

广发中证 1000 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。容诚会计师事务所（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	7
§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	8
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	57
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	58

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	82
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	83
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	83
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	83
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	83
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	84
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	84
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12	投资组合报告附注	84
§9	基金份额持有人信息	85
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2	期末上市基金前十名持有人	85
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
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	86
§10	开放式基金份额变动	86
§11	重大事件揭示	87
11.1	基金份额持有人大会决议	87
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	87
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4	基金投资策略的改变	87
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	87
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	87
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	87
11.8	其他重大事件	92
§12	影响投资者决策的其他重要信息	93
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	93
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	94
§13	备查文件目录	94
13.1	备查文件目录	94
13.2	存放地点	94
13.3	查阅方式	94

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 1000ETF
场内简称	1000 基金
基金主代码	560010
交易代码	560010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 28 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	9,276,621,726.00 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	2022-08-04

注：本基金的扩位证券简称为“中证 1000ETF 指数”。

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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
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（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股指期货投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。

业绩比较基准	中证 1000 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	证券时报
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	容诚会计师事务所（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 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,961,934,702.60	-187,881,341.62	-370,454,196.48
本期利润	4,454,481,249.00	40,784,378.13	-757,028,186.12
加权平均基金份额本期利润	0.6327	0.0201	-0.1870
本期加权平均净值利润率	28.96%	0.79%	-11.31%
本期基金份额净值增长率	2.66%	-5.89%	-11.47%
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	-3,802,125,316.28	-1,717,098,359.51	-870,730,843.43
期末可供分配基金份额利润	-0.4099	-0.4727	-0.3249
期末基金资产净值	22,480,844,342.46	8,575,019,758.23	6,721,301,961.90
期末基金份额净值	2.4234	2.3606	2.5083
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	-14.47%	-16.68%	-11.47%

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	4.33%	2.39%	4.36%	2.40%	-0.03%	-0.01%
过去六个月	22.25%	2.24%	21.69%	2.24%	0.56%	0.00%
过去一年	2.66%	2.11%	1.20%	2.12%	1.46%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.47%	1.57%	-16.08%	1.58%	1.61%	-0.01%

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

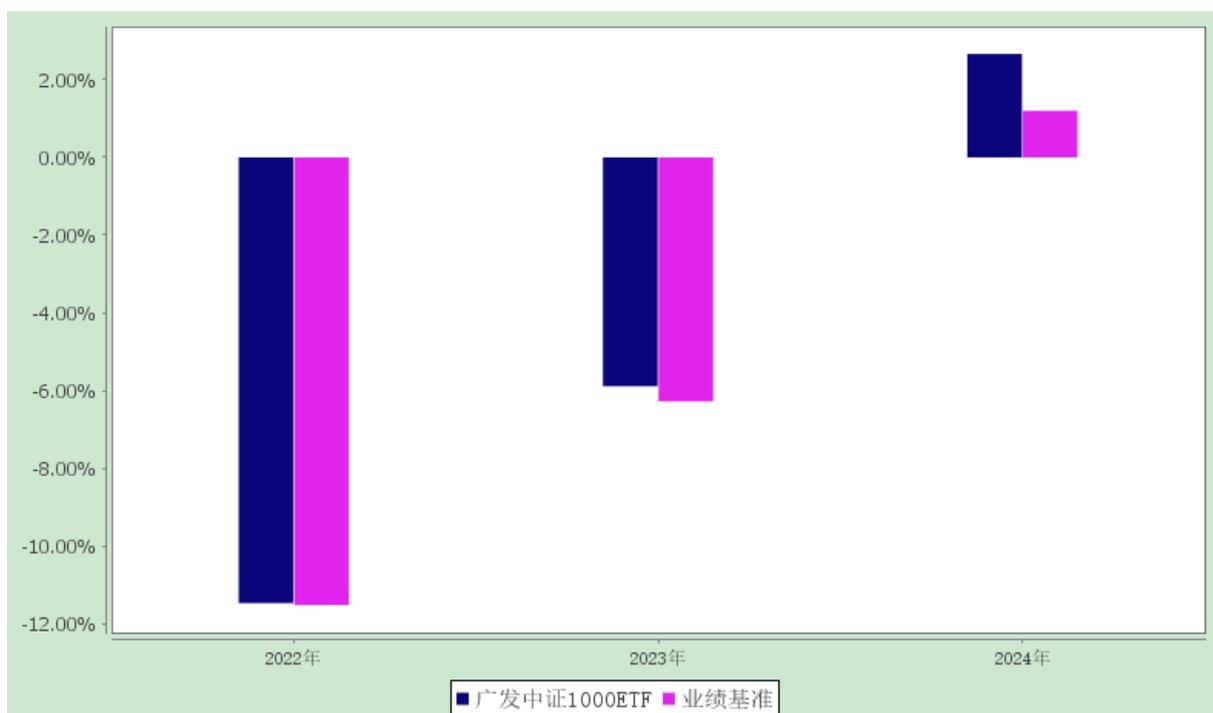
广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2022 年 7 月 28 日至 2024 年 12 月 31 日)



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

广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2022 年 7 月 28 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2022 年 7 月 28 日）至报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。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		

<p>罗国庆</p>	<p>本基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒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；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产业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；广发国证新能源车电池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；广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创</p>	<p>2022-07-28</p>	<p>-</p>	<p>15.1 年</p>	<p>罗国庆先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证医疗指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2020 年 8 月 26 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 7 月 25 日)、广发中证沪港深科技龙头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 2021 年 8 月 25 日至 2023 年 7 月 25 日)、广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 1 月 20 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金</p>
------------	---	-------------------	----------	---------------	---

	<p>板成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证港股通非银行金融主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板成长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；广发中证国新央企股东回报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；广发中证港股通非银行金融主题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；广发恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 A100 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；广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部副总</p>				<p>基金经理(自 2019 年 5 月 27 日至 2024 年 3 月 30 日)、广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2021 年 8 月 9 日至 2024 年 8 月 8 日)、广发中证 100 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 2019 年 5 月 27 日至 2024 年 10 月 27 日)。</p>
--	---	--	--	--	--

	经理				
--	----	--	--	--	--

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

本基金跟踪的标的是中证 1000 指数,该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后,规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成,综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。作为 ETF 基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,按照根据指数结构复制指数的方法投资,指数样本采用完全复制方法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

2024 年 A 股市场整体呈现先抑后扬的走势,全年波动较大,但是市场整体表现较好,主要宽基指数均取得正收益,市场走势可分四个阶段。第一阶段 2024 年 1 月至 2 月初,受美联储加息、全球经济增长速度减弱以及投资者负面情绪蔓延的因素影响,市场快速向下调整。第二阶段 2024 年 2 月初至 5 月中下旬,春节后国内政策端开始发力,海外 PMI 超预期以及国内二手房超预期,市场迎来超跌反弹行情。第三阶段 2024 年 5 月中下旬到 9 月中下旬,受市场基本面复苏偏弱以及海外推迟降息的影响,市场震荡走弱。第四阶段 2024 年 9 月中下旬至 12 月底,相关部门推出政策组合拳,此后中央政治局会议定调积极以及地产政策接连出台,市场快速上涨,随后维持高位震荡走势。从 2024 年全年主要指数的表现来看,沪深 300 指数上涨 14.68%,中证 500 指数上涨 5.46%,创业板指数上涨 13.23%,中证 1000 指数上涨 1.20%。

基金投资运作方面,报告期内,本基金严格遵守合同要求,认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作,运作过程中未发生任何风险事件。

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 2.66%,同期业绩比较基准收益率为 1.20%。

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 2025 年，从海外市场来看，尽管存在美国的关税政策大面积展开的风险，然而特朗普政策组合存在一定矛盾性，这就意味着美国经济和降息节奏的不确定性较高。从国内市场来看，国内宏观经济政策会不断加大逆周期调节力度，并且“适度宽松”的货币政策支持力度可能大于 2024 年，随着经济基本面的改善和政策端的持续发力，市场整体有望保持温和复苏的态势。总而言之，预计 2025 年市场会在不同情景之中反复摇摆而增加波动，投资者需要在不确定性较高的环境中做好仓位管理。

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

容诚审字[2025]200Z0787 号

广发中证 1000 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了广发中证 1000 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 1000 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年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

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估广发中证 1000 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，除非基金管理人管理层计划清算广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督广发中证 1000 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）评价基金管理人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）对基金管理人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 1000 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 1000 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、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。

我们与基金管理人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。

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

沈兆杰 吴琳杰

中国 北京

2025 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发中证 1000 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	281,499,946.81	79,333,801.76
结算备付金		160,055,331.93	84,266,242.21
存出保证金		66,578,192.87	20,775,675.62
交易性金融资产	7.4.7.2	21,982,447,705.60	8,421,334,378.71
其中：股票投资		21,982,447,705.60	8,420,700,032.83
基金投资		-	-
债券投资		-	634,345.88
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		4,240,896.66	280,336,112.49
应收股利		-	5,295.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	639,660.12
资产总计		22,494,822,073.87	8,886,691,165.91
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		-	249,640,499.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,029,166.91	2,384,797.93
应付托管费		1,009,722.31	476,959.57
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.98	41,649.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	9,938,834.21	59,127,501.27
负债合计		13,977,731.41	311,671,407.68
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	26,282,969,658.74	10,292,118,117.74
未分配利润	7.4.7.9	-3,802,125,316.28	-1,717,098,359.51
净资产合计		22,480,844,342.46	8,575,019,758.23

负债和净资产总计		22,494,822,073.87	8,886,691,165.91
----------	--	-------------------	------------------

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 2.4234 元，基金份额总额 9,276,621,726.00 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证 1000 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		4,488,431,095.85	72,432,511.08
1.利息收入		10,996,295.67	14,637,832.60
其中：存款利息收入	7.4.7.10	2,388,434.05	1,193,814.55
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		8,607,861.62	13,444,018.05
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,093,492,408.48	-189,459,953.03
其中：股票投资收益	7.4.7.11	1,791,128,165.18	-210,337,426.96
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,366,856.42	1,287,945.74
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	109,899,014.99	-18,327,042.37
股利收益	7.4.7.17	191,098,371.89	37,916,570.56
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	2,492,546,546.40	228,665,719.75

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	-108,604,154.70	18,588,911.76
减：二、营业总支出		33,949,846.85	31,648,132.95
1. 管理人报酬		25,127,105.08	26,024,836.02
2. 托管费		8,005,827.66	5,204,967.20
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		445,195.23	54,577.98
8. 其他费用	7.4.7.21	371,718.88	363,751.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,454,481,249.00	40,784,378.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,454,481,249.00	40,784,378.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,454,481,249.00	40,784,378.13

7.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 1000 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	10,292,118,117.74	-1,717,098,359.51	8,575,019,758.23
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	10,292,118,117.74	-1,717,098,359.51	8,575,019,758.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	15,990,851,541.00	-2,085,026,956.77	13,905,824,584.23

(一)、综合收益总额	-	4,454,481,249.00	4,454,481,249.00
(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)	15,990,851,541.00	-6,539,508,205.77	9,451,343,335.23
其中: 1.基金申购款	46,570,096,860.41	-13,049,338,905.65	33,520,757,954.76
2.基金赎回款	-30,579,245,319.41	6,509,830,699.88	-24,069,414,619.53
(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	26,282,969,658.74	-3,802,125,316.28	22,480,844,342.46
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	7,592,032,805.33	-870,730,843.43	6,721,301,961.90
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	7,592,032,805.33	-870,730,843.43	6,721,301,961.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,700,085,312.41	-846,367,516.08	1,853,717,796.33
(一)、综合收益总额	-	40,784,378.13	40,784,378.13
(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)	2,700,085,312.41	-887,151,894.21	1,812,933,418.20
其中: 1.基金申购款	25,232,906,388.70	-2,901,583,612.60	22,331,322,776.10
2.基金赎回款	-22,532,821,076.29	2,014,431,718.39	-20,518,389,357.90
(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	10,292,118,117.74	-1,717,098,359.51	8,575,019,758.23

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 1000 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[2022]699 号《关于准予广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的

批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2022 年 7 月 22 日向社会公开发行募集并于 2022 年 7 月 28 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2022 年 7 月 22 日至 2022 年 7 月 25 日，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 7,996,738,181.00 元，有效认购户数为 148,558 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 962,740.28 元。按照基金合同的有关约定，其中通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 15,186.66 元，折算为 15,181.00 份计入基金份额持有人的基金账户；其余 947,559.28 元计入基金财产。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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 and 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	281,499,946.81	79,333,801.76
等于：本金	281,472,381.72	79,325,704.42
加：应计利息	27,565.09	8,097.34
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	281,499,946.81	79,333,801.76

