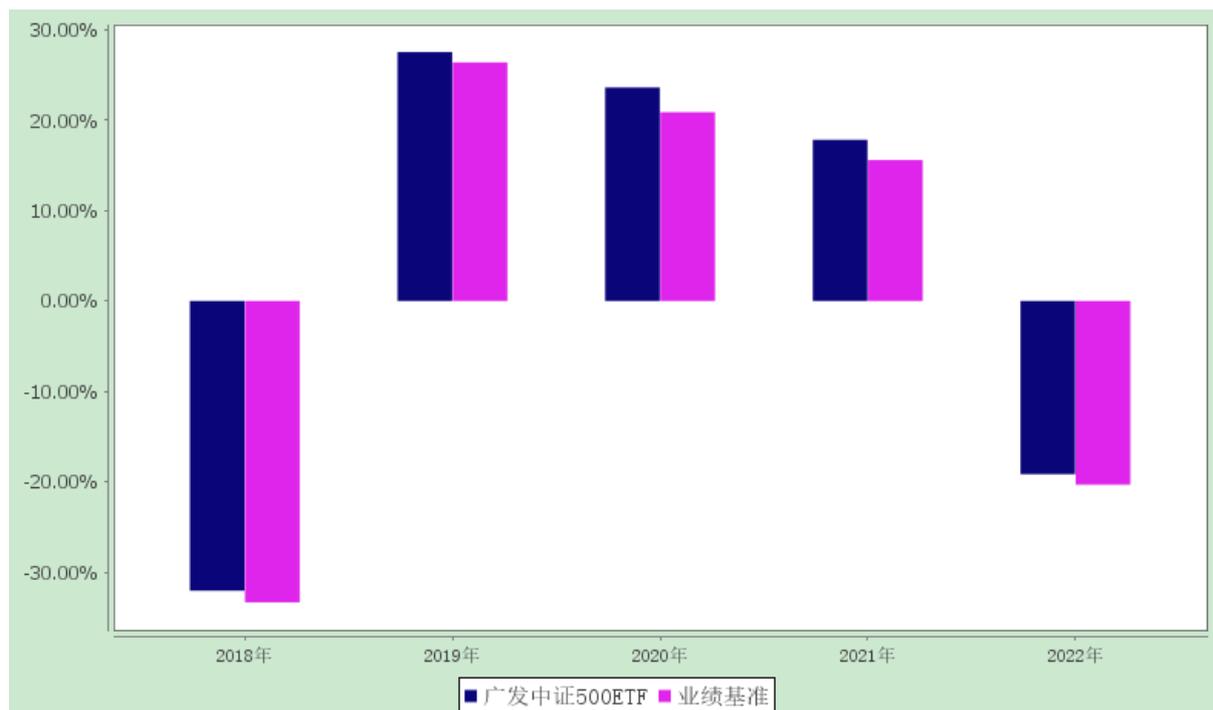
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2013 年 4 月 11 日至 2022 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年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

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深300交易型开放式指数证	2014-04-01	-	19年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研

	<p>券投资基金联接基金的基金经理；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；广发沪深 300 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；广发港股通恒生综合中型股指证券投资基金(LOF)的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理；广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金</p>			<p>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 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投</p>
--	--	--	--	---

	(QDII) 的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；指数投资部总经理助理			资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)。
--	--	--	--	---

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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；对于不同投资组合间的同时同向交易，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 19 次，其中 16 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 3 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

2022 年，整体 A 股市场经历震荡，趋势向下，沪深 300 指数下跌 21.63%，中证 500 指数下跌 20.31%，创业板指数下跌 29.37%。受到俄乌冲突、通胀压力影响，全年美联储多次加息，美元逐步

走强并筑顶，整体压制美股表现，全球市场情绪变化激烈，纳斯达克 100 指数下跌 32.97%，标普 500 指数下跌 19.44%，纳斯达克生物科技指数下跌 10.91%，道琼斯美国石油开发与生产指数上涨 52.09%，MSCI 美国 REIT 指数下跌 27.33%，标普全球 1200 医疗保健指数下跌 0.17%；同期港股表现也受到国内国外双重影响，恒生指数下跌 15.46%，恒生中型股下跌 19.87%，恒生科技下跌 27.19%，港股创新药下跌 20.63%。

2022 年，在俄乌冲突、美联储加息和国内疫情等不利影响下，A 股情绪整体表现疲弱；临近 5 月，复工复产的稳步推进，以及国内以“稳增长”为重心，经济预期开始向上修正，5 月各项经济数据均开始修复，工业增速转正，经济进入修复通道，在稳增长基调下，基建投资继续反弹，制造业投资则展现韧性。进入 4 季度，政策推动经济整体好转，平台治理定调更偏积极，房地产流动性缓解，扩内需消费恢复值得期待。房地产信贷、债券、股权政策“三箭齐发”，地产板块及相关产业链回暖，疫情防控政策优化，潜在消费动能的恢复与政策的超预期推动了 A 股的反弹。

本基金的标的指数是中证 500 指数，主要采用完全复制法来跟踪标的指数。作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-19.15%，同期业绩比较基准收益率为-20.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，美联储加息步伐的减缓和加息预期的逐步降低将降低利率波动和金融市场风险，提升全球市场风险偏好。2022 年 4 季度，在疫情政策调整以及经济复苏预期改善的影响下，市场明显反弹；虽然当前市场已经较为充分地反映了疫情之后经济环比修复的利好，但随着经济数据的稳步复苏，企业盈利有望企稳上行，相关经济数据同比修复将会是市场表现更加重要的动力。

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：

(一) 积极推进内部制度修订完善, 不折不扣做好监管新规内化工作, 扎实推进制度全覆盖工作, 确保公司经营管理与业务开展有章可循, 规范有序。

(二) 强化投资组合日常风险监控, 有效执行关联交易内控措施, 大力推进统一风险监控平台建设, 提升信息化管理水平, 实现对投资组合更精细化的风险管理。

(三) 加强稽核审计工作闭环管理, 通过专项检查、组织自查等方式进行了常规稽核检查, 制定整改方案, 并做好持续跟踪与督办。

(四) 建立合规培训长效机制, 持续落实常规化培训, 积极拓展多元化培训, 不断探索培训创新, 提高员工的主动合规意识, 强化第一道防线风险意识。

(五) 加强公司员工对外言行管理, 通过发布通知等规范性文件明确对全体员工的要求, 压实管理级员工的监督管理责任。

(六) 扎实推进反洗钱日常工作, 围绕反洗钱工作的基本要求, 按时保质完成洗钱风险自评估、反洗钱主题宣传等工作, 不断完善工作机制、提升工作质量。

(七) 完善子公司日常管理机制, 推动境内子公司相关制度修订与完善, 增强对子公司合规负责人的履职监督与保障, 加强对子公司报告事项的研究分析。

(八) 强化疫情防控远程权限及行为管理, 制定远程办公应急预案及各类远程办公合规指引, 强调信息技术安全及合规要求, 全力保障疫情期间公司各项业务合规、平稳运作。

(九) 推进信息披露自动化和智能化建设, 探索运用信息技术手段提升管理效能, 并不断完善工作指引, 在降低操作风险、提高工作效率的同时确保工作质量。

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

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

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

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内, 参与估值流程

各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、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 审计报告

安永华明(2023)审字第 60873695_G30 号

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中证 500 交易型开放式指数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，公允反映了广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度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，我们独立于广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，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

广发中证 500 交易型开放式指数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中证 500 交易型开放式指数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中证 500 交易型开放式指数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，就可能导致对广发中证 500 交易型开放式指数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中证 500 交易型开放式指数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 黄浩松

中国 北京

2023 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,902,280.53	28,793,490.70
结算备付金		17,934,009.25	20,376,362.24
存出保证金		2,022,095.72	3,285,776.61
交易性金融资产	7.4.7.2	2,824,537,129.41	3,076,928,417.39
其中：股票投资		2,824,537,129.41	3,073,988,591.31
基金投资		-	-
债券投资		-	2,939,826.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		11,063,017.51	6,839,320.13
应收股利		1,404.00	700.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	226,327.21	93,118.93
资产总计		2,878,686,263.63	3,136,317,186.00

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 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		-	-
应付清算款		20,005,720.74	12,625,021.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,162,616.16	1,250,819.74
应付托管费		232,523.21	250,163.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,279.82	7,989.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	5,421,606.93	3,176,375.04
负债合计		26,835,746.86	17,310,370.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	1,607,038,319.00	1,421,038,319.00
未分配利润	7.4.7.9	1,244,812,197.77	1,697,968,496.81
净资产合计		2,851,850,516.77	3,119,006,815.81
负债和净资产总计		2,878,686,263.63	3,136,317,186.00

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.7746 元，基金份额总额 1,607,038,319.00 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-541,515,907.23	494,936,647.26
1.利息收入		3,656,170.97	4,110,718.07
其中：存款利息收入	7.4.7.10	393,336.20	591,388.58
债券利息收入		-	2,904.72
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		3,262,834.77	3,516,424.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-96,452,503.18	474,077,996.45
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-142,992,909.21	430,184,837.86
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,952,791.72	1,328,690.11
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-1,954,944.85	8,353,696.11
股利收益	7.4.7.17	46,542,559.16	34,210,772.37
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	7.4.7.18	-453,633,447.40	10,197,425.19
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	4,913,872.38	6,550,507.55

减：二、营业总支出		17,469,786.71	23,285,326.37
1. 管理人报酬		13,696,743.87	13,605,082.42
2. 托管费		2,739,348.82	2,721,016.47
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		16,214.46	57,618.79
8. 其他费用	7.4.7.21	1,017,479.56	6,901,608.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-558,985,693.94	471,651,320.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-558,985,693.94	471,651,320.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-558,985,693.94	471,651,320.89

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,421,038,319.00	1,697,968,496.81	3,119,006,815.81
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基	1,421,038,319.00	1,697,968,496.81	3,119,006,815.81

金净值)			
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	186,000,000.00	-453,156,299.04	-267,156,299.04
(一)、综合收益总额	-	-558,985,693.94	-558,985,693.94
(二)、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)	186,000,000.00	105,829,394.90	291,829,394.90
其中: 1.基金申购款	1,122,000,000.00	925,675,916.03	2,047,675,916.03
2.基金赎回款	-936,000,000.00	-819,846,521.13	-1,755,846,521.13
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,607,038,319.00	1,244,812,197.77	2,851,850,516.77
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,825,038,319.00	1,574,939,796.90	3,399,978,115.90
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,825,038,319.00	1,574,939,796.90	3,399,978,115.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-404,000,000.00	123,028,699.91	-280,971,300.09
(一)、综合收益总额	-	471,651,320.89	471,651,320.89
(二)、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)	-404,000,000.00	-348,622,620.98	-752,622,620.98
其中: 1.基金申购款	1,180,000,000.00	1,186,568,366.34	2,366,568,366.34
2.基金赎回款	-1,584,000,000.00	-1,535,190,987.32	-3,119,190,987.32
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,421,038,319.00	1,697,968,496.81	3,119,006,815.81

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

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

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

本基金的财务报表于 2023 年 3 月 27 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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度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。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利

息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(9) 黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流

入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

(2) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；

(4) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的

要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 28,793,490.70 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,026.69 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 28,796,517.39 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,376,362.24 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9,158.29 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,385,520.53 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,285,776.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 91.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,285,867.61 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 93,118.93 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,026.69 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 9,158.29 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 91.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 297.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 80,545.95 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 80,545.95 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 80,545.95 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,076,928,417.39 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 297.00 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,076,928,714.39 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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。

(5) 境外投资

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

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	22,902,280.53	28,793,490.70
等于：本金	22,899,039.09	28,793,490.70
加：应计利息	3,241.44	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-

其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	22,902,280.53	28,793,490.70

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,064,078,028.89	-	2,824,537,129.41	-239,540,899.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,064,078,028.89	-	2,824,537,129.41	-239,540,899.48
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,860,686,191.43	-	3,073,988,591.31	213,302,399.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,733,974.08	-	2,939,826.08	205,852.00

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,733,974.08	-	2,939,826.08	205,852.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,863,420,165.51	-	3,076,928,417.39	213,508,251.88

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,334,070.59	-	-	-
其中：股指期货投资	13,334,070.59	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,334,070.59	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	20,383,134.55	-	-	-
其中：股指期货投资	20,383,134.55	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,383,134.55	-	-	-

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。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2303	IC2303	11.00	12,923,680.00	-410,390.59
合计	-	-	-	-410,390.59
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-410,390.59
净额	-	-	-	-

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

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

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	93,118.93
其他应收款	226,327.21	-
待摊费用	-	-
合计	226,327.21	93,118.93

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	796,413.11	1,141,176.25
其中：交易所市场	796,413.11	1,141,176.25
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	74,000.00	194,000.00
应付替代款	4,352,829.11	1,384,337.64
应付指数使用费	198,364.71	217,759.05
可退替代款	-	239,102.10
合计	5,421,606.93	3,176,375.04

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,421,038,319.00	1,421,038,319.00
本期申购	1,122,000,000.00	1,122,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-936,000,000.00	-936,000,000.00
本期末	1,607,038,319.00	1,607,038,319.00

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,931,836,520.24	-1,233,868,023.43	1,697,968,496.81
本期利润	-105,352,246.54	-453,633,447.40	-558,985,693.94
本期基金份额交易产生的变动数	376,912,786.70	-271,083,391.80	105,829,394.90
其中：基金申购款	2,279,811,039.84	-1,354,135,123.81	925,675,916.03

基金赎回款	-1,902,898,253.14	1,083,051,732.01	-819,846,521.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,203,397,060.40	-1,958,584,862.63	1,244,812,197.77

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	129,567.94	127,384.29
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	6,680.85
结算备付金利息收入	260,227.63	457,323.44
其他	3,540.63	-
合计	393,336.20	591,388.58

注：“其他”包含保证金利息收入，以往期间在“其他存款利息收入”列示。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-112,433,615.41	315,324,999.60
股票投资收益——赎回差价收入	-30,559,293.80	114,859,838.26
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	-142,992,909.21	430,184,837.86

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,723,599,487.57	2,648,989,519.76

减：卖出股票成本总额	1,831,922,712.48	2,333,664,520.16
减：交易费用	4,110,390.50	-
买卖股票差价收入	-112,433,615.41	315,324,999.60

7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,755,846,521.13	3,119,190,987.32
减：现金支付赎回款总额	864,190,570.13	1,623,714,869.32
减：赎回股票成本总额	922,215,244.80	1,380,616,279.74
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-30,559,293.80	114,859,838.26

7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
债券投资收益——利息收入	3,351.68	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,949,440.04	1,328,690.11
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	1,952,791.72	1,328,690.11

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1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	12,753,098.64	7,412,719.58

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,799,574.08	6,080,700.00
减：应计利息总额	3,701.02	3,329.47
减：交易费用	383.50	-
买卖债券差价收入	1,949,440.04	1,328,690.11

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间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	上年度可比期间收益金额
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-1,954,944.85	8,353,696.11

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	46,542,559.16	34,210,772.37
其中：证券出借权益补偿收入	3,327,528.56	2,496,634.03
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	46,542,559.16	34,210,772.37

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日

1.交易性金融资产	-453,049,151.36	11,712,670.89
——股票投资	-452,843,299.36	11,796,393.06
——债券投资	-205,852.00	-83,722.17
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-584,296.04	-1,506,174.55
——权证投资	-	-
——股指期货投资	-584,296.04	-1,506,174.55
3.其他	-	-9,071.15
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-453,633,447.40	10,197,425.19

注：其他为可退替代款公允价值变动收益。

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	4,913,872.38	6,550,507.55
合计	4,913,872.38	6,550,507.55

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

7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	74,000.00	74,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	930.43	1,043.97
指数使用费	821,804.68	816,304.99
其他	744.45	5,890,259.73
合计	1,017,479.56	6,901,608.69

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、申购赎回代办证券公司
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
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）	本基金的联接基金

广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
----------	-----------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	2,913,416.83	0.08%	-	-

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	2,872,600.00	13.80%	1,736,000.00	14.03%

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31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	1,385.16	0.07%	1,166.16	0.15%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

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。

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12 月31日	2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,696,743.87	13,605,082.42
其中：支付销售机构的客户维护费	89,177.98	91,212.26

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,739,348.82	2,721,016.47

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。

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

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。

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

单位：人民币元

本期				
2022年1月1日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	1,261,317,741.00	1,701,859.76	82,198,592.00	83,852.69
上年度可比期间				
2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	99,307,637.00	119,404.63	26,278,808.00	16,758.07

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

单位：人民币元

本期										
2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:股)	出借期限(单位:天)	费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	2022010400020663	微芯生物	2022-01-04	348,200.00	10,000.00	28	3.10	1,019.45	-	-
广发证券股份有限公司	2022011400019820	易华录	2022-01-14	315,200.00	10,000.00	28	3.10	759.98	-	-
广发证券股份有限公司	2022012500008966	易华录	2022-01-25	223,295.00	7,100.00	28	3.10	538.39	-	-
广发证券股份有限公司	2022012800021764	北京君正	2022-01-28	2,286,900.00	21,000.00	28	3.10	5,513.97	-	-
广发证券股份有限公司	2022020700052841	微芯生物	2022-02-07	295,800.00	10,000.00	28	3.10	713.21	-	-
广发证券股份有限公司	2022020800001929	圣湘生物	2022-02-08	667,030.00	13,000.00	28	3.10	1,608.28	-	-
广发证券股份有限公司	2022021100019462	易华录	2022-02-11	262,500.00	10,000.00	28	3.10	632.92	-	-
广发证券股份有限公司	2022022100000997	安科生物	2022-02-21	375,219.00	35,100.00	28	3.50	1,021.43	-	-
广发证券股份有限公司	2022022100000999	网宿科技	2022-02-21	533,250.00	75,000.00	28	3.50	1,451.63	-	-
广发证券股份有限公司	202202210021	机器人	2022-02-21	396,516.00	38,200.00	28	3.50	1,079.40	-	-

有限公司	0000 1001										
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1003	红日药 业	2022- 02-21	346,6 56.00	55,200.00	28	3.5 0	943.6 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1007	蓝色光 标	2022- 02-21	623,3 71.00	76,300.00	28	3.5 0	1,696 .95	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1009	信维通 信	2022- 02-21	665,1 12.00	29,600.00	28	3.5 0	1,810 .58	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1012	三聚环 保	2022- 02-21	375,4 08.00	43,200.00	28	3.5 0	1,021 .94	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1017	华策影 视	2022- 02-21	211,8 43.00	34,900.00	28	3.5 0	576.6 8	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1021	汤臣倍 健	2022- 02-21	669,2 40.00	26,000.00	28	3.5 0	1,821 .82	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1026	捷成股 份	2022- 02-21	417,0 91.00	63,100.00	28	3.5 0	1,135 .41	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1030	容百科 技	2022- 02-21	1,084 ,696. 00	8,200.00	28	3.5 0	2,952 .78	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1035	道通科 技	2022- 02-21	426,0 72.00	8,200.00	28	3.5 0	1,159 .86	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0221 0000 1047	光线传 媒	2022- 02-21	352,1 79.00	35,900.00	28	3.5 0	958.7 1	-	-	
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000	国瓷材 料	2022- 02-21	952,7 58.00	24,600.00	28	3.5 0	2,593 .62	-	-	

