

广发高股息优享混合型证券投资基金
2025 年中期报告
2025 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：二〇二五年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报 告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65

8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	67
9 开放式基金份额变动	67
10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	70
11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	71
12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发高股息优享混合型证券投资基金	
基金简称	广发高股息优享混合	
基金主代码	008704	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	267,716,051.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
下属分级基金的交易代码	008704	008705
报告期末下属分级基金的份额总额	205,614,175.94 份	62,101,875.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票，在深入研究的基础上，精选高股息主题股票进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金为一只混合型基金，其股票投资占基金资产的比例不低于 60%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。在境内股票和香港股票方面，本基金将综合考虑以下因素进行两地股票的配置：</p> <p>1、宏观经济因素（如 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）；</p> <p>2、估值因素（如市场整体估值水平、上市公司利润增长情况等）；</p> <p>3、政策因素（如财政政策、货币政策、税收政策等）；</p> <p>4、流动性因素（如货币政策的宽松情况、证券市场的资金面状况等）。</p>
业绩比较基准	中证红利指数收益率×80%+中证港股通高股息投资指数收益率(使用估值汇率调整)×15%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。</p>

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	任航
	联系电话	020-83936666	010-66060069
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105828	95599
传真		020-34281105	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		510308	100031
法定代表人		葛长伟	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	广发基金管理有限公司	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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025年1月1日至2025年6月30日）	
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
本期已实现收益	12,849,456.76	3,427,639.18
本期利润	14,025,769.48	3,873,784.63
加权平均基金份额本期利润	0.0655	0.0647
本期加权平均净值利润率	5.95%	6.00%
本期基金份额净值增长率	6.29%	6.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
期末可供分配利润	34,396,349.96	8,828,319.70
期末可供分配基金份额利润	0.1673	0.1422
期末基金资产净值	240,010,525.90	70,930,195.46
期末基金份额净值	1.1673	1.1422
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
基金份额累计净值增长率	16.73%	14.22%

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

广发高股息优享混合 A

阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.66%	0.46%	-0.13%	0.37%	2.79%	0.09%
过去三个月	5.86%	1.14%	1.37%	1.05%	4.49%	0.09%

过去六个月	6.29%	0.93%	8.36%	1.01%	-2.07%	-0.08%
过去一年	18.22%	1.14%	23.15%	1.13%	-4.93%	0.01%
过去三年	11.26%	1.02%	4.82%	1.06%	6.44%	-0.04%
自基金合同生效起至今	16.73%	1.08%	-3.75%	1.12%	20.48%	-0.04%

广发高股息优享混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.63%	0.46%	-0.13%	0.37%	2.76%	0.09%
过去三个月	5.77%	1.14%	1.37%	1.05%	4.40%	0.09%
过去六个月	6.09%	0.93%	8.36%	1.01%	-2.27%	-0.08%
过去一年	17.76%	1.14%	23.15%	1.13%	-5.39%	0.01%
过去三年	9.94%	1.02%	4.82%	1.06%	5.12%	-0.04%
自基金合同生效起至今	14.22%	1.08%	-3.75%	1.12%	17.97%	-0.04%

注：(1) 自 2025 年 3 月 14 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×45%+人民币计价的恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%”变更为“中证红利指数收益率×80%+中证港股通高股息投资指数收益率(使用估值汇率调整)×15%+人民币活期存款利率（税后）×5%”。

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

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

广发高股息优享混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 1 月 20 日至 2025 年 6 月 30 日)

广发高股息优享混合 A



广发高股息优享混合 C



注：自 2025 年 3 月 14 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×45%+人民币计价的恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%”变更为“中证红利指数收益率×80%+中证港股通高股息投资指数收益率(使用估值汇率调整)×15%+人民币活期存款利率（税后）×5%”。

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		
胡骏	本基金的基金经理；广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金的基金经理；广发中证科创创业50增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2023-06-13	-	10年	胡骏先生，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司量化投资部研究员、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自2021年6月17日至2022年8月24日)、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2021年12月29日至2023年1月10日)。

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，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；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 28 次，均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，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