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	19,625,855,549.09	-	21,982,447,705.60	2,356,592,156.51
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	19,625,855,549.09	-	21,982,447,705.60	2,356,592,156.51
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	8,577,404,862.72	-	8,420,700,032.83	-156,704,829.89

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	634,300.00	45.88	634,345.88	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	634,300.00	45.88	634,345.88	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,578,039,162.72	45.88	8,421,334,378.71	-156,704,829.89

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	504,373,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	504,373,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	504,373,680.00	-	-	-
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	144,291,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	144,291,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	144,291,040.00	-	-	-

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
IM2501	IM2501	405.00	482,419,800.00	-21,953,880.00
合计	-	-	-	-21,953,880.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-21,953,880.00
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	-	639,660.12
待摊费用	-	-
合计	-	639,660.12

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	704,660.44	458,682.14
其中：交易所市场	704,660.44	458,682.14
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	100,219.18
应付替代款	8,939,683.45	57,928,970.71
可退替代款	74,490.32	639,629.24
合计	9,938,834.21	59,127,501.27

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	3,632,621,726.00	10,292,118,117.74
本期申购	16,437,000,000.00	46,570,096,860.41
本期赎回（以“-”号填列）	-10,793,000,000.00	-30,579,245,319.41
本期末	9,276,621,726.00	26,282,969,658.74

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	-700,252,931.81	-1,016,845,427.70	-1,717,098,359.51
本期期初	-700,252,931.81	-1,016,845,427.70	-1,717,098,359.51

本期利润	1,961,934,702.60	2,492,546,546.40	4,454,481,249.00
本期基金份额交易产生的变动数	-2,448,505,292.71	-4,091,002,913.06	-6,539,508,205.77
其中：基金申购款	-5,759,599,653.95	-7,289,739,251.70	-13,049,338,905.65
基金赎回款	3,311,094,361.24	3,198,736,338.64	6,509,830,699.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,186,823,521.92	-2,615,301,794.36	-3,802,125,316.28

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
	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
活期存款利息收入	846,030.37	334,086.73
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	1,497,291.60	821,551.76
其他	45,112.08	38,176.06
合计	2,388,434.05	1,193,814.55

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
	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
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,394,219,169.61	-136,651,160.57
股票投资收益——赎回差价收入	396,908,995.57	-73,686,266.39
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	1,791,128,165.18	-210,337,426.96

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
卖出股票成交总额	21,294,866,895.97	16,317,481,560.44
减：卖出股票成本总额	19,884,728,420.71	16,433,586,602.66
减：交易费用	15,919,305.65	20,546,118.35
买卖股票差价收入	1,394,219,169.61	-136,651,160.57

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	24,069,414,619.53	20,518,389,357.90
减：现金支付赎回款总额	13,408,201,698.53	12,509,850,154.90
减：赎回股票成本总额	10,264,303,925.43	8,082,225,469.39
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	396,908,995.57	-73,686,266.39

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	2,144.14	1,004.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,364,712.28	1,286,941.45
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	1,366,856.42	1,287,945.74

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	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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,914,623.62	6,447,488.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,546,900.00	5,159,300.00
减：应计利息总额	2,254.57	988.95
减：交易费用	756.77	257.99
买卖债券差价收入	1,364,712.28	1,286,941.45

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	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
股指期货投资收益	109,899,014.99	-18,327,042.37

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
	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
股票投资产生的股利收益	191,098,371.89	37,916,570.56
其中：证券出借权益补偿收入	8,601,463.13	5,555,788.21
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	191,098,371.89	37,916,570.56

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	2,513,367,891.67	227,423,778.48
——股票投资	2,513,367,891.67	227,423,778.48
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-20,750,440.00	1,178,280.00
——权证投资	-	-
——股指期货投资	-20,750,440.00	1,178,280.00
3.其他	-70,905.27	63,661.27
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,492,546,546.40	228,665,719.75

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
	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
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-108,604,154.70	18,588,911.76
合计	-108,604,154.70	18,588,911.76

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	80,000.00	72,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
申赎登记费	150,000.00	150,000.00
银行汇划费	1,718.88	1,751.75
其他	20,000.00	20,000.00
合计	371,718.88	363,751.75

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 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的子公司

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 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	
	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	31,157,207,512.08	65.06%	24,194,744,283.66	71.68%

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 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	
	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	6,236,600.00	17.41%	3,153,600.00	25.76%

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 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	1,430,539.05	65.07%	356,760.07	50.63%
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	892,333.08	16.75%	290,985.85	63.44%

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	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管理费	25,127,105.08	26,024,836.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,927,756.43	2,429,317.17
应支付基金管理人的净管理费	23,199,348.65	23,595,518.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%（2024 年 2 月 7 日以前：0.50%）年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，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	8,005,827.66	5,204,967.20

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%（2024 年 2 月 7 日以前：0.10%）的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，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	381,807,897.00	265,991.36	-	-

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	1,717,243,674.80	1.50~4.25	2.12	1,195,368.32	-	-
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	1,028,502,121.00	1.10~4.25	2.25	880,532.82	129,985,909.00	54,415.61

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
广发中证 1000 交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金	207,919,019.00	2.24%	213,899,028.00	5.89%
广发证券股份有 限公司	674,561.00	0.01%	547,978,084.00	15.08%

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	
	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	
	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	281,499,946.81	846,030.37	79,333,801.76	334,086.73

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。

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
688608	恒玄科技	2024-07-10	6 个月	老股流通受限	129.94	316.95	60,000.00	7,796,400.00	19,017,000.00	-
688037	芯源微	2024-07-29	6 个月	老股流通受限	64.72	81.16	234,000.00	15,144,480.00	18,991,440.00	-
688578	艾力斯	2024-07-10	6 个月	大宗买入流通受限	55.41	59.23	200,000.00	11,082,000.00	11,846,000.00	-
688503	聚和材料	2024-07-01	6 个月	大宗买入流通受限	25.55	44.29	158,000.00	4,036,900.00	6,997,820.00	-
688123	聚辰股份	2024-07-29	6 个月	老股流通受限	55.49	56.68	110,000.00	6,103,900.00	6,234,800.00	-
600246	万通发展	2024-07-02	6 个月	大宗买入流通受限	6.37	7.39	615,000.00	3,917,550.00	4,544,850.00	-
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	2024-1-1-27	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	2024-1-0-22	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	2024-1-2-23	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	2024-0-9-19	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	2024-1-2-24	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	2024-1-0-09	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	2024-0-7-30	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279.00	5,161.50	15,861.15	-
301631	壹连科技	2024-1-1-12	6 个月	新股流通受限	72.99	101.96	153.00	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024-0-7-17	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	2024-0-8-14	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	2024-1-1-26	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	2024-0-7-25	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	2024-1-0-18	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	2024-0-8-21	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	2024-0-8-27	6 个月	新股流通	19.06	33.58	332.00	6,327.92	11,148.56	-

				受限							
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	2024-11-19	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	-	
60307	天和	2024-1	6 个月	新股	12.30	12.30	226.00	2,779.	2,779.	-	

2	磁材	2-24		流通受限				80	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
688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项停牌	35.20	2025-01-07	30.60	645,381.00	20,739,448.09	22,717,411.20	

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	-	634,345.88
未评级	-	-
合计	-	634,345.88

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期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	281,499,946.81	-	-	-	281,499,946.81
结算备付金	160,055,331.93	-	-	-	160,055,331.93
存出保证金	66,578,192.87	-	-	-	66,578,192.87
交易性金融资产	-	-	-	21,982,447,705.60	21,982,447,705.60
应收清算款	-	-	-	4,240,896.66	4,240,896.66
资产总计	508,133,471.61	-	-	21,986,688,602.26	22,494,822,073.87
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,029,166.91	3,029,166.91
应付托管费	-	-	-	1,009,722.31	1,009,722.31
应交税费	-	-	-	7.98	7.98
其他负债	-	-	-	9,938,834.21	9,938,834.21
负债总计	-	-	-	13,977,731.41	13,977,731.41
利率敏感度缺口	508,133,471.61	-	-	21,972,710,870.85	22,480,844,342.46
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	79,333,801.76	-	-	-	79,333,801.76
结算备付金	84,266,242.21	-	-	-	84,266,242.21
存出保证金	20,775,675.62	-	-	-	20,775,675.62
交易性金融资产	634,345.88	-	-	8,420,700,032.83	8,421,334,378.71
应收清算款	-	-	-	280,336,112.49	280,336,112.49
应收股利	-	-	-	5,295.00	5,295.00
其他资产	-	-	-	639,660.12	639,660.12

资产总计	185,010,065.47	-	-	8,701,681,100.44	8,886,691,165.91
负债					
应付清算款	-	-	-	249,640,499.42	249,640,499.42
应付管理人报酬	-	-	-	2,384,797.93	2,384,797.93
应付托管费	-	-	-	476,959.57	476,959.57
应交税费	-	-	-	41,649.49	41,649.49
其他负债	-	-	-	59,127,501.27	59,127,501.27
负债总计	-	-	-	311,671,407.68	311,671,407.68
利率敏感度缺口	185,010,065.47	-	-	8,390,009,692.76	8,575,019,758.23

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	21,982,447,705.60	97.78	8,420,700,032.83	98.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	634,345.88	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	21,982,447,705.60	97.78	8,421,334,378.71	98.21

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%	1,139,466,680.29	427,335,090.46
	下降 5%	-1,139,466,680.29	-427,335,090.46

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	21,891,472,641.21	8,355,867,195.79
第二层次	22,745,147.70	14,668,844.50
第三层次	68,229,916.69	50,798,338.42
合计	21,982,447,705.60	8,421,334,378.71

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	-	50,798,338.42	50,798,338.42
当期购买	-	48,323,523.99	48,323,523.99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	50,798,338.42	50,798,338.42
当期利得或损失总额	-	19,906,392.70	19,906,392.70
其中：计入损益的利得或损失	-	19,906,392.70	19,906,392.70
期末余额	-	68,229,916.69	68,229,916.69
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	-	19,906,392.70	19,906,392.70
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	-	-	-
当期购买	-	44,506,267.05	44,506,267.05
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	-	6,292,071.37	6,292,071.37
其中：计入损益的利得或损失	-	6,292,071.37	6,292,071.37

期末余额	-	50,798,338.42	50,798,338.42
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	-	6,292,071.37	6,292,071.37

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	68,229,916.69	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	26.65%-574.44%	负相关
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	50,798,338.42	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	19.62%-219.88%	负相关

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	21,982,447,705.60	97.72

	其中：普通股	21,982,447,705.60	97.72
	存托凭证	-	-
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计	441,555,278.74	1.96
8	其他各项资产	70,819,089.53	0.31
9	合计	22,494,822,073.87	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	144,138,615.36	0.64
B	采矿业	538,477,607.12	2.40
C	制造业	14,271,553,639.68	63.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	607,460,618.28	2.70
E	建筑业	376,959,230.02	1.68
F	批发和零售业	681,199,007.38	3.03
G	交通运输、仓储和邮政业	708,937,505.36	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,583,979,456.75	11.49
J	金融业	618,058,837.52	2.75
K	房地产业	355,356,573.11	1.58
L	租赁和商务服务业	420,712,125.36	1.87

M	科学研究和技术服务业	173,873,339.00	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	169,907,693.37	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	71,161,994.90	0.32
R	文化、体育和娱乐业	260,678,678.39	1.16
S	综合	-	-
	合计	21,982,454,921.60	97.78