司	1049									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1053	开山股 份	2022- 02-21	194,5 68.00	12,100.00	28	3.5 0	529.6 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1059	中际旭 创	2022- 02-21	661,5 99.00	17,100.00	28	3.5 0	1,801 .02	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1061	掌趣科 技	2022- 02-21	333,7 75.00	84,500.00	28	3.5 0	908.6 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1063	博腾股 份	2022- 02-21	809,5 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,203 .64	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1065	光环新 网	2022- 02-21	627,5 50.00	38,500.00	28	3.5 0	1,708 .33	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1066	我武生 物	2022- 02-21	418,6 56.00	9,600.00	28	3.5 0	1,139 .67	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1069	昆仑万 维	2022- 02-21	551,4 26.00	29,300.00	28	3.5 0	1,501 .10	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1079	光威复 材	2022- 02-21	669,7 50.00	9,500.00	28	3.5 0	1,823 .21	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0222 0001 1775	易华录	2022- 02-22	213,0 00.00	7,100.00	28	3.1 0	513.5 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0225 0001 8239	北京君 正	2022- 02-25	2,349 ,900. 00	21,000.00	28	3.1 0	5,665 .87	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0303 0000 1746	易华录	2022- 03-03	271,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	655.3 4	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0304 0000 0003	碧水源	2022- 03-04	1,845 ,200. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	4,448 .98	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0307 0004 1982	微芯生 物	2022- 03-07	271,0 00.00	10,000.00	28	3.1 0	700.0 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0308 0001 5056	圣湘生 物	2022- 03-08	567,3 20.00	13,000.00	28	3.1 0	1,416 .72	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0311 0001 7668	易华录	2022- 03-11	253,1 00.00	10,000.00	28	3.1 0	610.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1853	容百科 技	2022- 03-21	1,132 ,010. 00	8,200.00	28	3.5 0	3,081 .58	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1855	博腾股 份	2022- 03-21	881,0 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,398 .28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1857	开山股 份	2022- 03-21	166,2 54.00	12,100.00	28	3.5 0	452.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1859	光线传 媒	2022- 03-21	288,2 77.00	35,900.00	28	3.5 0	784.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1863	华策影 视	2022- 03-21	174,1 51.00	34,900.00	28	3.5 0	474.0 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1867	汤臣倍 健	2022- 03-21	567,0 60.00	26,000.00	28	3.5 0	1,543 .66	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1877	捷成股 份	2022- 03-21	375,4 45.00	63,100.00	28	3.5 0	1,022 .04	-	-
广发证	2022	光环新	2022-	528,9	38,500.00	28	3.5	1,440	-	-

券股份 有限公司	0321 0003 1899	网	03-21	90.00			0	.03		
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1901	光威复 材	2022- 03-21	603,8 20.00	9,500.00	28	3.5 0	1,643 .73	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1903	掌趣科 技	2022- 03-21	304,2 00.00	84,500.00	28	3.5 0	828.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1905	红日药 业	2022- 03-21	508,9 44.00	55,200.00	28	3.5 0	1,385 .46	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1907	国瓷材 料	2022- 03-21	842,5 50.00	24,600.00	28	3.5 0	2,293 .61	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1909	机器人	2022- 03-21	355,6 42.00	38,200.00	28	3.5 0	968.1 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1911	信维通 信	2022- 03-21	553,5 20.00	29,600.00	28	3.5 0	1,506 .80	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1913	我武生 物	2022- 03-21	388,8 00.00	9,600.00	28	3.5 0	1,058 .40	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1915	网宿科 技	2022- 03-21	450,0 00.00	75,000.00	28	3.5 0	1,225 .00	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1917	安科生 物	2022- 03-21	361,8 81.00	35,100.00	28	3.5 0	985.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1919	道通科 技	2022- 03-21	343,0 06.00	8,200.00	28	3.5 0	933.7 4	-	-
广发证 券股份	2022 0321	昆仑万 维	2022- 03-21	484,9 15.00	29,300.00	28	3.5 0	1,320 .05	-	-

有限公司	0003 1921									
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1925	蓝色光 标	2022- 03-21	622,6 08.00	76,300.00	28	3.5 0	1,694 .88	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1931	中际旭 创	2022- 03-21	577,6 38.00	17,100.00	28	3.5 0	1,572 .46	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0321 0003 1937	三聚环 保	2022- 03-21	288,5 76.00	43,200.00	28	3.5 0	785.5 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0322 0001 2515	易华录	2022- 03-22	164,0 10.00	7,100.00	28	3.1 0	395.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0325 0001 8846	北京君 正	2022- 03-25	1,974 ,210. 00	21,000.00	28	3.1 0	4,760 .04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0331 0000 6076	易华录	2022- 03-31	210,7 00.00	10,000.00	28	3.1 0	508.0 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0401 0000 4696	碧水源	2022- 04-01	1,671 ,600. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	4,030 .41	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0406 0005 0219	圣湘生 物	2022- 04-06	591,8 90.00	13,000.00	28	3.1 0	1,478 .08	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0408 0001 7195	易华录	2022- 04-08	192,1 00.00	10,000.00	28	3.1 0	463.1 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4145	中际旭 创	2022- 04-18	513,6 84.00	17,100.00	28	3.5 0	1,398 .36	-	-
广发证 券股份 有限公	2022 0418 0000	三聚环 保	2022- 04-18	253,1 52.00	43,200.00	28	3.5 0	689.1 4	-	-

司	4147									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4149	我武生 物	2022- 04-18	340,8 96.00	9,600.00	28	3.5 0	927.9 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4151	信维通 信	2022- 04-18	488,1 04.00	29,600.00	28	3.5 0	1,328 .73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4153	网宿科 技	2022- 04-18	405,0 00.00	75,000.00	28	3.5 0	1,102 .50	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4155	红日药 业	2022- 04-18	361,5 60.00	55,200.00	28	3.5 0	984.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4157	机器人	2022- 04-18	342,2 72.00	38,200.00	28	3.5 0	931.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4159	国瓷材 料	2022- 04-18	823,6 08.00	24,600.00	28	3.5 0	2,242 .04	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4161	蓝色光 标	2022- 04-18	508,9 21.00	76,300.00	28	3.5 0	1,385 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4163	昆仑万 维	2022- 04-18	441,8 44.00	29,300.00	28	3.5 0	1,202 .80	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4165	道通科 技	2022- 04-18	284,8 68.00	8,200.00	28	3.5 0	775.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4167	安科生 物	2022- 04-18	320,4 63.00	35,100.00	28	3.5 0	872.3 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4169	开山股 份	2022- 04-18	176,9 02.00	12,100.00	28	3.5 0	481.5 7	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4171	光线传 媒	2022- 04-18	276,7 89.00	35,900.00	28	3.5 0	753.4 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4173	容百科 技	2022- 04-18	878,1 38.00	8,200.00	28	3.5 0	2,390 .49	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4175	博腾股 份	2022- 04-18	841,2 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,289 .93	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4177	掌趣科 技	2022- 04-18	289,8 35.00	84,500.00	28	3.5 0	789.0 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4179	捷成股 份	2022- 04-18	311,7 14.00	63,100.00	28	3.5 0	848.5 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4181	光环新 网	2022- 04-18	453,5 30.00	38,500.00	28	3.5 0	1,234 .61	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4183	光威复 材	2022- 04-18	475,9 50.00	9,500.00	28	3.5 0	1,295 .64	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4185	汤臣倍 健	2022- 04-18	548,8 60.00	26,000.00	28	3.5 0	1,494 .12	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0418 0000 4187	华策影 视	2022- 04-18	165,4 26.00	34,900.00	28	3.5 0	450.3 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0419 0000 2982	易华录	2022- 04-19	130,3 56.00	7,100.00	28	3.1 0	314.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0422 0001 4406	北京君 正	2022- 04-22	1,627 ,500. 00	21,000.00	28	3.1 0	3,924 .08	-	-
广发证	2022	微芯生	2022-	651,0	30,000.00	28	3.1	1,569	-	-

券股份 有限公司	0428 0000 1365	物	04-28	00.00			0	.63		
广发证 券股份 有限公司	2022 0428 0000 7728	易华录	2022- 04-28	135,2 00.00	10,000.00	28	3.1 0	325.9 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0429 0000 5076	碧水源	2022- 04-29	1,313 ,200. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	3,166 .27	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0505 0007 1335	圣湘生 物	2022- 05-05	575,9 00.00	13,000.00	28	3.1 0	1,388 .56	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0506 0001 7501	易华录	2022- 05-06	148,0 00.00	10,000.00	28	3.1 0	395.0 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3487	蓝色光 标	2022- 05-16	439,4 88.00	76,300.00	28	3.5 0	1,196 .38	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3489	我武生 物	2022- 05-16	416,8 32.00	9,600.00	28	3.5 0	1,134 .71	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3491	网宿科 技	2022- 05-16	383,2 50.00	75,000.00	28	3.5 0	1,043 .29	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3493	安科生 物	2022- 05-16	325,7 28.00	35,100.00	28	3.5 0	886.7 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3495	三聚环 保	2022- 05-16	194,4 00.00	43,200.00	28	3.5 0	529.2 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3497	开山股 份	2022- 05-16	165,1 65.00	12,100.00	28	3.5 0	449.6 2	-	-
广发证 券股份	2022 0516	昆仑万 维	2022- 05-16	427,1 94.00	29,300.00	28	3.5 0	1,162 .92	-	-

有限公司	0000 3499										
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3501	信维通 信	2022- 05-16	456,7 28.00	29,600.00	28	3.5 0	1,243 .32	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3503	中际旭 创	2022- 05-16	542,9 25.00	17,100.00	28	3.5 0	1,477 .96	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3781	机器人	2022- 05-16	294,5 22.00	38,200.00	28	3.5 0	801.7 5	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3783	红日药 业	2022- 05-16	335,0 64.00	55,200.00	28	3.5 0	912.1 2	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3785	国瓷材 料	2022- 05-16	814,7 52.00	24,600.00	28	3.5 0	2,217 .94	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3787	捷成股 份	2022- 05-16	317,3 93.00	63,100.00	28	3.5 0	864.0 1	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3789	掌趣科 技	2022- 05-16	258,5 70.00	84,500.00	28	3.5 0	703.8 9	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3791	容百科 技	2022- 05-16	759,3 20.00	8,200.00	28	3.5 0	2,067 .04	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3793	光环新 网	2022- 05-16	371,5 25.00	38,500.00	28	3.5 0	1,011 .37	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3795	博腾股 份	2022- 05-16	714,5 00.00	10,000.00	28	3.5 0	1,945 .03	-	-	
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000	光威复 材	2022- 05-16	505,4 00.00	9,500.00	28	3.5 0	1,375 .81	-	-	

司	3797									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3799	汤臣倍 健	2022- 05-16	505,4 40.00	26,000.00	28	3.5 0	1,375 .92	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3801	光线传 媒	2022- 05-16	255,6 08.00	35,900.00	28	3.5 0	695.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3803	华策影 视	2022- 05-16	151,4 66.00	34,900.00	28	3.5 0	412.3 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0516 0000 3805	道通科 技	2022- 05-16	251,9 04.00	8,200.00	28	3.5 0	685.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0517 0000 3413	易华录	2022- 05-17	108,1 33.00	7,100.00	28	3.1 0	260.7 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0526 0000 7294	易华录	2022- 05-26	159,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	385.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0526 0000 7296	微芯生 物	2022- 05-26	632,7 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,525 .51	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0527 0000 5270	碧水源	2022- 05-27	1,349 ,600. 00	280,000.0 0	28	3.1 0	3,254 .04	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0531 0000 1282	圣湘生 物	2022- 05-31	77,37 6.00	1,600.00	28	3.1 0	186.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0602 0001 8752	圣湘生 物	2022- 06-02	424,4 50.00	13,000.00	28	3.1 0	1,023 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0606 0001 2034	易华录	2022- 06-06	168,0 00.00	10,000.00	14	3.1 0	202.5 3	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0608 0000 1117	碧水源	2022- 06-08	62,92 0.00	13,000.00	28	3.5 0	171.2 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0609 0000 0831	易华录	2022- 06-09	113,8 20.00	7,000.00	28	3.1 0	274.4 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9323	国瓷材 料	2022- 06-13	910,4 46.00	24,600.00	28	3.5 0	2,478 .44	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9325	捷成股 份	2022- 06-13	309,1 90.00	63,100.00	28	3.5 0	841.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9327	光环新 网	2022- 06-13	390,0 05.00	38,500.00	28	3.5 0	1,061 .68	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9329	道通科 技	2022- 06-13	296,5 94.00	8,200.00	28	3.5 0	807.3 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9331	光威复 材	2022- 06-13	539,5 05.00	9,500.00	28	3.5 0	1,468 .65	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9333	博腾股 份	2022- 06-13	779,1 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,120 .88	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9335	光线传 媒	2022- 06-13	307,6 63.00	35,900.00	28	3.5 0	837.5 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9337	汤臣倍 健	2022- 06-13	514,8 00.00	26,000.00	28	3.5 0	1,401 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0613 0001 9339	红日药 业	2022- 06-13	320,7 12.00	55,200.00	28	3.5 0	873.0 5	-	-
广发证	2022	机器人	2022-	323,5	38,200.00	28	3.5	880.7	-	-

券股份 有限公司	0613 0001 9341		06-13	54.00			0	9		
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1187	三聚环 保	2022- 06-13	205,6 32.00	43,200.00	28	3.5 0	559.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1189	蓝色光 标	2022- 06-13	473,8 23.00	76,300.00	28	3.5 0	1,289 .85	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1191	安科生 物	2022- 06-13	328,8 87.00	35,100.00	28	3.5 0	895.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1195	我武生 物	2022- 06-13	447,4 56.00	9,600.00	28	3.5 0	1,218 .07	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1197	网宿科 技	2022- 06-13	388,5 00.00	75,000.00	28	3.5 0	1,057 .58	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1199	开山股 份	2022- 06-13	177,5 07.00	12,100.00	28	3.5 0	483.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1201	信维通 信	2022- 06-13	469,1 60.00	29,600.00	28	3.5 0	1,277 .16	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1203	昆仑万 维	2022- 06-13	437,7 42.00	29,300.00	28	3.5 0	1,191 .63	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0002 1205	中际旭 创	2022- 06-13	560,8 80.00	17,100.00	28	3.5 0	1,526 .84	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0616 0000 1216	华大基 因	2022- 06-16	1,874 ,040. 00	28,000.00	28	3.1 0	4,518 .52	-	-
广发证 券股份	2022 0617	英科医 疗	2022- 06-17	230,1 12.00	9,400.00	28	3.1 0	554.8 3	-	-

有限公司	0000 2318										
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2319	当升科 技	2022- 06-17	818,9 31.00	8,700.00	28	3.1 0	1,974 .53	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2320	宋城演 艺	2022- 06-17	389,6 85.00	31,300.00	28	3.1 0	939.5 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2322	稳健医 疗	2022- 06-17	155,2 80.00	2,400.00	28	3.1 0	374.4 0	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2324	华测检 测	2022- 06-17	668,4 18.00	30,300.00	28	3.1 0	1,611 .63	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2326	贝达药 业	2022- 06-17	297,3 30.00	5,300.00	28	3.1 0	716.9 0	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2332	君实生 物	2022- 06-17	671,5 00.00	7,900.00	28	3.1 0	1,619 .06	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2336	中控技 术	2022- 06-17	469,6 80.00	6,000.00	28	3.1 0	1,132 .45	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2338	康希诺	2022- 06-17	278,4 90.00	1,500.00	28	3.1 0	671.4 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2340	西部超 导	2022- 06-17	497,8 38.00	5,700.00	28	3.1 0	1,200 .34	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2342	固德威	2022- 06-17	399,0 00.00	1,200.00	28	3.1 0	962.0 3	-	-	
广发证 券股份 有限公 司	2022 0620 0000	九号公 司	2022- 06-20	353,0 20.00	7,600.00	28	3.1 0	851.1 7	-	-	

司	1644									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0623 0000 8533	微芯生 物	2022- 06-23	758,1 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,827 .86	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0623 0000 8535	易华录	2022- 06-23	177,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	428.7 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0627 0000 0271	碧水源	2022- 06-27	707,8 20.00	141,000.0 0	28	3.1 0	1,828 .54	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0628 0001 0894	圣湘生 物	2022- 06-28	48,06 4.00	1,600.00	28	3.1 0	115.8 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0630 0001 5575	圣湘生 物	2022- 06-30	384,9 30.00	13,000.00	28	3.1 0	928.1 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0706 0001 3019	碧水源	2022- 07-06	65,39 0.00	13,000.00	28	3.5 0	178.0 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0707 0000 7758	易华录	2022- 07-07	115,7 80.00	7,000.00	28	3.1 0	279.1 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8862	捷成股 份	2022- 07-11	315,5 00.00	63,100.00	28	3.5 0	858.8 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8864	光线传 媒	2022- 07-11	300,4 83.00	35,900.00	28	3.5 0	817.9 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8868	信维通 信	2022- 07-11	488,6 96.00	29,600.00	28	3.5 0	1,330 .34	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8876	汤臣倍 健	2022- 07-11	530,6 60.00	26,000.00	28	3.5 0	1,444 .57	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8878	开山股 份	2022- 07-11	183,5 57.00	12,100.00	28	3.5 0	499.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8880	光环新 网	2022- 07-11	371,1 40.00	38,500.00	28	3.5 0	1,010 .33	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8884	博腾股 份	2022- 07-11	790,8 00.00	10,000.00	28	3.5 0	2,152 .73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8888	昆仑万 维	2022- 07-11	435,9 84.00	29,300.00	28	3.5 0	1,186 .85	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8890	国瓷材 料	2022- 07-11	791,1 36.00	24,600.00	28	3.5 0	2,153 .65	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8896	中际旭 创	2022- 07-11	514,3 68.00	17,100.00	28	3.5 0	1,400 .22	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8904	海新能 科	2022- 07-11	223,3 44.00	43,200.00	28	3.5 0	607.9 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8906	我武生 物	2022- 07-11	501,4 08.00	9,600.00	28	3.5 0	1,364 .94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8908	红日药 业	2022- 07-11	400,7 52.00	55,200.00	28	3.5 0	1,090 .94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8912	安科生 物	2022- 07-11	350,6 49.00	35,100.00	28	3.5 0	954.5 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0711 0001 8914	蓝色光 标	2022- 07-11	466,1 93.00	76,300.00	28	3.5 0	1,269 .08	-	-
广发证	2022	机器人	2022-	395,7	38,200.00	28	3.5	1,077	-	-

券股份 有限公司	0711 0001 8916		07-11	52.00			0	.32		
广发证 券股份 有限公司	2022 0711 0001 8920	道通科 技	2022- 07-11	247,4 76.00	8,200.00	28	3.5 0	673.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0711 0001 8922	网宿科 技	2022- 07-11	384,7 50.00	75,000.00	28	3.5 0	1,047 .38	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0711 0001 8938	光威复 材	2022- 07-11	563,3 50.00	9,500.00	28	3.5 0	1,533 .56	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0714 0001 2818	华大基 因	2022- 07-14	1,877 ,960. 00	28,000.00	28	3.1 0	4,527 .97	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 3131	宋城演 艺	2022- 07-15	413,4 73.00	31,300.00	28	3.1 0	996.9 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 3133	当升科 技	2022- 07-15	935,6 85.00	8,700.00	28	3.1 0	2,256 .04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 3135	华测检 测	2022- 07-15	642,9 66.00	30,300.00	28	3.1 0	1,550 .26	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 5131	中控技 术	2022- 07-15	402,3 00.00	6,000.00	28	3.1 0	969.9 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 5135	康希诺	2022- 07-15	259,6 95.00	1,500.00	28	3.1 0	626.1 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 5137	固德威	2022- 07-15	445,2 00.00	1,200.00	28	3.1 0	1,073 .43	-	-
广发证 券股份	2022 0715	君实生 物	2022- 07-15	538,8 59.00	7,900.00	28	3.1 0	1,299 .25	-	-