2025 年上半年，权益市场震荡上行，上证指数上涨 2.76%，深证成指上涨 0.48%，中证红利指数下跌 3.07%，行业表现分化较大，从申万一级行业来看，有色金属、银行、国防军工、传媒均上涨超过 10%，而煤炭、食品饮料、房地产表现较差，跌幅超 5%。一季度，国内科技公司在 AI 大模型和人形机器人领域持续突破，市场在 DeepSeek、人形机器人等板块的带动下，科技成长风格表现较好；二季度，美国发布所谓“对等关税”行政令，受此影响，市场大幅调整，但是随后国内政策发力，央行、国资委等纷纷表态将维护市场稳定，市场随即企稳。5 月 12 日，中美双方发布《中美日内瓦经贸会谈联合声明》，中美贸易摩擦阶段性缓和；6 月，伊以冲突笼罩全球市场，但在多方努力

下，冲突得以解决，对 A 股市场影响有限。

在本报告期内，本基金维持在红利类资产上的布局，也积极关注分红提升幅度较大的公司，同时通过定量指标，筛选前期跌幅较大、资金储备充沛、基本面出现改善的公司。我们认为目前投资者偏好有所提升，红利类资产出现一定程度滞胀。但从长期看，红利类资产依旧可以作为底仓进行配置；同时随着政策更加积极稳定，部分红利类顺周期板块也有望受益于经济复苏。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 6.29%，C 类基金份额净值增长率为 6.09%，同期业绩比较基准收益率为 8.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内政策托底意愿依然较强，权益市场依旧存在比较好的投资机会。科技板块方面，海外 AI 资本开支继续推进；消费板块方面，政策持续支持内生消费循环，有利于国内消费能力回升；周期板块在“反内卷”的背景下也有望受到关注；红利资产在资产荒的背景下，调整之后仍有配置价值。

本基金将继续通过定量指标筛选优质公司，力争获取相对基准稳健的超额收益。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—广发基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，广发基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发高股息优享混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	17,999,287.56	19,929,803.09
结算备付金		693,918.92	719,285.96
存出保证金		36,477.95	55,477.36
交易性金融资产	6.4.7.2	292,078,069.66	297,253,991.76
其中：股票投资		292,078,069.66	295,835,124.53
基金投资		-	-
债券投资		-	1,418,867.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		3,805,484.97	798,827.81
应收股利		721,861.08	56,098.64
应收申购款		1,002,905.62	121,207.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		316,338,005.76	318,934,691.91
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,955,642.90	933,273.63
应付赎回款		734,648.55	511,212.49
应付管理人报酬		303,316.07	322,044.72

应付托管费		50,552.69	53,674.11
应付销售服务费		22,619.72	22,247.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	330,504.47	308,628.46
负债合计		5,397,284.40	2,151,080.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	267,716,051.70	289,656,016.11
未分配利润	6.4.7.9	43,224,669.66	27,127,595.09
净资产合计		310,940,721.36	316,783,611.20
负债和净资产总计		316,338,005.76	318,934,691.91

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，广发高股息优享混合 A 基金份额净值人民币 1.1673 元，基金份额总额 205,614,175.94 份；广发高股息优享混合 C 基金份额净值人民币 1.1422 元，基金份额总额 62,101,875.76 份；总份额总额 267,716,051.70 份。

6.2 利润表

会计主体：广发高股息优享混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业收入		20,208,779.99	16,787,384.51
1.利息收入		46,567.98	46,608.03
其中：存款利息收入	6.4.7.10	43,043.37	41,645.29
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		3,524.61	4,962.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,524,291.20	15,598,273.44
其中：股票投资收益	6.4.7.11	12,276,485.25	8,705,661.31
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	29,080.25	118,679.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,218,725.70	6,773,932.85
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）	6.4.7.18	1,622,458.17	1,131,441.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	15,462.64	11,061.58
减：二、营业总支出		2,309,225.88	2,356,382.72
1. 管理人报酬		1,789,402.33	1,828,045.03
2. 托管费		298,233.81	304,674.17
3. 销售服务费		128,189.86	131,298.27
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.04	0.11
8. 其他费用	6.4.7.21	93,399.84	92,365.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,899,554.11	14,431,001.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,899,554.11	14,431,001.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,899,554.11	14,431,001.79

6.3 净资产变动表

会计主体：广发高股息优享混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	289,656,016.11	27,127,595.09	316,783,611.20
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	289,656,016.11	27,127,595.09	316,783,611.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,939,964.41	16,097,074.57	-5,842,889.84
(一)、综合收益总额	-	17,899,554.11	17,899,554.11