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	002456	欧菲光	11,338,200	135,831,636.00	0.60
2	002130	沃尔核材	3,464,100	87,468,525.00	0.39
3	002851	麦格米特	1,370,575	84,235,539.50	0.37
4	300757	罗博特科	372,700	83,976,764.00	0.37
5	688608	恒玄科技	248,572	80,372,671.64	0.36
6	002405	四维图新	8,152,701	78,592,037.64	0.35
7	600171	上海贝岭	1,949,100	77,340,288.00	0.34
8	300346	南大光电	1,974,600	76,199,814.00	0.34
9	688027	国盾量子	221,910	66,209,067.60	0.29
10	000528	柳工	5,448,600	65,710,116.00	0.29
11	688235	百济神州-U	393,939	63,432,057.78	0.28
12	603005	晶方科技	2,239,000	63,251,750.00	0.28
13	002837	英维克	1,524,996	61,609,838.40	0.27
14	600363	联创光电	1,250,700	59,883,516.00	0.27
15	300458	全志科技	1,520,999	58,953,921.24	0.26
16	001696	宗申动力	2,353,000	58,589,700.00	0.26
17	002139	拓邦股份	4,277,100	58,211,331.00	0.26
18	300623	捷捷微电	1,681,900	57,453,704.00	0.26
19	002402	和而泰	3,169,175	57,393,759.25	0.26
20	600100	同方股份	8,059,700	57,304,467.00	0.25
21	002312	川发龙蟒	3,891,300	56,307,111.00	0.25

22	000415	渤海租赁	14,879,700	56,096,469.00	0.25
23	300085	银之杰	1,455,500	55,672,875.00	0.25
24	300459	汤姆猫	9,655,000	55,419,700.00	0.25
25	300088	长信科技	8,430,509	55,135,528.86	0.25
26	605589	圣泉集团	2,325,300	54,830,574.00	0.24
27	300857	协创数据	504,100	53,883,249.00	0.24
28	002126	银轮股份	2,857,674	53,495,657.28	0.24
29	002583	海能达	3,743,600	53,196,556.00	0.24
30	600559	老白干酒	2,506,500	52,611,435.00	0.23
31	000766	通化金马	3,318,400	52,098,880.00	0.23
32	688347	华虹公司	1,120,484	52,068,891.48	0.23
33	300679	电连技术	870,400	51,962,880.00	0.23
34	300315	掌趣科技	9,386,300	51,624,650.00	0.23
35	601677	明泰铝业	4,275,662	51,436,213.86	0.23
36	688018	乐鑫科技	232,055	50,587,990.00	0.23
37	000099	中信海直	1,859,400	49,013,784.00	0.22
38	300068	南都电源	2,993,506	48,315,186.84	0.21
39	002400	省广集团	5,999,500	47,936,005.00	0.21
40	300077	国民技术	2,000,400	47,689,536.00	0.21
41	688568	中科星图	933,587	47,640,944.61	0.21
42	601777	千里科技	6,212,500	47,525,625.00	0.21
43	300627	华测导航	1,125,000	47,025,000.00	0.21
44	002497	雅化集团	3,951,601	46,233,731.70	0.21
45	300779	惠城环保	470,640	45,934,464.00	0.20
46	688116	天奈科技	1,181,126	45,839,500.06	0.20
47	688037	芯源微	551,574	45,550,153.62	0.20
48	300762	上海瀚讯	2,154,989	45,319,418.67	0.20
49	300115	长盈精密	2,787,087	45,262,292.88	0.20
50	300568	星源材质	4,614,129	44,849,333.88	0.20
51	300296	利亚德	6,936,744	44,672,631.36	0.20
52	300666	江丰电子	638,866	44,369,243.70	0.20
53	300229	拓尔思	2,103,066	44,038,202.04	0.20
54	600072	中船科技	3,098,200	43,529,710.00	0.19
55	002176	江特电机	5,862,700	43,442,607.00	0.19
56	002389	航天彩虹	2,391,100	43,159,355.00	0.19
57	688019	安集科技	309,180	43,087,324.80	0.19
58	603236	移远通信	629,276	43,067,649.44	0.19
59	300253	卫宁健康	5,986,950	42,866,562.00	0.19
60	300182	捷成股份	7,298,246	42,840,704.02	0.19
61	002506	协鑫集成	16,039,400	42,825,198.00	0.19
62	688343	云天励飞-U	854,526	42,384,489.60	0.19
63	002245	蔚蓝锂芯	3,949,100	42,215,879.00	0.19
64	600577	精达股份	5,788,600	42,198,894.00	0.19
65	300170	汉得信息	3,380,600	41,919,440.00	0.19

66	601975	招商南油	13,356,800	41,806,784.00	0.19
67	002222	福晶科技	1,290,161	41,801,216.40	0.19
68	002416	爱施德	2,550,835	41,502,085.45	0.18
69	688050	爱博医疗	454,533	41,376,138.99	0.18
70	601375	中原证券	9,481,800	40,961,376.00	0.18
71	002617	露笑科技	5,296,097	40,515,142.05	0.18
72	601333	广深铁路	11,658,100	39,987,283.00	0.18
73	300570	太辰光	545,761	39,676,824.70	0.18
74	002003	伟星股份	2,798,733	39,658,046.61	0.18
75	688266	泽璟制药-U	635,024	39,568,345.44	0.18
76	600323	瀚蓝环境	1,674,909	39,561,350.58	0.18
77	002151	北斗星通	1,489,100	39,520,714.00	0.18
78	002145	中核钛白	9,318,800	39,511,712.00	0.18
79	600446	金证股份	2,273,500	39,195,140.00	0.17
80	000875	吉电股份	7,448,500	39,179,110.00	0.17
81	605111	新洁能	1,142,800	38,752,348.00	0.17
82	300432	富临精工	2,513,950	38,664,551.00	0.17
83	300738	奥飞数据	2,654,204	38,485,958.00	0.17
84	000686	东北证券	4,825,900	38,317,646.00	0.17
85	300045	华力创通	1,815,200	37,919,528.00	0.17
86	002075	沙钢股份	6,045,400	37,844,204.00	0.17
87	300674	宇信科技	1,938,200	37,833,664.00	0.17
88	601528	瑞丰银行	6,716,940	37,816,372.20	0.17
89	600601	方正科技	8,608,300	37,790,437.00	0.17
90	600761	安徽合力	2,140,000	37,771,000.00	0.17
91	000628	高新发展	604,336	37,644,089.44	0.17
92	603083	剑桥科技	922,253	37,443,471.80	0.17
93	000581	威孚高科	1,975,900	37,304,992.00	0.17
94	600331	宏达股份	4,887,700	37,244,274.00	0.17
95	300083	创世纪	5,700,900	37,112,859.00	0.17
96	300181	佐力药业	2,408,100	36,988,416.00	0.16
97	002807	江阴银行	8,467,400	36,833,190.00	0.16
98	300735	光弘科技	1,315,033	36,807,773.67	0.16
99	600216	浙江医药	2,310,200	36,639,772.00	0.16
100	688208	道通科技	930,450	36,436,422.00	0.16
101	002698	博实股份	2,109,550	35,862,350.00	0.16
102	600388	龙净环保	2,834,806	35,860,295.90	0.16
103	002484	江海股份	2,037,372	35,816,999.76	0.16
104	600908	无锡银行	6,030,600	35,640,846.00	0.16
105	002936	郑州银行	16,957,965	35,611,726.50	0.16
106	600718	东软集团	3,283,100	35,358,987.00	0.16
107	300035	中科电气	2,357,200	35,240,140.00	0.16
108	600186	莲花控股	6,166,900	35,151,330.00	0.16
109	601222	林洋能源	4,964,700	35,100,429.00	0.16

110	600602	云赛智联	2,218,000	35,088,760.00	0.16
111	000681	视觉中国	1,684,800	35,077,536.00	0.16
112	600667	太极实业	5,050,800	34,951,536.00	0.16
113	300672	国科微	521,750	34,826,812.50	0.15
114	002701	奥瑞金	6,133,100	34,774,677.00	0.15
115	000860	顺鑫农业	1,776,000	34,578,720.00	0.15
116	600285	羚锐制药	1,558,500	34,536,360.00	0.15
117	000970	中科三环	3,327,550	34,506,693.50	0.15
118	600728	佳都科技	7,367,600	34,480,368.00	0.15
119	688327	云从科技-UW	2,848,442	34,466,148.20	0.15
120	002036	联创电子	3,657,000	34,375,800.00	0.15
121	000917	电广传媒	4,860,700	34,365,149.00	0.15
122	600133	东湖高新	3,663,866	34,257,147.10	0.15
123	000951	中国重汽	2,012,040	34,164,439.20	0.15
124	300773	拉卡拉	1,924,663	34,066,535.10	0.15
125	300777	中简科技	1,203,807	34,055,700.03	0.15
126	002249	大洋电机	5,790,400	33,989,648.00	0.15
127	300438	鹏辉能源	1,209,100	33,987,801.00	0.15
128	002428	云南锗业	1,796,100	33,946,290.00	0.15
129	300101	振芯科技	1,562,850	33,851,331.00	0.15
130	600562	国睿科技	1,698,500	33,851,105.00	0.15
131	688183	生益电子	856,944	33,643,621.44	0.15
132	300624	万兴科技	531,868	33,587,464.20	0.15
133	600338	西藏珠峰	3,139,700	33,500,599.00	0.15
134	600850	电科数字	1,401,050	33,485,095.00	0.15
135	000690	宝新能源	7,462,500	33,432,000.00	0.15
136	600452	涪陵电力	3,153,044	33,390,735.96	0.15
137	002747	埃斯顿	1,792,578	33,162,693.00	0.15
138	300303	聚飞光电	4,841,100	33,016,302.00	0.15
139	300775	三角防务	1,324,200	33,012,306.00	0.15
140	300133	华策影视	4,568,700	32,986,014.00	0.15
141	000422	湖北宣化	2,608,500	32,919,270.00	0.15
142	600641	万业企业	2,237,300	32,709,326.00	0.15
143	600120	浙江东方	7,017,400	32,701,084.00	0.15
144	601137	博威合金	1,610,785	32,698,935.50	0.15
145	000829	天音控股	2,467,600	32,522,968.00	0.14
146	300827	上能电气	740,412	32,504,086.80	0.14
147	688318	财富趋势	189,708	32,440,068.00	0.14
148	688676	金盘科技	782,858	32,425,978.36	0.14
149	300525	博思软件	2,080,820	32,419,175.60	0.14
150	603871	嘉友国际	1,672,312	32,359,237.20	0.14
151	600064	南京高科	4,164,180	32,355,678.60	0.14
152	688408	中信博	448,956	32,324,832.00	0.14
153	600877	电科芯片	2,438,800	32,167,772.00	0.14

154	603766	隆鑫通用	3,531,500	32,136,650.00	0.14
155	002335	科华数据	1,105,492	31,970,828.64	0.14
156	688322	奥比中光-UW	687,513	31,969,354.50	0.14
157	688088	虹软科技	827,479	31,907,590.24	0.14
158	000627	天茂集团	6,804,400	31,776,548.00	0.14
159	600206	有研新材	2,026,400	31,753,688.00	0.14
160	300638	广和通	1,572,706	31,690,025.90	0.14
161	300348	长亮科技	2,215,100	31,675,930.00	0.14
162	688484	南芯科技	878,493	31,660,887.72	0.14
163	600771	广誉远	1,675,027	31,591,009.22	0.14
164	300294	博雅生物	1,041,105	31,524,659.40	0.14
165	605090	九丰能源	1,103,000	31,468,590.00	0.14
166	600864	哈投股份	4,272,000	31,399,200.00	0.14
167	600399	抚顺特钢	5,408,100	31,366,980.00	0.14
168	000810	创维数字	1,964,800	31,279,616.00	0.14
169	603662	柯力传感	483,400	31,227,640.00	0.14
170	002270	华明装备	1,845,900	31,177,251.00	0.14
171	603300	海南华铁	5,389,660	31,152,234.80	0.14
172	300811	铂科新材	575,611	31,031,189.01	0.14
173	002745	木林森	3,551,500	30,969,080.00	0.14
174	000620	新华联	14,134,644	30,954,870.36	0.14
175	002396	星网锐捷	1,619,100	30,746,709.00	0.14
176	688166	博瑞医药	1,017,639	30,732,697.80	0.14
177	000543	皖能电力	3,883,400	30,717,694.00	0.14
178	002221	东华能源	3,235,500	30,704,895.00	0.14
179	001301	尚太科技	447,612	30,683,802.60	0.14
180	000762	西藏矿业	1,426,329	30,666,073.50	0.14
181	002354	天娱数科	5,699,500	30,606,315.00	0.14
182	300783	三只松鼠	827,800	30,520,986.00	0.14
183	300180	华峰超纤	4,835,300	30,462,390.00	0.14
184	300657	弘信电子	1,343,800	30,450,508.00	0.14
185	600246	万通发展	4,092,200	30,449,990.00	0.14
186	600986	浙文互联	5,069,800	30,317,404.00	0.13
187	603063	禾望电气	1,516,700	30,273,332.00	0.13
188	300456	赛微电子	1,761,650	30,265,147.00	0.13
189	301050	雷电微力	586,067	30,229,335.86	0.13
190	300409	道氏技术	2,215,800	30,157,038.00	0.13
191	002063	远光软件	5,235,448	30,156,180.48	0.13
192	000801	四川九洲	2,103,400	30,099,654.00	0.13
193	300298	三诺生物	1,165,300	30,076,393.00	0.13
194	600621	华鑫股份	1,824,991	30,075,851.68	0.13
195	000680	山推股份	3,096,301	30,034,119.70	0.13
196	600330	天通股份	4,226,800	30,010,280.00	0.13
197	600827	百联股份	2,744,014	29,992,073.02	0.13