有限公司	0001 5141									
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 5143	西部超 导	2022- 07-15	549,0 24.00	5,700.00	28	3.1 0	1,323 .76	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 5145	贝达药 业	2022- 07-15	287,2 60.00	5,300.00	28	3.1 0	692.6 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0715 0001 5147	稳健医 疗	2022- 07-15	176,2 56.00	2,400.00	28	3.1 0	424.9 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0718 0001 6227	九号公 司	2022- 07-18	360,3 92.00	7,600.00	28	3.1 0	868.9 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0721 0000 8426	易华录	2022- 07-21	175,8 00.00	10,000.00	28	3.1 0	423.8 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0721 0000 8428	微芯生 物	2022- 07-21	753,3 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,816 .29	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0726 0000 9350	圣湘生 物	2022- 07-26	45,79 2.00	1,600.00	28	3.1 0	110.4 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0727 0002 5666	碧水源	2022- 07-27	793,8 30.00	141,000.0 0	28	3.1 0	1,914 .01	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0728 0001 4409	圣湘生 物	2022- 07-28	388,8 30.00	13,000.00	12	3.1 0	401.7 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0803 0000 2150	机器人	2022- 08-03	398,0 44.00	38,200.00	28	3.1 0	959.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0803 0000	蓝色光 标	2022- 08-03	276,0 00.00	50,000.00	28	3.1 0	665.4 7	-	-

司	2152									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0803 0000 2155	中际旭 创	2022- 08-03	556,6 05.00	17,100.00	28	3.1 0	1,342 .04	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0803 0000 2158	万孚生 物	2022- 08-03	326,3 25.00	9,500.00	28	3.1 0	786.8 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0803 0000 2165	光线传 媒	2022- 08-03	295,4 57.00	35,900.00	28	3.1 0	712.3 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0803 0000 2167	睿创微 纳	2022- 08-03	320,9 22.00	8,100.00	28	3.1 0	773.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0803 0001 3439	碧水源	2022- 08-03	69,68 0.00	13,000.00	28	3.5 0	189.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1560	信维通 信	2022- 08-09	529,8 40.00	29,600.00	28	3.1 0	1,277 .50	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1563	蓝色光 标	2022- 08-09	434,9 10.00	76,300.00	28	3.1 0	1,048 .62	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1564	网宿科 技	2022- 08-09	406,5 00.00	75,000.00	28	3.1 0	980.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1566	开山股 份	2022- 08-09	193,9 63.00	12,100.00	28	3.1 0	467.6 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1568	汤臣倍 健	2022- 08-09	455,2 60.00	26,000.00	28	3.1 0	1,097 .68	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1569	昆仑万 维	2022- 08-09	413,1 30.00	29,300.00	28	3.1 0	996.1 0	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1573	捷成股 份	2022- 08-09	324,9 65.00	63,100.00	28	3.1 0	783.5 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1574	光威复 材	2022- 08-09	705,8 50.00	9,500.00	28	3.1 0	1,701 .88	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0809 0000 1579	海新能 科	2022- 08-09	209,5 20.00	43,200.00	28	3.1 0	505.1 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0811 0001 5874	华大基 因	2022- 08-11	1,731 ,240. 00	28,000.00	28	3.1 0	4,174 .21	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 8677	宋城演 艺	2022- 08-12	399,3 88.00	31,300.00	28	3.1 0	962.9 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 8679	当升科 技	2022- 08-12	816,2 34.00	8,700.00	28	3.1 0	1,968 .03	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 8681	华测检 测	2022- 08-12	625,9 98.00	30,300.00	28	3.1 0	1,509 .35	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 8687	贝达药 业	2022- 08-12	275,2 29.00	5,300.00	28	3.1 0	663.6 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 8689	稳健医 疗	2022- 08-12	177,0 48.00	2,400.00	28	3.1 0	426.8 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 9105	西部超 导	2022- 08-12	619,8 18.00	5,700.00	28	3.1 0	1,494 .45	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0812 0001 9121	中控技 术	2022- 08-12	507,0 60.00	6,000.00	28	3.1 0	1,222 .58	-	-
广发证	2022	康希诺	2022-	250,5	1,500.00	28	3.1	603.9	-	-

券股份 有限公司	0812 0001 9125		08-12	00.00			0	8		
广发证 券股份 有限公司	2022 0812 0001 9127	固德威	2022- 08-12	433,2 00.00	1,200.00	28	3.1 0	1,044 .49	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0812 0001 9131	君实生 物	2022- 08-12	473,1 31.00	7,900.00	28	3.1 0	1,140 .77	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0815 0001 5809	九号公 司	2022- 08-15	414,5 80.00	7,600.00	28	3.1 0	1,035 .30	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0818 0001 6507	易华录	2022- 08-18	175,1 00.00	10,000.00	14	3.1 0	211.0 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0818 0001 6509	微芯生 物	2022- 08-18	815,1 00.00	30,000.00	28	3.1 0	1,965 .30	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0823 0001 5122	圣湘生 物	2022- 08-23	44,36 8.00	1,600.00	28	3.1 0	106.9 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0824 0002 7341	碧水源	2022- 08-24	786,7 80.00	141,000.0 0	28	3.1 0	1,897 .01	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0831 0001 4942	万孚生 物	2022- 08-31	310,0 80.00	9,500.00	28	3.1 0	747.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0831 0001 4948	蓝色光 标	2022- 08-31	284,5 00.00	50,000.00	28	3.1 0	685.9 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0831 0001 4952	中际旭 创	2022- 08-31	501,3 72.00	17,100.00	28	3.1 0	1,208 .86	-	-
广发证 券股份	2022 0831	机器人	2022- 08-31	373,2 14.00	38,200.00	28	3.1 0	899.8 6	-	-

有限公司	0001 5032									
广发证 券股份 有限公司	2022 0831 0001 7396	碧水源	2022- 08-31	71,63 0.00	13,000.00	28	3.5 0	194.9 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0831 0001 7400	光线传 媒	2022- 08-31	332,0 75.00	35,900.00	28	3.1 0	800.6 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0831 0001 7408	睿创微 纳	2022- 08-31	352,9 98.00	8,100.00	28	3.1 0	851.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 5273	信维通 信	2022- 09-06	509,1 20.00	29,600.00	28	3.1 0	1,490 .59	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 5275	光威复 材	2022- 09-06	768,4 55.00	9,500.00	28	3.1 0	2,249 .87	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 5277	网宿科 技	2022- 09-06	382,5 00.00	75,000.00	28	3.1 0	1,119 .88	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 5281	海新能 科	2022- 09-06	206,0 64.00	43,200.00	28	3.1 0	603.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 5291	汤臣倍 健	2022- 09-06	470,0 80.00	26,000.00	28	3.1 0	1,376 .29	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 5293	捷成股 份	2022- 09-06	338,8 47.00	63,100.00	28	3.1 0	992.0 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0906 0001 7731	开山股 份	2022- 09-06	233,2 88.00	12,100.00	28	3.1 0	683.0 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0906 0001	昆仑万 维	2022- 09-06	417,5 25.00	29,300.00	28	3.1 0	1,222 .42	-	-

司	7747									
广发证 券股份 有限公 司	2022 0908 0001 6366	华大基 因	2022- 09-08	1,652 ,000. 00	28,000.00	28	3.1 0	4,552 .18	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2011	当升科 技	2022- 09-09	683,9 07.00	8,700.00	28	3.1 0	1,825 .65	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2013	固德威	2022- 09-09	370,8 00.00	1,200.00	28	3.1 0	989.8 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2015	西部超 导	2022- 09-09	652,0 80.00	5,700.00	28	3.1 0	1,740 .69	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2371	贝达药 业	2022- 09-09	237,1 75.00	5,300.00	28	3.1 0	633.1 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2373	稳健医 疗	2022- 09-09	162,4 32.00	2,400.00	28	3.1 0	433.6 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2375	宋城演 艺	2022- 09-09	396,2 58.00	31,300.00	28	3.1 0	1,057 .79	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2377	康希诺	2022- 09-09	204,1 50.00	1,500.00	28	3.1 0	544.9 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2379	君实生 物	2022- 09-09	424,3 88.00	7,900.00	28	3.1 0	1,132 .88	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 2381	华测检 测	2022- 09-09	655,6 92.00	30,300.00	28	3.1 0	1,750 .33	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0909 0002 3269	中控技 术	2022- 09-09	469,4 40.00	6,000.00	28	3.1 0	1,253 .14	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0913 0000 1705	万达信 息	2022- 09-13	129,3 60.00	15,400.00	14	3.2 0	160.9 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0913 0002 5833	九号公 司	2022- 09-13	323,7 60.00	7,600.00	28	3.1 0	780.6 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0915 0000 1702	万达信 息	2022- 09-15	108,5 04.00	13,200.00	14	3.5 0	147.6 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0920 0001 7373	圣湘生 物	2022- 09-20	38,22 4.00	1,600.00	28	3.1 0	92.16	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0922 0000 0898	碧水源	2022- 09-22	22,32 0.00	4,500.00	14	3.2 0	35.71	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0927 0002 5871	万达信 息	2022- 09-27	119,5 04.00	15,400.00	14	3.2 0	148.7 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0928 0001 6255	机器人	2022- 09-28	339,9 80.00	38,200.00	28	3.1 0	819.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0928 0001 6257	碧水源	2022- 09-28	62,79 0.00	13,000.00	28	3.5 0	170.9 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0928 0001 6261	蓝色光 标	2022- 09-28	232,0 00.00	50,000.00	28	3.1 0	559.3 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0928 0001 6263	万孚生 物	2022- 09-28	277,9 70.00	9,500.00	28	3.1 0	670.2 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0928 0001 6307	中际旭 创	2022- 09-28	461,0 16.00	17,100.00	28	3.1 0	1,111 .56	-	-
广发证	2022	光线传	2022-	262,7	35,900.00	28	3.1	633.6	-	-

券股份 有限公司	0928 0001 6311	媒	09-28	88.00			0	1		
广发证 券股份 有限公司	2022 0928 0001 6333	睿创微 纳	2022- 09-28	306,7 47.00	8,100.00	28	3.1 0	739.6 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0929 0001 4457	万达信 息	2022- 09-29	98,20 8.00	13,200.00	14	3.5 0	133.6 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0007 9139	海新能 科	2022- 10-10	174,5 28.00	43,200.00	28	3.1 0	420.8 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0007 9161	信维通 信	2022- 10-10	409,6 64.00	29,600.00	28	3.1 0	987.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0008 0391	碧水源	2022- 10-10	21,10 5.00	4,500.00	14	3.2 0	26.26	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0008 7151	宋城演 艺	2022- 10-10	350,5 60.00	31,300.00	28	3.1 0	845.2 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 0195	贝达药 业	2022- 10-10	234,7 90.00	5,300.00	28	3.1 0	566.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 0197	稳健医 疗	2022- 10-10	163,2 24.00	2,400.00	28	3.1 0	393.5 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 5057	中控技 术	2022- 10-10	443,8 80.00	6,000.00	28	3.1 0	1,070 .24	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 5161	康希诺	2022- 10-10	174,9 00.00	1,500.00	28	3.1 0	421.7 0	-	-
广发证 券股份	2022 1010	君实生 物	2022- 10-10	370,3 52.00	7,900.00	28	3.1 0	892.9 6	-	-

有限公司	0009 5163									
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 5167	固德威	2022- 10-10	331,1 88.00	1,200.00	28	3.1 0	798.5 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 5169	西部超 导	2022- 10-10	579,1 20.00	5,700.00	28	3.1 0	1,396 .32	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 8903	华测检 测	2022- 10-10	605,6 97.00	30,300.00	28	3.1 0	1,460 .40	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0009 9995	当升科 技	2022- 10-10	560,4 54.00	8,700.00	28	3.1 0	1,351 .32	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0010 0419	捷成股 份	2022- 10-10	276,3 78.00	63,100.00	28	3.1 0	666.3 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0010 0423	开山股 份	2022- 10-10	227,9 64.00	12,100.00	28	3.1 0	549.6 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0010 0429	光威复 材	2022- 10-10	753,5 40.00	9,500.00	28	3.1 0	1,816 .87	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0010 0435	网宿科 技	2022- 10-10	333,0 00.00	75,000.00	28	3.1 0	802.9 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0010 0439	昆仑万 维	2022- 10-10	355,4 09.00	29,300.00	28	3.1 0	856.9 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1010 0010 0443	汤臣倍 健	2022- 10-10	451,3 60.00	26,000.00	28	3.1 0	1,088 .28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1011 0002	万达信 息	2022- 10-11	113,0 36.00	15,400.00	14	3.2 0	140.6 7	-	-

司	5593									
广发证 券股份 有限公 司	2022 1011 0002 6731	九号公 司	2022- 10-11	284,3 16.00	7,600.00	28	3.1 0	685.5 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1013 0001 6312	万达信 息	2022- 10-13	103,4 88.00	13,200.00	14	3.5 0	140.8 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1018 0000 6967	圣湘生 物	2022- 10-18	40,57 6.00	1,600.00	28	3.1 0	97.83	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0001 8440	中际旭 创	2022- 10-26	490,9 41.00	17,100.00	28	3.1 0	1,183 .71	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0001 8442	机器人	2022- 10-26	353,7 32.00	38,200.00	28	3.1 0	852.8 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0001 8444	万孚生 物	2022- 10-26	294,6 90.00	9,500.00	28	3.1 0	710.5 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0001 8472	光线传 媒	2022- 10-26	251,6 59.00	35,900.00	28	3.1 0	606.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0002 3282	睿创微 纳	2022- 10-26	360,8 55.00	8,100.00	28	3.1 0	870.0 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0002 3300	碧水源	2022- 10-26	64,09 0.00	13,000.00	28	3.5 0	174.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1026 0002 3302	蓝色光 标	2022- 10-26	230,5 00.00	50,000.00	28	3.1 0	555.7 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1027 0001 6825	万达信 息	2022- 10-27	112,9 92.00	13,200.00	14	3.5 0	153.7 9	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0007 8573	光威复 材	2022- 11-07	697,3 00.00	9,500.00	28	3.1 0	1,681 .27	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0007 9675	康希诺	2022- 11-07	387,0 00.00	1,500.00	28	3.1 0	933.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0007 9677	君实生 物	2022- 11-07	554,2 64.00	7,900.00	28	3.1 0	1,336 .39	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0007 9689	昆仑万 维	2022- 11-07	401,9 96.00	29,300.00	28	3.1 0	969.2 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0008 1263	贝达药 业	2022- 11-07	260,9 19.00	5,300.00	28	3.1 0	629.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0008 1265	稳健医 疗	2022- 11-07	169,0 08.00	2,400.00	28	3.1 0	407.5 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0008 7435	固德威	2022- 11-07	463,2 00.00	1,200.00	28	3.1 0	1,116 .83	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0008 7439	西部超 导	2022- 11-07	596,7 90.00	5,700.00	28	3.1 0	1,438 .93	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0009 0477	网宿科 技	2022- 11-07	412,5 00.00	75,000.00	28	3.1 0	994.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0009 2899	汤臣倍 健	2022- 11-07	475,2 80.00	26,000.00	28	3.1 0	1,145 .95	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1107 0009 2923	中控技 术	2022- 11-07	536,4 00.00	6,000.00	28	3.1 0	1,293 .32	-	-
广发证	2022	信维通	2022-	507,6	29,600.00	28	3.1	1,223	-	-

券股份 有限公司	1107 0009 2933	信	11-07	40.00			0	.98		
广发证 券股份 有限公司	2022 1107 0009 2937	海新能 科	2022- 11-07	183,6 00.00	43,200.00	28	3.1 0	442.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1107 0009 4075	宋城演 艺	2022- 11-07	424,7 41.00	31,300.00	28	3.1 0	1,024 .10	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1107 0009 4077	当升科 技	2022- 11-07	571,5 90.00	8,700.00	28	3.1 0	1,378 .17	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1107 0009 4107	华测检 测	2022- 11-07	625,0 89.00	30,300.00	28	3.1 0	1,507 .16	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1107 0009 4159	捷成股 份	2022- 11-07	304,7 73.00	63,100.00	28	3.1 0	734.8 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1107 0009 4161	开山股 份	2022- 11-07	223,8 50.00	12,100.00	28	3.1 0	539.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1108 0002 4785	九号公 司	2022- 11-08	252,0 92.00	7,600.00	28	3.1 0	607.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1110 0001 9546	万达信 息	2022- 11-10	121,8 36.00	13,200.00	14	3.5 0	165.8 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1115 0000 9196	圣湘生 物	2022- 11-15	42,83 2.00	1,600.00	14	3.1 0	51.64	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 1117 0000 0607	蓝色光 标	2022- 11-17	127,1 62.00	21,700.00	14	3.2 0	158.2 5	-	-
广发证 券股份	2022 1123	万孚生 物	2022- 11-23	375,6 30.00	9,500.00	28	3.1 0	905.6 9	-	-

有限公司	0001 4864										
广发证 券股份 有限公司	2022 1123 0001 4872	机器人	2022- 11-23	373,5 96.00	38,200.00	28	3.1 0	900.7 8	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1123 0001 4874	蓝色光 标	2022- 11-23	274,5 00.00	50,000.00	28	3.1 0	661.8 5	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1123 0001 4878	睿创微 纳	2022- 11-23	350,5 68.00	8,100.00	28	3.1 0	845.2 6	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1123 0001 4882	中际旭 创	2022- 11-23	498,2 94.00	17,100.00	28	3.1 0	1,201 .44	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1123 0001 4884	光线传 媒	2022- 11-23	271,4 04.00	35,900.00	28	3.1 0	654.3 9	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1124 0001 6396	万达信 息	2022- 11-24	121,1 76.00	13,200.00	14	3.5 0	164.9 3	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1205 0002 0162	康希诺	2022- 12-05	280,3 20.00	1,500.00	7	3.1 0	168.9 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1205 0002 0204	贝达药 业	2022- 12-05	265,0 53.00	5,300.00	7	3.1 0	159.7 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1205 0002 0206	稳健医 疗	2022- 12-05	179,7 60.00	2,400.00	7	3.1 0	108.3 6	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1205 0002 4472	宋城演 艺	2022- 12-05	445,7 12.00	31,300.00	7	3.1 0	268.6 7	-	-	
广发证 券股份 有限公司	2022 1205 0002	当升科 技	2022- 12-05	537,6 60.00	8,700.00	7	3.1 0	324.0 9	-	-	