(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)	-21,939,964.41	-1,802,479.54	-23,742,443.95
其中： 1.基金申购款	24,687,482.46	2,303,584.03	26,991,066.49
2.基金赎回款	-46,627,446.87	-4,106,063.57	-50,733,510.44
(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	267,716,051.70	43,224,669.66	310,940,721.36
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	312,143,972.00	-19,268,066.19	292,875,905.81
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	312,143,972.00	-19,268,066.19	292,875,905.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,516,255.61	14,193,615.65	12,677,360.04
(一)、综合收益总额	-	14,431,001.79	14,431,001.79
(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)	-1,516,255.61	-237,386.14	-1,753,641.75
其中： 1.基金申购款	25,147,153.59	-1,198,239.65	23,948,913.94
2.基金赎回款	-26,663,409.20	960,853.51	-25,702,555.69
(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	310,627,716.39	-5,074,450.54	305,553,265.85

产		
---	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发高股息优享混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2019]2753 号《关于准予广发高股息优享混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发高股息优享混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2020 年 1 月 2 日向社会公开发行募集并于 2020 年 1 月 20 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 1 月 16 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 4,773,512,020.10 元，有效认购户数为 54,801 户。其中广发高股息优享混合 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 3,557,500,284.30 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 426,283.93 元；广发高股息优享混合 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 1,215,477,312.44 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 108,139.43 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	17,999,287.56
等于： 本金	17,997,452.77
加： 应计利息	1,834.79
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	17,999,287.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	278,815,867.98	-	292,078,069.66	13,262,201.68
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	278,815,867.98	-	292,078,069.66	13,262,201.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	323.61
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	249,313.34
其中：交易所市场	249,313.34
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,867.52
合计	330,504.47

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发高股息优享混合 A		
项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	228,624,113.54	228,624,113.54
本期申购	4,313,057.83	4,313,057.83
本期赎回(以“-”号填列)	-27,322,995.43	-27,322,995.43

本期末	205,614,175.94	205,614,175.94
-----	----------------	----------------

金额单位：人民币元

项目	广发高股息优享混合 C	
	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	61,031,902.57	61,031,902.57
本期申购	20,374,424.63	20,374,424.63
本期赎回(以“-”号填列)	-19,304,451.44	-19,304,451.44
本期末	62,101,875.76	62,101,875.76

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发高股息优享混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,188,753.94	-32,735,244.85	22,453,509.09
本期期初	55,188,753.94	-32,735,244.85	22,453,509.09
本期利润	12,849,456.76	1,176,312.72	14,025,769.48
本期基金份额交易产生的变动数	-6,015,861.38	3,932,932.77	-2,082,928.61
其中：基金申购款	1,140,450.68	-680,449.12	460,001.56
基金赎回款	-7,156,312.06	4,613,381.89	-2,542,930.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,022,349.32	-27,625,999.36	34,396,349.96

单位：人民币元

广发高股息优享混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,478,980.36	-8,804,894.36	4,674,086.00
本期期初	13,478,980.36	-8,804,894.36	4,674,086.00
本期利润	3,427,639.18	446,145.45	3,873,784.63
本期基金份额交易产生的变动数	340,373.48	-59,924.41	280,449.07
其中：基金申购款	5,028,982.53	-3,185,400.06	1,843,582.47
基金赎回款	-4,688,609.05	3,125,475.65	-1,563,133.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,246,993.02	-8,418,673.32	8,828,319.70

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
活期存款利息收入		41,190.45

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	1,625.36
其他	227.56
合计	43,043.37

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,276,485.25
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	12,276,485.25

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	550,553,306.63
减：卖出股票成本总额	537,330,043.76
减：交易费用	946,777.62
买卖股票差价收入	12,276,485.25

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,467.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,612.26
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	29,080.25

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	1,452,572.41
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	1,409,267.00
减：应计利息总额	20,687.89
减：交易费用	5.26
买卖债券差价收入	22,612.26

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,218,725.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,218,725.70

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	1,622,458.17
——股票投资	1,629,838.77
——债券投资	-7,380.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,622,458.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	10,594.54
基金转换费收入	4,868.10
合计	15,462.64

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	16,860.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,712.96
账户维护费	9,000.00
其他	1,319.36
合计	93,399.84