198	002544	普天科技	1,399,285	29,986,677.55	0.13
199	300319	麦捷科技	2,385,900	29,776,032.00	0.13
200	002127	南极电商	6,759,100	29,740,040.00	0.13
201	600821	金开新能	5,500,500	29,702,700.00	0.13
202	002123	梦网科技	2,747,400	29,699,394.00	0.13
203	000682	东方电子	2,769,100	29,657,061.00	0.13
204	300776	帝尔激光	466,120	29,635,909.60	0.13
205	000503	国新健康	2,691,100	29,548,278.00	0.13
206	600552	凯盛科技	2,587,500	29,523,375.00	0.13
207	301078	孩子王	2,591,000	29,485,580.00	0.13
208	600635	大众公用	6,617,409	29,447,470.05	0.13
209	688333	铂力特	746,613	29,438,950.59	0.13
210	002174	游族网络	3,148,200	29,435,670.00	0.13
211	300075	数字政通	1,701,377	29,433,822.10	0.13
212	600750	江中药业	1,294,510	29,385,377.00	0.13
213	300166	东方国信	3,118,800	29,316,720.00	0.13
214	002839	张家港行	6,707,300	29,310,901.00	0.13
215	000676	智度股份	3,463,400	29,300,364.00	0.13
216	000035	中国天楹	6,006,400	29,251,168.00	0.13
217	300130	新国都	1,345,000	29,132,700.00	0.13
218	601126	四方股份	1,711,100	29,020,256.00	0.13
219	603920	世运电路	985,200	28,964,880.00	0.13
220	688200	华峰测控	277,044	28,951,098.00	0.13
221	300379	东方通	1,915,000	28,897,350.00	0.13
222	600572	康恩贝	6,191,900	28,854,254.00	0.13
223	600422	昆药集团	1,818,902	28,829,596.70	0.13
224	300598	诚迈科技	595,372	28,816,004.80	0.13
225	603678	火炬电子	944,200	28,798,100.00	0.13
226	600179	安通控股	10,168,300	28,776,289.00	0.13
227	300049	福瑞股份	911,288	28,742,023.52	0.13
228	300036	超图软件	1,692,005	28,730,244.90	0.13
229	300327	中颖电子	1,169,144	28,608,953.68	0.13
230	603283	赛腾股份	413,000	28,563,080.00	0.13
231	601860	紫金银行	10,015,300	28,543,605.00	0.13
232	600596	新安股份	3,249,542	28,530,978.76	0.13
233	601020	华钰矿业	2,255,280	28,461,633.60	0.13
234	603306	华懋科技	897,200	28,360,492.00	0.13
235	002317	众生药业	2,333,504	28,352,073.60	0.13
236	603565	中谷物流	2,886,328	28,286,014.40	0.13
237	002654	万润科技	2,327,694	28,234,928.22	0.13
238	002948	青岛银行	7,277,000	28,234,760.00	0.13
239	300236	上海新阳	754,376	28,191,031.12	0.13
240	000969	安泰科技	2,526,382	28,169,159.30	0.13
241	688596	正帆科技	791,263	28,129,399.65	0.13

242	000902	新洋丰	2,152,900	28,073,816.00	0.12
243	688141	杰华特	916,471	28,053,177.31	0.12
244	002183	怡亚通	6,240,300	28,018,947.00	0.12
245	603881	数据港	1,235,772	27,990,235.80	0.12
246	000685	中山公用	3,028,100	27,949,363.00	0.12
247	300113	顺网科技	1,661,700	27,933,177.00	0.12
248	600456	宝钛股份	981,200	27,915,140.00	0.12
249	600185	格力地产	3,878,153	27,883,920.07	0.12
250	600587	新华医疗	1,665,810	27,735,736.50	0.12
251	601778	晶科科技	9,834,900	27,734,418.00	0.12
252	002906	华阳集团	900,400	27,687,300.00	0.12
253	688582	芯动联科	550,158	27,678,448.98	0.12
254	688016	心脉医疗	251,801	27,660,339.85	0.12
255	688498	源杰科技	206,103	27,659,022.60	0.12
256	002239	奥特佳	9,062,600	27,640,930.00	0.12
257	002675	东诚药业	2,259,100	27,606,202.00	0.12
258	300663	科蓝软件	1,589,100	27,586,776.00	0.12
259	600210	紫江企业	4,169,600	27,561,056.00	0.12
260	300576	容大感光	609,800	27,550,764.00	0.12
261	300185	通裕重工	10,665,800	27,411,106.00	0.12
262	600151	航天机电	3,433,300	27,397,734.00	0.12
263	600420	国药现代	2,294,400	27,395,136.00	0.12
264	600633	浙数文化	2,618,300	27,387,418.00	0.12
265	300026	红日药业	7,218,900	27,359,631.00	0.12
266	301171	易点天下	970,200	27,349,938.00	0.12
267	688409	富创精密	528,995	27,280,272.15	0.12
268	002315	焦点科技	654,100	27,262,888.00	0.12
269	688289	圣湘生物	1,200,600	27,253,620.00	0.12
270	600114	东睦股份	1,684,900	27,244,833.00	0.12
271	600595	中孚实业	9,615,634	27,212,244.22	0.12
272	002681	奋达科技	4,342,800	27,099,072.00	0.12
273	002215	诺普信	2,412,900	27,096,867.00	0.12
274	002332	仙琚制药	2,718,331	27,020,210.14	0.12
275	600993	马应龙	1,034,800	27,018,628.00	0.12
276	600428	中远海特	3,699,100	27,003,430.00	0.12
277	600269	赣粤高速	4,804,100	26,951,001.00	0.12
278	300475	香农芯创	944,391	26,905,699.59	0.12
279	002597	金禾实业	1,177,248	26,876,571.84	0.12
280	002182	宝武镁业	2,379,976	26,846,129.28	0.12
281	600320	振华重工	6,831,100	26,777,912.00	0.12
282	300087	荃银高科	2,266,860	26,748,948.00	0.12
283	600273	嘉化能源	3,354,000	26,731,380.00	0.12
284	601678	滨化股份	7,075,100	26,602,376.00	0.12
285	603323	苏农银行	5,027,200	26,593,888.00	0.12

286	300079	数码视讯	4,907,312	26,548,557.92	0.12
287	688110	东芯股份	1,063,718	26,486,578.20	0.12
288	600201	生物股份	3,857,800	26,464,508.00	0.12
289	300109	新开源	1,656,181	26,416,086.95	0.12
290	603393	新天然气	871,900	26,392,413.00	0.12
291	000429	粤高速 A	1,794,800	26,383,560.00	0.12
292	002292	奥飞娱乐	3,050,007	26,382,560.55	0.12
293	002020	京新药业	2,061,120	26,382,336.00	0.12
294	300284	苏交科	2,595,600	26,345,340.00	0.12
295	002171	楚江新材	3,193,800	26,189,160.00	0.12
296	600123	兰花科创	3,057,490	26,172,114.40	0.12
297	603108	润达医疗	1,640,000	26,125,200.00	0.12
298	688029	南微医学	384,949	26,018,702.91	0.12
299	002212	天融信	4,032,300	26,008,335.00	0.12
300	000727	冠捷科技	9,353,100	26,001,618.00	0.12
301	600461	洪城环境	2,613,100	26,000,345.00	0.12
302	002015	协鑫能科	3,341,400	25,929,264.00	0.12
303	300678	中科信息	711,750	25,886,347.50	0.12
304	600759	洲际油气	11,365,598	25,799,907.46	0.11
305	688503	聚和材料	579,268	25,655,779.72	0.11
306	601718	际华集团	9,023,800	25,627,592.00	0.11
307	300457	赢合科技	1,334,987	25,551,651.18	0.11
308	002541	鸿路钢构	1,424,999	25,550,232.07	0.11
309	601519	大智慧	2,754,800	25,481,900.00	0.11
310	601187	厦门银行	4,510,795	25,440,883.80	0.11
311	300618	寒锐钴业	744,804	25,152,031.08	0.11
312	688279	峰岬科技	159,454	25,145,895.80	0.11
313	002567	唐人神	4,925,900	25,122,090.00	0.11
314	002351	漫步者	1,521,200	25,099,800.00	0.11
315	002832	比音勒芬	1,171,114	25,073,550.74	0.11
316	002488	金固股份	2,400,000	25,056,000.00	0.11
317	300034	钢研高纳	1,602,840	25,004,304.00	0.11
318	002421	达实智能	7,288,100	24,998,183.00	0.11
319	600037	歌华有线	3,345,759	24,959,362.14	0.11
320	603997	继峰股份	2,177,300	24,930,085.00	0.11
321	600916	中国黄金	2,889,100	24,904,042.00	0.11
322	300685	艾德生物	1,091,956	24,896,596.80	0.11
323	300027	华谊兄弟	9,499,400	24,888,428.00	0.11
324	600057	厦门象屿	3,833,100	24,876,819.00	0.11
325	600550	保变电气	3,165,300	24,847,605.00	0.11
326	002773	康弘药业	1,267,100	24,835,160.00	0.11
327	000012	南玻 A	4,697,200	24,801,216.00	0.11
328	002265	建设工业	1,065,200	24,787,204.00	0.11
329	301297	富乐德	582,200	24,743,500.00	0.11

330	600967	内蒙一机	2,907,200	24,711,200.00	0.11
331	600645	中源协和	1,279,000	24,684,700.00	0.11
332	002004	华邦健康	5,445,100	24,611,852.00	0.11
333	603505	金石资源	1,036,040	24,595,589.60	0.11
334	002091	江苏国泰	3,358,700	24,585,684.00	0.11
335	002100	天康生物	3,745,600	24,533,680.00	0.11
336	002668	TCL 智家	1,867,800	24,505,536.00	0.11
337	300188	国投智能	1,775,500	24,484,145.00	0.11
338	002649	博彦科技	2,009,300	24,352,716.00	0.11
339	000420	吉林化纤	6,724,100	24,274,001.00	0.11
340	600717	天津港	4,971,800	24,212,666.00	0.11
341	000089	深圳机场	3,511,500	24,194,235.00	0.11
342	601963	重庆银行	2,601,885	24,145,492.80	0.11
343	000062	深圳华强	1,074,500	24,068,800.00	0.11
344	603398	沐邦高科	1,045,800	24,063,858.00	0.11
345	600267	海正药业	2,896,200	24,038,460.00	0.11
346	603220	中贝通信	1,037,847	23,839,345.59	0.11
347	600328	中盐化工	3,026,490	23,818,476.30	0.11
348	300655	晶瑞电材	2,543,005	23,802,526.80	0.11
349	300910	瑞丰新材	498,336	23,715,810.24	0.11
350	002011	盾安环境	2,191,500	23,690,115.00	0.11
351	002706	良信股份	3,080,400	23,657,472.00	0.11
352	688362	甬矽电子	700,588	23,595,803.84	0.10
353	000758	中色股份	4,771,100	23,569,234.00	0.10
354	688076	诺泰生物	453,787	23,560,621.04	0.10
355	688063	派能科技	588,040	23,551,002.00	0.10
356	002847	盐津铺子	376,119	23,545,049.40	0.10
357	688702	盛科通信-U	280,026	23,522,184.00	0.10
358	002276	万马股份	2,771,400	23,446,044.00	0.10
359	603690	至纯科技	931,700	23,394,987.00	0.10
360	600248	陕建股份	5,193,800	23,268,224.00	0.10
361	000712	锦龙股份	1,536,800	23,236,416.00	0.10
362	600252	中恒集团	9,429,600	23,196,816.00	0.10
363	300693	盛弘股份	857,241	23,111,217.36	0.10
364	300613	富瀚微	395,060	23,111,010.00	0.10
365	603308	应流股份	1,637,100	23,083,110.00	0.10
366	603699	纽威股份	1,040,000	23,056,800.00	0.10
367	600116	三峡水利	3,293,600	23,022,264.00	0.10
368	002716	湖南白银	6,774,450	22,965,385.50	0.10
369	300323	华灿光电	2,773,400	22,963,752.00	0.10
370	002643	万润股份	1,913,179	22,958,148.00	0.10
371	300398	飞凯材料	1,455,764	22,942,840.64	0.10
372	000156	华数传媒	3,180,200	22,897,440.00	0.10
373	688548	广钢气体	2,272,308	22,882,141.56	0.10

