

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2024 年年度报告
2024 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：二〇二五年三月二十九日

§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 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。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 2024 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	16
§6 审计报告	16
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	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
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	72
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	73
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	73
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12	投资组合报告附注	73
§9	基金份额持有人信息	74
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2	期末上市基金前十名持有人	75
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§10	开放式基金份额变动	75
§11	重大事件揭示	76
11.1	基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4	基金投资策略的改变	76
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8	其他重大事件	81
§12	影响投资者决策的其他重要信息	82
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	82
§13	备查文件目录	83
13.1	备查文件目录	83
13.2	存放地点	83
13.3	查阅方式	83

§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	1,237,038,319.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-05-24

注：本基金的扩位证券简称为“中证 500ETF 基金”。

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-34281105	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		葛长伟	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-147,184,985.83	-118,627,712.08	-105,352,246.54
本期利润	219,382,313.77	-189,004,587.01	-558,985,693.94
加权平均基金份额本期利润	0.1241	-0.1130	-0.3826
本期加权平均净值利润率	7.64%	-6.24%	-20.38%
本期基金份额净值增长率	7.43%	-5.97%	-19.15%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	980,539,782.60	1,179,003,412.23	1,244,812,197.77
期末可供分配基金份额利润	0.7927	0.6687	0.7746
期末基金资产净值	2,217,578,101.60	2,942,041,731.23	2,851,850,516.77
期末基金份额净值	1.7927	1.6687	1.7746
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	79.27%	66.87%	77.46%

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	-0.19%	2.02%	-0.30%	2.03%	0.11%	-0.01%
过去六个月	16.64%	2.00%	15.84%	2.01%	0.80%	-0.01%

过去一年	7.43%	1.81%	5.46%	1.82%	1.97%	-0.01%
过去三年	-18.32%	1.39%	-22.20%	1.40%	3.88%	-0.01%
过去五年	18.93%	1.36%	8.70%	1.37%	10.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	79.27%	1.56%	66.58%	1.58%	12.69%	-0.02%

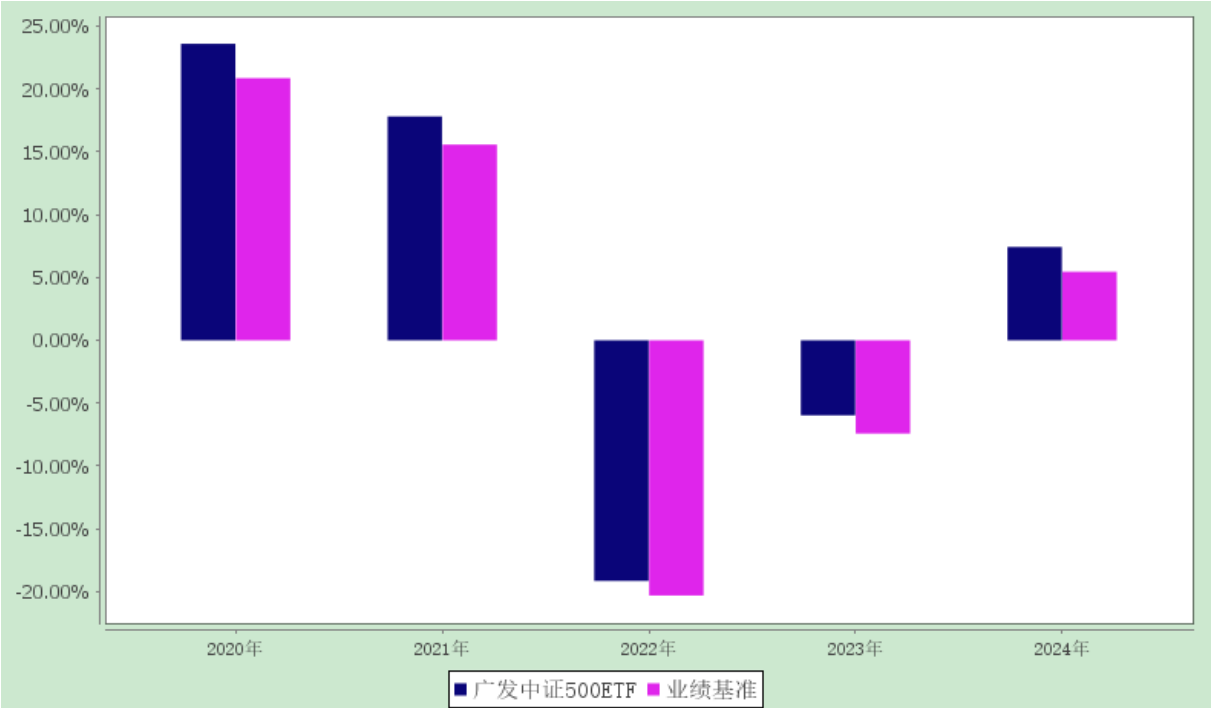
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2024 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；广发中证 500 交易型开放式指数证	2014-04-01	-	20.5 年	刘杰先生，中国籍，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

	券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基			投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 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
--	---	--	--	---

	金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部总经理助理				技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 8 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金经理(自 2023 年 3 月 8 日至 2024 年 3 月 30 日)。
--	--	--	--	--	--

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告

聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 33 次，其中 32 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，A 股市场情绪波动较大，呈现宽幅震荡行情，其中，沪深 300 指数上涨 14.68%，中证 500 指数上涨 5.46%，创业板指上涨 13.23%，北证 50 下跌 4.14%。

2024 年开年延续了 2023 年弱势行情，持续下跌至 2 月初，市场情绪呈现一定过度反应，但随着 2 月份地方楼市政策放松等政策影响以及 ETF 资金逆势流入，市场在超跌探底后快速反弹；2 季度，市场关注点转向基本面，“春季躁动”行情逐渐平息，市场进入窄幅震荡行情；进入 3 季度，一系列以旧换新政策陆续落地，货币政策维持宽松，资本市场也暂停了转融券等做空机制，9 月中下旬开始，监管打出了政策组合拳，不仅下调存款准备金率 0.5 个百分点，创设证券、基金、保险公司互换便利，还推出了大规模化解地方政府隐性债务风险的举措，最终促成市场急速修复；4 季度整体风险偏好迅速回升，市场呈现行业轮动加速、主题投资活跃度上升等特点。总体上，2024 年 A 股在政策与市场博弈中走出“V 型”反转，分化与波动贯穿全年。

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 7.43%，同期业绩比较基准收益率为 5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随美联储降息周期开启，全球资金成本逐步走低，有利于全球经济逐步回暖。国内货币政策转向后，市场估值水平有望得到改善。海内外政策共振大背景下，国内更多政策的推出，例如推动中长期资金入市和指数化投资高质量发展，均有利于市场情绪进一步改善。结构上，随着“以旧换新”等举措的持续推动，更多行业供需矛盾逐步缓解，盈利预期也有望逐步好转，A 股的结构性机会有望较 2024 年进一步增多。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司继续严格遵循“合规、诚信、专业、稳健”的证券基金行业文化核心理念，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

（一）扎实推进各项重要监管规定贯彻落实，通过邀请外部律师解读、制定专项工作方案、明确工作流程、制定工作指引及建立系统监测等，确保新规全面内化。

（二）持续强化内部监督检查，聚焦重大监管政策变化和重点工作部署开展专项检查，对境外投资、投资者适当性、网下打新、子公司治理等多项重要业务及内部治理领域开展了专项检查，进一步规范内部管理。

（三）多措并举完善合规管理工作机制，推进制度体系建设，细化内部管理要求；强化合规培训宣导，持续完善合规培训课程库，不断提高培训专业性、针对性和有效性；改进合规考核工作，进一步优化考核方案和流程。

（四）聚焦员工日常行为管理，从制度建设、培训、检查、考核、问责等多个维度全面优化长效管理机制，从严从实加强员工言行管理，促进全员规范执业。

（五）持续加强投资合规行为日常监控，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平，完善对合规风险的闭环监控，实现对投资组合更精细化的风险管理。

（六）进一步完善公司信息技术合规管理，引进培养信息技术审计专业人才，聘请外部机构开展信息技术全面审计，将信息技术内部检查工作做细做深。

（七）进一步优化洗钱风险管理组织架构，扎实做好客户尽职调查、可疑交易报送和名单监测等工作，积极配合监管机构开展形式丰富的反洗钱宣传工作，持续推动反洗钱系统优化升级，探索提升反洗钱工作质效的有效路径。