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	2,991,232.62	0.28%	144,840,772.60	8.30%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	1,335,721.78	6.45%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	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	1,304.21	0.28%	41.63	0.02%
关联方名称	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	136,051.31	10.24%	119,871.11	18.84%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,789,402.33	1,828,045.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	449,693.50	444,417.61
应支付基金管理人的净管理费	1,339,708.83	1,383,627.42

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费=前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	298,233.81	304,674.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
--------------------	----------------------------

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	22,646.19	22,646.19
中国农业银行股份有限公司	-	2,996.05	2,996.05
广发证券股份有限公司	-	60,706.00	60,706.00
合计	-	86,348.24	86,348.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	23,738.02	23,738.02
中国农业银行股份有限公司	-	3,349.30	3,349.30
广发证券股份有限公司	-	66,017.15	66,017.15
合计	-	93,104.47	93,104.47

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额净资产值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.40%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发高股息优享混合 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发高股息优享混合 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日	期末余额	2024年1月1日至2024年6月30日	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	17,999,287.56	41,190.45	9,957,865.27	29,854.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-

68854 5	兴福 电子	2025-0 1-15	6 个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	957.00	11,177 .76	25,791 .15	-
30145 8	钧崴 电子	2025-0 1-02	6 个月	新股 流通 受限	10.40	34.11	701.00	7,290. 40	23,911 .11	-
68858 3	思看 科技	2025-0 1-08	6 个月	新股 流通 受限	33.46	79.68	227.00	5,855. 50	18,087 .36	-
30167 8	新恒 汇	2025-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	12.80	44.54	382.00	4,889. 60	17,014 .28	-
30160 2	超研 股份	2025-0 1-15	6 个月	新股 流通 受限	6.70	24.80	658.00	4,408. 60	16,318 .40	-
30127 5	汉朔 科技	2025-0 3-04	6 个月	新股 流通 受限	27.50	56.19	265.00	7,287. 50	14,890 .35	-
30147 9	弘景 光电	2025-0 3-06	6 个月	新股 流通 受限	41.90	77.87	182.00	5,447. 00	14,172 .34	-
30153 5	浙江 华远	2025-0 3-18	6 个月	新股 流通 受限	4.92	18.99	734.00	3,611. 28	13,938 .66	-
68875 7	胜科 纳米	2025-0 3-18	6 个月	新股 流通 受限	9.08	25.94	536.00	4,866. 88	13,903 .84	-
00138 8	信通 电子	2025-0 6-24	1 个 月 (含)	新股 流通 受限	16.42	16.42	843.00	13,842 .06	13,842 .06	-
68875 8	赛分 科技	2025-0 1-02	6 个月	新股 流通 受限	4.32	16.97	777.00	3,356. 64	13,185 .69	-
60307 2	天和 磁材	2024-1 2-24	6 个月	新股 流通 受限	12.30	54.45	226.00	2,779. 80	12,305 .70	-
30150 1	恒鑫 生活	2025-0 3-11	6 个月	新股 流通 受限	39.92	45.22	255.00	7,025. 92	11,531 .10	-
00135 6	富岭 股份	2025-0 1-16	6 个月	新股 流通 受限	5.30	14.44	709.00	3,757. 70	10,237 .96	-
30165 8	首航 新能	2025-0 3-26	6 个月	新股 流通	11.80	22.98	437.00	5,156. 60	10,042 .26	-

				受限						
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	69.00	6,182.40	9,624.12	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	153.00	4,054.50	5,000.04	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	44.00	4,114.00	3,989.04	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
00139	吉麒	2025-0	6 个月	新股	12.08	18.12	178.00	2,150.	3,225.	-

0	绒材	5-21		流通受限				24	36	
60325 7	中国瑞林	2025-0 3-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78.00	1,600. 56	2,922. 66	-
60340 0	华之杰	2025-0 6-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57.00	1,133. 16	2,497. 17	-
60338 2	海阳科技	2025-0 6-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105.00	1,207. 50	2,350. 95	-
00133 5	信凯科技	2025-0 4-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80.00	1,024. 00	2,244. 00	-
60312 0	肯特催化	2025-0 4-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172. 95	-
00138 8	信通电子	2025-0 6-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94.00	1,543. 48	1,543. 48	-

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 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
60096 2	国投中鲁	2025-06-23	重大事项停牌	13.43	2025-07-07	14.77	19,200.00	245,037.33	257,856.00	-
68831 3	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	800.00	14,478.98	30,440.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的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；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成损失的风险。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	1,317,464.16
合计	-	1,317,464.16