374	600409	三友化工	4,234,300	22,865,220.00	0.10
375	002079	苏州固锴	2,223,800	22,838,426.00	0.10
376	002895	川恒股份	927,646	22,820,091.60	0.10
377	002192	融捷股份	714,400	22,789,360.00	0.10
378	688139	海尔生物	645,381	22,717,411.20	0.10
379	002539	云图控股	2,901,900	22,692,858.00	0.10
380	300641	正丹股份	912,600	22,668,984.00	0.10
381	000795	英洛华	2,327,600	22,647,548.00	0.10
382	300682	朗新集团	1,855,900	22,641,980.00	0.10
383	300415	伊之密	1,128,093	22,629,545.58	0.10
384	000811	冰轮环境	1,843,342	22,599,372.92	0.10
385	301039	中集车辆	2,494,900	22,578,845.00	0.10
386	603599	广信股份	1,869,220	22,524,101.00	0.10
387	000555	神州信息	2,006,700	22,475,040.00	0.10
388	688262	国芯科技	808,532	22,396,336.40	0.10
389	300747	锐科激光	1,167,112	22,361,865.92	0.10
390	300482	万孚生物	994,160	22,279,125.60	0.10
391	000650	仁和药业	3,849,300	22,171,968.00	0.10
392	688798	艾为电子	317,527	22,169,735.14	0.10
393	300761	立华股份	1,138,900	22,162,994.00	0.10
394	001309	德明利	253,870	22,137,464.00	0.10
395	600729	重庆百货	753,900	22,051,575.00	0.10
396	688766	普冉股份	217,695	22,043,795.70	0.10
397	000657	中钨高新	2,392,022	22,030,522.62	0.10
398	002458	益生股份	2,288,000	21,987,680.00	0.10
399	300357	我武生物	1,079,965	21,944,888.80	0.10
400	002324	普利特	2,302,225	21,940,204.25	0.10
401	600055	万东医疗	1,452,136	21,927,253.60	0.10
402	603588	高能环境	4,183,920	21,923,740.80	0.10
403	603039	泛微网络	446,400	21,873,600.00	0.10
404	300633	开立医疗	743,574	21,853,639.86	0.10
405	002061	浙江交科	5,356,020	21,852,561.60	0.10
406	600266	城建发展	4,283,300	21,844,830.00	0.10
407	000927	中国铁物	8,305,700	21,843,991.00	0.10
408	600158	中体产业	2,634,300	21,785,661.00	0.10
409	600933	爱柯迪	1,334,800	21,757,240.00	0.10
410	688123	聚辰股份	375,162	21,752,080.24	0.10
411	000923	河钢资源	1,563,500	21,732,650.00	0.10
412	688332	中科蓝讯	166,297	21,701,758.50	0.10
413	002010	传化智联	4,781,300	21,659,289.00	0.10
414	600782	新钢股份	6,477,400	21,634,516.00	0.10
415	600459	贵研铂业	1,573,540	21,604,704.20	0.10
416	688083	中望软件	251,518	21,522,395.26	0.10
417	603619	中曼石油	1,110,400	21,497,344.00	0.10

418	301029	怡合达	869,400	21,491,568.00	0.10
419	301293	三博脑科	495,280	21,435,718.40	0.10
420	300470	中密控股	568,355	21,426,983.50	0.10
421	600509	天富能源	3,306,700	21,394,349.00	0.10
422	600664	哈药股份	5,178,500	21,387,205.00	0.10
423	603218	日月股份	1,774,800	21,386,340.00	0.10
424	603027	千禾味业	1,762,720	21,346,539.20	0.09
425	000821	京山轻机	1,710,400	21,294,480.00	0.09
426	600012	皖通高速	1,204,800	21,264,720.00	0.09
427	002468	申通快递	2,093,100	21,203,103.00	0.09
428	603279	景津装备	1,183,800	21,166,344.00	0.09
429	002048	宁波华翔	1,674,100	21,127,142.00	0.09
430	688629	华丰科技	630,759	21,124,118.91	0.09
431	600894	广日股份	1,446,700	21,121,820.00	0.09
432	000735	罗牛山	3,164,200	21,073,572.00	0.09
433	300352	北信源	3,988,600	21,059,808.00	0.09
434	600575	淮河能源	5,296,000	21,025,120.00	0.09
435	000901	航天科技	1,914,700	21,004,259.00	0.09
436	300031	宝通科技	1,144,400	20,965,408.00	0.09
437	600480	凌云股份	1,935,200	20,919,512.00	0.09
438	300593	新雷能	1,857,642	20,805,590.40	0.09
439	300224	正海磁材	1,688,600	20,786,666.00	0.09
440	300620	光库科技	427,400	20,771,640.00	0.09
441	603496	恒为科技	763,900	20,762,802.00	0.09
442	002023	海特高新	2,036,626	20,671,753.90	0.09
443	002006	精工科技	1,252,692	20,669,418.00	0.09
444	002726	龙大美食	2,604,600	20,628,432.00	0.09
445	002446	盛路通信	3,143,900	20,592,545.00	0.09
446	300232	洲明科技	2,987,200	20,522,064.00	0.09
447	601369	陕鼓动力	2,355,300	20,491,110.00	0.09
448	002737	葵花药业	999,017	20,469,858.33	0.09
449	600556	天下秀	3,921,000	20,389,200.00	0.09
450	600211	西藏药业	550,255	20,326,419.70	0.09
451	600063	皖维高新	5,078,300	20,313,200.00	0.09
452	300123	亚光科技	3,500,000	20,300,000.00	0.09
453	600597	光明乳业	2,376,700	20,297,018.00	0.09
454	600017	日照港	6,337,300	20,279,360.00	0.09
455	688789	宏华数科	305,446	20,275,505.48	0.09
456	002043	兔宝宝	1,704,400	20,248,272.00	0.09
457	000552	甘肃能化	7,353,500	20,222,125.00	0.09
458	600006	东风股份	2,738,600	20,183,482.00	0.09
459	600888	新疆众和	2,842,000	20,178,200.00	0.09
460	300634	彩讯股份	924,450	20,153,010.00	0.09
461	603358	华达科技	603,168	20,145,811.20	0.09

462	601311	骆驼股份	2,421,967	20,078,106.43	0.09
463	002099	海翔药业	3,887,312	20,058,529.92	0.09
464	600138	中青旅	1,977,800	20,054,892.00	0.09
465	603337	杰克股份	658,300	20,051,818.00	0.09
466	603267	鸿远电子	553,000	20,035,190.00	0.09
467	002326	永太科技	2,229,336	19,930,263.84	0.09
468	002237	恒邦股份	1,972,700	19,924,270.00	0.09
469	600835	上海机电	1,111,100	19,910,912.00	0.09
470	605507	国邦医药	954,500	19,882,235.00	0.09
471	600757	长江传媒	2,074,900	19,856,793.00	0.09
472	688352	硕中科技	1,632,138	19,797,833.94	0.09
473	600094	大名城	5,413,990	19,706,923.60	0.09
474	002761	浙江建投	2,237,100	19,641,738.00	0.09
475	002226	江南化工	3,620,300	19,622,026.00	0.09
476	600502	安徽建工	4,103,946	19,616,861.88	0.09
477	600315	上海家化	1,156,220	19,551,680.20	0.09
478	002254	泰和新材	2,075,471	19,509,427.40	0.09
479	002081	金螳螂	5,455,800	19,477,206.00	0.09
480	301071	力量钻石	537,268	19,475,965.00	0.09
481	600366	宁波韵升	2,645,500	19,470,880.00	0.09
482	300244	迪安诊断	1,712,600	19,438,010.00	0.09
483	000848	承德露露	2,167,000	19,437,990.00	0.09
484	000028	国药一致	664,059	19,423,725.75	0.09
485	000913	钱江摩托	1,077,240	19,401,092.40	0.09
486	002993	奥海科技	472,999	19,392,959.00	0.09
487	300463	迈克生物	1,468,400	19,382,880.00	0.09
488	600059	古越龙山	2,181,600	19,372,608.00	0.09
489	600649	城投控股	4,346,400	19,341,480.00	0.09
490	603197	保隆科技	510,955	19,288,551.25	0.09
491	002097	山河智能	2,568,500	19,263,750.00	0.09
492	600971	恒源煤电	2,046,126	19,254,045.66	0.09
493	300602	飞荣达	1,000,800	19,235,376.00	0.09
494	600259	广晟有色	691,600	19,233,396.00	0.09
495	600507	方大特钢	4,744,300	19,214,415.00	0.09
496	600586	金晶科技	3,414,600	19,190,052.00	0.09
497	300446	航天智造	1,161,900	19,182,969.00	0.09
498	300772	运达股份	1,446,310	19,149,144.40	0.09
499	300770	新媒股份	472,894	19,109,646.54	0.09
500	600787	中储股份	2,985,300	19,046,214.00	0.08
501	600110	诺德股份	4,760,900	19,043,600.00	0.08
502	002605	姚记科技	714,122	19,038,492.52	0.08
503	002163	海南发展	2,034,900	19,026,315.00	0.08
504	300260	新莱应材	702,260	19,024,223.40	0.08
505	000737	北方铜业	2,436,000	19,000,800.00	0.08

506	300451	创业慧康	4,236,100	18,977,728.00	0.08
507	603100	川仪股份	878,960	18,941,588.00	0.08
508	601702	华峰铝业	1,031,300	18,893,416.00	0.08
509	600478	科力远	4,566,700	18,860,471.00	0.08
510	000928	中钢国际	2,960,800	18,860,296.00	0.08
511	002815	崇达技术	1,847,247	18,841,919.40	0.08
512	002233	塔牌集团	2,452,300	18,809,141.00	0.08
513	301035	润丰股份	386,025	18,807,138.00	0.08
514	600395	盘江股份	3,693,394	18,799,375.46	0.08
515	301291	明阳电气	427,887	18,792,797.04	0.08
516	601200	上海环境	2,299,800	18,789,366.00	0.08
517	603281	江瀚新材	767,584	18,729,049.60	0.08
518	600125	铁龙物流	3,151,517	18,688,495.81	0.08
519	688127	蓝特光学	688,993	18,671,710.30	0.08
520	000837	秦川机床	2,079,900	18,656,703.00	0.08
521	000049	德赛电池	792,949	18,642,230.99	0.08
522	300393	中来股份	2,976,677	18,604,231.25	0.08
523	000582	北部湾港	2,356,600	18,570,008.00	0.08
524	601900	南方传媒	1,227,900	18,553,569.00	0.08
525	300151	昌红科技	1,090,595	18,540,115.00	0.08
526	601028	玉龙股份	1,617,100	18,531,966.00	0.08
527	601952	苏垦农发	1,892,910	18,531,588.90	0.08
528	688575	亚辉龙	1,172,190	18,520,602.00	0.08
529	600866	星湖科技	2,860,200	18,505,494.00	0.08
530	300725	药石科技	549,709	18,470,222.40	0.08
531	002214	大立科技	1,651,300	18,411,995.00	0.08
532	000090	天健集团	4,478,600	18,407,046.00	0.08
533	688739	成大生物	712,447	18,366,883.66	0.08
534	600033	福建高速	4,728,300	18,345,804.00	0.08
535	002219	新里程	6,947,600	18,341,664.00	0.08
536	002038	双鹭药业	2,453,700	18,329,139.00	0.08
537	002390	信邦制药	4,015,600	18,270,980.00	0.08
538	600776	东方通信	1,632,400	18,266,556.00	0.08
539	688100	威胜信息	504,189	18,251,641.80	0.08
540	301219	腾远钴业	403,514	18,242,867.94	0.08
541	600305	恒顺醋业	2,284,253	18,228,338.94	0.08
542	688321	微芯生物	980,291	18,213,806.78	0.08
543	003021	兆威机电	246,372	18,209,354.52	0.08
544	600458	时代新材	1,418,600	18,172,266.00	0.08
545	300705	九典制药	1,011,516	18,156,712.20	0.08
546	600869	远东股份	3,810,900	18,101,775.00	0.08
547	688403	汇成股份	2,019,512	18,094,827.52	0.08
548	600623	华谊集团	2,583,300	18,083,100.00	0.08
549	002891	中宠股份	505,798	18,056,988.60	0.08