（八）持续做好基金宣传推介材料的审核，坚持贯彻基金销售相关法规和监管要求，加强对自媒体账号、对外言论发布、网络直播等领域的合规管理，加大投资者教育和保护力度。

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 2024 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（2025）审字第 70009676_G295 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 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表和净资产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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

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

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金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
高鹤 何明智
中国 北京
2025 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	28,008,110.71	30,263,999.84
结算备付金		13,303,360.47	6,483,854.01
存出保证金		5,358,191.42	4,008,003.85
交易性金融资产	7.4.7.2	2,175,992,864.78	2,907,560,565.10
其中：股票投资		2,173,163,167.05	2,907,350,558.66
基金投资		-	-
债券投资		2,829,697.73	210,006.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		23,960,475.34	16,976,094.71
应收股利		-	512.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	133,621.47
资产总计		2,246,623,002.72	2,965,426,650.98
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20,594,627.56	11,609,871.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		994,046.06	1,198,328.74
应付托管费		198,809.19	239,665.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		59,567.87	20,270.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	7,197,850.44	10,316,782.64
负债合计		29,044,901.12	23,384,919.75
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	1,237,038,319.00	1,763,038,319.00
未分配利润	7.4.7.9	980,539,782.60	1,179,003,412.23
净资产合计		2,217,578,101.60	2,942,041,731.23

负债和净资产总计		2,246,623,002.72	2,965,426,650.98
----------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.7927 元，基金份额总额 1,237,038,319.00 份。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		237,741,130.14	-169,688,122.12
1.利息收入		3,023,582.98	8,976,313.17
其中：存款利息收入	7.4.7.10	326,587.70	267,086.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		2,696,995.28	8,709,226.42
2.投资收益（损失以“-”填列）		-137,197,405.08	-109,996,645.63
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-200,838,779.88	-157,639,306.56
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,766.31	608,075.53
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	4,930,802.69	-1,949,458.55
股利收益	7.4.7.17	58,685,805.80	48,984,043.95
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	366,567,299.60	-70,376,874.93

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	5,347,652.64	1,709,085.27
减：二、营业总支出		18,358,816.37	19,316,464.89
1. 管理人报酬		14,393,999.64	15,149,290.20
2. 托管费		2,878,799.90	3,029,857.98
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		27,514.89	33,907.43
8. 其他费用	7.4.7.21	1,058,501.94	1,103,409.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		219,382,313.77	-189,004,587.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		219,382,313.77	-189,004,587.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		219,382,313.77	-189,004,587.01

7.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,763,038,319.00	1,179,003,412.23	2,942,041,731.23
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,763,038,319.00	1,179,003,412.23	2,942,041,731.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-526,000,000.00	-198,463,629.63	-724,463,629.63

(一)、综合收益总额	-	219,382,313.77	219,382,313.77
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-526,000,000.00	-417,845,943.40	-943,845,943.40
其中: 1.基金申购款	2,676,000,000.00	1,703,261,374.38	4,379,261,374.38
2.基金赎回款	-3,202,000,000.00	-2,121,107,317.78	-5,323,107,317.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	1,237,038,319.00	980,539,782.60	2,217,578,101.60
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,607,038,319.00	1,244,812,197.77	2,851,850,516.77
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,607,038,319.00	1,244,812,197.77	2,851,850,516.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	156,000,000.00	-65,808,785.54	90,191,214.46
(一)、综合收益总额	-	-189,004,587.01	-189,004,587.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	156,000,000.00	123,195,801.47	279,195,801.47
其中: 1.基金申购款	1,122,000,000.00	886,326,206.32	2,008,326,206.32
2.基金赎回款	-966,000,000.00	-763,130,404.85	-1,729,130,404.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	1,763,038,319.00	1,179,003,412.23	2,942,041,731.23

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：葛长伟 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。

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、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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

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：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）金融负债分类

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

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

（3）衍生金融工具

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

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的有关过去事项、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。对于已经开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金管理人在基金满足基金合同约定的收益分配条件后，方可进行收益分配。本基金收益分配比例的确定原则为，使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，且本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管

理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据国税发明电[2002]47 号《黄金交易增值税征收管理办法》，基金买卖黄金现货实盘合约及黄金现货延期交收合约未发生实物交割的，免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额

为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	28,008,110.71	30,263,999.84
等于：本金	28,005,443.56	30,261,707.82
加：应计利息	2,667.15	2,292.02
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	28,008,110.71	30,263,999.84

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,116,839,942.15	-	2,173,163,167.05	56,323,224.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,512,000.00	1,948.03	2,829,697.73	315,749.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,512,000.00	1,948.03	2,829,697.73	315,749.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,119,351,942.15	1,948.03	2,175,992,864.78	56,638,974.60
项目		上年度末			
		2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,217,632,803.66	-	2,907,350,558.66	-310,282,245.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	210,000.00	6.44	210,006.44	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	210,000.00	6.44	210,006.44	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,217,842,803.66	6.44	2,907,560,565.10	-310,282,245.00

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 2024 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	39,151,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	39,151,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	39,151,680.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 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	29,369,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	29,369,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	29,369,040.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

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
IC2501	IC2501	18.00	20,590,560.00	193,440.00
IC2503	IC2503	16.00	18,161,280.00	-593,280.00
合计	-	-	-	-399,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-399,840.00
净额	-	-	-	-

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

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	133,621.47
待摊费用	-	-
合计	-	133,621.47

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024 年 12 月 31 日	2023 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	316,092.15	735,025.31
其中：交易所市场	316,092.15	735,025.31
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	72,000.00	72,000.00
应付指数使用费	212,800.71	224,470.83
应付替代款	6,595,509.55	9,085,537.66
可退替代款	1,448.03	199,748.84
合计	7,197,850.44	10,316,782.64

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,763,038,319.00	1,763,038,319.00
本期申购	2,676,000,000.00	2,676,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,202,000,000.00	-3,202,000,000.00
本期末	1,237,038,319.00	1,237,038,319.00

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	3,392,923,723.03	-2,213,920,310.80	1,179,003,412.23
本期期初	3,392,923,723.03	-2,213,920,310.80	1,179,003,412.23
本期利润	-147,184,985.83	366,567,299.60	219,382,313.77
本期基金份额交易产生的	-938,754,912.79	520,908,969.39	-417,845,943.40

变动数			
其中：基金申购款	4,948,856,324.80	-3,245,594,950.42	1,703,261,374.38
基金赎回款	-5,887,611,237.59	3,766,503,919.81	-2,121,107,317.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,306,983,824.41	-1,326,444,041.81	980,539,782.60

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	155,043.98	79,569.16
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	166,972.69	184,309.61
其他	4,571.03	3,207.98
合计	326,587.70	267,086.75

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-104,417,496.44	-115,611,749.04
股票投资收益——赎回差价收入	-96,421,283.44	-42,027,557.52
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	-200,838,779.88	-157,639,306.56

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	---	--

		月 31 日
卖出股票成交总额	3,311,214,039.76	1,516,254,882.25
减：卖出股票成本总额	3,411,757,040.65	1,628,892,957.69
减：交易费用	3,874,495.55	2,973,673.60
买卖股票差价收入	-104,417,496.44	-115,611,749.04

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	5,323,107,317.78	1,729,130,404.85
减：现金支付赎回款总额	2,675,492,663.78	875,341,672.85
减：赎回股票成本总额	2,744,035,937.44	895,816,289.52
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-96,421,283.44	-42,027,557.52

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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
债券投资收益——利息收入	1,960.16	1,186.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,806.15	606,889.15
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	24,766.31	608,075.53

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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	232,892.78	2,862,218.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	210,000.00	2,254,000.00
减：应计利息总额	77.33	1,215.25
减：交易费用	9.30	114.56
买卖债券差价收入	22,806.15	606,889.15

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	4,930,802.69	-1,949,458.55

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	58,685,805.80	48,984,043.95
其中：证券出借权益补偿收入	3,360,728.77	6,452,997.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	58,685,805.80	48,984,043.95