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	101,403.07
未评级	-	-
合计	-	101,403.07

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资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。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，

导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	17,999,287.56	-	-	-	17,999,287.56
结算备付金	693,918.92	-	-	-	693,918.92
存出保证金	36,477.95	-	-	-	36,477.95
交易性金融资产	-	-	-	292,078,069.66	292,078,069.66
应收清算款	-	-	-	3,805,484.97	3,805,484.97
应收股利	-	-	-	721,861.08	721,861.08
应收申购款	-	-	-	1,002,905.62	1,002,905.62
资产总计	18,729,684.43	-	-	297,608,321.33	316,338,005.76
负债					
应付清算款	-	-	-	3,955,642.90	3,955,642.90
应付赎回款	-	-	-	734,648.55	734,648.55
应付管理人报酬	-	-	-	303,316.07	303,316.07
应付托管费	-	-	-	50,552.69	50,552.69
应付销售服务费	-	-	-	22,619.72	22,619.72
其他负债	-	-	-	330,504.47	330,504.47
负债总计	-	-	-	5,397,284.40	5,397,284.40
利率敏感度缺口	18,729,684.43	-	-	292,211,036.93	310,940,721.36
上年度末 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	19,929,803.09	-	-	-	19,929,803.09
结算备付金	719,285.96	-	-	-	719,285.96

存出保证金	55,477.36	-	-	-	55,477.36
交易性金融资产	1,418,867.23	-	-	295,835,124.53	297,253,991.76
应收清算款	-	-	-	798,827.81	798,827.81
应收股利	-	-	-	56,098.64	56,098.64
应收申购款	-	-	-	121,207.29	121,207.29
资产总计	22,123,433.64	-	-	296,811,258.27	318,934,691.91
负债					
应付清算款	-	-	-	933,273.63	933,273.63
应付赎回款	-	-	-	511,212.49	511,212.49
应付管理人报酬	-	-	-	322,044.72	322,044.72
应付托管费	-	-	-	53,674.11	53,674.11
应付销售服务费	-	-	-	22,247.23	22,247.23
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
其他负债	-	-	-	308,628.46	308,628.46
负债总计	-	-	-	2,151,080.71	2,151,080.71
利率敏感度缺口	22,123,433.64	-	-	294,660,177.56	316,783,611.20

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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)	
分析		本期末	上年度末
2025年6月30日	2024年12月31日		
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-1,034.38
	市场利率下降 25 个基点	-	1,036.01

注：本基金本报告期末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	43,939,911.52	-	43,939,911.52
应收股利	1,654.24	93,561.63	-	95,215.87
资产合计	1,654.24	44,033,473.15	-	44,035,127.39
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,654.24	44,033,473.15	-	44,035,127.39
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	25,048,528.22	-	25,048,528.22
资产合计	-	25,048,528.22	-	25,048,528.22
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	25,048,528.22	-	25,048,528.22

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
所有外币相对人民币升值 5%	2,201,756.37	1,252,426.41	
所有外币相对人民币贬值 5%	-2,201,756.37	-1,252,426.41	

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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 (%)
			2025年6月30日	2024年12月31日
交易性金融资产—股票投资	292,078,069.66	93.93	295,835,124.53	93.39

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	101,403.07	0.03
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	292,078,069.66	93.93	295,936,527.60	93.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
上升 5%	15,239,060.03	12,990,516.25	
	下降 5%	-15,239,060.03	-12,990,516.25

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2025年6月30日
第一层次	291,416,646.63
第二层次	303,681.54
第三层次	357,741.49
合计	292,078,069.66

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	292,078,069.66	92.33
	其中：股票	292,078,069.66	92.33
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	18,693,206.48	5.91
8	其他各项资产	5,566,729.62	1.76
9	合计	316,338,005.76	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 43,939,911.52 元，占基金资产净值比例 14.13%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	98,756.00	0.03