司	4474									
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5426	中控技 术	2022- 12-05	552,4 80.00	6,000.00	7	3.1 0	333.0 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5444	固德威	2022- 12-05	375,6 00.00	1,200.00	7	3.1 0	226.4 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5446	西部超 导	2022- 12-05	545,2 05.00	5,700.00	7	3.1 0	328.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5608	开山股 份	2022- 12-05	185,3 72.00	12,100.00	28	3.1 0	415.0 3	181,500.00	415.03
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5616	信维通 信	2022- 12-05	514,7 44.00	29,600.00	28	3.1 0	1,152 .45	488,696.00	1,152.45
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5620	海新能 科	2022- 12-05	187,9 20.00	43,200.00	28	3.1 0	420.7 3	188,352.00	420.73
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 5624	捷成股 份	2022- 12-05	309,1 90.00	63,100.00	28	3.1 0	692.2 4	282,057.00	692.24
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0002 9446	华测检 测	2022- 12-05	655,9 95.00	30,300.00	7	3.1 0	395.4 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0003 0042	光威复 材	2022- 12-05	668,8 00.00	9,500.00	28	3.1 0	1,497 .37	686,375.00	1,497.37
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0003 0058	汤臣倍 健	2022- 12-05	553,8 00.00	26,000.00	28	3.1 0	1,239 .90	593,320.00	1,239.90
广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0003 0078	网宿科 技	2022- 12-05	426,0 00.00	75,000.00	28	3.1 0	953.7 7	418,500.00	953.77

广发证 券股份 有限公 司	2022 1205 0003 0082	昆仑万 维	2022- 12-05	427,4 87.00	29,300.00	28	3.1 0	957.1 0	422,213.00	957.10
广发证 券股份 有限公 司	2022 1206 0000 1814	卫宁健 康	2022- 12-06	322,0 43.00	30,700.00	14	3.2 0	400.7 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1206 0000 1820	长信科 技	2022- 12-06	96,43 2.00	14,700.00	14	3.2 0	120.0 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1206 0000 1821	红日药 业	2022- 12-06	59,40 8.00	9,400.00	14	3.2 0	73.93	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1206 0000 1841	九号公 司	2022- 12-06	478,8 56.00	13,600.00	14	3.2 0	595.9 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1206 0001 6496	九号公 司	2022- 12-06	267,5 96.00	7,600.00	13	3.1 0	299.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1208 0001 5729	万达信 息	2022- 12-08	127,5 12.00	13,200.00	14	3.5 0	173.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 1219 0000 2955	晶晨股 份	2022- 12-19	102,4 80.00	1,400.00	14	3.2 0	109.3 1	98,714.00	109.31
广发证 券股份 有限公 司	2022 1219 0000 3000	朗新科 技	2022- 12-19	340,9 12.00	14,300.00	14	3.2 0	363.6 4	314,314.00	363.64
广发证 券股份 有限公 司	2022 1219 0000 3041	易事特	2022- 12-19	349,4 08.00	48,800.00	14	3.2 0	372.7 0	333,304.00	372.70
广发证 券股份 有限公 司	2022 1220 0000 2565	晶晨股 份	2022- 12-20	110,9 25.00	1,500.00	14	3.2 0	108.4 6	105,765.00	108.46
广发证	2022	安科生	2022-	24,62	2,500.00	14	3.2	24.08	23,400.00	24.08

券股份 有限公司	1220 0000 2687	物	12-20	5.00			0			
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0000 2688	宋城演 艺	2022- 12-20	482,2 47.00	33,700.00	14	3.2 0	471.5 3	492,020.00	471.53
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0000 2694	易事特	2022- 12-20	26,75 1.00	3,700.00	14	3.2 0	26.16	25,271.00	26.16
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0000 2695	华大基 因	2022- 12-20	342,4 00.00	6,400.00	14	3.2 0	334.7 9	330,816.00	334.79
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0000 2697	景嘉微	2022- 12-20	123,7 28.00	2,200.00	14	3.2 0	120.9 8	120,054.00	120.98
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0000 2698	长川科 技	2022- 12-20	554,6 40.00	12,000.00	14	3.2 0	542.3 1	534,960.00	542.31
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0001 6430	九号公 司	2022- 12-20	446,3 52.00	13,600.00	14	3.2 0	436.4 3	414,664.00	436.43
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0001 9580	红日药 业	2022- 12-20	54,61 4.00	9,400.00	14	3.2 0	53.40	53,392.00	53.40
广发证 券股份 有限公司	2022 1220 0001 9582	卫宁健 康	2022- 12-20	288,8 87.00	30,700.00	14	3.2 0	282.4 7	315,596.00	282.47
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0000 4903	红日药 业	2022- 12-21	314,3 21.00	54,100.00	14	3.2 0	279.4 0	307,288.00	279.40
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0000 4905	易事特	2022- 12-21	565,3 80.00	81,000.00	14	3.2 0	502.5 6	553,230.00	502.56
广发证 券股份	2022 1221	中际旭 创	2022- 12-21	983,0 04.00	36,300.00	14	3.2 0	873.7 8	981,189.00	873.78

有限公司	0000 4914									
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0002 0415	机器人	2022- 12-21	349,5 30.00	38,200.00	28	3.1 0	300.9 8	343,036.00	300.98
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0002 0417	蓝色光 标	2022- 12-21	245,0 00.00	50,000.00	28	3.1 0	210.9 7	252,500.00	210.97
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0002 0419	光线传 媒	2022- 12-21	296,1 75.00	35,900.00	28	3.1 0	255.0 4	310,894.00	255.04
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0002 0425	中际旭 创	2022- 12-21	463,0 68.00	17,100.00	28	3.1 0	398.7 5	462,213.00	398.75
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0002 0431	睿创微 纳	2022- 12-21	308,7 72.00	8,100.00	28	3.1 0	265.8 9	301,239.00	265.89
广发证 券股份 有限公司	2022 1221 0002 2227	万孚生 物	2022- 12-21	346,8 45.00	9,500.00	28	3.1 0	298.6 7	302,765.00	298.67
广发证 券股份 有限公司	2022 1222 0000 2168	长信科 技	2022- 12-22	77,81 4.00	13,100.00	14	3.2 0	62.25	78,207.00	62.25
广发证 券股份 有限公司	2022 1222 0001 6747	万达信 息	2022- 12-22	112,4 64.00	13,200.00	14	3.5 0	98.41	111,276.00	98.41
广发证 券股份 有限公司	2022 1223 0000 2181	新宙邦	2022- 12-23	279,3 90.00	6,700.00	14	3.2 0	198.6 8	291,249.00	198.68
广发证 券股份 有限公司	2022 1227 0000 2119	迈克生 物	2022- 12-27	291,8 28.00	16,600.00	14	3.2 0	103.7 6	287,180.00	103.76
广发证 券股份 有限公	2022 1227 0000	新产业	2022- 12-27	437,3 10.00	9,000.00	14	3.2 0	155.4 9	451,260.00	155.49

司	2126									
上年度可比期间										
2021年1月1日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:股)	出借期限 (单位:天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	2021080500001198	微芯生物	2021-08-05	1,519,792.00	37,600.00	28	3.10	3,664.39	-	-
广发证券股份有限公司	2021090200011066	微芯生物	2021-09-02	1,394,960.00	37,600.00	28	3.10	3,363.40	-	-
广发证券股份有限公司	2021093000012841	微芯生物	2021-09-30	1,413,008.00	37,600.00	28	3.10	3,406.92	-	-
广发证券股份有限公司	2021102800012999	微芯生物	2021-10-28	1,387,440.00	37,600.00	28	3.10	3,345.27	-	-
广发证券股份有限公司	2021111900001036	易华录	2021-11-19	1,368,580.00	41,000.00	28	3.10	3,299.80	-	-
广发证券股份有限公司	2021112500008618	微芯生物	2021-11-25	1,397,968.00	37,600.00	28	3.10	3,370.66	-	-
广发证券股份有限公司	2021120300001006	北京君正	2021-12-03	3,101,280.00	21,000.00	28	3.10	7,477.53	-	-
广发证券股份有限公司	2021120600000977	微芯生物	2021-12-06	365,700.00	10,000.00	28	3.10	787.27	350,100.00	787.27
广发证券股份有限公司	2021121700001486	易华录	2021-12-17	338,000.00	10,000.00	28	3.10	407.48	353,500.00	407.48
广发证	2021	微芯生	2021-	1,290	37,600.00	28	3.1	889.2	1,316,376.0	889.22

券股份 有限公司	1223 0001 1695	物	12-23	,808. 00			0	2	0	
广发证 券股份 有限公司	2021 1228 0000 0923	易华录	2021- 12-28	258,0 14.00	7,100.00	28	3.1 0	66.65	250,985.00	66.65
广发证 券股份 有限公司	2021 1231 0002 4278	北京君 正	2021- 12-31	2,814 ,000. 00	21,000.00	28	3.1 0	-	2,814,000.0 0	-

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发中证 500 交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金(LOF)	1,353,028,321.00	84.19%	1,183,711,221.00	83.30%
广发证券股份有 限公司	12,406,881.00	0.77%	27,904,001.00	1.96%

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

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31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	22,902,280.53	129,567.94	28,793,490.70	127,384.29

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。

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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。本基金本报告期末持有 315,948 股基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股（2021 年 12 月 31 日：294,848 股），成本总额为人民币 5,112,817.47 元（2021 年 12 月 31 日：5,419,594.32 元），估值总额为 4,151,556.72 元（2021 年 12 月 31 日：5,301,367.04 元），占本基金资产净值的比例为 0.15%（2021 年 12 月 31 日：0.17%）。

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（2022 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688380	中微半导	2022-07-29	6 个月	新股流通受限	30.86	26.44	12,677.00	391,212.22	335,179.88	-
688332	中科蓝讯	2022-07-08	6 个月	新股流通受限	91.66	50.21	5,870.00	538,044.20	294,732.70	20221026 除权除

										息,派 息比 例 0.5500 (含税)
30109 5	广立 微	2022-0 7-28	6 个月	新股 流通 受限	58.00	86.49	740.00	42,920 .00	64,002 .60	-
30132 7	华宝 新能	2022-0 9-08	6 个月	新股 流通 受限	237.50	176.97	242.00	57,475 .00	42,826 .74	-
30115 2	天力 锂能	2022-0 8-19	6 个月	新股 流通 受限	57.00	46.64	433.00	24,681 .00	20,195 .12	-
30112 1	紫建 电子	2022-0 8-01	6 个月	新股 流通 受限	61.07	49.77	290.00	17,710 .30	14,433 .30	-
30133 9	通行 宝	2022-0 9-02	6 个月	新股 流通 受限	18.78	15.59	913.00	17,146 .14	14,233 .67	-
30129 7	富乐 德	2022-1 2-23	6 个月	新股 流通 受限	8.48	12.99	1,015. 00	8,607. 20	13,184 .85	-
30133 8	凯格 精机	2022-0 8-08	6 个月	新股 流通 受限	46.33	48.99	257.00	11,906 .81	12,590 .43	-
30136 6	一博 科技	2022-0 9-19	6 个月	新股 流通 受限	65.35	45.09	268.00	17,513 .80	12,084 .12	20221 207 除 权除 息,派 息比 例 0.4700 (含税)
30127 3	瑞晨 环保	2022-1 0-11	6 个月	新股 流通 受限	37.89	37.79	277.00	10,495 .53	10,467 .83	-
30126 5	华新 环保	2022-1 2-08	6 个月	新股 流通 受限	13.28	11.40	819.00	10,876 .32	9,336. 60	-
30131 8	维海 德	2022-0 8-03	6 个月	新股 流通 受限	64.68	41.74	206.00	13,324 .08	8,598. 44	20220 922 除 权除 息,派 息比

										例 0.5000 (含税)
301326	捷邦科技	2022-09-09	6 个月	新股流通受限	51.72	36.62	227.00	11,740.44	8,312.74	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346.00	6,456.36	7,518.58	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	255.00	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新股流通受限	25.25	29.14	247.00	6,236.75	7,197.58	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新股流通受限	38.46	25.31	283.00	10,884.18	7,162.73	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6 个月	新股流通受限	14.60	12.60	565.00	8,249.00	7,119.00	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新股流通受限	40.66	22.61	303.00	12,319.98	6,850.83	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新股流通受限	22.33	18.52	337.00	7,525.21	6,241.24	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新股流通受限	47.75	53.27	115.00	5,491.25	6,126.05	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6 个月	新股流通受限	25.49	20.38	275.00	7,009.75	5,604.50	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股流通受限	39.00	24.46	228.00	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	新股流通受限	41.52	34.30	158.00	6,560.16	5,419.40	-

注：截至本报告期末 2022 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债券和权证。

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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022-12-26	重大事项停牌	46.41	2023-01-10	51.05	131,260.00	6,676,064.37	6,091,776.60	
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	2023-01-10	56.88	81,600.00	4,849,036.66	4,347,648.00	

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 2022 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 2022 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

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	300003	乐普医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	22.97	157,600.00	3,620,072.00
2	002422	科伦药业	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 30 日	26.61	135,200.00	3,597,672.00
3	002966	苏州银行	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	7.78	418,300.00	3,254,374.00
4	300724	捷佳伟创	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	114.02	28,100.00	3,203,962.00
5	002385	大北农	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	8.90	351,200.00	3,125,680.00
6	600079	人福医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	23.89	128,600.00	3,072,254.00
7	600988	赤峰黄金	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	18.05	153,000.00	2,761,650.00

8	300390	天华超净	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	55.88	48,500.00	2,710,180.0 0
9	603605	珀莱雅	2023 年 1 月 11 日	167.4 8	16,000.00	2,679,680.0 0
10	002738	中矿资源	2023 年 1 月 17 日 -2023 年 1 月 18 日	66.66	39,100.00	2,606,406.0 0
11	002340	格林美	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 30 日	7.43	349,800.00	2,599,014.0 0
12	603517	绝味食品	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	61.09	42,000.00	2,565,780.0 0
13	002138	顺络电子	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	26.18	96,900.00	2,536,842.0 0
14	300568	星源材质	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	21.26	113,900.00	2,421,514.0 0
15	002223	鱼跃医疗	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	31.86	71,100.00	2,265,246.0 0
16	688567	孚能科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	27.03	79,200.00	2,140,776.0 0
17	000975	银泰黄金	2023 年 1 月 9 日 -2023 年 1 月 18 日	11.04	192,300.00	2,122,992.0 0
18	000591	太阳能	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 18 日	7.33	282,100.00	2,067,793.0 0
19	603596	伯特利	2023 年 1 月 18 日	79.80	25,800.00	2,058,840.0 0
20	002603	以岭药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	29.96	67,100.00	2,010,316.0 0
21	002624	完美世界	2023 年 1 月 4 日	12.72	157,600.00	2,004,672.0 0
22	600521	华海药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	21.86	91,300.00	1,995,818.0 0
23	002407	多氟多	2023 年 1 月 3 日	33.32	59,000.00	1,965,880.0 0
24	000629	钒钛股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	4.73	414,000.00	1,958,220.0 0
25	600258	首旅酒店	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	24.80	78,800.00	1,954,240.0 0
26	600026	中远海能	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	12.05	160,700.00	1,936,435.0 0
27	002384	东山精密	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	24.73	77,600.00	1,919,048.0 0
28	000831	中国稀土	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	32.88	57,400.00	1,887,312.0 0
29	601555	东吴证券	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 12 日	6.53	284,100.00	1,855,173.0 0

30	603737	三棵树	2023 年 1 月 4 日	113.8 3	16,200.00	1,844,046.0 0
31	000630	铜陵有色	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	3.12	578,200.00	1,803,984.0 0
32	002078	太阳纸业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 5 日	11.52	156,500.00	1,802,880.0 0
33	603613	国联股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	88.44	20,300.00	1,795,332.0 0
34	600418	江淮汽车	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 12 日	13.13	136,100.00	1,786,993.0 0
35	002739	万达电影	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	14.00	125,900.00	1,762,600.0 0
36	000009	中国宝安	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 30 日	12.09	145,600.00	1,760,304.0 0
37	002030	达安基因	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	15.56	113,000.00	1,758,280.0 0
38	300308	中际旭创	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 18 日	27.03	65,000.00	1,756,950.0 0
39	002156	通富微电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	16.48	104,900.00	1,728,752.0 0
40	603233	大参林	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	39.60	43,600.00	1,726,560.0 0
41	600143	金发科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	9.69	177,000.00	1,715,130.0 0
42	600529	山东药玻	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	28.40	59,900.00	1,701,160.0 0
43	002797	第一创业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	5.63	300,100.00	1,689,563.0 0
44	300073	当升科技	2023 年 1 月 3 日	56.40	29,500.00	1,663,800.0 0
45	002353	杰瑞股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 5 日	27.91	59,500.00	1,660,645.0 0
46	600516	方大炭素	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	6.12	263,800.00	1,614,456.0 0
47	002203	海亮股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	11.30	141,700.00	1,601,210.0 0
48	600298	安琪酵母	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	45.22	35,400.00	1,600,788.0 0
49	600563	法拉电子	2023 年 1 月 2 日	159.8 8	10,000.00	1,598,800.0 0
50	300144	宋城演艺	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	14.60	108,600.00	1,585,560.0 0
51	600879	航天电子	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	6.80	233,100.00	1,585,080.0 0

52	002372	伟星新材	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	21.34	74,200.00	1,583,428.0 0
53	002444	巨星科技	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	18.98	83,000.00	1,575,340.0 0
54	603939	益丰药房	2023 年 1 月 12 日	63.84	24,400.00	1,557,696.0 0
55	002326	永太科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	21.83	70,400.00	1,536,832.0 0
56	601168	西部矿业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 5 日	10.20	150,200.00	1,532,040.0 0
57	600157	永泰能源	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 3 日	1.53	984,800.00	1,506,744.0 0
58	600380	健康元	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	11.29	132,800.00	1,499,312.0 0
59	600499	科达制造	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	14.21	105,200.00	1,494,892.0 0
60	002531	天顺风能	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	15.13	96,300.00	1,457,019.0 0
61	600415	小商品城	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	5.24	274,200.00	1,436,808.0 0
62	002506	协鑫集成	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 18 日	2.91	489,500.00	1,424,445.0 0
63	300146	汤臣倍健	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	22.82	62,100.00	1,417,122.0 0
64	600765	中航重机	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	31.09	45,500.00	1,414,595.0 0
65	300373	扬杰科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	52.60	26,800.00	1,409,680.0 0
66	600056	中国医药	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 19 日	17.23	81,700.00	1,407,691.0 0
67	300682	朗新科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	21.98	63,800.00	1,402,324.0 0
68	000636	风华高科	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 6 日	14.83	94,300.00	1,398,469.0 0
69	300026	红日药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	5.68	245,000.00	1,391,600.0 0
70	601699	潞安环能	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 17 日	16.85	82,000.00	1,381,700.0 0
71	000750	国海证券	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 12 日	3.33	413,300.00	1,376,289.0 0
72	002195	二三四五	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	2.01	683,900.00	1,374,639.0 0
73	000400	许继电气	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	19.97	68,800.00	1,373,936.0 0