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
------	----	---------

	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	366,925,973.60	-70,746,099.52
——股票投资	366,610,223.90	-70,746,099.52
——债券投资	315,749.70	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-353,920.00	364,470.59
——权证投资	-	-
——股指期货投资	-353,920.00	364,470.59
3.其他	-4,754.00	4,754.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	366,567,299.60	-70,376,874.93

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	5,347,652.64	1,709,085.27
合计	5,347,652.64	1,709,085.27

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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	72,000.00	72,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	914.88	934.74
指数使用费	863,639.87	908,957.41
其他	1,947.19	1,517.13
合计	1,058,501.94	1,103,409.28

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	基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
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）	基金管理人子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人子公司
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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023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	306,784,509.26	4.92%	-	-

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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023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	-	-	210,000.00	3.94%

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			
	2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券股份有限公司	56,756.95	3.12%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023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、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、2024 年 7 月 1 日前，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；

4、自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,393,999.64	15,149,290.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	91,629.38	85,873.46
应支付基金管理人的净管理费	14,302,370.26	15,063,416.74

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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,878,799.90	3,029,857.98

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				
2024年1月1日至2024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	-	-	-	-
上年度可比期间				

2023年1月1日至2023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	229,326,015.00	186,955.49	-	-

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						
2024年1月1日至2024年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	322,402,059.70	1.30~4.02	1.80	205,033.95	-	-
上年度可比期间						
2023年1月1日至2023年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	529,323,870.50	1.10~4.25	3.02	624,947.14	11,071,934.00	7,696.29

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证 500 交易型开放式指数	978,018,100.00	79.06%	1,429,970,521.00	81.11%

证券投资基金联接基金(LOF)				
广发证券股份有限公司	6,329,046.00	0.51%	1,774,391.00	0.10%

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

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	28,008,110.71	155,043.98	30,263,999.84	79,569.16

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 219,154 股基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股（2023 年 12 月 31 日：325,554 股），成本总额为人民币 3,772,840.14 元（2023 年 12 月 31 日：5,588,086.13 元），估值总额为人民币 4,264,736.84 元（2023 年 12 月 31 日：5,417,218.56 元），占本基金资产净值的比例为 0.19%（2023 年 12 月 31 日：0.18%）。

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（2024 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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	新股流通受限	21.23	65.78	957.00	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6 个月	新股流通受限	55.18	165.78	289.00	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6 个月	新股流通受限	8.00	56.10	804.00	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406.00	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024-12-04	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744.00	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	780.00	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-11-02	6 个月	新股流通受限	17.58	33.06	979.00	17,210.82	32,365.74	-
001391	国货航	2024-12-23	6 个月	新股流通受限	2.30	6.80	4,686.00	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6 个月	新股流通受限	9.40	43.23	652.00	6,128.80	28,185.96	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1 个月内(含)	新股流通受限	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-11-09	6 个月	新股流通受限	6.88	24.84	816.00	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279.00	5,161.50	15,861.15	-
30163	壹连	2024-1	6 个月	新股	72.99	101.96	153.00	11,167	15,599	-

1	科技	1-12		流通受限				.47	.88	
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	396.00	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350.00	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新股流通受限	22.36	44.92	306.00	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新股流通受限	44.50	65.38	184.00	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6 个月	新股流通受限	27.70	41.77	276.00	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新股流通受限	18.09	53.14	215.00	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332.00	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6 个月	新股流通受限	27.76	39.79	253.00	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	233.00	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	6 个月	新股流通受限	14.00	36.14	257.00	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	291.00	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143.00	4,290.00	8,132.41	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	210.00	5,029.50	7,528.50	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6 个月	新股流通受限	9.68	27.91	265.00	2,565.20	7,396.15	-

603395	红四方	2024-1-19	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154.00	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185.00	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	254.00	4,417.06	4,559.30	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	100.00	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	106.00	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6 个月	新股流通受限	14.65	27.35	128.00	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	129.00	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2024 年 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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023-05-19	重大事项停牌	0.01	-	-	2,139,042.00	4,535,045.01	21,390.42	-

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 2024 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 2024 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	2,829,697.73	210,006.44
未评级	-	-
合计	2,829,697.73	210,006.44

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 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标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

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、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,008,110.71	-	-	-	28,008,110.71
结算备付金	13,303,360.47	-	-	-	13,303,360.47
存出保证金	5,358,191.42	-	-	-	5,358,191.42
交易性金融资产	2,829,697.73	-	-	2,173,163,167.05	2,175,992,864.78
应收清算款	-	-	-	23,960,475.34	23,960,475.34
资产总计	49,499,360.33	-	-	2,197,123,642.39	2,246,623,002.72
负债					
应付清算款	-	-	-	20,594,627.56	20,594,627.56
应付管理人报酬	-	-	-	994,046.06	994,046.06
应付托管费	-	-	-	198,809.19	198,809.19
应交税费	-	-	-	59,567.87	59,567.87

其他负债	-	-	-	7,197,850.44	7,197,850.44
负债总计	-	-	-	29,044,901.12	29,044,901.12
利率敏感度缺口	49,499,360.33	-	-	2,168,078,741.27	2,217,578,101.60
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,263,999.84	-	-	-	30,263,999.84
结算备付金	6,483,854.01	-	-	-	6,483,854.01
存出保证金	4,008,003.85	-	-	-	4,008,003.85
交易性金融资产	210,006.44	-	-	2,907,350,558.66	2,907,560,565.10
应收清算款	-	-	-	16,976,094.71	16,976,094.71
应收股利	-	-	-	512.00	512.00
其他资产	-	-	-	133,621.47	133,621.47
资产总计	40,965,864.14	-	-	2,924,460,786.84	2,965,426,650.98
负债					
应付清算款	-	-	-	11,609,871.98	11,609,871.98
应付管理人报酬	-	-	-	1,198,328.74	1,198,328.74
应付托管费	-	-	-	239,665.74	239,665.74
应交税费	-	-	-	20,270.65	20,270.65
其他负债	-	-	-	10,316,782.64	10,316,782.64
负债总计	-	-	-	23,384,919.75	23,384,919.75
利率敏感度缺口	40,965,864.14	-	-	2,901,075,867.09	2,942,041,731.23

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,173,163,167.05	98.00	2,907,350,558.66	98.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,829,697.73	0.13	210,006.44	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,175,992,864.78	98.12	2,907,560,565.10	98.83

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	112,400,924.52	148,323,362.38
	下降 5%	-112,400,924.52	-148,323,362.38

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	2,175,345,731.17	2,906,301,012.34
第二层次	27,736.50	210,006.44
第三层次	619,397.11	1,049,546.32
合计	2,175,992,864.78	2,907,560,565.10

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	1,049,546.32	1,049,546.32
当期购买	-	242,293.99	242,293.99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,028,155.90	1,028,155.90
当期利得或损失总额	-	355,712.70	355,712.70
其中：计入损益的利得或损失	-	355,712.70	355,712.70
期末余额	-	619,397.11	619,397.11

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	-	355,712.70	355,712.70
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	932,375.51	932,375.51
当期购买	-	1,417,880.06	1,417,880.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,638,637.42	2,638,637.42
转出第三层次	-	932,375.51	932,375.51
当期利得或损失总额	-	-3,006,971.16	-3,006,971.16
其中：计入损益的利得或损失	-	-3,006,971.16	-3,006,971.16
期末余额	-	1,049,546.32	1,049,546.32
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	-	-3,006,971.16	-3,006,971.16

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	598,006.69	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	26.65%-574.44%	负相关
退市股票	21,390.42	收益法	未来现金流	0.01	正相关
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
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	1,028,155.90	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%-219.88%	负相关
退市股票	21,390.42	收益法	未来现金流	0.01	正相关

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	2,173,163,167.05	96.73
	其中：普通股	2,165,782,284.55	96.40
	存托凭证	7,380,882.50	0.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,829,697.73	0.13
	其中：债券	2,829,697.73	0.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,311,471.18	1.84
8	其他各项资产	29,318,666.76	1.31
9	合计	2,246,623,002.72	100.00