550	603866	桃李面包	2,733,087	18,038,374.20	0.08
551	000915	华特达因	640,025	18,035,904.50	0.08
552	002518	科士达	800,500	18,035,265.00	0.08
553	688270	臻镭科技	513,555	17,974,425.00	0.08
554	601890	亚星锚链	2,305,800	17,962,182.00	0.08
555	002635	安洁科技	1,127,903	17,956,215.76	0.08
556	603033	三维股份	1,410,000	17,892,900.00	0.08
557	300687	赛意信息	982,200	17,876,040.00	0.08
558	301095	广立微	342,938	17,856,781.66	0.08
559	600996	贵广网络	2,081,600	17,797,680.00	0.08
560	688192	迪哲医药-U	429,068	17,793,449.96	0.08
561	688779	五矿新能	3,327,083	17,700,081.56	0.08
562	300363	博腾股份	1,121,800	17,690,786.00	0.08
563	600773	西藏城投	1,638,800	17,666,264.00	0.08
564	600740	山西焦化	4,379,400	17,648,982.00	0.08
565	300841	康华生物	323,325	17,627,679.00	0.08
566	300119	瑞普生物	959,290	17,622,157.30	0.08
567	000930	中粮科技	3,169,100	17,588,505.00	0.08
568	600976	健民集团	421,700	17,576,456.00	0.08
569	002077	大港股份	1,197,700	17,570,259.00	0.08
570	300726	宏达电子	563,874	17,536,481.40	0.08
571	600675	中华企业	6,238,000	17,528,780.00	0.08
572	600313	农发种业	2,590,100	17,483,175.00	0.08
573	300171	东富龙	1,315,909	17,475,271.52	0.08
574	300226	上海钢联	763,756	17,467,099.72	0.08
575	301316	慧博云通	683,000	17,464,310.00	0.08
576	688559	海目星	507,310	17,451,464.00	0.08
577	601500	通用股份	3,268,400	17,420,572.00	0.08
578	600490	鹏欣资源	5,294,900	17,420,221.00	0.08
579	688326	经纬恒润-W	206,704	17,383,806.40	0.08
580	688400	凌云光	791,643	17,352,814.56	0.08
581	603128	华贸物流	2,681,600	17,242,688.00	0.08
582	688388	嘉元科技	1,166,397	17,181,027.81	0.08
583	600169	太原重工	6,896,220	17,171,587.80	0.08
584	603368	柳药集团	960,700	17,158,102.00	0.08
585	002928	华夏航空	2,204,000	17,103,040.00	0.08
586	600389	江山股份	1,179,675	17,046,303.75	0.08
587	000603	盛达资源	1,417,424	16,994,913.76	0.08
588	688091	上海谊众	425,323	16,978,894.16	0.08
589	603713	密尔克卫	331,600	16,977,920.00	0.08
590	603026	石大胜华	484,900	16,971,500.00	0.08
591	603328	依顿电子	1,721,000	16,969,060.00	0.08
592	000966	长源电力	3,566,800	16,942,300.00	0.08
593	002777	久远银海	980,430	16,883,004.60	0.08

594	002243	力合科创	2,086,400	16,816,384.00	0.07
595	603305	旭升集团	1,278,748	16,815,536.20	0.07
596	600197	伊力特	974,800	16,815,300.00	0.07
597	300820	英杰电气	304,300	16,812,575.00	0.07
598	688106	金宏气体	987,599	16,799,058.99	0.07
599	002925	盈趣科技	1,071,500	16,779,690.00	0.07
600	300596	利安隆	549,525	16,760,512.50	0.07
601	688556	高测股份	1,498,624	16,754,616.32	0.07
602	000065	北方国际	1,709,700	16,720,866.00	0.07
603	600531	豫光金铅	2,601,000	16,698,420.00	0.07
604	002705	新宝股份	1,112,311	16,684,665.00	0.07
605	688062	迈威生物-U	825,906	16,683,301.20	0.07
606	601619	嘉泽新能	5,023,900	16,679,348.00	0.07
607	300660	江苏雷利	436,400	16,679,208.00	0.07
608	000550	江铃汽车	710,296	16,656,441.20	0.07
609	600710	苏美达	1,789,800	16,645,140.00	0.07
610	688639	华恒生物	516,646	16,641,167.66	0.07
611	688522	纳睿雷达	295,277	16,635,906.18	0.07
612	002697	红旗连锁	2,814,200	16,631,922.00	0.07
613	601163	三角轮胎	1,097,100	16,533,297.00	0.07
614	688696	极米科技	168,445	16,510,978.90	0.07
615	688612	威迈斯	699,359	16,462,910.86	0.07
616	601326	秦港股份	4,908,200	16,442,470.00	0.07
617	600557	康缘药业	1,204,000	16,398,480.00	0.07
618	002967	广电计量	998,606	16,377,138.40	0.07
619	000061	农产品	2,335,250	16,370,102.50	0.07
620	000048	京基智农	909,400	16,369,200.00	0.07
621	002550	千红制药	2,633,300	16,326,460.00	0.07
622	002108	沧州明珠	4,546,100	16,320,499.00	0.07
623	002929	润建股份	485,074	16,308,187.88	0.07
624	600775	南京熊猫	1,623,900	16,303,956.00	0.07
625	600751	海航科技	6,195,200	16,293,376.00	0.07
626	688007	光峰科技	1,101,353	16,289,010.87	0.07
627	688300	联瑞新材	252,874	16,285,085.60	0.07
628	601208	东材科技	2,155,100	16,249,454.00	0.07
629	601101	昊华能源	1,971,300	16,223,799.00	0.07
630	603583	捷昌驱动	656,120	16,212,725.20	0.07
631	603612	索通发展	1,199,400	16,203,894.00	0.07
632	000990	诚志股份	2,090,400	16,200,600.00	0.07
633	002537	海联金汇	2,815,700	16,190,275.00	0.07
634	002291	遥望科技	2,561,300	16,161,803.00	0.07
635	002727	一心堂	1,230,879	16,026,044.58	0.07
636	002068	黑猫股份	1,505,600	16,019,584.00	0.07
637	300821	东岳硅材	2,063,717	16,014,443.92	0.07

638	002985	北摩高科	679,500	15,968,250.00	0.07
639	300455	航天智装	1,231,800	15,964,128.00	0.07
640	301155	海力风电	299,410	15,961,547.10	0.07
641	688167	炬光科技	250,469	15,954,875.30	0.07
642	001287	中电港	785,400	15,951,474.00	0.07
643	688366	昊海生科	263,178	15,943,323.24	0.07
644	603888	新华网	713,600	15,941,824.00	0.07
645	000950	重药控股	2,959,900	15,924,262.00	0.07
646	300261	雅本化学	2,320,800	15,897,480.00	0.07
647	002194	武汉凡谷	1,413,900	15,863,958.00	0.07
648	600163	中闽能源	2,604,700	15,862,623.00	0.07
649	000756	新华制药	1,008,830	15,848,719.30	0.07
650	000719	中原传媒	1,394,900	15,846,064.00	0.07
651	688372	伟测科技	270,518	15,830,713.36	0.07
652	603383	顶点软件	421,120	15,792,000.00	0.07
653	300580	贝斯特	687,400	15,775,830.00	0.07
654	002626	金达威	1,044,588	15,773,278.80	0.07
655	688146	中船特气	542,628	15,757,917.12	0.07
656	300129	泰胜风能	2,233,800	15,748,290.00	0.07
657	600073	光明肉业	2,268,700	15,744,778.00	0.07
658	600682	南京新百	2,300,400	15,734,736.00	0.07
659	000059	华锦股份	3,277,001	15,696,834.79	0.07
660	600882	妙可蓝多	874,500	15,653,550.00	0.07
661	605376	博迁新材	539,900	15,630,105.00	0.07
662	000557	西部创业	3,004,140	15,591,486.60	0.07
663	300039	上海凯宝	2,507,900	15,498,822.00	0.07
664	300134	大富科技	1,318,700	15,468,351.00	0.07
665	300366	创意信息	1,663,261	15,468,327.30	0.07
666	603477	巨星农牧	871,300	15,465,575.00	0.07
667	688630	芯碁微装	267,849	15,460,244.28	0.07
668	002154	报喜鸟	3,496,300	15,418,683.00	0.07
669	001914	招商积余	1,458,700	15,418,459.00	0.07
670	688131	皓元医药	431,652	15,409,976.40	0.07
671	002498	汉缆股份	4,544,800	15,406,872.00	0.07
672	002859	洁美科技	742,300	15,402,725.00	0.07
673	300183	东软载波	795,900	15,400,665.00	0.07
674	600963	岳阳林纸	3,021,200	15,347,696.00	0.07
675	688190	云路股份	166,265	15,296,380.00	0.07
676	600075	新疆天业	3,511,676	15,275,790.60	0.07
677	603008	喜临门	910,187	15,254,734.12	0.07
678	603533	掌阅科技	750,800	15,248,748.00	0.07
679	300443	金雷股份	764,978	15,238,361.76	0.07
680	600648	外高桥	1,277,300	15,212,643.00	0.07
681	600812	华北制药	2,940,900	15,204,453.00	0.07

682	000828	东莞控股	1,420,600	15,186,214.00	0.07
683	002274	华昌化工	1,954,400	15,185,688.00	0.07
684	601908	京运通	4,964,800	15,142,640.00	0.07
685	601595	上海电影	612,756	15,135,073.20	0.07
686	002511	中顺洁柔	2,214,400	15,080,064.00	0.07
687	002320	海峡股份	2,300,850	15,070,567.50	0.07
688	002987	京北方	1,057,662	15,050,530.26	0.07
689	600217	中再资环	2,839,400	15,048,820.00	0.07
690	600861	北京人力	777,600	15,046,560.00	0.07
691	002545	东方铁塔	2,140,300	15,046,309.00	0.07
692	603733	仙鹤股份	728,200	15,022,766.00	0.07
693	603567	珍宝岛	1,294,500	15,016,200.00	0.07
694	002461	珠江啤酒	1,518,300	15,015,987.00	0.07
695	601609	金田股份	2,544,900	15,014,910.00	0.07
696	688700	东威科技	507,816	14,960,259.36	0.07
697	300913	兆龙互连	259,915	14,947,711.65	0.07
698	300855	图南股份	681,365	14,935,520.80	0.07
699	002960	青鸟消防	1,278,732	14,922,802.44	0.07
700	002349	精华制药	1,950,600	14,922,090.00	0.07
701	600301	华锡有色	872,400	14,839,524.00	0.07
702	601969	海南矿业	2,090,200	14,819,518.00	0.07
703	601801	皖新传媒	2,018,200	14,813,588.00	0.07
704	688502	茂莱光学	73,465	14,795,851.00	0.07
705	600997	开滦股份	2,188,500	14,794,260.00	0.07
706	688631	莱斯信息	169,720	14,780,914.80	0.07
707	688598	金博股份	701,457	14,772,684.42	0.07
708	688066	航天宏图	721,229	14,713,071.60	0.07
709	688006	杭可科技	823,695	14,711,192.70	0.07
710	600449	宁夏建材	978,800	14,701,576.00	0.07
711	002191	劲嘉股份	3,496,172	14,683,922.40	0.07
712	601606	长城军工	1,248,300	14,680,008.00	0.07
713	002588	史丹利	1,988,400	14,674,392.00	0.07
714	603317	天味食品	1,097,923	14,646,292.82	0.07
715	605333	沪光股份	447,800	14,611,714.00	0.06
716	600477	杭萧钢构	5,681,588	14,601,681.16	0.06
717	688432	有研硅	1,287,096	14,544,184.80	0.06
718	603638	艾迪精密	860,500	14,533,845.00	0.06
719	000488	ST 晨鸣	4,759,100	14,515,255.00	0.06
720	300579	数字认证	460,340	14,463,882.80	0.06
721	601827	三峰环境	1,684,500	14,453,010.00	0.06
722	600961	株冶集团	1,830,800	14,408,396.00	0.06
723	002216	三全食品	1,200,600	14,407,200.00	0.06
724	603118	共进股份	1,618,700	14,406,430.00	0.06
725	300416	苏试试验	1,214,760	14,285,577.60	0.06