B	采矿业	15,552,184.80	5.00
C	制造业	102,096,087.02	32.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,458,334.00	4.01
E	建筑业	8,642,305.00	2.78
F	批发和零售业	7,492,067.00	2.41
G	交通运输、仓储和邮政业	22,184,715.00	7.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,753,811.00	1.21
J	金融业	60,070,319.91	19.32
K	房地产业	3,925,721.91	1.26
L	租赁和商务服务业	3,411,167.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	353,038.50	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	3,108,171.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	90,725.00	0.03
Q	卫生和社会工作	154,752.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	4,715,765.00	1.52
S	综合	30,238.00	0.01
	合计	248,138,158.14	79.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	8,709,915.90	2.80
原材料	1,156,288.76	0.37
工业	9,649,193.41	3.10
非日常生活消费品	1,292,228.61	0.42
日常消费品	809,683.94	0.26
医疗保健	3,259,785.34	1.05
金融	13,773,148.93	4.43
信息技术	2,365,193.42	0.76
通讯业务	1,323,950.78	0.43
公用事业	1,310,763.98	0.42
房地产	289,758.45	0.09
合计	43,939,911.52	14.13

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	01398	工商银行	457,000	2,592,254.35	0.83
1	601398	工商银行	263,700	2,001,483.00	0.64
2	01088	中国神华	94,500	2,624,158.92	0.84
2	601088	中国神华	37,600	1,524,304.00	0.49
3	600919	江苏银行	323,060	3,857,336.40	1.24
4	00857	中国石油股份	330,000	2,031,368.63	0.65
4	601857	中国石油	179,500	1,534,725.00	0.49
5	601838	成都银行	175,600	3,529,560.00	1.14
6	601919	中远海控	164,100	2,468,064.00	0.79
6	01919	中远海控	83,000	1,032,436.83	0.33
7	601998	中信银行	300,600	2,555,100.00	0.82
7	00998	中信银行	92,000	627,567.51	0.20
8	03988	中国银行	584,000	2,428,559.33	0.78
8	601988	中国银行	71,400	401,268.00	0.13
9	00939	建设银行	270,000	1,950,113.88	0.63
9	601939	建设银行	86,000	811,840.00	0.26
10	601668	中国建筑	475,500	2,743,635.00	0.88
11	601077	渝农商行	372,600	2,660,364.00	0.86
12	600901	江苏金租	422,500	2,560,350.00	0.82
13	600000	浦发银行	178,500	2,477,580.00	0.80
14	01898	中煤能源	147,000	1,217,234.38	0.39
14	601898	中煤能源	105,300	1,151,982.00	0.37
15	600019	宝钢股份	356,900	2,351,971.00	0.76
16	601818	光大银行	420,000	1,743,000.00	0.56
16	06818	中国光大银行	168,000	600,573.79	0.19
17	000651	格力电器	51,300	2,304,396.00	0.74
18	601009	南京银行	186,116	2,162,667.92	0.70
19	00386	中国石油化工股份	358,000	1,341,824.99	0.43
19	600028	中国石化	140,900	794,676.00	0.26
20	601229	上海银行	200,509	2,127,400.49	0.68
21	601328	交通银行	195,100	1,560,800.00	0.50
21	03328	交通银行	81,000	539,236.04	0.17
22	601658	邮储银行	382,300	2,091,181.00	0.67
23	600273	嘉化能源	240,300	2,032,938.00	0.65
24	600989	宝丰能源	124,400	2,007,816.00	0.65
25	000333	美的集团	27,500	1,985,500.00	0.64
26	600016	民生银行	329,400	1,564,650.00	0.50