74	601636	旗滨集团	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	11.39	120,200.00	1,369,078.0 0
75	300296	利亚德	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	5.66	241,100.00	1,364,626.0 0
76	002250	联化科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	15.50	87,900.00	1,362,450.0 0
77	600008	首创环保	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	2.83	480,300.00	1,359,249.0 0
78	000887	中鼎股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	14.47	93,500.00	1,352,945.0 0
79	002028	思源电气	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	38.22	35,000.00	1,337,700.0 0
80	603858	步长制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	21.01	63,200.00	1,327,832.0 0
81	688116	天奈科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	77.14	17,200.00	1,326,808.0 0
82	600160	巨化股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	15.51	85,500.00	1,326,105.0 0
83	600487	亨通光电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 6 日	15.06	87,800.00	1,322,268.0 0
84	600522	中天科技	2023 年 1 月 2 日	16.15	81,500.00	1,316,225.0 0
85	603589	口子窖	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	57.67	22,700.00	1,309,109.0 0
86	601128	常熟银行	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	7.55	173,100.00	1,306,905.0 0
87	000932	华菱钢铁	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	4.70	277,300.00	1,303,310.0 0
88	300037	新宙邦	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 11 日	43.47	29,800.00	1,295,406.0 0
89	000519	中兵红箭	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	19.64	65,600.00	1,288,384.0 0
90	600325	华发股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	9.06	141,200.00	1,279,272.0 0
91	600256	广汇能源	2023 年 1 月 2 日	9.02	140,900.00	1,270,918.0 0
92	002155	湖南黄金	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	12.95	97,700.00	1,265,215.0 0
93	300285	国瓷材料	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	27.57	45,200.00	1,246,164.0 0
94	603885	吉祥航空	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	16.18	77,000.00	1,245,860.0 0
95	600392	盛和资源	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	14.00	88,700.00	1,241,800.0 0

96	600021	上海电力	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	10.01	124,000.00	1,241,240.00
97	300251	光线传媒	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	8.66	141,000.00	1,221,060.00
98	002625	光启技术	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	17.02	71,700.00	1,220,334.00
99	601872	招商轮船	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	5.59	217,100.00	1,213,589.00
100	300168	万达信息	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	8.43	142,600.00	1,202,118.00
101	601880	辽港股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 16 日	1.62	735,500.00	1,191,510.00
102	600859	王府井	2023 年 1 月 3 日	28.14	42,300.00	1,190,322.00
103	002497	雅化集团	2023 年 1 月 11 日	23.25	50,900.00	1,183,425.00
104	601992	金隅集团	2023 年 1 月 3 日	2.54	464,400.00	1,179,576.00
105	600655	豫园股份	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	7.61	154,800.00	1,178,028.00
106	600348	华阳股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	14.25	82,300.00	1,172,775.00
107	000960	锡业股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	14.10	82,800.00	1,167,480.00
108	002939	长城证券	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	8.28	140,900.00	1,166,652.00
109	688390	固德威	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	323.09	3,600.00	1,163,124.00
110	600566	济川药业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	27.22	42,400.00	1,154,128.00
111	689009	九号公司-WD	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	30.49	37,400.00	1,140,326.00
112	601778	晶科科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 10 日	5.50	207,300.00	1,140,150.00
113	300677	英科医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	21.03	53,900.00	1,133,517.00
114	002368	太极股份	2023 年 1 月 12 日	28.13	40,200.00	1,130,826.00
115	601456	国联证券	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	11.25	100,500.00	1,130,625.00
116	002936	郑州银行	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 11 日	2.35	476,800.00	1,120,480.00
117	300850	新强联	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	53.28	21,000.00	1,118,880.00

118	000878	云南铜业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 10 日	11.75	95,200.00	1,118,600.00
119	600839	四川长虹	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	2.64	423,100.00	1,116,984.00
120	601016	节能风电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 30 日	3.81	291,500.00	1,110,615.00
121	600885	宏发股份	2023 年 1 月 11 日	33.41	33,200.00	1,109,212.00
122	000999	华润三九	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	46.81	23,500.00	1,100,035.00
123	002683	广东宏大	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	26.96	40,800.00	1,099,968.00
124	600109	国金证券	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	8.70	126,300.00	1,098,810.00
125	600673	东阳光	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	8.69	126,400.00	1,098,416.00
126	601058	赛轮轮胎	2023 年 1 月 11 日	10.02	108,800.00	1,090,176.00
127	000027	深圳能源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	6.36	170,900.00	1,086,924.00
128	600500	中化国际	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	6.61	163,200.00	1,078,752.00
129	600435	北方导航	2023 年 1 月 5 日	11.60	92,900.00	1,077,640.00
130	002244	滨江集团	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	8.83	121,900.00	1,076,377.00
131	603000	人民网	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	16.87	63,600.00	1,072,932.00
132	601108	财通证券	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	7.12	150,600.00	1,072,272.00
133	000683	远兴能源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	7.84	136,600.00	1,070,944.00
134	000998	隆平高科	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	16.07	66,600.00	1,070,262.00
135	603218	日月股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	20.30	52,700.00	1,069,810.00
136	601607	上海医药	2023 年 1 月 30 日	17.83	59,800.00	1,066,234.00
137	002183	怡亚通	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 12 日	6.43	164,800.00	1,059,664.00
138	300418	昆仑万维	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	14.41	73,400.00	1,057,694.00
139	600546	山煤国际	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	14.49	72,800.00	1,054,872.00

140	600390	五矿资本	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	5.08	205,600.00	1,044,448.0 0
141	002152	广电运通	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	9.94	104,500.00	1,038,730.0 0
142	300088	长信科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	5.97	173,700.00	1,036,989.0 0
143	600739	辽宁成大	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	12.59	82,300.00	1,036,157.0 0
144	600398	海澜之家	2023 年 1 月 3 日	5.30	193,500.00	1,025,550.0 0
145	300136	信维通信	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	16.51	61,600.00	1,017,016.0 0
146	600663	陆家嘴	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	9.74	104,400.00	1,016,856.0 0
147	603267	鸿远电子	2023 年 1 月 2 日	101.1 6	10,000.00	1,011,600.0 0
148	300482	万孚生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	31.87	31,700.00	1,010,279.0 0
149	600497	驰宏锌锗	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 18 日	5.06	199,200.00	1,007,952.0 0
150	000807	云铝股份	2023 年 1 月 11 日	11.12	90,300.00	1,004,136.0 0
151	603883	老百姓	2023 年 1 月 3 日	40.47	24,700.00	999,609.00
152	600171	上海贝岭	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	17.43	57,100.00	995,253.00
153	300604	长川科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	44.58	22,200.00	989,676.00
154	600027	华电国际	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	5.88	168,200.00	989,016.00
155	002212	天融信	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	9.99	98,900.00	988,011.00
156	000656	金科股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	1.91	513,900.00	981,549.00
157	300253	卫宁健康	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	10.28	95,300.00	979,684.00
158	600489	中金黄金	2023 年 1 月 11 日	8.19	119,100.00	975,429.00
159	002430	杭氧股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	39.36	24,600.00	968,256.00
160	300212	易华录	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	20.41	47,200.00	963,352.00
161	000883	湖北能源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	4.20	228,000.00	957,600.00
162	002299	圣农发展	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	23.69	40,300.00	954,707.00

163	600704	物产中大	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	4.81	196,800.00	946,608.00
164	600409	三友化工	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 5 日	6.61	143,000.00	945,230.00
165	002092	中泰化学	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	7.46	126,400.00	942,944.00
166	300376	易事特	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	6.83	138,000.00	942,540.00
167	600699	均胜电子	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	14.05	66,400.00	932,920.00
168	002273	水晶光电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	11.79	78,800.00	929,052.00
169	600705	中航产融	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	3.28	282,800.00	927,584.00
170	002268	电科网安	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	30.53	30,200.00	922,006.00
171	002468	申通快递	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	10.33	88,100.00	910,073.00
172	688122	西部超导	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	94.69	9,600.00	909,024.00
173	601000	唐山港	2023 年 1 月 4 日	2.74	330,100.00	904,474.00
174	000830	鲁西化工	2023 年 1 月 11 日	12.39	72,400.00	897,036.00
175	000783	长江证券	2023 年 1 月 11 日	5.33	167,900.00	894,907.00
176	600201	生物股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	9.01	98,200.00	884,782.00
177	601696	中银证券	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 11 日	10.57	83,700.00	884,709.00
178	600580	卧龙电驱	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	12.46	70,900.00	883,414.00
179	688002	睿创微纳	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 18 日	37.19	23,700.00	881,403.00
180	600511	国药股份	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 10 日	27.90	31,300.00	873,270.00
181	300463	迈克生物	2023 年 1 月 9 日 -2023 年 1 月 13 日	17.30	50,400.00	871,920.00
182	601162	天风证券	2023 年 1 月 11 日	2.87	303,300.00	870,471.00
183	603816	顾家家居	2023 年 1 月 11 日	42.71	20,300.00	867,013.00
184	600372	中航电子	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	15.97	54,000.00	862,380.00
185	300383	光环新网	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	8.16	105,500.00	860,880.00
186	000540	中天金融	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	1.51	569,400.00	859,794.00
187	600376	首开股份	2023 年 1 月 2 日	5.69	150,800.00	858,052.00

			-2023 年 1 月 30 日			
188	600062	华润双鹤	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	17.89	47,700.00	853,353.00
189	000537	广宇发展	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	13.23	64,400.00	852,012.00
190	600233	圆通速递	2023 年 1 月 2 日	20.09	42,100.00	845,789.00
191	600155	华创阳安	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 18 日	6.50	129,900.00	844,350.00
192	600567	山鹰国际	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	2.48	338,800.00	840,224.00
193	000988	华工科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	16.41	51,100.00	838,551.00
194	300676	华大基因	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	51.69	16,200.00	837,378.00
195	002745	木林森	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	8.11	103,000.00	835,330.00
196	000739	普洛药业	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	21.54	38,000.00	818,520.00
197	600909	华安证券	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	4.59	178,300.00	818,397.00
198	300070	碧水源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	4.73	171,600.00	811,668.00
199	002294	信立泰	2023 年 1 月 11 日	32.85	24,600.00	808,110.00
200	600985	淮北矿业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	12.80	62,900.00	805,120.00
201	600728	佳都科技	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 12 日	5.28	151,600.00	800,448.00
202	601156	东航物流	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	15.26	52,400.00	799,624.00
203	002511	中顺洁柔	2023 年 1 月 9 日 -2023 年 1 月 11 日	13.74	58,100.00	798,294.00
204	002019	亿帆医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	12.25	64,700.00	792,575.00
205	002131	利欧股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	1.77	443,400.00	784,818.00
206	000738	航发控制	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	25.64	30,400.00	779,456.00
207	300866	安克创新	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	59.27	13,000.00	770,510.00
208	601577	长沙银行	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	6.76	113,700.00	768,612.00
209	000559	万向钱潮	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	4.87	157,100.00	765,077.00
210	603228	景旺电子	2023 年 1 月 4 日	20.24	37,700.00	763,048.00

			-2023 年 1 月 5 日			
211	000997	新大陆	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	13.01	58,600.00	762,386.00
212	002568	百润股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	37.36	20,200.00	754,672.00
213	300024	机器人	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 18 日	8.98	84,000.00	754,320.00
214	603379	三美股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	28.46	26,500.00	754,190.00
215	600177	雅戈尔	2023 年 1 月 11 日	6.33	119,100.00	753,903.00
216	603456	九州药业	2023 年 1 月 3 日	42.43	17,700.00	751,011.00
217	603056	德邦股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	20.83	35,900.00	747,797.00
218	001914	招商积余	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	15.38	48,500.00	745,930.00
219	002128	电投能源	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	12.34	60,400.00	745,336.00
220	003035	南网能源	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	5.67	131,000.00	742,770.00
221	002416	爱施德	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 5 日	9.48	77,900.00	738,492.00
222	002572	索菲亚	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	18.16	40,500.00	735,480.00
223	600737	中粮糖业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 3 日	6.94	105,700.00	733,558.00
224	600482	中国动力	2023 年 1 月 11 日	15.29	47,900.00	732,391.00
225	000983	山西焦煤	2023 年 1 月 2 日	11.65	62,700.00	730,455.00
226	300630	普利制药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	24.66	29,600.00	729,936.00
227	600369	西南证券	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	3.75	194,400.00	729,000.00
228	600906	财达证券	2023 年 1 月 12 日	7.57	95,100.00	719,907.00
229	600166	福田汽车	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	2.81	255,700.00	718,517.00
230	600153	建发股份	2023 年 1 月 18 日	13.65	52,600.00	717,990.00
231	002408	齐翔腾达	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	7.04	101,800.00	716,672.00
232	300058	蓝色光标	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 18 日	5.05	141,300.00	713,565.00
233	300182	捷成股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 12 日	4.47	159,100.00	711,177.00
234	000728	国元证券	2023 年 1 月 11 日	6.33	112,300.00	710,859.00
235	600582	天地科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	5.20	136,400.00	709,280.00

236	002434	万里扬	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 13 日	8.05	87,800.00	706,790.00
237	603866	桃李面包	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	15.40	45,800.00	705,320.00
238	600556	天下秀	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 12 日	6.74	104,200.00	702,308.00
239	002673	西部证券	2023 年 1 月 11 日	6.09	115,000.00	700,350.00
240	002249	大洋电机	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	5.12	136,500.00	698,880.00
241	601568	北元集团	2023 年 1 月 3 日	5.67	122,900.00	696,843.00
242	002507	涪陵榨菜	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 6 日	25.77	26,900.00	693,213.00
243	002056	横店东磁	2023 年 1 月 4 日	18.74	36,900.00	691,506.00
244	601997	贵阳银行	2023 年 1 月 11 日	5.49	125,200.00	687,348.00
245	000050	深天马 A	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	8.66	79,300.00	686,738.00
246	300699	光威复材	2023 年 1 月 2 日	72.25	9,500.00	686,375.00
247	600707	彩虹股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	4.14	165,200.00	683,928.00
248	600315	上海家化	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	31.85	21,400.00	681,590.00
249	603606	东方电缆	2023 年 1 月 6 日	67.83	10,000.00	678,300.00
250	601005	重庆钢铁	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	1.58	428,400.00	676,872.00
251	600060	海信视像	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	13.54	49,300.00	667,522.00
252	300363	博腾股份	2023 年 1 月 11 日	40.85	16,300.00	665,855.00
253	600998	九州通	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	13.04	50,600.00	659,824.00
254	600095	湘财股份	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 18 日	7.56	87,000.00	657,720.00
255	601717	郑煤机	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	11.16	58,100.00	648,396.00
256	000156	华数传媒	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 6 日	7.49	86,100.00	644,889.00
257	002409	雅克科技	2023 年 1 月 11 日	50.37	12,800.00	644,736.00
258	002505	鹏都农牧	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	2.58	247,500.00	638,550.00
259	603650	彤程新材	2023 年 1 月 18 日	30.83	20,600.00	635,098.00
260	600801	华新水泥	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 3 日	14.82	42,800.00	634,296.00
261	000703	恒逸石化	2023 年 1 月 11 日	7.03	90,100.00	633,403.00
262	002281	光迅科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	15.72	40,200.00	631,944.00

263	603658	安图生物	2023 年 1 月 11 日	61.85	10,200.00	630,870.00
264	002465	海格通信	2023 年 1 月 11 日	8.12	77,600.00	630,112.00
265	300869	康泰医学	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 18 日	32.57	19,300.00	628,601.00
266	603198	迎驾贡酒	2023 年 1 月 2 日	62.78	10,000.00	627,800.00
267	601866	中远海发	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	2.42	257,200.00	622,424.00
268	601666	平煤股份	2023 年 1 月 11 日	10.81	57,000.00	616,170.00
269	000623	吉林敖东	2023 年 1 月 11 日	14.99	41,100.00	616,089.00
270	000990	诚志股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	8.80	69,700.00	613,360.00
271	002221	东华能源	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	7.63	80,200.00	611,926.00
272	300474	景嘉微	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	54.57	11,200.00	611,184.00
273	601828	美凯龙	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	4.69	130,300.00	611,107.00
274	002153	石基信息	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	14.99	40,700.00	610,093.00
275	603077	和邦生物	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	3.04	200,100.00	608,304.00
276	600131	国网信通	2023 年 1 月 3 日	14.96	40,400.00	604,384.00
277	600637	东方明珠	2023 年 1 月 11 日	6.65	90,600.00	602,490.00
278	002925	盈趣科技	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 3 日	16.52	36,200.00	598,024.00
279	002429	兆驰股份	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	3.49	171,300.00	597,837.00
280	002127	南极电商	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	4.81	124,200.00	597,402.00
281	601718	际华集团	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 12 日	2.91	204,600.00	595,386.00
282	688301	奕瑞科技	2023 年 1 月 11 日	457.8 8	1,300.00	595,244.00
283	000930	中粮科技	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	8.36	70,600.00	590,216.00
284	002508	老板电器	2023 年 1 月 11 日	27.76	21,200.00	588,512.00
285	000970	中科三环	2023 年 1 月 11 日	13.64	42,900.00	585,156.00
286	600536	中国软件	2023 年 1 月 3 日	58.33	10,000.00	583,300.00
287	002191	劲嘉股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	7.23	80,500.00	582,015.00
288	002595	豪迈科技	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	23.15	25,100.00	581,065.00
289	603638	艾迪精密	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	14.92	38,900.00	580,388.00

290	600271	航天信息	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 11 日	10.41	55,600.00	578,796.00
291	000987	越秀资本	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	5.99	96,400.00	577,436.00
292	603160	汇顶科技	2023 年 1 月 11 日	50.20	11,400.00	572,280.00
293	600642	申能股份	2023 年 1 月 11 日	5.49	103,900.00	570,411.00
294	600867	通化东宝	2023 年 1 月 11 日	9.18	61,900.00	568,242.00
295	002146	荣盛发展	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	2.17	261,700.00	567,889.00
296	601106	中国一重	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	2.93	193,700.00	567,541.00
297	600848	上海临港	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	11.92	47,600.00	567,392.00
298	002396	星网锐捷	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	19.16	29,600.00	567,136.00
299	002701	奥瑞金	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	5.05	111,800.00	564,590.00
300	300244	迪安诊断	2023 年 1 月 11 日	25.13	22,300.00	560,399.00
301	688029	南微医学	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	82.13	6,800.00	558,484.00
302	601958	金钼股份	2023 年 1 月 13 日	11.55	47,900.00	553,245.00
303	603568	伟明环保	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	18.53	29,600.00	548,488.00
304	688009	中国通号	2023 年 1 月 11 日	4.79	114,300.00	547,497.00
305	000039	中集集团	2023 年 1 月 11 日	7.04	77,600.00	546,304.00
306	002124	天邦食品	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	6.11	89,100.00	544,401.00
307	000155	川能动力	2023 年 1 月 11 日	17.84	30,100.00	536,984.00
308	000513	丽珠集团	2023 年 1 月 11 日	32.48	16,500.00	535,920.00
309	300558	贝达药业	2023 年 1 月 11 日	49.27	10,800.00	532,116.00
310	002266	浙富控股	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	3.91	135,800.00	530,978.00
311	600827	百联股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	12.12	43,200.00	523,584.00
312	002532	天山铝业	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	7.72	67,700.00	522,644.00
313	600598	北大荒	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 11 日	13.76	37,900.00	521,504.00
314	300017	网宿科技	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	5.58	92,700.00	517,266.00
315	601969	海南矿业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	7.41	69,800.00	517,218.00
316	600787	中储股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	4.97	103,800.00	515,886.00