注：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。

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	12,550,132.63	0.57
B	采矿业	76,140,348.85	3.43
C	制造业	1,349,480,614.64	60.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,770,273.57	3.60
E	建筑业	23,591,702.89	1.06
F	批发和零售业	51,842,656.36	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	33,218,032.28	1.50
H	住宿和餐饮业	6,847,285.03	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,874,370.51	8.61
J	金融业	225,074,128.41	10.15
K	房地产业	27,828,647.02	1.25
L	租赁和商务服务业	18,943,022.54	0.85
M	科学研究和技术服务业	15,026,986.79	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	10,532,316.55	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,183,640.00	0.23
Q	卫生和社会工作	12,604,076.60	0.57
R	文化、体育和娱乐业	28,399,087.39	1.28
S	综合	5,255,844.99	0.24
	合计	2,173,163,167.05	98.00

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	002625	光启技术	466,501	22,298,747.80	1.01
2	600418	江淮汽车	540,631	20,273,662.50	0.91
3	000988	华工科技	311,336	13,480,848.80	0.61
4	002384	东山精密	422,758	12,344,533.60	0.56
5	300339	润和软件	246,400	12,327,392.00	0.56
6	600157	永泰能源	6,844,725	11,704,479.75	0.53
7	600839	四川长虹	1,142,556	11,025,665.40	0.50
8	002797	第一创业	1,300,585	10,859,884.75	0.49
9	600487	亨通光电	611,200	10,524,864.00	0.47
10	301236	软通动力	176,875	10,384,331.25	0.47
11	002340	格林美	1,587,311	10,365,140.83	0.47
12	300207	欣旺达	456,900	10,193,439.00	0.46
13	002156	通富微电	329,150	9,726,382.50	0.44
14	688777	中控技术	195,793	9,725,038.31	0.44
15	601162	天风证券	2,144,786	9,608,641.28	0.43
16	601555	东吴证券	1,230,721	9,599,623.80	0.43
17	002273	水晶光电	430,991	9,576,620.02	0.43
18	002966	苏州银行	1,164,439	9,443,600.29	0.43
19	002185	华天科技	792,970	9,206,381.70	0.42
20	601099	太平洋	2,109,800	8,987,748.00	0.41
21	601933	永辉超市	1,404,700	8,905,798.00	0.40
22	600096	云天化	397,109	8,855,530.70	0.40
23	002202	金风科技	855,500	8,837,315.00	0.40
24	000423	东阿阿胶	139,645	8,758,534.40	0.39
25	000066	中国长城	599,100	8,728,887.00	0.39
26	600536	中国软件	184,122	8,596,656.18	0.39
27	600352	浙江龙盛	806,533	8,299,224.57	0.37
28	601168	西部矿业	516,051	8,292,939.57	0.37
29	600079	人福医药	353,342	8,261,135.96	0.37
30	600885	宏发股份	258,617	8,229,192.94	0.37
31	601108	财通证券	1,004,710	8,208,480.70	0.37
32	600988	赤峰黄金	514,221	8,026,989.81	0.36
33	300017	网宿科技	755,360	7,984,155.20	0.36
34	002738	中矿资源	223,166	7,922,393.00	0.36
35	300476	胜宏科技	186,700	7,858,203.00	0.35
36	002138	顺络电子	249,352	7,849,600.96	0.35
37	601577	长沙银行	871,433	7,747,039.37	0.35
38	002078	太阳纸业	519,097	7,718,972.39	0.35
39	002281	光迅科技	147,388	7,689,231.96	0.35
40	300136	信维通信	299,560	7,620,806.40	0.34
41	300474	景嘉微	81,101	7,582,132.49	0.34
42	002085	万丰奥威	393,600	7,458,720.00	0.34

43	689009	九号公司	155,387	7,380,882.50	0.33
44	600879	航天电子	817,743	7,326,977.28	0.33
45	300803	指南针	75,900	7,282,605.00	0.33
46	300058	蓝色光标	781,462	7,251,967.36	0.33
47	002517	恺英网络	532,400	7,245,964.00	0.33
48	002444	巨星科技	222,830	7,208,550.50	0.33
49	688120	华海清科	44,218	7,207,091.82	0.32
50	300223	北京君正	104,300	7,113,260.00	0.32
51	688099	晶晨股份	103,551	7,111,882.68	0.32
52	603893	瑞芯微	64,491	7,097,879.46	0.32
53	601615	明阳智能	562,600	7,094,386.00	0.32
54	601128	常熟银行	932,992	7,062,749.44	0.32
55	300002	神州泰岳	606,900	7,033,971.00	0.32
56	002353	杰瑞股份	190,134	7,033,056.66	0.32
57	600109	国金证券	803,531	7,014,825.63	0.32
58	000783	长江证券	1,026,674	7,001,916.68	0.32
59	002195	岩山科技	1,759,551	6,985,417.47	0.32
60	300024	机器人	388,164	6,967,543.80	0.31
61	603160	汇顶科技	85,198	6,861,846.92	0.31
62	600298	安琪酵母	188,500	6,795,425.00	0.31
63	002128	电投能源	346,863	6,791,577.54	0.31
64	002223	鱼跃医疗	186,100	6,790,789.00	0.31
65	688617	惠泰医疗	18,238	6,790,554.54	0.31
66	002532	天山铝业	862,800	6,790,236.00	0.31
67	300496	中科创达	113,910	6,784,479.60	0.31
68	000728	国元证券	809,581	6,768,097.16	0.31
69	002673	西部证券	829,667	6,761,786.05	0.30
70	002465	海格通信	614,110	6,742,927.80	0.30
71	688469	芯联集成-U	1,309,526	6,717,868.38	0.30
72	603606	东方电缆	127,800	6,715,890.00	0.30
73	688213	思特威-W	86,379	6,713,375.88	0.30
74	601567	三星医疗	218,100	6,708,756.00	0.30
75	688072	拓荆科技	43,343	6,660,518.81	0.30
76	601198	东兴证券	601,099	6,618,099.99	0.30
77	600765	中航重机	321,678	6,584,748.66	0.30
78	300114	中航电测	91,300	6,553,514.00	0.30
79	600862	中航高科	258,469	6,528,926.94	0.29
80	002008	大族激光	260,472	6,511,800.00	0.29
81	688047	龙芯中科	49,200	6,508,176.00	0.29
82	300383	光环新网	445,015	6,492,768.85	0.29
83	300012	华测检测	520,124	6,465,141.32	0.29
84	300866	安克创新	65,960	6,440,334.40	0.29
85	000831	中国稀土	229,427	6,435,427.35	0.29
86	600895	张江高科	240,021	6,432,562.80	0.29

87	002472	双环传动	210,003	6,430,291.86	0.29
88	301358	湖南裕能	140,800	6,381,056.00	0.29
89	600177	雅戈尔	716,653	6,378,211.70	0.29
90	603605	珀莱雅	73,700	6,242,390.00	0.28
91	300699	光威复材	179,912	6,233,950.80	0.28
92	002595	豪迈科技	123,908	6,218,942.52	0.28
93	600873	梅花生物	619,132	6,209,893.96	0.28
94	601233	桐昆股份	521,481	6,153,475.80	0.28
95	300037	新宙邦	163,229	6,111,293.76	0.28
96	300395	菲利华	161,700	6,081,537.00	0.27
97	000400	许继电气	220,339	6,065,932.67	0.27
98	688122	西部超导	141,131	6,043,229.42	0.27
99	300054	鼎龙股份	232,000	6,036,640.00	0.27
100	300604	长川科技	136,000	6,001,680.00	0.27
101	300142	沃森生物	495,100	5,980,808.00	0.27
102	601990	南京证券	685,471	5,936,178.86	0.27
103	000750	国海证券	1,381,488	5,912,768.64	0.27
104	603596	伯特利	131,751	5,874,777.09	0.26
105	000009	中国宝安	638,725	5,844,333.75	0.26
106	002436	兴森科技	523,800	5,819,418.00	0.26
107	688249	晶合集成	248,763	5,806,128.42	0.26
108	688525	佰维存储	93,170	5,773,744.90	0.26
109	600369	西南证券	1,236,025	5,772,236.75	0.26
110	600642	申能股份	606,477	5,755,466.73	0.26
111	601696	中银证券	515,639	5,754,531.24	0.26
112	600153	建发股份	546,437	5,748,517.24	0.26
113	002850	科达利	58,735	5,737,234.80	0.26
114	002261	拓维信息	311,600	5,705,396.00	0.26
115	688521	芯原股份	108,228	5,674,394.04	0.26
116	600143	金发科技	652,366	5,636,442.24	0.25
117	002821	凯莱英	73,600	5,600,224.00	0.25
118	600398	海澜之家	743,514	5,576,355.00	0.25
119	000021	深科技	289,332	5,514,667.92	0.25
120	601216	君正集团	1,037,900	5,459,354.00	0.25
121	300724	捷佳伟创	86,147	5,445,351.87	0.25
122	000738	航发控制	243,912	5,424,602.88	0.24
123	601997	贵阳银行	903,610	5,421,660.00	0.24
124	000932	华菱钢铁	1,283,523	5,365,126.14	0.24
125	002294	信立泰	172,605	5,338,672.65	0.24
126	002558	巨人网络	418,600	5,312,034.00	0.24
127	600529	山东药玻	205,355	5,291,998.35	0.24
128	600909	华安证券	872,750	5,288,865.00	0.24
129	000878	云南铜业	433,408	5,283,243.52	0.24
130	600497	驰宏锌锗	944,774	5,262,391.18	0.24