726	301510	固高科技	546,500	14,263,650.00	0.06
727	000881	中广核技	1,942,200	14,236,326.00	0.06
728	003006	百亚股份	593,071	14,227,773.29	0.06
729	600651	飞乐音响	3,428,700	14,194,818.00	0.06
730	301031	中熔电气	136,400	14,188,328.00	0.06
731	603229	奥翔药业	1,419,804	14,183,841.96	0.06
732	300850	新强联	740,700	14,154,777.00	0.06
733	002060	广东建工	3,858,200	14,121,012.00	0.06
734	000600	建投能源	2,493,900	14,115,474.00	0.06
735	600966	博汇纸业	2,733,600	14,105,376.00	0.06
736	300428	立中集团	865,223	14,103,134.90	0.06
737	601949	中国出版	1,961,100	14,080,698.00	0.06
738	600643	爱建集团	2,720,950	14,067,311.50	0.06
739	002434	万里扬	2,260,500	14,015,100.00	0.06
740	688439	振华风光	271,834	13,942,365.86	0.06
741	605368	蓝天燃气	1,218,100	13,922,883.00	0.06
742	002051	中工国际	1,695,400	13,834,464.00	0.06
743	688515	裕太微-U	139,182	13,779,018.00	0.06
744	000567	海德股份	2,012,688	13,746,659.04	0.06
745	000029	深深房 A	912,500	13,742,250.00	0.06
746	002101	广东鸿图	1,146,463	13,734,626.74	0.06
747	603995	甬金股份	750,575	13,728,016.75	0.06
748	002158	汉钟精机	738,400	13,675,168.00	0.06
749	002399	海普瑞	1,278,600	13,668,234.00	0.06
750	603919	金徽酒	697,160	13,664,336.00	0.06
751	000688	国城矿业	1,148,700	13,658,043.00	0.06
752	301175	中科环保	2,525,200	13,636,080.00	0.06
753	301363	美好医疗	417,900	13,548,318.00	0.06
754	002258	利尔化学	1,637,300	13,540,471.00	0.06
755	301205	联特科技	178,544	13,513,995.36	0.06
756	001270	铖昌科技	354,224	13,495,934.40	0.06
757	301511	德福科技	1,074,500	13,495,720.00	0.06
758	603876	鼎胜新材	1,524,580	13,492,533.00	0.06
759	000767	晋控电力	5,315,900	13,449,227.00	0.06
760	688707	振华新材	1,227,455	13,440,632.25	0.06
761	002840	华统股份	1,065,800	13,439,738.00	0.06
762	301487	盟固利	631,800	13,438,386.00	0.06
763	301325	曼恩斯特	247,680	13,421,779.20	0.06
764	300406	九强生物	1,002,062	13,387,548.32	0.06
765	600548	深高速	988,700	13,327,676.00	0.06
766	300527	中船应急	1,643,825	13,265,667.75	0.06
767	002041	登海种业	1,217,524	13,258,836.36	0.06
768	002204	大连重工	2,660,100	13,247,298.00	0.06
769	300861	美畅股份	663,700	13,240,815.00	0.06

770	688389	普门科技	888,638	13,231,819.82	0.06
771	688232	新点软件	455,322	13,199,784.78	0.06
772	301015	百洋医药	542,596	13,136,249.16	0.06
773	600640	国脉文化	1,096,700	13,094,598.00	0.06
774	002125	湘潭电化	1,296,189	13,065,585.12	0.06
775	603043	广州酒家	784,780	13,050,891.40	0.06
776	600508	上海能源	984,700	13,027,581.00	0.06
777	688549	中巨芯-U	1,528,799	13,025,367.48	0.06
778	600783	鲁信创投	1,027,400	13,017,158.00	0.06
779	000088	盐田港	2,672,867	13,016,862.29	0.06
780	600223	福瑞达	1,720,300	13,005,468.00	0.06
781	600020	中原高速	3,075,400	12,978,188.00	0.06
782	605168	三人行	360,661	12,954,943.12	0.06
783	002267	陕天然气	1,523,100	12,870,195.00	0.06
784	600639	浦东金桥	1,158,700	12,861,570.00	0.06
785	600335	国机汽车	2,061,500	12,843,145.00	0.06
786	000498	山东路桥	2,155,400	12,824,630.00	0.06
787	000597	东北制药	2,433,000	12,821,910.00	0.06
788	603171	税友股份	418,700	12,770,350.00	0.06
789	000672	上峰水泥	1,667,623	12,757,315.95	0.06
790	002327	富安娜	1,441,700	12,744,628.00	0.06
791	002516	旷达科技	2,508,800	12,719,616.00	0.06
792	002585	双星新材	2,374,800	12,681,432.00	0.06
793	600929	雪天盐业	2,263,800	12,654,642.00	0.06
794	001213	中铁特货	3,032,600	12,645,942.00	0.06
795	688147	微导纳米	469,991	12,638,057.99	0.06
796	301087	可孚医疗	356,132	12,592,827.52	0.06
797	600874	创业环保	2,103,800	12,559,686.00	0.06
798	601869	长飞光纤	419,400	12,535,866.00	0.06
799	601515	东峰集团	3,145,438	12,518,843.24	0.06
800	688443	智翔金泰-U	498,608	12,510,074.72	0.06
801	002612	朗姿股份	764,043	12,499,743.48	0.06
802	603636	南威软件	1,190,200	12,497,100.00	0.06
803	300257	开山股份	1,365,600	12,454,272.00	0.06
804	002941	新疆交建	1,110,800	12,407,636.00	0.06
805	688150	莱特光电	549,822	12,381,991.44	0.06
806	603169	兰石重装	2,256,900	12,300,105.00	0.05
807	688380	中微半导	408,775	12,222,372.50	0.05
808	688690	纳微科技	693,948	12,213,484.80	0.05
809	000718	苏宁环球	5,175,000	12,213,000.00	0.05
810	605599	菜百股份	1,075,000	12,201,250.00	0.05
811	002833	弘亚数控	723,100	12,169,773.00	0.05
812	688107	安路科技	410,012	12,128,154.96	0.05
813	002489	浙江永强	3,739,600	12,116,304.00	0.05

814	600657	信达地产	2,912,500	12,116,000.00	0.05
815	601096	宏盛华源	2,777,015	12,080,015.25	0.05
816	688298	东方生物	411,738	12,076,275.54	0.05
817	600987	航民股份	1,737,556	12,058,638.64	0.05
818	603299	苏盐井神	1,082,400	12,057,936.00	0.05
819	002581	未名医药	1,130,062	12,023,859.68	0.05
820	002991	甘源食品	128,400	12,007,968.00	0.05
821	001337	四川黄金	574,700	11,999,736.00	0.05
822	300856	科思股份	467,300	11,972,226.00	0.05
823	688097	博众精工	455,451	11,955,588.75	0.05
824	301239	普瑞眼科	254,725	11,946,602.50	0.05
825	002190	成飞集成	617,501	11,942,469.34	0.05
826	002755	奥赛康	939,200	11,937,232.00	0.05
827	601921	浙版传媒	1,513,700	11,927,956.00	0.05
828	600475	华光环能	1,322,543	11,916,112.43	0.05
829	000791	甘肃能源	1,975,800	11,914,074.00	0.05
830	688578	艾力斯	200,000	11,846,000.00	0.05
831	600662	外服控股	2,336,000	11,843,520.00	0.05
832	600195	中牧股份	1,757,531	11,793,033.01	0.05
833	601882	海天精工	536,018	11,754,874.74	0.05
834	601107	四川成渝	2,240,300	11,716,769.00	0.05
835	301238	瑞泰新材	747,204	11,701,214.64	0.05
836	300768	迪普科技	668,250	11,694,375.00	0.05
837	688048	长光华芯	299,515	11,678,089.85	0.05
838	603025	大豪科技	763,480	11,643,070.00	0.05
839	000813	德展健康	3,708,100	11,606,353.00	0.05
840	603801	志邦家居	899,980	11,528,743.80	0.05
841	300737	科顺股份	2,270,200	11,509,914.00	0.05
842	301536	星辰科技	143,700	11,481,630.00	0.05
843	000885	城发环境	874,000	11,458,140.00	0.05
844	300973	立高食品	292,396	11,412,215.88	0.05
845	600604	市北高新	2,396,773	11,408,639.48	0.05
846	002034	旺能环境	734,433	11,383,711.50	0.05
847	002302	西部建设	1,729,300	11,378,794.00	0.05
848	603466	风语筑	1,215,656	11,329,913.92	0.05
849	000935	四川双马	780,900	11,307,432.00	0.05
850	688531	日联科技	237,133	11,294,644.79	0.05
851	600810	神马股份	1,385,400	11,207,886.00	0.05
852	688658	悦康药业	776,158	11,184,436.78	0.05
853	605123	派克新材	207,500	11,155,200.00	0.05
854	300080	易成新能	2,549,400	11,140,878.00	0.05
855	601038	一拖股份	747,200	11,043,616.00	0.05
856	000025	特力 A	668,494	11,043,520.88	0.05
857	000736	中交地产	1,279,800	11,006,280.00	0.05

858	301589	诺瓦星云	63,400	11,006,240.00	0.05
859	002242	九阳股份	1,061,200	10,994,032.00	0.05
860	600780	通宝能源	1,949,701	10,976,816.63	0.05
861	000968	蓝焰控股	1,650,400	10,975,160.00	0.05
862	603123	翠微股份	1,359,600	10,944,780.00	0.05
863	000869	张裕 A	471,600	10,936,404.00	0.05
864	601069	西部黄金	951,300	10,892,385.00	0.05
865	603609	禾丰股份	1,256,500	10,831,030.00	0.05
866	603297	永新光学	115,191	10,807,219.62	0.05
867	301207	华兰疫苗	617,050	10,804,545.50	0.05
868	002053	云南能投	944,600	10,768,440.00	0.05
869	301216	万凯新材	1,050,650	10,716,630.00	0.05
870	002378	章源钨业	1,653,380	10,697,368.60	0.05
871	300723	一品红	625,300	10,667,618.00	0.05
872	301348	蓝箭电子	415,313	10,640,319.06	0.05
873	603915	国茂股份	904,000	10,594,880.00	0.05
874	688261	东微半导	252,031	10,582,781.69	0.05
875	688348	昱能科技	216,618	10,570,958.40	0.05
876	003012	东鹏控股	1,593,700	10,534,357.00	0.05
877	605020	永和股份	517,980	10,530,533.40	0.05
878	600058	五矿发展	1,478,500	10,526,920.00	0.05
879	603566	普莱柯	824,100	10,515,516.00	0.05
880	300492	华图山鼎	143,800	10,468,640.00	0.05
881	002959	小熊电器	216,700	10,382,097.00	0.05
882	001323	慕思股份	273,900	10,356,159.00	0.05
883	688209	英集芯	584,532	10,328,680.44	0.05
884	688586	江航装备	1,077,872	10,315,235.04	0.05
885	688337	普源精电	264,310	10,308,090.00	0.05
886	301047	义翘神州	166,470	10,296,169.50	0.05
887	003040	楚天龙	786,053	10,273,712.71	0.05
888	603055	台华新材	923,800	10,235,704.00	0.05
889	603730	岱美股份	1,138,548	10,235,546.52	0.05
890	002096	易普力	859,500	10,210,860.00	0.05
891	603301	振德医疗	457,500	10,060,425.00	0.04
892	301153	中科江南	359,618	10,047,726.92	0.04
893	301327	华宝新能	130,440	10,006,052.40	0.04
894	603348	文灿股份	420,024	9,937,767.84	0.04
895	688686	奥普特	128,002	9,678,231.22	0.04
896	301526	国际复材	2,609,723	9,655,975.10	0.04
897	688185	康希诺	157,468	9,613,421.40	0.04
898	301217	铜冠铜箔	853,200	9,453,456.00	0.04
899	603327	福蓉科技	775,050	9,409,107.00	0.04
900	601015	陕西黑猫	2,816,900	9,408,446.00	0.04
901	600903	贵州燃气	1,180,620	9,208,836.00	0.04