317	600006	东风汽车	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	5.58	91,700.00	511,686.00
318	688208	道通科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	31.55	16,200.00	511,110.00
319	002670	国盛金控	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	7.41	68,900.00	510,549.00
320	600507	方大特钢	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 18 日	6.02	84,500.00	508,690.00
321	002557	洽洽食品	2023 年 1 月 2 日	50.00	10,000.00	500,000.00
322	300001	特锐德	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	15.21	32,800.00	498,888.00
323	688521	芯原股份-U	2023 年 1 月 11 日	44.07	11,300.00	497,991.00
324	688289	圣湘生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	21.95	22,300.00	489,485.00
325	600378	昊华科技	2023 年 1 月 11 日	42.91	11,400.00	489,174.00
326	002958	青农商行	2023 年 1 月 11 日	2.89	168,600.00	487,254.00
327	002500	山西证券	2023 年 1 月 11 日	5.30	91,500.00	484,950.00
328	600718	东软集团	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	9.95	48,700.00	484,565.00
329	600871	石化油服	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	1.98	243,000.00	481,140.00
330	600316	洪都航空	2023 年 1 月 11 日	25.19	18,800.00	473,572.00
331	600208	新湖中宝	2023 年 1 月 11 日	2.54	186,400.00	473,456.00
332	603927	中科软	2023 年 1 月 11 日	29.61	15,800.00	467,838.00
333	002831	裕同科技	2023 年 1 月 3 日	33.07	14,100.00	466,287.00
334	000937	冀中能源	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	6.36	73,200.00	465,552.00
335	600038	中直股份	2023 年 1 月 18 日	46.41	10,000.00	464,100.00
336	000547	航天发展	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 5 日	9.39	49,300.00	462,927.00
337	000060	中金岭南	2023 年 1 月 11 日	4.10	112,200.00	460,020.00
338	688779	长远锂科	2023 年 1 月 11 日	14.59	31,500.00	459,585.00
339	300888	稳健医疗	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	71.50	6,400.00	457,600.00
340	300115	长盈精密	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 19 日	10.33	44,200.00	456,586.00
341	300832	新产业	2023 年 1 月 10 日	50.14	9,000.00	451,260.00
342	000553	安道麦 A	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	9.05	49,700.00	449,785.00
343	002653	海思科	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	22.25	20,100.00	447,225.00
344	000062	深圳华强	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	12.21	36,600.00	446,886.00
345	600755	厦门国贸	2023 年 1 月 11 日	7.14	62,500.00	446,250.00

346	002010	传化智联	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	5.34	83,200.00	444,288.00
347	601298	青岛港	2023 年 1 月 4 日	5.61	79,100.00	443,751.00
348	000825	太钢不锈	2023 年 1 月 11 日	4.32	101,800.00	439,776.00
349	002373	千方科技	2023 年 1 月 11 日	8.92	49,000.00	437,080.00
350	300072	海新能科	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	4.36	100,200.00	436,872.00
351	603225	新凤鸣	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	10.88	39,700.00	431,936.00
352	600118	中国卫星	2023 年 1 月 3 日	21.55	20,000.00	431,000.00
353	000402	金融街	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	5.25	81,700.00	428,925.00
354	600535	天士力	2023 年 1 月 11 日	10.76	39,800.00	428,248.00
355	600970	中材国际	2023 年 1 月 11 日	8.52	50,000.00	426,000.00
356	600096	云天化	2023 年 1 月 4 日	21.04	20,000.00	420,800.00
357	600339	中油工程	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	2.98	140,900.00	419,882.00
358	000961	中南建设	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 30 日	2.19	191,500.00	419,385.00
359	688777	中控技术	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	90.83	4,600.00	417,818.00
360	600236	桂冠电力	2023 年 1 月 2 日	5.76	72,500.00	417,600.00
361	600282	南钢股份	2023 年 1 月 11 日	3.15	132,500.00	417,375.00
362	000563	陕国投 A	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	3.03	137,600.00	416,928.00
363	600498	烽火通信	2023 年 1 月 11 日	13.14	31,500.00	413,910.00
364	603156	养元饮品	2023 年 1 月 11 日	22.27	18,500.00	411,995.00
365	688185	康希诺	2023 年 1 月 11 日	146.0 2	2,800.00	408,856.00
366	000089	深圳机场	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	7.86	51,600.00	405,576.00
367	300776	帝尔激光	2023 年 1 月 11 日	126.0 0	3,200.00	403,200.00
368	600259	广晟有色	2023 年 1 月 2 日	40.20	10,000.00	402,000.00
369	601665	齐鲁银行	2023 年 1 月 11 日	4.17	95,200.00	396,984.00
370	300009	安科生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	9.36	42,200.00	394,992.00
371	300257	开山股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	15.00	26,300.00	394,500.00
372	603707	健友股份	2023 年 1 月 11 日	18.04	21,600.00	389,664.00
373	000778	新兴铸管	2023 年 1 月 11 日	3.65	106,000.00	386,900.00
374	300861	美畅股份	2023 年 1 月 11 日	49.16	7,800.00	383,448.00
375	601598	中国外运	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	3.84	99,800.00	383,232.00

376	601608	中信重工	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	3.49	109,500.00	382,155.00
377	600959	江苏有线	2023 年 1 月 11 日	2.97	128,600.00	381,942.00
378	600329	达仁堂	2023 年 1 月 11 日	29.10	12,900.00	375,390.00
379	001872	招商港口	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 4 日	14.36	26,000.00	373,360.00
380	002690	美亚光电	2023 年 1 月 11 日	23.90	15,600.00	372,840.00
381	600373	中文传媒	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	9.57	38,800.00	371,316.00
382	600216	浙江医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	11.69	31,600.00	369,404.00
383	000598	兴蓉环境	2023 年 1 月 11 日	4.89	75,400.00	368,706.00
384	000021	深科技	2023 年 1 月 3 日	10.69	34,400.00	367,736.00
385	300618	寒锐钴业	2023 年 1 月 11 日	40.05	9,100.00	364,455.00
386	002002	鸿达兴业	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 10 日	3.24	111,500.00	361,260.00
387	002867	周大生	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	14.03	25,300.00	354,959.00
388	000401	冀东水泥	2023 年 1 月 11 日	8.23	43,100.00	354,713.00
389	600022	山东钢铁	2023 年 1 月 11 日	1.48	237,500.00	351,500.00
390	600517	国网英大	2023 年 1 月 11 日	4.84	72,300.00	349,932.00
391	603712	七一二	2023 年 1 月 2 日	34.92	10,000.00	349,200.00
392	002048	宁波华翔	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 3 日	13.90	24,900.00	346,110.00
393	000415	渤海租赁	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	2.21	156,400.00	345,644.00
394	600895	张江高科	2023 年 1 月 11 日	11.34	30,100.00	341,334.00
395	600667	太极实业	2023 年 1 月 11 日	5.16	65,300.00	336,948.00
396	601333	广深铁路	2023 年 1 月 11 日	2.27	146,100.00	331,647.00
397	600064	南京高科	2023 年 1 月 11 日	6.61	49,800.00	329,178.00
398	600956	新天绿能	2023 年 1 月 4 日	9.64	33,700.00	324,868.00
399	000581	威孚高科	2023 年 1 月 11 日	17.73	18,300.00	324,459.00
400	600623	华谊集团	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 13 日	6.32	50,400.00	318,528.00
401	601118	海南橡胶	2023 年 1 月 11 日	4.38	72,100.00	315,798.00
402	601158	重庆水务	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 4 日	5.13	61,200.00	313,956.00
403	000959	首钢股份	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	3.77	82,400.00	310,648.00
404	600167	联美控股	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	6.32	48,500.00	306,520.00
405	600549	厦门钨业	2023 年 1 月 30 日	19.55	15,600.00	304,980.00
406	000869	张裕 A	2023 年 1 月 2 日	30.24	10,000.00	302,400.00
407	600808	马钢股份	2023 年 1 月 11 日	2.81	107,400.00	301,794.00

408	000967	盈峰环境	2023 年 1 月 11 日	4.54	66,300.00	301,002.00
409	600928	西安银行	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	3.52	84,000.00	295,680.00
410	601179	中国西电	2023 年 1 月 4 日	4.61	63,300.00	291,813.00
411	002439	启明星辰	2023 年 1 月 12 日	26.08	11,100.00	289,488.00
412	000898	鞍钢股份	2023 年 1 月 11 日	2.67	106,100.00	283,287.00
413	600967	内蒙一机	2023 年 1 月 11 日	8.26	33,900.00	280,014.00
414	000686	东北证券	2023 年 1 月 2 日	6.50	43,000.00	279,500.00
415	002563	森马服饰	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 11 日	5.24	52,600.00	275,624.00
416	002948	青岛银行	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 9 日	3.36	82,000.00	275,520.00
417	688099	晶晨股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	70.51	3,900.00	274,989.00
418	603317	天味食品	2023 年 1 月 11 日	27.48	10,000.00	274,800.00
419	600917	重庆燃气	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 18 日	7.96	34,000.00	270,640.00
420	301029	怡合达	2023 年 1 月 11 日	65.74	4,100.00	269,534.00
421	601611	中国核建	2023 年 1 月 11 日	7.60	35,000.00	266,000.00
422	601991	大唐发电	2023 年 1 月 11 日	2.79	90,700.00	253,053.00
423	600032	浙江新能	2023 年 1 月 4 日	11.49	22,000.00	252,780.00
424	600968	海油发展	2023 年 1 月 11 日	2.88	85,900.00	247,392.00
425	002004	华邦健康	2023 年 1 月 2 日	5.10	48,500.00	247,350.00
426	600037	歌华有线	2023 年 1 月 2 日	8.14	29,800.00	242,572.00
427	600782	新钢股份	2023 年 1 月 2 日	4.09	58,600.00	239,674.00
428	601228	广州港	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	3.15	75,800.00	238,770.00
429	600161	天坛生物	2023 年 1 月 5 日	23.73	10,000.00	237,300.00
430	601928	凤凰传媒	2023 年 1 月 11 日	7.92	29,600.00	234,432.00
431	600377	宁沪高速	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 11 日	8.22	28,500.00	234,270.00
432	600862	中航高科	2023 年 1 月 6 日	22.29	10,500.00	234,045.00
433	600764	中国海防	2023 年 1 月 2 日	22.96	10,000.00	229,600.00
434	688188	柏楚电子	2023 年 1 月 13 日	217.08	1,000.00	217,080.00
435	688088	虹软科技	2023 年 1 月 11 日	22.51	9,400.00	211,594.00
436	600299	安迪苏	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	8.26	25,300.00	208,978.00
437	002174	游族网络	2023 年 1 月 2 日	9.26	22,400.00	207,424.00
438	600446	金证股份	2023 年 1 月 2 日	10.29	20,100.00	206,829.00
439	601139	深圳燃气	2023 年 1 月 2 日 -2023 年 1 月 11 日	6.54	31,600.00	206,664.00
440	688819	天能股份	2023 年 1 月 11 日	36.74	5,600.00	205,744.00
441	600597	光明乳业	2023 年 1 月 3 日	10.76	18,100.00	194,756.00

442	000488	晨鸣纸业	2023 年 1 月 2 日	4.98	37,500.00	186,750.00
443	000031	大悦城	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 9 日	3.76	46,700.00	175,592.00
444	002705	新宝股份	2023 年 1 月 2 日	16.65	10,100.00	168,165.00
445	002242	九阳股份	2023 年 1 月 18 日	16.48	10,000.00	164,800.00
446	600307	酒钢宏兴	2023 年 1 月 2 日	1.65	96,000.00	158,400.00
447	600648	外高桥	2023 年 1 月 11 日	11.95	12,500.00	149,375.00
448	600350	山东高速	2023 年 1 月 11 日	5.69	25,400.00	144,526.00
449	600863	内蒙华电	2023 年 1 月 3 日	3.49	38,300.00	133,667.00
450	002945	华林证券	2023 年 1 月 3 日	13.18	10,000.00	131,800.00
451	300741	华宝股份	2023 年 1 月 11 日	23.53	5,600.00	131,768.00
452	600835	上海机电	2023 年 1 月 6 日	11.22	10,400.00	116,688.00
453	600352	浙江龙盛	2023 年 1 月 11 日	9.90	10,000.00	99,000.00
454	601990	南京证券	2023 年 1 月 13 日	7.93	10,400.00	82,472.00
455	600823	世茂股份	2023 年 1 月 2 日	2.36	34,500.00	81,420.00
456	688772	珠海冠宇	2023 年 1 月 11 日	18.64	4,300.00	80,152.00
457	600066	宇通客车	2023 年 1 月 2 日	7.51	10,000.00	75,100.00
458	002233	塔牌集团	2023 年 1 月 6 日	7.10	10,400.00	73,840.00
459	000685	中山公用	2023 年 1 月 6 日	7.03	10,500.00	73,815.00
460	002110	三钢闽光	2023 年 1 月 30 日	4.70	10,000.00	47,000.00
461	688006	杭可科技	2023 年 1 月 13 日	43.77	1,000.00	43,770.00
462	600126	杭钢股份	2023 年 1 月 3 日	4.13	10,000.00	41,300.00
463	300012	华测检测	2023 年 1 月 13 日	22.30	1,000.00	22,300.00
合计	-	-	-	-	44,071,400.00	398,667,095.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	1,970,974.08
AAA 以下	-	968,852.00
未评级	-	-
合计	-	2,939,826.08

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。

7.4.13.3 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。

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。

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 2022 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	22,902,280.53	-	-	-	22,902,280.53
结算备付金	17,934,009.25	-	-	-	17,934,009.25
存出保证金	2,022,095.72	-	-	-	2,022,095.72
交易性金融资产	-	-	-	2,824,537,129.41	2,824,537,129.41

应收清算款	-	-	-	11,063,017.51	11,063,017.51
应收股利	-	-	-	1,404.00	1,404.00
其他资产	-	-	-	226,327.21	226,327.21
资产总计	42,858,385.50	-	-	2,835,827,878.13	2,878,686,263.63
负债					
应付清算款	-	-	-	20,005,720.74	20,005,720.74
应付管理人报酬	-	-	-	1,162,616.16	1,162,616.16
应付托管费	-	-	-	232,523.21	232,523.21
应交税费	-	-	-	13,279.82	13,279.82
其他负债	-	-	-	5,421,606.93	5,421,606.93
负债总计	-	-	-	26,835,746.86	26,835,746.86
利率敏感度缺口	42,858,385.50	-	-	2,808,992,131.27	2,851,850,516.77
上年度末					
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	28,793,490.70	-	-	-	28,793,490.70
结算备付金	20,376,362.24	-	-	-	20,376,362.24
存出保证金	3,285,776.61	-	-	-	3,285,776.61
交易性金融资产	2,939,826.08	-	-	3,073,988,591.31	3,076,928,417.39
应收证券清算款	-	-	-	6,839,320.13	6,839,320.13
应收利息	-	-	-	93,118.93	93,118.93
应收股利	-	-	-	700.00	700.00
资产总计	55,395,455.63	-	-	3,080,921,730.37	3,136,317,186.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,625,021.71	12,625,021.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,250,819.74	1,250,819.74
应付托管费	-	-	-	250,163.95	250,163.95
应付交易费用	-	-	-	1,141,176.25	1,141,176.25
应交税费	-	-	-	7,989.75	7,989.75
其他负债	-	-	-	2,035,198.79	2,035,198.79
负债总计	-	-	-	17,310,370.19	17,310,370.19

利率敏感度缺口	55,395,455.63	-	-	3,063,611,360.18	3,119,006,815.81
---------	---------------	---	---	------------------	------------------

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

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。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	2,824,537,129.41	99.04	3,073,988,591.31	98.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,939,826.08	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	2,824,537,129.41	99.04	3,076,928,417.39	98.65

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	上升 5%	141,721,646.19	145,047,401.77
	下降 5%	-141,721,646.19	-145,047,401.77

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,813,165,329.30	3,065,493,551.58
第二层次	10,439,424.60	11,434,865.81
第三层次	932,375.51	-
合计	2,824,537,129.41	3,076,928,417.39

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,262,049.68	1,262,049.68
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-329,674.17	-329,674.17
其中：计入损益的利得或损失	-	-329,674.17	-329,674.17
期末余额	-	932,375.51	932,375.51
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-329,674.17	-329,674.17
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

流动性折扣估值处于限售期的股票投资	932,375.51	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	18.91%-97.55%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
无	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	2,824,537,129.41	98.12
	其中：普通股	2,818,963,953.78	97.93
	存托凭证	5,573,175.63	0.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	40,836,289.78	1.42

	计		
8	其他各项资产	13,312,844.44	0.46
9	合计	2,878,686,263.63	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 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 398,667,095.00 元，占基金资产净值比例 13.98%。

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	27,064,345.04	0.95
B	采矿业	125,448,648.98	4.40
C	制造业	1,715,908,780.26	60.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,683,120.33	3.32
E	建筑业	25,035,159.01	0.88
F	批发和零售业	118,847,722.09	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	63,800,748.86	2.24
H	住宿和餐饮业	7,278,750.40	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	202,194,799.13	7.09
J	金融业	246,624,096.56	8.65
K	房地产业	58,040,333.28	2.04
L	租赁和商务服务业	32,851,724.56	1.15
M	科学研究和技术服务业	30,882,868.05	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	15,872,834.11	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,645,052.42	0.20
R	文化、体育和娱乐业	37,460,426.12	1.31

S	综合	16,897,720.21	0.59
	合计	2,824,537,129.41	99.04

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

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	002340	格林美	2,284,900	16,976,807.00	0.60
2	300012	华测检测	744,300	16,597,890.00	0.58
3	600157	永泰能源	9,867,300	15,096,969.00	0.53
4	002384	东山精密	608,400	15,045,732.00	0.53
5	300724	捷佳伟创	123,600	14,092,872.00	0.49
6	688777	中控技术	151,845	13,792,081.35	0.48
7	603613	国联股份	153,618	13,585,975.92	0.48
8	688122	西部超导	142,889	13,530,159.41	0.47
9	300003	乐普医疗	586,000	13,460,420.00	0.47
10	002422	科伦药业	504,691	13,429,827.51	0.47
11	600487	亨通光电	877,400	13,213,644.00	0.46
12	688063	派能科技	41,744	13,176,493.60	0.46
13	002385	大北农	1,474,548	13,123,477.20	0.46
14	002966	苏州银行	1,631,928	12,696,399.84	0.45
15	603606	东方电缆	183,900	12,473,937.00	0.44
16	603345	安井食品	76,700	12,416,196.00	0.44
17	600885	宏发股份	370,855	12,390,265.55	0.43
18	600765	中航重机	393,237	12,225,738.33	0.43
19	600079	人福医药	508,900	12,157,621.00	0.43
20	600096	云天化	570,100	11,994,904.00	0.42
21	002497	雅化集团	509,100	11,836,575.00	0.42
22	601555	东吴证券	1,782,800	11,641,684.00	0.41
23	600352	浙江龙盛	1,157,700	11,461,230.00	0.40
24	002407	多氟多	338,477	11,278,053.64	0.40
25	002603	以岭药业	371,472	11,129,301.12	0.39
26	002625	光启技术	653,700	11,125,974.00	0.39
27	000009	中国宝安	918,310	11,102,367.90	0.39
28	601058	赛轮轮胎	1,089,400	10,915,788.00	0.38