131	000729	燕京啤酒	437,052	5,262,106.08	0.24
132	600673	东阳光	465,531	5,255,844.99	0.24
133	300919	中伟股份	144,900	5,233,788.00	0.24
134	688002	睿创微纳	111,005	5,218,345.05	0.24
135	600141	兴发集团	239,143	5,189,403.10	0.23
136	002607	中公教育	1,524,600	5,183,640.00	0.23
137	603345	安井食品	63,500	5,173,980.00	0.23
138	688361	中科飞测	58,966	5,162,473.30	0.23
139	002409	雅克科技	88,593	5,133,964.35	0.23
140	000623	吉林敖东	296,216	5,115,650.32	0.23
141	600155	华创云信	689,512	5,102,388.80	0.23
142	000997	新大陆	255,492	5,097,065.40	0.23
143	000034	神州数码	145,300	5,092,765.00	0.23
144	603338	浙江鼎力	78,400	5,058,368.00	0.23
145	000733	振华科技	119,800	5,051,966.00	0.23
146	300073	当升科技	125,416	5,051,756.48	0.23
147	002065	东华软件	695,406	5,048,647.56	0.23
148	600549	厦门钨业	261,343	5,036,079.61	0.23
149	002064	华峰化学	614,500	5,026,610.00	0.23
150	300001	特锐德	228,445	5,014,367.75	0.23
151	601665	齐鲁银行	896,638	5,012,206.42	0.23
152	600118	中国卫星	183,072	4,997,865.60	0.23
153	601456	国联民生	369,515	4,995,842.80	0.23
154	002318	久立特材	213,400	4,995,694.00	0.23
155	688188	柏楚电子	25,588	4,970,469.00	0.22
156	002432	九安医疗	121,550	4,956,809.00	0.22
157	600563	法拉电子	41,527	4,938,390.84	0.22
158	603087	甘李药业	111,506	4,917,414.60	0.22
159	002739	万达电影	403,800	4,902,132.00	0.22
160	600820	隧道股份	679,839	4,888,042.41	0.22
161	600704	物产中大	962,148	4,868,468.88	0.22
162	600580	卧龙电驱	282,692	4,859,475.48	0.22
163	600521	华海药业	271,473	4,851,222.51	0.22
164	600312	平高电气	252,500	4,848,000.00	0.22
165	600637	东方明珠	624,575	4,846,702.00	0.22
166	600060	海信视像	241,991	4,825,300.54	0.22
167	601179	中国西电	633,689	4,809,699.51	0.22
168	002410	广联达	408,100	4,799,256.00	0.22
169	600699	均胜电子	305,437	4,786,197.79	0.22
170	002841	视源股份	129,300	4,772,463.00	0.22
171	600132	重庆啤酒	74,900	4,720,198.00	0.21
172	002984	森麒麟	190,960	4,709,073.60	0.21
173	002385	大北农	1,068,468	4,626,466.44	0.21
174	300003	乐普医疗	407,285	4,618,611.90	0.21

175	601666	平煤股份	459,904	4,608,238.08	0.21
176	002262	恩华药业	188,900	4,599,715.00	0.21
177	603568	伟明环保	211,295	4,570,310.85	0.21
178	002568	百润股份	162,253	4,544,706.53	0.20
179	603939	益丰药房	188,134	4,539,673.42	0.20
180	300763	锦浪科技	74,200	4,531,394.00	0.20
181	688180	君实生物-U	165,760	4,530,220.80	0.20
182	300144	宋城演艺	487,600	4,529,804.00	0.20
183	000683	远兴能源	808,964	4,522,108.76	0.20
184	300751	迈为股份	43,000	4,521,450.00	0.20
185	603179	新泉股份	105,500	4,504,850.00	0.20
186	600390	五矿资本	695,610	4,486,684.50	0.20
187	600392	盛和资源	436,416	4,486,356.48	0.20
188	600008	首创环保	1,364,025	4,474,002.00	0.20
189	002152	广电运通	383,537	4,472,041.42	0.20
190	002044	美年健康	970,200	4,453,218.00	0.20
191	000039	中集集团	571,045	4,437,019.65	0.20
192	002407	多氟多	369,380	4,432,560.00	0.20
193	300373	扬杰科技	100,904	4,391,342.08	0.20
194	000513	丽珠集团	115,136	4,375,168.00	0.20
195	600863	内蒙华电	1,010,341	4,374,776.53	0.20
196	600486	扬农化工	75,586	4,374,161.82	0.20
197	603589	口子窖	111,338	4,368,903.12	0.20
198	603129	春风动力	27,800	4,366,546.00	0.20
199	600170	上海建工	1,647,368	4,365,525.20	0.20
200	300529	健帆生物	148,549	4,358,427.66	0.20
201	002624	完美世界	420,264	4,341,327.12	0.20
202	601717	郑煤机	333,667	4,330,997.66	0.20
203	601000	唐山港	917,903	4,323,323.13	0.19
204	300251	光线传媒	455,697	4,301,779.68	0.19
205	000960	锡业股份	306,206	4,296,070.18	0.19
206	600763	通策医疗	96,624	4,290,105.60	0.19
207	600316	洪都航空	133,516	4,288,533.92	0.19
208	600872	中炬高新	194,500	4,282,890.00	0.19
209	000703	恒逸石化	680,473	4,273,370.44	0.19
210	000426	兴业银锡	384,000	4,270,080.00	0.19
211	600498	烽火通信	219,154	4,264,736.84	0.19
212	600816	建元信托	1,218,200	4,263,700.00	0.19
213	000723	美锦能源	938,700	4,233,537.00	0.19
214	603816	顾家家居	152,525	4,206,639.50	0.19
215	300285	国瓷材料	246,802	4,205,506.08	0.19
216	600516	方大炭素	870,440	4,204,225.20	0.19
217	300558	贝达药业	77,891	4,200,661.63	0.19
218	603979	金诚信	115,700	4,199,910.00	0.19