902	688105	诺唯赞	415,234	9,205,737.78	0.04
903	688351	微电生理-U	481,968	9,176,670.72	0.04
904	300926	博俊科技	415,350	9,141,853.50	0.04
905	603439	贵州三力	702,600	9,133,800.00	0.04
906	301268	铭利达	550,700	9,130,606.00	0.04
907	002275	桂林三金	599,200	9,041,928.00	0.04
908	000030	富奥股份	1,753,900	8,997,507.00	0.04
909	688336	三生国健	417,091	8,934,089.22	0.04
910	601033	永兴股份	616,786	8,918,725.56	0.04
911	002088	鲁阳节能	694,500	8,882,655.00	0.04
912	603355	莱克电气	391,900	8,876,535.00	0.04
913	603983	丸美生物	274,700	8,861,822.00	0.04
914	002901	大博医疗	287,100	8,854,164.00	0.04
915	000899	赣能股份	1,015,400	8,844,134.00	0.04
916	603985	恒润股份	757,000	8,841,760.00	0.04
917	605116	奥锐特	416,700	8,800,704.00	0.04
918	002314	南山控股	3,694,300	8,792,434.00	0.04
919	002946	新乳业	596,800	8,659,568.00	0.04
920	301339	通行宝	425,600	8,656,704.00	0.04
921	603162	海通发展	936,180	8,612,856.00	0.04
922	301069	凯盛新材	577,500	8,558,550.00	0.04
923	605009	豪悦护理	213,391	8,527,104.36	0.04
924	002534	西子洁能	765,700	8,506,927.00	0.04
925	601886	江河集团	1,571,500	8,486,100.00	0.04
926	601083	锦江航运	887,263	8,446,743.76	0.04
927	688206	概伦电子	442,940	8,375,995.40	0.04
928	003009	中天火箭	212,100	8,271,900.00	0.04
929	688001	华兴源创	302,658	8,202,031.80	0.04
930	000761	本钢板材	2,561,500	8,196,800.00	0.04
931	688392	骄成超声	200,517	8,181,093.60	0.04
932	603989	艾华集团	542,500	8,180,900.00	0.04
933	688177	百奥泰	421,560	8,169,832.80	0.04
934	000058	深赛格	1,010,700	8,115,921.00	0.04
935	301376	致欧科技	416,300	7,959,656.00	0.04
936	002651	利君股份	1,078,800	7,907,604.00	0.04
937	603719	良品铺子	555,200	7,889,392.00	0.04
938	001308	康冠科技	286,390	7,875,725.00	0.04
939	300702	天宇股份	472,400	7,870,184.00	0.04
940	002911	佛燃能源	621,176	7,851,664.64	0.03
941	603013	亚普股份	521,300	7,809,074.00	0.03
942	002913	奥士康	323,200	7,792,352.00	0.03
943	300869	康泰医学	558,333	7,783,162.02	0.03
944	300894	火星人	565,300	7,744,610.00	0.03
945	301371	敷尔佳	204,500	7,728,055.00	0.03

946	002978	安宁股份	271,654	7,720,406.68	0.03
947	301367	怡和嘉业	122,520	7,718,760.00	0.03
948	300755	华致酒行	432,285	7,711,964.40	0.03
949	600618	氯碱化工	780,100	7,691,786.00	0.03
950	688268	华特气体	165,764	7,611,882.88	0.03
951	603093	南华期货	636,900	7,579,110.00	0.03
952	001258	立新能源	950,400	7,565,184.00	0.03
953	000019	深粮控股	1,147,359	7,538,148.63	0.03
954	001236	弘业期货	780,800	7,526,912.00	0.03
955	301246	宏源药业	551,407	7,460,536.71	0.03
956	300741	华宝股份	424,100	7,375,099.00	0.03
957	000517	荣安地产	3,298,600	7,355,878.00	0.03
958	603530	神马电力	297,100	7,341,341.00	0.03
959	688315	诺禾致源	575,454	7,193,175.00	0.03
960	603877	太平鸟	485,400	7,183,920.00	0.03
961	601022	宁波远洋	890,300	7,149,109.00	0.03
962	605296	神农集团	255,300	7,071,810.00	0.03
963	301558	三态股份	804,800	7,050,048.00	0.03
964	688776	国光电气	148,743	7,040,006.19	0.03
965	688526	科前生物	485,617	6,939,466.93	0.03
966	688433	华曙高科	285,148	6,655,354.32	0.03
967	605222	起帆电缆	429,200	6,609,680.00	0.03
968	605577	龙版传媒	450,400	6,544,312.00	0.03
969	001311	多利科技	249,179	6,426,326.41	0.03
970	601811	新华文轩	404,100	6,404,985.00	0.03
971	688383	新益昌	141,752	6,360,412.24	0.03
972	002990	盛视科技	267,509	6,198,183.53	0.03
973	301381	赛维时代	271,300	6,174,788.00	0.03
974	603693	江苏新能	614,790	6,055,681.50	0.03
975	001389	广合科技	119,400	6,005,820.00	0.03
976	605011	杭州热电	278,000	5,954,760.00	0.03
977	688128	中国电研	280,431	5,891,855.31	0.03
978	603489	八方股份	240,441	5,727,304.62	0.03
979	001269	欧晶科技	199,820	5,692,871.80	0.03
980	603057	紫燕食品	281,700	5,659,353.00	0.03
981	003039	顺控发展	423,800	5,543,304.00	0.02
982	605365	立达信	348,300	5,468,310.00	0.02
983	688523	航天环宇	272,387	5,447,740.00	0.02
984	603219	富佳股份	380,200	5,387,434.00	0.02
985	001322	箭牌家居	656,000	5,307,040.00	0.02
986	301508	中机认检	154,000	5,236,000.00	0.02
987	301090	华润材料	753,600	5,229,984.00	0.02
988	301500	飞南资源	275,230	4,954,140.00	0.02
989	301559	中集环科	314,600	4,829,110.00	0.02

990	600403	大有能源	1,638,800	4,818,072.00	0.02
991	601068	中铝国际	1,077,700	4,752,657.00	0.02
992	301565	中仑新材	207,511	4,440,735.40	0.02
993	301606	绿联科技	115,696	4,372,790.04	0.02
994	603132	金徽股份	377,600	4,240,448.00	0.02
995	601279	英利汽车	1,072,300	4,106,909.00	0.02
996	603103	横店影视	256,075	3,684,919.25	0.02
997	301262	海看股份	143,788	3,576,007.56	0.02
998	301177	迪阿股份	152,863	3,491,390.92	0.02
999	301180	万祥科技	199,900	3,092,453.00	0.01
1,000	603075	热威股份	140,000	2,608,200.00	0.01
1,001	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
1,002	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
1,003	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
1,004	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
1,005	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
1,006	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
1,007	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
1,008	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
1,009	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
1,010	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
1,011	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
1,012	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
1,013	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
1,014	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
1,015	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
1,016	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
1,017	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
1,018	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
1,019	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
1,020	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
1,021	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
1,022	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
1,023	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
1,024	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
1,025	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
1,026	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
1,027	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
1,028	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
1,029	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
1,030	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
1,031	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
1,032	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
1,033	603285	键邦股份	129	2,916.69	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	002456	欧菲光	176,831,068.79	2.06
2	300339	润和软件	135,977,047.34	1.59
3	300476	胜宏科技	111,776,141.05	1.30
4	002405	四维图新	111,112,099.12	1.30
5	002085	万丰奥威	101,276,832.77	1.18
6	300346	南大光电	99,428,470.17	1.16
7	002318	久立特材	98,966,887.10	1.15
8	002176	江特电机	94,303,169.14	1.10
9	000426	兴业银锡	93,323,294.40	1.09
10	300573	兴齐眼药	92,306,538.87	1.08
11	002126	银轮股份	92,075,896.22	1.07
12	000528	柳工	91,003,955.81	1.06
13	300624	万兴科技	87,414,378.02	1.02
14	000766	通化金马	85,510,355.64	1.00
15	300315	掌趣科技	83,236,774.45	0.97
16	301308	江波龙	83,102,794.70	0.97
17	600171	上海贝岭	80,106,903.00	0.93
18	000034	神州数码	79,375,780.36	0.93
19	002312	川发龙蟒	78,245,178.00	0.91
20	002130	沃尔核材	77,297,592.54	0.90

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	300339	润和软件	293,254,364.27	3.42
2	300476	胜宏科技	171,541,257.55	2.00
3	002085	万丰奥威	171,201,683.36	2.00
4	002456	欧菲光	131,711,642.44	1.54
5	002318	久立特材	126,300,719.36	1.47
6	000426	兴业银锡	119,197,131.30	1.39
7	000034	神州数码	116,917,380.75	1.36
8	601099	太平洋	116,670,846.90	1.36
9	300573	兴齐眼药	104,729,589.60	1.22
10	301308	江波龙	102,817,813.47	1.20
11	002436	兴森科技	92,256,226.13	1.08
12	002312	川发龙蟒	89,693,150.35	1.05
13	002405	四维图新	86,220,977.49	1.01
14	000403	派林生物	85,414,239.86	1.00
15	300002	神州泰岳	83,480,646.65	0.97
16	300054	鼎龙股份	74,928,687.79	0.87
17	300624	万兴科技	73,738,415.93	0.86
18	002176	江特电机	73,255,075.00	0.85
19	300346	南大光电	72,866,574.67	0.85
20	688617	惠泰医疗	70,979,510.23	0.83

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	26,629,413,963.40
卖出股票收入（成交）总额	21,294,866,895.97

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	66,578,192.87
2	应收清算款	4,240,896.66
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	70,819,089.53
---	----	---------------

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	688608	恒玄科技	19,017,000.00	0.08	老股流通受限

§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 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
27,722	334,630.32	8,919,536,867.00	96.15%	357,084,859.00	3.85%	207,919,019.00	2.24%

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1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中央汇金资产管理有限责任公司	4,236,425,860.00	45.67%
2	中央汇金投资有限责任公司	3,799,915,155.00	40.96%
3	中国平安人寿保险股份有限公司-自有	81,923,345.00	0.88%

	资金		
4	申万宏源证券有限公司	49,423,329.00	0.53%
5	大家人寿保险股份有限公司-万能产品	49,178,620.00	0.53%
6	瑞众人寿保险有限责任公司-自有资金	40,723,100.00	0.44%
7	中国平安人寿保险股份有限公司-寿险传统低-自主	39,920,195.00	0.43%
8	兴业证券股份有限公司	31,092,372.00	0.34%
9	百年人寿保险股份有限公司-百年传统	30,059,600.00	0.32%
10	中国人寿保险股份有限公司	25,001,614.00	0.27%
11	广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	207,919,019.00	2.24%

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(2022年7月28日)基金份额总额	7,996,738,181.00
本报告期期初基金份额总额	3,632,621,726.00
本报告期基金总申购份额	16,437,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,793,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,276,621,726.00

§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

自 2024 年 12 月 27 日起,本基金改聘容诚会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 80,000 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	
广发证券	8	31,157,207,512.08	65.06%	1,430,539.05	65.07%	-
中信建投证券	4	16,729,813,239.57	34.94%	768,038.92	34.93%	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
申万宏源证券	3	-	-	-	-	减少 1 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	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
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
广发证券	6,236,600.00	17.41%	-	-	-	-
中信建投证券	29,590,623.62	82.59%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
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	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
2	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
3	关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-07
4	关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-08
5	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
6	关于增加西南证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-20
7	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
8	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
9	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
10	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
11	关于增加渤海证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-17

12	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	2024-06-12
13	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
14	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
15	关于增加中原证券为广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-08-06
16	关于增加国联证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-08-28
17	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
18	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
19	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
20	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
21	关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-28

§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
机构	1	20240123-20240205	352,115,928.00	379,566,549.00	706,680,863.00	25,001,614.00	0.27%
	2	20240206-20241231	-	3,799,915,155.00	-	3,799,915,155.00	40.96%
	3	20240717-20241231	-	4,236,425,860.00	-	4,236,425,860.00	45.67%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p>							

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

1、为更好地满足广大投资者的投资理财需求，根据《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》等法律法规的规定以及本基金基金合同的约定，本基金管理人经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定自 2024 年 2 月 7 日起调低本基金的管理费率及托管费率，并据此对本基金基金合同等法律文件进行相应修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金修订基金合同等法律文件的公告》。

2、由于基金投资运作需要，本基金管理人决定自 2024 年 2 月 19 日起，将本基金最小申购、赎回单位由 1,000,000 份调整为 3,000,000 份。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- （二）《广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）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