29	002738	中矿资源	163,200	10,878,912.00	0.38
30	601233	桐昆股份	751,400	10,857,730.00	0.38
31	688390	固德威	33,260	10,745,973.40	0.38
32	600988	赤峰黄金	588,500	10,622,425.00	0.37
33	600489	中金黄金	1,294,300	10,600,317.00	0.37
34	603688	石英股份	80,400	10,558,128.00	0.37
35	603605	珀莱雅	62,935	10,540,353.80	0.37
36	600298	安琪酵母	232,600	10,518,172.00	0.37
37	300146	汤臣倍健	453,730	10,354,118.60	0.36
38	002028	思源电气	269,172	10,287,753.84	0.36
39	601108	财通证券	1,438,940	10,245,252.80	0.36
40	603939	益丰药房	160,400	10,239,936.00	0.36
41	000630	铜陵有色	3,278,940	10,230,292.80	0.36
42	600418	江淮汽车	778,925	10,227,285.25	0.36
43	300144	宋城演艺	699,500	10,212,700.00	0.36
44	600536	中国软件	174,263	10,164,760.79	0.36
45	000807	云铝股份	906,892	10,084,639.04	0.35
46	300037	新宙邦	231,918	10,081,475.46	0.35
47	600399	抚顺特钢	703,100	10,061,361.00	0.35
48	300699	光威复材	138,159	9,981,987.75	0.35
49	600141	兴发集团	343,369	9,957,701.00	0.35
50	603517	绝味食品	162,113	9,903,483.17	0.35
51	300073	当升科技	174,600	9,847,440.00	0.35
52	300285	国瓷材料	353,294	9,740,315.58	0.34
53	601077	渝农商行	2,752,100	9,714,913.00	0.34
54	300568	星源材质	455,700	9,688,182.00	0.34
55	600873	梅花生物	947,600	9,646,568.00	0.34
56	600859	王府井	342,586	9,640,370.04	0.34
57	600563	法拉电子	59,918	9,579,689.84	0.34
58	300390	天华超净	171,100	9,561,068.00	0.34
59	603456	九洲药业	222,600	9,444,918.00	0.33
60	002138	顺络电子	358,423	9,383,514.14	0.33
61	603816	顾家家居	219,200	9,362,032.00	0.33
62	600160	巨化股份	603,185	9,355,399.35	0.33
63	603589	口子窖	159,966	9,225,239.22	0.32
64	002185	华天科技	1,110,573	9,206,650.17	0.32
65	000783	长江证券	1,724,500	9,191,585.00	0.32
66	601128	常熟银行	1,213,480	9,161,774.00	0.32
67	600153	建发股份	665,139	9,079,147.35	0.32
68	002192	融捷股份	92,600	9,065,540.00	0.32
69	688099	晶晨股份	128,473	9,058,631.23	0.32
70	000629	钒钛股份	1,912,593	9,046,564.89	0.32
71	601699	潞安环能	534,619	9,008,330.15	0.32
72	605358	立昂微	210,500	8,967,300.00	0.31

73	000683	远兴能源	1,128,200	8,845,088.00	0.31
74	601162	天风证券	3,077,400	8,832,138.00	0.31
75	601607	上海医药	492,422	8,779,884.26	0.31
76	603596	伯特利	109,800	8,762,040.00	0.31
77	600392	盛和资源	624,878	8,748,292.00	0.31
78	688567	孚能科技	323,243	8,737,258.29	0.31
79	300357	我武生物	158,508	8,733,790.80	0.31
80	002568	百润股份	233,600	8,727,296.00	0.31
81	600109	国金证券	999,973	8,699,765.10	0.31
82	600161	天坛生物	366,260	8,691,349.80	0.30
83	601168	西部矿业	850,618	8,676,303.60	0.30
84	000932	华菱钢铁	1,842,180	8,658,246.00	0.30
85	600499	科达制造	608,800	8,651,048.00	0.30
86	600521	华海药业	392,600	8,582,236.00	0.30
87	600486	扬农化工	82,188	8,539,333.20	0.30
88	000831	中国稀土	259,500	8,532,360.00	0.30
89	600027	华电国际	1,446,767	8,506,989.96	0.30
90	002223	鱼跃医疗	264,608	8,430,410.88	0.30
91	002797	第一创业	1,496,803	8,427,000.89	0.30
92	603077	和邦生物	2,741,645	8,334,600.80	0.29
93	600862	中航高科	373,293	8,320,700.97	0.29
94	002078	太阳纸业	716,895	8,258,630.40	0.29
95	601636	旗滨集团	716,102	8,156,401.78	0.29
96	000999	华润三九	174,213	8,154,910.53	0.29
97	000975	银泰黄金	738,489	8,152,918.56	0.29
98	002294	信立泰	246,977	8,113,194.45	0.28
99	601872	招商轮船	1,444,100	8,072,519.00	0.28
100	600497	驰宏锌锗	1,585,700	8,023,642.00	0.28
101	002532	天山铝业	1,035,000	7,990,200.00	0.28
102	600143	金发科技	823,139	7,976,216.91	0.28
103	002268	电科网安	260,940	7,966,498.20	0.28
104	300253	卫宁健康	767,236	7,887,186.08	0.28
105	688385	复旦微电	112,958	7,885,597.98	0.28
106	002299	圣农发展	330,540	7,830,492.60	0.27
107	600177	雅戈尔	1,234,809	7,816,340.97	0.27
108	601696	中银证券	737,000	7,790,090.00	0.27
109	601990	南京证券	977,200	7,749,196.00	0.27
110	002439	启明星辰	296,481	7,732,224.48	0.27
111	002624	完美世界	607,200	7,723,584.00	0.27
112	600705	中航产融	2,350,500	7,709,640.00	0.27
113	000591	太阳能	1,050,100	7,697,233.00	0.27
114	002025	航天电器	115,600	7,658,500.00	0.27
115	600348	华阳股份	536,981	7,651,979.25	0.27
116	000998	隆平高科	469,400	7,543,258.00	0.26

117	000738	航发控制	292,311	7,494,854.04	0.26
118	688301	奕瑞科技	16,347	7,484,964.36	0.26
119	600026	中远海能	620,024	7,471,289.20	0.26
120	600549	厦门钨业	380,399	7,436,800.45	0.26
121	000728	国元证券	1,167,300	7,389,009.00	0.26
122	002850	科达利	62,000	7,366,220.00	0.26
123	600482	中国动力	480,200	7,342,258.00	0.26
124	000988	华工科技	447,124	7,337,304.84	0.26
125	002273	水晶光电	620,241	7,312,641.39	0.26
126	000519	中兵红箭	371,482	7,295,906.48	0.26
127	600258	首旅酒店	293,498	7,278,750.40	0.26
128	002673	西部证券	1,192,800	7,264,152.00	0.25
129	300604	长川科技	161,400	7,195,212.00	0.25
130	603737	三棵树	63,000	7,171,290.00	0.25
131	002507	涪陵榨菜	277,623	7,154,344.71	0.25
132	601997	贵阳银行	1,294,874	7,108,858.26	0.25
133	300136	信维通信	427,100	7,051,421.00	0.25
134	300832	新产业	139,760	7,007,566.40	0.25
135	002092	中泰化学	928,233	6,924,618.18	0.24
136	000703	恒逸石化	979,100	6,883,073.00	0.24
137	002030	达安基因	439,266	6,834,978.96	0.24
138	002430	杭氧股份	173,600	6,832,896.00	0.24
139	600325	华发股份	748,642	6,782,696.52	0.24
140	002056	横店东磁	361,583	6,776,065.42	0.24
141	002739	万达电影	483,900	6,774,600.00	0.24
142	002557	洽洽食品	135,136	6,756,800.00	0.24
143	601198	东兴证券	868,600	6,705,592.00	0.24
144	300363	博腾股份	164,100	6,703,485.00	0.24
145	000729	燕京啤酒	627,718	6,666,365.16	0.23
146	603233	大参林	167,900	6,648,840.00	0.23
147	600704	物产中大	1,382,084	6,647,824.04	0.23
148	002156	通富微电	403,200	6,644,736.00	0.23
149	002465	海格通信	817,518	6,638,246.16	0.23
150	600529	山东药玻	231,197	6,565,994.80	0.23
151	600879	航天电子	965,016	6,562,108.80	0.23
152	300308	中际旭创	242,001	6,541,287.03	0.23
153	300088	长信科技	1,094,002	6,531,191.94	0.23
154	601016	节能风电	1,699,363	6,474,573.03	0.23
155	603658	安图生物	104,580	6,468,273.00	0.23
156	002353	杰瑞股份	229,414	6,402,944.74	0.22
157	600546	山煤国际	440,700	6,385,743.00	0.22
158	002409	雅克科技	126,700	6,381,879.00	0.22
159	600415	小商品城	1,214,292	6,362,890.08	0.22
160	000960	锡业股份	448,481	6,323,582.10	0.22

161	688116	天奈科技	81,849	6,313,831.86	0.22
162	000878	云南铜业	536,908	6,308,669.00	0.22
163	000830	鲁西化工	508,817	6,304,242.63	0.22
164	002683	广东宏大	233,690	6,300,282.40	0.22
165	000400	许继电气	314,324	6,277,050.28	0.22
166	603267	鸿远电子	61,900	6,261,804.00	0.22
167	600516	方大炭素	1,017,476	6,226,953.12	0.22
168	601666	平煤股份	574,700	6,212,507.00	0.22
169	000623	吉林敖东	412,245	6,179,552.55	0.22
170	600170	上海建工	2,365,154	6,149,400.40	0.22
171	600655	豫园股份	805,000	6,126,050.00	0.21
172	600038	中直股份	131,260	6,091,776.60	0.21
173	300017	网宿科技	1,087,600	6,068,808.00	0.21
174	002444	巨星科技	319,119	6,056,878.62	0.21
175	002372	伟星新材	282,973	6,038,643.82	0.21
176	600637	东方明珠	907,580	6,035,407.00	0.21
177	300418	昆仑万维	418,348	6,028,394.68	0.21
178	601456	国联证券	535,285	6,021,956.25	0.21
179	300373	扬杰科技	114,300	6,012,180.00	0.21
180	601577	长沙银行	889,249	6,011,323.24	0.21
181	600642	申能股份	1,094,409	6,008,305.41	0.21
182	600739	辽宁成大	475,769	5,989,931.71	0.21
183	603444	吉比特	19,135	5,986,193.40	0.21
184	600166	福田汽车	2,126,242	5,974,740.02	0.21
185	002080	中材科技	278,700	5,972,541.00	0.21
186	002203	海亮股份	527,985	5,966,230.50	0.21
187	600699	均胜电子	423,125	5,944,906.25	0.21
188	000155	川能动力	330,300	5,892,552.00	0.21
189	002326	永太科技	269,500	5,883,185.00	0.21
190	603127	昭衍新药	100,500	5,870,205.00	0.21
191	603160	汇顶科技	116,800	5,863,360.00	0.21
192	002508	老板电器	210,900	5,854,584.00	0.21
193	000970	中科三环	429,137	5,853,428.68	0.21
194	603026	胜华新材	63,000	5,814,900.00	0.20
195	603712	七一二	166,373	5,809,745.16	0.20
196	600673	东阳光	666,899	5,795,352.31	0.20
197	600380	健康元	510,736	5,766,209.44	0.20
198	600909	华安证券	1,255,509	5,762,786.31	0.20
199	000039	中集集团	816,970	5,751,468.80	0.20
200	688002	睿创微纳	154,121	5,731,759.99	0.20
201	600867	通化东宝	620,684	5,697,879.12	0.20
202	600985	淮北矿业	444,940	5,695,232.00	0.20
203	002065	东华软件	999,673	5,658,149.18	0.20
204	300244	迪安诊断	224,634	5,645,052.42	0.20

205	000750	国海证券	1,692,564	5,636,238.12	0.20
206	002531	天顺风能	371,407	5,619,387.91	0.20
207	600118	中国卫星	259,900	5,600,845.00	0.20
208	300058	蓝色光标	1,108,441	5,597,627.05	0.20
209	000739	普洛药业	259,723	5,594,433.42	0.20
210	689009	九号公司	182,787	5,573,175.63	0.20
211	600056	中国医药	323,177	5,568,339.71	0.20
212	300676	华大基因	107,400	5,551,506.00	0.19
213	600369	西南证券	1,475,647	5,533,676.25	0.19
214	600008	首创环保	1,949,278	5,516,456.74	0.19
215	002152	广电运通	552,670	5,493,539.80	0.19
216	688009	中国通号	1,143,793	5,478,768.47	0.19
217	002831	裕同科技	164,892	5,452,978.44	0.19
218	600998	九州通	414,864	5,409,826.56	0.19
219	000027	深圳能源	849,244	5,401,191.84	0.19
220	000513	丽珠集团	166,026	5,392,524.48	0.19
221	300866	安克创新	90,900	5,387,643.00	0.19
222	002936	郑州银行	2,289,346	5,379,963.10	0.19
223	300070	碧水源	1,135,753	5,372,111.69	0.19
224	300474	景嘉微	98,419	5,370,724.83	0.19
225	000547	航天发展	569,240	5,345,163.60	0.19
226	000636	风华高科	360,021	5,339,111.43	0.19
227	002408	齐翔腾达	757,092	5,329,927.68	0.19
228	600372	中航电子	333,416	5,324,653.52	0.19
229	002131	利欧股份	3,006,122	5,320,835.94	0.19
230	300558	贝达药业	107,781	5,310,369.87	0.19
231	002506	协鑫集成	1,822,200	5,302,602.00	0.19
232	002212	天融信	529,999	5,294,690.01	0.19
233	002926	华西证券	701,983	5,285,931.99	0.19
234	601880	辽港股份	3,249,106	5,263,551.72	0.18
235	600435	北方导航	453,727	5,263,233.20	0.18
236	603883	老百姓	129,070	5,223,462.90	0.18
237	300682	朗新科技	237,500	5,220,250.00	0.18
238	002183	怡亚通	807,225	5,190,456.75	0.18
239	300026	红日药业	912,305	5,181,892.40	0.18
240	002572	索菲亚	283,873	5,155,133.68	0.18
241	603858	步长制药	245,254	5,152,786.54	0.18
242	600820	隧道股份	975,274	5,139,693.98	0.18
243	600271	航天信息	492,759	5,129,621.19	0.18
244	002195	二三四五	2,546,054	5,117,568.54	0.18
245	600390	五矿资本	1,002,363	5,092,004.04	0.18
246	300383	光环新网	623,652	5,089,000.32	0.18
247	600580	卧龙电驱	408,228	5,086,520.88	0.18
248	300296	利亚德	897,540	5,080,076.40	0.18

249	002250	联化科技	327,475	5,075,862.50	0.18
250	002500	山西证券	957,583	5,075,189.90	0.18
251	603156	养元饮品	226,430	5,042,596.10	0.18
252	600863	内蒙华电	1,444,052	5,039,741.48	0.18
253	600848	上海临港	422,620	5,037,630.40	0.18
254	000887	中鼎股份	348,027	5,035,950.69	0.18
255	002368	太极股份	178,305	5,015,719.65	0.18
256	002958	青农商行	1,731,637	5,004,430.93	0.18
257	688538	和辉光电-U	1,865,461	4,999,435.48	0.18
258	600378	昊华科技	116,100	4,981,851.00	0.17
259	600021	上海电力	496,979	4,974,759.79	0.17
260	300024	机器人	552,087	4,957,741.26	0.17
261	601958	金铂股份	427,289	4,935,187.95	0.17
262	300001	特锐德	323,464	4,919,887.44	0.17
263	300009	安科生物	524,510	4,909,413.60	0.17
264	002244	滨江集团	553,870	4,890,672.10	0.17
265	002155	湖南黄金	376,530	4,876,063.50	0.17
266	688521	芯原股份-U	110,230	4,857,836.10	0.17
267	600208	新湖中宝	1,907,215	4,844,326.10	0.17
268	688256	寒武纪-U	88,437	4,825,122.72	0.17
269	000997	新大陆	370,198	4,816,275.98	0.17
270	603885	吉祥航空	297,638	4,815,782.84	0.17
271	300776	帝尔激光	38,209	4,814,334.00	0.17
272	600315	上海家化	150,987	4,808,935.95	0.17
273	000060	中金岭南	1,166,532	4,782,781.20	0.17
274	603893	瑞芯微	69,400	4,775,414.00	0.17
275	600755	厦门国贸	668,341	4,771,954.74	0.17
276	002511	中顺洁柔	347,031	4,768,205.94	0.17
277	000050	深天马 A	547,561	4,741,878.26	0.17
278	600316	洪都航空	188,148	4,739,448.12	0.17
279	601992	金隅集团	1,851,969	4,704,001.26	0.16
280	603927	中科软	158,434	4,691,230.74	0.16
281	600060	海信视像	345,926	4,683,838.04	0.16
282	601005	重庆钢铁	2,947,418	4,656,920.44	0.16
283	600511	国药股份	166,913	4,656,872.70	0.16
284	688779	长远锂科	316,028	4,610,848.52	0.16
285	300251	光线传媒	525,379	4,549,782.14	0.16
286	601717	郑煤机	407,587	4,548,670.92	0.16
287	600801	华新水泥	304,341	4,510,333.62	0.16
288	600528	中铁工业	587,115	4,479,687.45	0.16
289	300168	万达信息	531,065	4,476,877.95	0.16
290	002939	长城证券	540,100	4,472,028.00	0.16
291	600201	生物股份	496,175	4,470,536.75	0.16
292	688185	康希诺	30,603	4,468,650.06	0.16

293	601231	环旭电子	274,900	4,461,627.00	0.16
294	600566	济川药业	163,516	4,450,905.52	0.16
295	000021	深科技	414,640	4,432,501.60	0.16
296	603218	日月股份	217,500	4,415,250.00	0.15
297	000825	太钢不锈	1,021,285	4,411,951.20	0.15
298	600066	宇通客车	587,428	4,411,584.28	0.15
299	600906	财达证券	580,900	4,397,413.00	0.15
300	600171	上海贝岭	251,881	4,390,285.83	0.15
301	002373	千方科技	490,517	4,375,411.64	0.15
302	600598	北大荒	316,402	4,353,691.52	0.15
303	300850	新强联	81,600	4,347,648.00	0.15
304	600839	四川长虹	1,638,978	4,326,901.92	0.15
305	300677	英科医疗	205,120	4,313,673.60	0.15
306	600282	南钢股份	1,368,833	4,311,823.95	0.15
307	600535	天士力	399,420	4,297,759.20	0.15
308	600827	百联股份	352,996	4,278,311.52	0.15
309	601665	齐鲁银行	1,025,800	4,277,586.00	0.15
310	600970	中材国际	500,555	4,264,728.60	0.15
311	601866	中远海发	1,751,832	4,239,433.44	0.15
312	601778	晶科科技	770,200	4,236,100.00	0.15
313	002127	南极电商	873,628	4,202,150.68	0.15
314	603568	伟明环保	226,753	4,201,733.09	0.15
315	002153	石基信息	279,840	4,194,801.60	0.15
316	002128	电投能源	339,459	4,188,924.06	0.15
317	601179	中国西电	907,134	4,181,887.74	0.15
318	600500	中化国际	629,494	4,160,955.34	0.15
319	000709	河钢股份	1,838,031	4,153,950.06	0.15
320	600498	烽火通信	315,948	4,151,556.72	0.15
321	000930	中粮科技	495,689	4,143,960.04	0.15
322	000012	南玻 A	613,169	4,114,363.99	0.14
323	300182	捷成股份	918,836	4,107,196.92	0.14
324	600398	海澜之家	771,146	4,087,073.80	0.14
325	002595	豪迈科技	176,037	4,075,256.55	0.14
326	300888	稳健医疗	56,733	4,056,409.50	0.14
327	603000	人民网	240,069	4,049,964.03	0.14
328	002701	奥瑞金	800,520	4,042,626.00	0.14
329	002019	亿帆医药	326,303	3,997,211.75	0.14
330	000987	越秀资本	666,135	3,990,148.65	0.14
331	002124	天邦食品	652,582	3,987,276.02	0.14
332	000581	威孚高科	224,679	3,983,558.67	0.14
333	002396	星网锐捷	207,296	3,971,791.36	0.14
334	002985	北摩高科	87,627	3,951,977.70	0.14
335	600959	江苏有线	1,327,871	3,943,776.87	0.14
336	603707	健友股份	218,058	3,933,766.32	0.14