219	002958	青农商行	1,377,893	4,188,794.72	0.19
220	002500	山西证券	665,298	4,178,071.44	0.19
221	300390	天华新能	180,314	4,156,237.70	0.19
222	000921	海信家电	143,630	4,150,907.00	0.19
223	002603	以岭药业	259,100	4,148,191.00	0.19
224	000629	钒钛股份	1,439,533	4,145,855.04	0.19
225	000830	鲁西化工	354,572	4,144,946.68	0.19
226	688578	艾力斯	69,187	4,144,301.30	0.19
227	605358	立昂微	166,439	4,122,694.03	0.19
228	002025	航天电器	84,833	4,119,490.48	0.19
229	002939	长城证券	501,033	4,108,470.60	0.19
230	000893	亚钾国际	203,500	4,102,560.00	0.19
231	000636	风华高科	285,821	4,101,531.35	0.18
232	002155	湖南黄金	260,413	4,096,296.49	0.18
233	601966	玲珑轮胎	226,374	4,083,786.96	0.18
234	002429	兆驰股份	700,988	4,051,710.64	0.18
235	002926	华西证券	487,567	4,051,681.77	0.18
236	688052	纳芯微	31,087	4,050,636.10	0.18
237	000591	太阳能	848,124	4,037,070.24	0.18
238	601880	辽港股份	2,325,776	4,023,592.48	0.18
239	600535	天士力	277,745	4,016,192.70	0.18
240	600998	九州通	780,926	3,998,341.12	0.18
241	600021	上海电力	435,300	3,991,701.00	0.18
242	600511	国药股份	116,572	3,989,093.84	0.18
243	002203	海亮股份	370,752	3,985,584.00	0.18
244	600348	华阳股份	557,477	3,952,511.93	0.18
245	603927	中科软	181,327	3,934,795.90	0.18
246	600380	健康元	348,708	3,929,939.16	0.18
247	600325	华发股份	681,026	3,922,709.76	0.18
248	600038	中直股份	101,631	3,918,891.36	0.18
249	002414	高德红外	527,400	3,918,582.00	0.18
250	603077	和邦生物	1,915,059	3,906,720.36	0.18
251	600208	衢州发展	1,314,697	3,891,503.12	0.18
252	600655	豫园股份	604,134	3,884,581.62	0.18
253	600970	中材国际	408,524	3,872,807.52	0.17
254	300567	精测电子	59,400	3,819,420.00	0.17
255	002423	中粮资本	285,192	3,818,720.88	0.17
256	300146	汤臣倍健	316,457	3,813,306.85	0.17
257	601016	节能风电	1,201,707	3,809,411.19	0.17
258	600754	锦江酒店	141,700	3,806,062.00	0.17
259	688385	复旦微电	99,108	3,804,756.12	0.17
260	000060	中金岭南	809,459	3,796,362.71	0.17
261	300748	金力永磁	212,087	3,792,115.56	0.17
262	600859	王府井	245,566	3,784,172.06	0.17

263	002756	永兴材料	100,230	3,780,675.60	0.17
264	603000	人民网	170,808	3,764,608.32	0.17
265	300487	蓝晓科技	78,570	3,761,145.90	0.17
266	600583	海油工程	685,100	3,747,497.00	0.17
267	000519	中兵红箭	258,485	3,735,108.25	0.17
268	002683	广东宏大	140,943	3,732,170.64	0.17
269	600901	江苏金租	711,819	3,715,695.18	0.17
270	603885	吉祥航空	271,137	3,714,576.90	0.17
271	600166	福田汽车	1,470,895	3,691,946.45	0.17
272	600707	彩虹股份	445,563	3,662,527.86	0.17
273	000998	隆平高科	326,995	3,652,534.15	0.16
274	688278	特宝生物	49,779	3,652,285.23	0.16
275	300212	易华录	155,907	3,648,223.80	0.16
276	600546	山煤国际	306,820	3,629,680.60	0.16
277	603156	养元饮品	156,978	3,585,377.52	0.16
278	600282	南钢股份	762,317	3,575,266.73	0.16
279	002439	启明星辰	225,521	3,567,742.22	0.16
280	300601	康泰生物	208,000	3,567,200.00	0.16
281	300677	英科医疗	140,400	3,549,312.00	0.16
282	601001	晋控煤业	259,400	3,545,998.00	0.16
283	600004	白云机场	367,300	3,526,080.00	0.16
284	600131	国网信通	186,461	3,525,977.51	0.16
285	002507	涪陵榨菜	249,418	3,524,276.34	0.16
286	000598	兴蓉环境	462,094	3,507,293.46	0.16
287	688220	翱捷科技-U	64,549	3,491,455.41	0.16
288	688065	凯赛生物	89,906	3,488,352.80	0.16
289	002373	千方科技	342,748	3,475,464.72	0.16
290	300765	新诺威	130,300	3,464,677.00	0.16
291	600867	通化东宝	429,137	3,458,844.22	0.16
292	002653	海思科	103,898	3,454,608.50	0.16
293	601918	新集能源	480,500	3,449,990.00	0.16
294	603899	晨光股份	114,000	3,448,500.00	0.16
295	000050	深天马 A	380,494	3,435,860.82	0.15
296	600483	福能股份	343,178	3,421,484.66	0.15
297	300070	碧水源	674,531	3,413,126.86	0.15
298	688017	绿的谐波	31,475	3,401,188.50	0.15
299	688772	珠海冠宇	210,241	3,380,675.28	0.15
300	002120	韵达股份	449,400	3,379,488.00	0.15
301	000563	陕国投 A	948,639	3,377,154.84	0.15
302	300118	东方日升	281,600	3,373,568.00	0.15
303	600737	中粮糖业	330,409	3,373,475.89	0.15
304	601611	中国核建	373,057	3,372,435.28	0.15
305	601231	环旭电子	203,405	3,356,182.50	0.15
306	603486	科沃斯	71,400	3,355,800.00	0.15

307	601098	中南传媒	222,513	3,339,920.13	0.15
308	601155	新城控股	278,800	3,334,448.00	0.15
309	002430	杭氧股份	152,347	3,321,164.60	0.15
310	603290	斯达半导	36,943	3,318,220.26	0.15
311	002244	滨江集团	384,784	3,312,990.24	0.15
312	601156	东航物流	196,153	3,309,101.11	0.15
313	600566	济川药业	113,728	3,307,210.24	0.15
314	301308	江波龙	38,300	3,293,800.00	0.15
315	603529	爱玛科技	80,255	3,292,060.10	0.15
316	688005	容百科技	104,209	3,287,793.95	0.15
317	601991	大唐发电	1,151,936	3,283,017.60	0.15
318	000987	越秀资本	465,295	3,266,370.90	0.15
319	002056	横店东磁	251,669	3,261,630.24	0.15
320	300676	华大基因	77,393	3,248,184.21	0.15
321	600598	北大荒	220,127	3,246,873.25	0.15
322	600416	湘电股份	286,700	3,236,843.00	0.15
323	603228	景旺电子	115,933	3,227,574.72	0.15
324	000818	航锦科技	168,500	3,218,350.00	0.15
325	601866	中远海发	1,228,840	3,207,272.40	0.14
326	002368	太极股份	135,405	3,206,390.40	0.14
327	000887	中鼎股份	243,942	3,200,519.04	0.14
328	600435	北方导航	325,017	3,172,165.92	0.14
329	300595	欧普康视	166,831	3,161,447.45	0.14
330	600582	天地科技	511,252	3,159,537.36	0.14
331	603658	安图生物	72,050	3,144,262.00	0.14
332	002508	老板电器	146,618	3,142,023.74	0.14
333	002670	国盛金控	239,813	3,139,152.17	0.14
334	300009	安科生物	363,289	3,138,816.96	0.14
335	600271	航天信息	343,768	3,131,726.48	0.14
336	002240	盛新锂能	226,931	3,127,109.18	0.14
337	000958	电投产融	501,393	3,123,678.39	0.14
338	002831	裕同科技	115,119	3,119,724.90	0.14
339	600755	厦门国贸	468,495	3,110,806.80	0.14
340	002572	索菲亚	178,523	3,067,025.14	0.14
341	000155	川能动力	285,244	3,046,405.92	0.14
342	600258	首旅酒店	207,309	3,041,223.03	0.14
343	300888	稳健医疗	72,013	3,030,307.04	0.14
344	300573	兴齐眼药	43,300	3,021,474.00	0.14
345	600685	中船防务	127,100	3,012,270.00	0.14
346	688363	华熙生物	58,951	3,008,859.04	0.14
347	601958	金钼股份	298,674	3,004,660.44	0.14
348	600995	南网储能	296,900	3,004,628.00	0.14
349	000883	湖北能源	602,287	2,999,389.26	0.14
350	600848	上海临港	296,642	2,996,084.20	0.14