337	000598	兴蓉环境	796,716	3,895,941.24	0.14
338	000401	冀东水泥	473,364	3,895,785.72	0.14
339	300115	长盈精密	376,309	3,887,271.97	0.14
340	600895	张江高科	341,800	3,876,012.00	0.14
341	000778	新兴铸管	1,061,714	3,875,256.10	0.14
342	300861	美畅股份	78,600	3,863,976.00	0.14
343	688188	柏楚电子	17,576	3,815,398.08	0.13
344	600663	陆家嘴	391,533	3,813,531.42	0.13
345	002670	国盛金控	513,811	3,807,339.51	0.13
346	600582	天地科技	731,518	3,803,893.60	0.13
347	600718	东软集团	381,502	3,795,944.90	0.13
348	300618	寒锐钴业	94,755	3,794,937.75	0.13
349	688208	道通科技	120,243	3,793,666.65	0.13
350	300482	万孚生物	118,776	3,785,391.12	0.13
351	002249	大洋电机	738,168	3,779,420.16	0.13
352	600507	方大特钢	626,654	3,772,457.08	0.13
353	600297	广汇汽车	1,790,277	3,759,581.70	0.13
354	002690	美亚光电	157,182	3,756,649.80	0.13
355	002266	浙富控股	955,219	3,734,906.29	0.13
356	688690	纳微科技	71,616	3,707,560.32	0.13
357	600517	国网英大	765,200	3,703,568.00	0.13
358	600329	达仁堂	127,246	3,702,858.60	0.13
359	000883	湖北能源	876,372	3,680,762.40	0.13
360	603225	新凤鸣	337,502	3,672,021.76	0.13
361	002505	鹏都农牧	1,418,960	3,660,916.80	0.13
362	603866	桃李面包	237,295	3,654,343.00	0.13
363	000656	金科股份	1,913,000	3,653,830.00	0.13
364	600409	三友化工	551,515	3,645,514.15	0.13
365	601000	唐山港	1,314,679	3,602,220.46	0.13
366	000089	深圳机场	458,148	3,601,043.28	0.13
367	002002	鸿达兴业	1,111,112	3,600,002.88	0.13
368	300212	易华录	175,860	3,589,302.60	0.13
369	600022	山东钢铁	2,409,289	3,565,747.72	0.13
370	600259	广晟有色	88,690	3,565,338.00	0.13
371	000785	居然之家	871,500	3,564,435.00	0.12
372	600064	南京高科	539,117	3,563,563.37	0.12
373	600871	石化油服	1,798,600	3,561,228.00	0.12
374	600567	山鹰国际	1,429,543	3,545,266.64	0.12
375	601106	中国一重	1,209,809	3,544,740.37	0.12
376	600216	浙江医药	301,411	3,523,494.59	0.12
377	002429	兆驰股份	1,009,411	3,522,844.39	0.12
378	300376	易事特	513,524	3,507,368.92	0.12
379	002468	申通快递	338,247	3,494,091.51	0.12
380	600782	新钢股份	848,900	3,472,001.00	0.12

381	002081	金螳螂	713,443	3,460,198.55	0.12
382	601333	广深铁路	1,506,764	3,420,354.28	0.12
383	601718	际华集团	1,169,526	3,403,320.66	0.12
384	601187	厦门银行	590,401	3,382,997.73	0.12
385	600667	太极实业	652,183	3,365,264.28	0.12
386	601118	海南橡胶	764,755	3,349,626.90	0.12
387	002191	劲嘉股份	459,803	3,324,375.69	0.12
388	600597	光明乳业	307,700	3,310,852.00	0.12
389	600728	佳都科技	626,014	3,305,353.92	0.12
390	600737	中粮糖业	475,803	3,302,072.82	0.12
391	000537	广宇发展	247,565	3,275,284.95	0.11
392	600062	华润双鹤	182,995	3,273,780.55	0.11
393	601156	东航物流	213,600	3,259,536.00	0.11
394	600376	首开股份	571,295	3,250,668.55	0.11
395	300463	迈克生物	187,586	3,245,237.80	0.11
396	600131	国网信通	216,449	3,238,077.04	0.11
397	600155	华创阳安	497,912	3,236,428.00	0.11
398	002010	传化智联	603,690	3,223,704.60	0.11
399	002745	木林森	396,191	3,213,109.01	0.11
400	000540	中天金融	2,120,042	3,201,263.42	0.11
401	002221	东华能源	418,296	3,191,598.48	0.11
402	300072	海新能科	729,949	3,182,577.64	0.11
403	601098	中南传媒	318,626	3,179,887.48	0.11
404	600967	内蒙一机	380,718	3,144,730.68	0.11
405	002416	爱施德	329,468	3,123,356.64	0.11
406	600126	杭钢股份	755,522	3,120,305.86	0.11
407	000156	华数传媒	410,605	3,075,431.45	0.11
408	601991	大唐发电	1,095,352	3,056,032.08	0.11
409	002048	宁波华翔	219,384	3,049,437.60	0.11
410	601568	北元集团	531,269	3,012,295.23	0.11
411	600808	马钢股份	1,071,559	3,011,080.79	0.11
412	000937	冀中能源	472,069	3,002,358.84	0.11
413	688029	南微医学	36,267	2,978,608.71	0.10
414	603228	景旺电子	145,797	2,950,931.28	0.10
415	002423	中粮资本	408,660	2,926,005.60	0.10
416	600901	江苏金租	533,885	2,925,689.80	0.10
417	603056	德邦股份	139,204	2,899,619.32	0.10
418	600095	湘财股份	382,606	2,892,501.36	0.10
419	600373	中文传媒	302,199	2,892,044.43	0.10
420	002281	光迅科技	183,933	2,891,426.76	0.10
421	603379	三美股份	101,538	2,889,771.48	0.10
422	688289	圣湘生物	130,672	2,868,250.40	0.10
423	001914	招商积余	185,674	2,855,666.12	0.10
424	003035	南网能源	502,660	2,850,082.20	0.10

425	000559	万向钱潮	584,720	2,847,586.40	0.10
426	000898	鞍钢股份	1,063,089	2,838,447.63	0.10
427	301029	怡合达	43,100	2,833,394.00	0.10
428	000402	金融街	534,189	2,804,492.25	0.10
429	300630	普利制药	112,798	2,781,598.68	0.10
430	603317	天味食品	99,308	2,728,983.84	0.10
431	002434	万里扬	337,012	2,712,946.60	0.10
432	600556	天下秀	401,604	2,706,810.96	0.09
433	601608	中信重工	771,326	2,691,927.74	0.09
434	601598	中国外运	700,923	2,691,544.32	0.09
435	002867	周大生	191,454	2,686,099.62	0.09
436	000563	陕国投 A	880,899	2,669,123.97	0.09
437	601928	凤凰传媒	336,260	2,663,179.20	0.09
438	601611	中国核建	349,457	2,655,873.20	0.09
439	600195	中牧股份	227,669	2,645,513.78	0.09
440	002948	青岛银行	785,748	2,640,113.28	0.09
441	600707	彩虹股份	636,049	2,633,242.86	0.09
442	000959	首钢股份	697,624	2,630,042.48	0.09
443	300257	开山股份	175,036	2,625,540.00	0.09
444	600968	海油发展	900,205	2,592,590.40	0.09
445	002110	三钢闽光	546,341	2,567,802.70	0.09
446	000967	盈峰环境	564,776	2,564,083.04	0.09
447	600167	联美控股	405,097	2,560,213.04	0.09
448	001203	大中矿业	195,900	2,532,987.00	0.09
449	002705	新宝股份	148,233	2,468,079.45	0.09
450	603650	彤程新材	79,526	2,451,786.58	0.09
451	000415	渤海租赁	1,101,540	2,434,403.40	0.09
452	300869	康泰医学	72,300	2,354,811.00	0.08
453	000990	诚志股份	267,120	2,350,656.00	0.08
454	002925	盈趣科技	141,211	2,332,805.72	0.08
455	600307	酒钢宏兴	1,388,049	2,290,280.85	0.08
456	002242	九阳股份	138,711	2,285,957.28	0.08
457	601828	美凯龙	485,300	2,276,057.00	0.08
458	601615	明阳智能	90,000	2,273,400.00	0.08
459	603638	艾迪精密	150,025	2,238,373.00	0.08
460	600339	中油工程	742,106	2,211,475.88	0.08
461	000031	大悦城	570,427	2,144,805.52	0.08
462	600764	中国海防	93,300	2,142,168.00	0.08
463	688006	杭可科技	48,723	2,132,605.71	0.07
464	002399	海普瑞	165,640	2,128,474.00	0.07
465	600623	华谊集团	332,606	2,102,069.92	0.07
466	002146	荣盛发展	965,732	2,095,638.44	0.07
467	002653	海思科	94,098	2,093,680.50	0.07
468	600928	西安银行	588,057	2,069,960.64	0.07

469	688088	虹软科技	89,615	2,017,233.65	0.07
470	688819	天能股份	54,165	1,990,022.10	0.07
471	600648	外高桥	165,415	1,976,709.25	0.07
472	601969	海南矿业	266,079	1,971,645.39	0.07
473	603719	良品铺子	53,200	1,961,484.00	0.07
474	600006	东风汽车	351,288	1,960,187.04	0.07
475	600787	中储股份	389,565	1,936,138.05	0.07
476	002563	森马服饰	357,355	1,872,540.20	0.07
477	000961	中南建设	853,348	1,868,832.12	0.07
478	600377	宁沪高速	222,409	1,828,201.98	0.06
479	000869	张裕 A	60,378	1,825,830.72	0.06
480	601869	长飞光纤	54,010	1,762,346.30	0.06
481	601298	青岛港	312,351	1,752,289.11	0.06
482	000062	深圳华强	141,489	1,727,580.69	0.06
483	000553	安道麦 A	190,196	1,721,273.80	0.06
484	600350	山东高速	296,186	1,685,298.34	0.06
485	601139	深圳燃气	253,578	1,658,400.12	0.06
486	002945	华林证券	122,700	1,617,186.00	0.06
487	601228	广州港	468,155	1,474,688.25	0.05
488	600299	安迪苏	176,963	1,461,714.38	0.05
489	001872	招商港口	100,791	1,447,358.76	0.05
490	603355	莱克电气	50,825	1,425,133.00	0.05
491	603868	飞科电器	21,046	1,417,027.18	0.05
492	600522	中天科技	81,500	1,316,225.00	0.05
493	300741	华宝股份	54,590	1,284,502.70	0.05
494	600256	广汇能源	140,900	1,270,918.00	0.04
495	600956	新天绿能	130,905	1,261,924.20	0.04
496	601158	重庆水务	235,400	1,207,602.00	0.04
497	600927	永安期货	71,900	1,159,028.00	0.04
498	603786	科博达	16,204	1,066,709.32	0.04
499	600917	重庆燃气	132,400	1,053,904.00	0.04
500	001227	兰州银行	277,700	1,046,929.00	0.04
501	600032	浙江新能	84,600	972,054.00	0.03
502	002901	大博医疗	25,744	876,068.32	0.03
503	600233	圆通速递	42,100	845,789.00	0.03
504	688772	珠海冠宇	41,646	776,281.44	0.03
505	000983	山西焦煤	62,700	730,455.00	0.03
506	603198	迎驾贡酒	10,000	627,800.00	0.02
507	600236	桂冠电力	72,500	417,600.00	0.01
508	688380	中微半导	12,677	335,179.88	0.01
509	688332	中科蓝讯	5,870	294,732.70	0.01
510	000686	东北证券	43,000	279,500.00	0.01
511	002004	华邦健康	48,500	247,350.00	0.01
512	600037	歌华有线	29,800	242,572.00	0.01

513	002174	游族网络	22,400	207,424.00	0.01
514	600446	金证股份	20,100	206,829.00	0.01
515	000488	晨鸣纸业	37,500	186,750.00	0.01
516	601966	玲珑轮胎	6,745	138,137.60	0.00
517	600835	上海机电	10,400	116,688.00	0.00
518	600823	世茂股份	34,500	81,420.00	0.00
519	002233	塔牌集团	10,400	73,840.00	0.00
520	000685	中山公用	10,500	73,815.00	0.00
521	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
522	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
523	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
524	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
525	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
526	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
527	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
528	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
529	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
530	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
531	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
532	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
533	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
534	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
535	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
536	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
537	301139	元道通信	283	7,162.73	0.00
538	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
539	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
540	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
541	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
542	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
543	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
544	301233	盛帮股份	158	5,419.40	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	002340	格林美	27,776,878.28	0.89
2	300012	华测检测	21,795,537.58	0.70

3	300769	德方纳米	20,570,485.77	0.66
4	002497	雅化集团	20,562,113.95	0.66
5	600096	云天化	18,079,311.04	0.58
6	002240	盛新锂能	17,929,557.00	0.57
7	002407	多氟多	17,637,295.07	0.57
8	300390	天华超净	16,701,366.50	0.54
9	300073	当升科技	16,685,033.11	0.53
10	300003	乐普医疗	15,374,576.39	0.49
11	688063	派能科技	14,070,732.98	0.45
12	002738	中矿资源	13,943,657.12	0.45
13	002625	光启技术	13,563,819.00	0.43
14	002756	永兴材料	13,316,637.07	0.43
15	002384	东山精密	13,135,289.28	0.42
16	000783	长江证券	13,109,345.00	0.42
17	688180	君实生物-U	12,647,689.12	0.41
18	688122	西部超导	12,424,418.55	0.40
19	300568	星源材质	12,159,352.03	0.39
20	601058	赛轮轮胎	11,981,786.00	0.38

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，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。

8.4.2 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	002340	格林美	28,145,423.69	0.90
2	000733	振华科技	26,111,045.00	0.84
3	002180	纳思达	23,291,173.76	0.75
4	000723	美锦能源	19,603,805.00	0.63
5	600256	广汇能源	19,600,839.96	0.63
6	600522	中天科技	18,015,413.00	0.58
7	000983	山西焦煤	17,470,486.50	0.56
8	600188	兖矿能源	17,342,901.02	0.56
9	300763	锦浪科技	17,175,767.30	0.55
10	300751	迈为股份	16,894,638.80	0.54

11	300769	德方纳米	16,331,697.00	0.52
12	601615	明阳智能	16,069,081.04	0.52
13	600732	爱旭股份	14,621,258.68	0.47
14	002013	中航机电	14,482,315.31	0.46
15	688005	容百科技	14,235,457.41	0.46
16	000009	中国宝安	14,080,533.38	0.45
17	002240	盛新锂能	13,948,402.12	0.45
18	601117	中国化学	13,917,213.15	0.45
19	600884	杉杉股份	13,112,192.92	0.42
20	601689	拓普集团	12,581,323.78	0.40

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	1,943,365,695.34
卖出股票收入（成交）总额	1,723,599,487.57

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 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。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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，四川科伦药业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。浙江中控技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚。

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	2,022,095.72
2	应收清算款	11,063,017.51
3	应收股利	1,404.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	226,327.21
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,312,844.44

8.12.4 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。

8.12.5 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	300003	乐普医疗	3,620,072.00	0.13	转融通流通受限
2	002422	科伦药业	3,597,672.00	0.13	转融通流通受限
3	300724	捷佳伟创	3,203,962.00	0.11	转融通流通受限
4	002340	格林美	2,599,014.00	0.09	转融通流通受限
5	002384	东山精密	1,919,048.00	0.07	转融通流通受限
6	603613	国联股份	1,795,332.00	0.06	转融通流通受限
7	600157	永泰能源	1,506,744.00	0.05	转融通流通受限
8	688122	西部超导	909,024.00	0.03	转融通流通受限
9	688777	中控技术	417,818.00	0.01	转融通流通受限
10	300012	华测检测	22,300.00	0.00	转融通流通受限

§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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
16,555	97,072.69	1,469,507,677.00	91.44%	137,530,642.00	8.56%	1,353,028,321.00	84.19%

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

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	29,785,800.00	1.85%
2	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	26,787,300.00	1.67%
3	广发证券股份有限公司	12,406,881.00	0.77%
4	国泰君安证券股份有限公司	8,300,000.00	0.52%
5	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	7,957,100.00	0.50%
6	方正证券股份有限公司	7,905,175.00	0.49%
7	招商证券股份有限公司	4,318,000.00	0.27%
8	交银理财有限责任公司-交银理财稳享悦添利私银尊享(260 天持有期)理财产品	3,465,300.00	0.22%
9	广发证券股份有限公司融券专用证券账户	3,328,900.00	0.21%
10	上海朗绿投资管理有限公司	2,045,000.00	0.13%
11	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,353,028,321.00	84.19%

9.3 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%

9.4 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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 4 月 11 日)基金份额总额	425,038,319.00
本报告期期初基金份额总额	1,421,038,319.00
本报告期基金总申购份额	1,122,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	936,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,607,038,319.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

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

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

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 5 年为本基金提供审计服务，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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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	
万联证券	4	1,839,609,953.85	50.59%	425,519.77	21.18%	-
中泰证券	5	829,924,981.61	22.82%	772,913.01	38.47%	-
粤开证券	2	523,473,192.11	14.40%	487,660.96	24.27%	-
华泰证券	5	440,249,411.32	12.11%	321,490.55	16.00%	-

广发证券	8	2,913,416.83	0.08%	1,385.16	0.07%	-
中信建投	4	168,242.66	0.00%	156.67	0.01%	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
国元证券	2	-	-	-	-	-

安信证券	5	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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。

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
万联证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	3,575,686.15	17.18%	-	-	-	-
粤开证券	8,218,226.54	39.48%	-	-	-	-
华泰证券	6,152,185.95	29.55%	-	-	-	-
广发证券	2,872,600.00	13.80%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-21
2	关于增加开源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	2022-02-15
3	关于增加华安证券为旗下部分基金场内申购	中国证监会规定报刊及	2022-03-22

	赎回代理券商的公告	网站	
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-30
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-21
6	关于增加平安证券为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资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	2022-06-09
7	关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-06-17
8	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20
9	关于增加上海证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-08
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-30
11	广发基金管理有限公司关于调整“特定投资群体(养老金客户)”的客户适用范围的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-02
12	关于增加财达证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-10-14
13	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-10-26
14	关于增加华金证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-11-03
15	关于增加东方财富证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-11-07
16	关于增加金元证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-11-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1	20220101-20221231	1,183,711,221.00	1,234,789,600.00	1,065,472,500.00	1,353,028,321.00	84.19%
产品特有风险							
报告期内, 本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况, 由此可能导致的特有风险主要							

包括：

- ① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- ② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- ③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- ④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- ⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海证券交易所《关于上海证券交易所 ETF 申赎业务多码合一及迁移上线切换有关事项的通知》，自 2022 年 6 月 20 日起，本基金取消申赎业务相关代码，投资者可通过本基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与 ETF 申赎业务。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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

13.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日