351	688114	华大智造	63,898	2,989,787.42	0.13
352	688538	和辉光电-U	1,287,400	2,986,768.00	0.13
353	600129	太极集团	120,568	2,980,440.96	0.13
354	002268	电科网安	183,016	2,974,010.00	0.13
355	600378	昊华科技	102,807	2,972,150.37	0.13
356	603444	吉比特	13,529	2,960,686.36	0.13
357	000739	普洛药业	181,610	2,952,978.60	0.13
358	600739	辽宁成大	285,006	2,949,812.10	0.13
359	003031	中瓷电子	55,860	2,926,505.40	0.13
360	600517	国网英大	531,076	2,926,228.76	0.13
361	603379	三美股份	75,979	2,916,074.02	0.13
362	603298	杭叉集团	162,480	2,906,767.20	0.13
363	000027	深圳能源	443,412	2,873,309.76	0.13
364	601118	海南橡胶	529,367	2,863,875.47	0.13
365	000403	派林生物	135,300	2,858,889.00	0.13
366	600906	财达证券	400,725	2,845,147.50	0.13
367	000778	新兴铸管	740,474	2,843,420.16	0.13
368	000785	居然智家	793,202	2,831,731.14	0.13
369	000709	河钢股份	1,277,585	2,823,462.85	0.13
370	603728	鸣志电器	51,900	2,802,600.00	0.13
371	603712	七一二	143,368	2,791,374.96	0.13
372	603737	三棵树	65,501	2,790,342.60	0.13
373	601636	旗滨集团	496,991	2,788,119.51	0.13
374	600499	科达制造	357,289	2,786,854.20	0.13
375	002299	圣农发展	192,462	2,786,849.76	0.13
376	600528	中铁工业	344,084	2,773,317.04	0.13
377	601399	国机重装	892,600	2,749,208.00	0.12
378	600606	绿地控股	1,306,500	2,743,650.00	0.12
379	600373	中文传媒	217,482	2,729,399.10	0.12
380	002557	洽洽食品	93,913	2,728,172.65	0.12
381	002080	中材科技	208,146	2,722,549.68	0.12
382	601928	凤凰传媒	235,612	2,718,962.48	0.12
383	600329	达仁堂	88,172	2,715,697.60	0.12
384	603858	步长制药	171,373	2,707,693.40	0.12
385	688234	天岳先进	52,667	2,696,550.40	0.12
386	600977	中国电影	231,300	2,685,393.00	0.12
387	600968	海油发展	627,635	2,680,001.45	0.12
388	688536	思瑞浦	28,946	2,677,505.00	0.12
389	688567	孚能科技	226,132	2,623,131.20	0.12
390	601598	中国外运	487,229	2,606,675.15	0.12
391	603650	彤程新材	74,512	2,605,684.64	0.12
392	600884	杉杉股份	349,100	2,600,795.00	0.12
393	600959	江苏有线	772,785	2,588,829.75	0.12
394	600056	中国医药	231,667	2,571,503.70	0.12

395	600871	石化油服	1,257,574	2,565,450.96	0.12
396	600095	湘财股份	354,881	2,555,143.20	0.12
397	601212	白银有色	916,200	2,547,036.00	0.11
398	600062	华润双鹤	128,385	2,542,023.00	0.11
399	688387	信科移动-U	424,749	2,531,504.04	0.11
400	002266	浙富控股	811,118	2,530,688.16	0.11
401	600801	华新水泥	208,455	2,522,305.50	0.11
402	000559	万向钱潮	409,226	2,516,739.90	0.11
403	688297	中无人机	62,457	2,515,767.96	0.11
404	000032	深桑达 A	141,600	2,497,824.00	0.11
405	600764	中国海防	87,986	2,491,763.52	0.11
406	002372	伟星新材	196,918	2,487,074.34	0.11
407	601106	中国一重	845,841	2,461,397.31	0.11
408	000825	太钢不锈	704,094	2,450,247.12	0.11
409	301301	川宁生物	206,000	2,443,160.00	0.11
410	002019	亿帆医药	226,657	2,429,763.04	0.11
411	002487	大金重工	118,016	2,418,147.84	0.11
412	603688	石英股份	83,942	2,411,653.66	0.11
413	600663	陆家嘴	243,947	2,400,438.48	0.11
414	603882	金域医学	86,500	2,381,345.00	0.11
415	601608	中信重工	566,926	2,381,089.20	0.11
416	688778	厦钨新能	51,644	2,357,032.16	0.11
417	688563	航材股份	42,042	2,347,625.28	0.11
418	688349	三一重能	75,693	2,337,399.84	0.11
419	600808	马钢股份	746,009	2,305,167.81	0.10
420	603456	九洲药业	166,160	2,273,068.80	0.10
421	688561	奇安信-U	84,295	2,261,634.85	0.10
422	600925	苏能股份	425,000	2,252,500.00	0.10
423	603556	海兴电力	60,500	2,237,895.00	0.10
424	300957	贝泰妮	52,400	2,236,956.00	0.10
425	600500	中化国际	555,098	2,231,493.96	0.10
426	002408	齐翔腾达	441,147	2,218,969.41	0.10
427	601019	山东出版	194,300	2,205,305.00	0.10
428	002531	天顺风能	278,736	2,204,801.76	0.10
429	600578	京能电力	621,400	2,187,328.00	0.10
430	601965	中国汽研	123,900	2,183,118.00	0.10
431	001227	兰州银行	884,614	2,176,150.44	0.10
432	688425	铁建重工	493,175	2,169,970.00	0.10
433	600350	山东高速	210,251	2,161,380.28	0.10
434	001286	陕西能源	232,467	2,157,293.76	0.10
435	603233	大参林	141,715	2,134,227.90	0.10
436	688390	固德威	51,907	2,122,996.30	0.10
437	600612	老凤祥	39,100	2,121,957.00	0.10
438	688301	奕瑞科技	22,192	2,120,889.44	0.10

439	603225	新凤鸣	189,096	2,104,638.48	0.09
440	600098	广州发展	326,700	2,097,414.00	0.09
441	688516	奥特维	48,420	2,097,070.20	0.09
442	000937	冀中能源	329,195	2,080,512.40	0.09
443	601568	北元集团	493,211	2,071,486.20	0.09
444	603185	弘元绿能	126,640	2,057,900.00	0.09
445	600688	上海石化	678,700	2,049,674.00	0.09
446	600126	杭钢股份	415,768	1,987,371.04	0.09
447	603707	健友股份	149,760	1,987,315.20	0.09
448	002867	周大生	135,928	1,975,033.84	0.09
449	000967	盈峰环境	393,100	1,953,707.00	0.09
450	603883	老百姓	117,824	1,928,778.88	0.09
451	601139	深圳燃气	267,670	1,889,750.20	0.09
452	600720	中交设计	213,000	1,887,180.00	0.09
453	600339	中油工程	517,156	1,851,418.48	0.08
454	601992	金隅集团	1,030,829	1,834,875.62	0.08
455	002153	石基信息	253,211	1,807,926.54	0.08
456	002608	江苏国信	234,982	1,802,311.94	0.08
457	600295	鄂尔多斯	182,600	1,782,176.00	0.08
458	000898	鞍钢股份	740,237	1,776,568.80	0.08
459	002563	森马服饰	249,743	1,753,195.86	0.08
460	000537	中绿电	191,491	1,746,397.92	0.08
461	688032	禾迈股份	15,364	1,730,600.96	0.08
462	000401	冀东水泥	330,182	1,726,851.86	0.08
463	300140	节能环保	287,700	1,723,323.00	0.08
464	003022	联泓新科	123,600	1,701,972.00	0.08
465	688281	华秦科技	18,134	1,688,275.40	0.08
466	688248	南网科技	51,672	1,658,154.48	0.07
467	600032	浙江新能	222,200	1,644,280.00	0.07
468	688331	荣昌生物	54,551	1,642,530.61	0.07
469	002690	美亚光电	109,231	1,618,803.42	0.07
470	601228	广州港	464,675	1,575,248.25	0.07
471	600299	安迪苏	123,629	1,551,543.95	0.07
472	603786	科博达	25,104	1,551,427.20	0.07
473	301165	锐捷网络	21,200	1,530,640.00	0.07
474	600007	中国国贸	62,000	1,516,520.00	0.07
475	688520	神州细胞-U	41,858	1,516,515.34	0.07
476	600928	西安银行	413,106	1,491,312.66	0.07
477	301267	华夏眼科	77,700	1,479,408.00	0.07
478	688172	燕东微	73,715	1,477,985.75	0.07
479	600361	创新新材	382,400	1,476,064.00	0.07
480	000959	首钢股份	482,429	1,471,408.45	0.07
481	003035	南网能源	349,579	1,461,240.22	0.07
482	688475	萤石网络	48,155	1,453,799.45	0.07

483	603056	德邦股份	94,866	1,359,429.78	0.06
484	002945	华林证券	84,325	1,292,702.25	0.06
485	000539	粤电力 A	277,200	1,255,716.00	0.06
486	301498	乖宝宠物	16,000	1,253,120.00	0.06
487	601061	中信金属	168,100	1,220,406.00	0.06
488	001203	大中矿业	140,109	1,213,343.94	0.05
489	688375	国博电子	24,276	1,198,263.36	0.05
490	600927	永安期货	89,980	1,186,836.20	0.05
491	603826	坤彩科技	61,365	1,181,276.25	0.05
492	688819	天能股份	42,356	1,152,930.32	0.05
493	601858	中国科传	48,400	986,392.00	0.04
494	688276	百克生物	38,824	974,870.64	0.04
495	688153	唯捷创芯	26,775	895,891.50	0.04
496	601158	重庆水务	177,600	870,240.00	0.04
497	603341	龙旗科技	15,900	743,325.00	0.03
498	600956	新天绿能	94,619	713,427.26	0.03
499	688295	中复神鹰	31,244	622,692.92	0.03
500	603868	飞科电器	14,928	619,810.56	0.03
501	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
502	300296	利亚德	8,800	56,672.00	0.00
503	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
504	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
505	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
506	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
507	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
508	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
509	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
510	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
511	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
512	400174	中天 3	2,139,042	21,390.42	0.00
513	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
514	601033	永兴股份	1,258	18,190.68	0.00
515	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
516	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
517	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
518	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
519	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
520	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
521	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
522	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
523	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
524	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
525	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
526	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00

527	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
528	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
529	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
530	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
531	301539	宏鑫科技	361	6,682.11	0.00
532	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
533	002865	钧达股份	99	5,058.90	0.00
534	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
535	001379	腾达科技	213	4,867.05	0.00
536	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
537	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
538	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
539	603082	北自科技	107	3,627.30	0.00
540	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
541	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
542	603375	盛景微	72	2,692.08	0.00
543	001387	雪祺电气	173	2,399.51	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	300502	新易盛	41,849,006.01	1.42
2	300394	天孚通信	27,835,414.41	0.95
3	002028	思源电气	24,749,510.32	0.84
4	002340	格林美	23,045,836.00	0.78
5	000933	神火股份	22,670,523.32	0.77
6	000988	华工科技	22,291,432.00	0.76
7	002625	光启技术	21,920,785.83	0.75
8	002463	沪电股份	20,813,244.24	0.71
9	002966	苏州银行	20,529,956.13	0.70
10	000630	铜陵有色	19,759,574.00	0.67
11	300418	昆仑万维	19,530,051.73	0.66
12	002156	通富微电	18,912,651.00	0.64
13	000975	山金国际	18,834,932.80	0.64
14	301236	软通动力	18,688,966.74	0.64
15	002422	科伦药业	18,143,435.40	0.62
16	002517	恺英网络	18,130,514.94	0.62
17	002738	中矿资源	17,662,356.60	0.60

18	002078	太阳纸业	17,485,668.53	0.59
19	300207	欣旺达	16,860,874.23	0.57
20	002797	第一创业	16,850,481.00	0.57

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	300502	新易盛	83,178,978.20	2.83
2	300394	天孚通信	45,844,752.65	1.56
3	002028	思源电气	45,632,789.72	1.55
4	002463	沪电股份	41,778,211.01	1.42
5	002422	科伦药业	35,981,191.30	1.22
6	000933	神火股份	34,967,252.54	1.19
7	000975	山金国际	34,449,066.59	1.17
8	300418	昆仑万维	32,855,722.73	1.12
9	000630	铜陵有色	31,651,557.10	1.08
10	002625	光启技术	30,929,990.80	1.05
11	002340	格林美	28,539,110.87	0.97
12	000988	华工科技	27,672,250.95	0.94
13	002966	苏州银行	24,119,751.70	0.82
14	002517	恺英网络	23,990,476.57	0.82
15	301236	软通动力	23,640,820.76	0.80
16	002156	通富微电	23,435,948.77	0.80
17	002384	东山精密	22,192,938.97	0.75
18	300207	欣旺达	22,117,100.04	0.75
19	002078	太阳纸业	20,971,473.00	0.71
20	002532	天山铝业	20,773,390.00	0.71

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	2,933,700,789.38
卖出股票收入（成交）总额	3,311,214,039.76

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,829,697.73	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,829,697.73	0.13

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113691.SH	和邦转债	15,940	1,763,167.07	0.08
2	113685.SH	升 24 转债	4,810	563,867.21	0.03
3	113682.SH	益丰转债	4,010	453,969.02	0.02
4	113683.SH	伟 24 转债	360	48,694.43	0.00

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，苏州东山精密制造股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方消防救援大队的处罚。苏州东山精密制造股份有限公司、永泰能源集团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，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	5,358,191.42
2	应收清算款	23,960,475.34

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,318,666.76

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	113685	升 24 转债	563,867.21	0.03
2	113682	益丰转债	453,969.02	0.02
3	113683	伟 24 转债	48,694.43	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证 500 交易型开 放式指数证券投资基 金联接基金(LOF)	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
13,430	92,110.08	1,044,921,931.00	84.47%	192,116,388.00	15.53%	978,018,100.00	79.06%

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	东方证券股份有限公司	8,676,140.00	0.70%
2	国投证券股份有限公司	7,353,000.00	0.59%
3	广发证券股份有限公司	6,329,046.00	0.51%
4	香港中央结算有限公司	5,811,200.00	0.47%
5	中信建投证券股份有限公司	4,498,500.00	0.36%
6	兴宝国际信托有限责任公司	4,064,000.00	0.33%
7	招商证券股份有限公司	3,974,400.00	0.32%
8	中信证券股份有限公司	3,536,300.00	0.29%
9	冉启兵	2,501,100.00	0.20%
10	华泰证券股份有限公司	2,357,100.00	0.19%
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)	978,018,100.00	79.06%

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	1,763,038,319.00
本报告期基金总申购份额	2,676,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	3,202,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,237,038,319.00

§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

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 7 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 72,000 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	广发基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-01
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	无

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	3,296,390,977.06	52.82%	810,600.06	44.57%	-
申万宏源证券	3	1,258,956,489.66	20.17%	232,917.70	12.81%	减少 1 个
华泰证券	5	537,499,924.72	8.61%	214,747.64	11.81%	-
光大证券	3	324,853,120.47	5.21%	60,097.80	3.30%	-
广发证券	8	306,784,509.26	4.92%	56,756.95	3.12%	-
招商证券	4	201,719,132.37	3.23%	171,419.91	9.43%	-
华创证券	2	187,486,179.56	3.00%	177,339.33	9.75%	-
国盛证券	2	126,992,658.32	2.03%	94,723.17	5.21%	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	新增 2 个
中银证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-

申万宏源西部	1	-	-	-	-	新增 1 个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
首创证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	减少 2 个

注：1、选择标准

- (1) 经营行为稳健规范，合规内控制度健全，财务状况良好，在业内具有良好声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；

(3) 具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

(4) 具有较强的综合研究能力，拥有独立的研究部门及相当规模的研究团队，有完善的研究报告质量和合规保障机制，能及时向公司提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告，可以根据公司管理基金的特定要求，提供专门研究报告；

(5) 公司证券研究报告业务、内控管理、合规风控等方面未受到重大行政处罚或重大行政监管措施；

(6) 中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

(1) 对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

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

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。2024年7月1日前，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；自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,594,000.00	58.07%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	481,000.00	17.52%	-	-	-	-
华创证券	437,000.00	15.92%	-	-	-	-
国盛证券	232,892.78	8.48%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加华宝证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-11
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
3	关于增加民生证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-31
4	关于增加山西证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-18
5	关于增加华创证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
8	关于增加联储证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-24
9	关于增加渤海证券为旗下部分 ETF 一级交易	中国证监会规定报刊及	2024-05-17

	商的公告	网站	
10	关于增加爱建证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-07-11
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-07-18
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-08-30
13	关于增加大同证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-09-13
14	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-25
15	关于增加万和证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-04

§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	20240101-20241231	1,429,970,521.00	2,555,979,901.00	3,007,932,322.00	978,018,100.00	79.06 %
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。							

§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

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

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

二〇二五年三月二十九日