26	01988	民生银行	94,500	383,497.77	0.12
27	601169	北京银行	280,000	1,912,400.00	0.62
28	601098	中南传媒	144,500	1,895,840.00	0.61
29	002966	苏州银行	213,500	1,874,530.00	0.60
30	603565	中谷物流	194,200	1,854,610.00	0.60
31	600036	招商银行	40,300	1,851,785.00	0.60
32	03866	青岛银行	466,500	1,739,986.92	0.56
32	002948	青岛银行	20,600	102,588.00	0.03
33	600219	南山铝业	478,900	1,834,187.00	0.59
34	002807	江阴银行	382,800	1,818,300.00	0.58
35	603323	苏农银行	321,080	1,801,258.80	0.58
36	600015	华夏银行	212,400	1,680,084.00	0.54
37	600642	申能股份	192,400	1,654,640.00	0.53
38	601577	长沙银行	165,900	1,649,046.00	0.53
39	06198	青岛港	227,000	1,362,143.24	0.44
39	601298	青岛港	31,500	273,735.00	0.09
40	601918	新集能源	251,100	1,622,106.00	0.52
41	002533	金杯电工	164,700	1,604,178.00	0.52
42	601166	兴业银行	67,000	1,563,780.00	0.50
43	00548	深圳高速公路股份	184,000	1,149,421.78	0.37
43	600548	深高速	35,400	370,638.00	0.12
44	600064	南京高科	186,200	1,435,602.00	0.46
45	600694	大商股份	77,180	1,431,689.00	0.46
46	601825	沪农商行	147,500	1,430,750.00	0.46
47	002271	东方雨虹	132,700	1,423,871.00	0.46
48	600098	广州发展	218,200	1,363,750.00	0.44
49	600820	隧道股份	222,800	1,359,080.00	0.44
50	601665	齐鲁银行	208,400	1,317,088.00	0.42
51	002597	金禾实业	55,700	1,311,735.00	0.42
52	002267	陕天然气	173,200	1,311,124.00	0.42
53	601003	柳钢股份	371,500	1,307,680.00	0.42
54	600398	海澜之家	178,900	1,245,144.00	0.40
55	600177	雅戈尔	166,400	1,214,720.00	0.39
56	600757	长江传媒	130,300	1,209,184.00	0.39
57	001965	招商公路	100,200	1,202,400.00	0.39
58	600018	上港集团	201,300	1,149,423.00	0.37
59	000581	威孚高科	60,000	1,136,400.00	0.37
60	601997	贵阳银行	181,600	1,133,184.00	0.36
61	001872	招商港口	56,900	1,130,034.00	0.36
62	600519	贵州茅台	800	1,127,616.00	0.36
63	600033	福建高速	318,400	1,127,136.00	0.36
64	600269	赣粤高速	222,500	1,125,850.00	0.36
65	601187	厦门银行	165,700	1,125,103.00	0.36

66	600008	首创环保	371,800	1,122,836.00	0.36
67	000001	平安银行	91,800	1,108,026.00	0.36
68	002128	电投能源	54,600	1,079,988.00	0.35
69	600057	厦门象屿	150,500	1,058,015.00	0.34
70	000895	双汇发展	43,000	1,049,630.00	0.34
71	600585	海螺水泥	47,300	1,015,531.00	0.33
72	301109	军信股份	66,300	986,544.00	0.32
73	01513	丽珠医药	36,600	986,301.28	0.32
74	600428	中远海特	156,600	978,750.00	0.31
75	002925	盈趣科技	53,700	965,526.00	0.31
76	002142	宁波银行	35,200	963,072.00	0.31
77	600282	南钢股份	224,900	944,580.00	0.30
78	000429	粤高速 A	70,000	933,100.00	0.30
79	600039	四川路桥	93,500	925,650.00	0.30
80	601083	锦江航运	82,200	913,242.00	0.29
81	600060	海信视像	39,500	909,290.00	0.29
82	000672	上峰水泥	115,000	908,500.00	0.29
83	002293	罗莱生活	103,910	908,173.40	0.29
84	000902	新洋丰	64,800	896,184.00	0.29
85	600012	皖通高速	26,500	449,970.00	0.14
85	00995	安徽皖通高速公路	38,000	436,641.66	0.14
86	600895	张江高科	34,200	878,940.00	0.28
87	00598	中国外运	171,000	620,654.93	0.20
87	601598	中国外运	50,400	248,472.00	0.08
88	601686	友发集团	149,400	848,592.00	0.27
89	01963	重庆银行	71,500	531,416.06	0.17
89	601963	重庆银行	28,700	311,682.00	0.10
90	601126	四方股份	51,300	834,651.00	0.27
91	603855	华荣股份	37,500	829,875.00	0.27
92	000858	五粮液	6,900	820,410.00	0.26
93	000937	冀中能源	139,100	799,825.00	0.26
94	002206	海利得	156,400	799,204.00	0.26
95	600575	淮河能源	228,400	797,116.00	0.26
96	600461	洪城环境	82,000	790,480.00	0.25
97	600997	开滦股份	132,700	781,603.00	0.25
98	600987	航民股份	110,300	779,821.00	0.25
99	002061	浙江交科	192,300	761,508.00	0.24
100	601139	深圳燃气	119,600	760,656.00	0.24
101	002327	富安娜	101,500	753,130.00	0.24
102	600582	天地科技	124,900	748,151.00	0.24
103	01800	中国交通建设	127,000	594,144.54	0.19
103	601800	中国交建	17,100	152,019.00	0.05
104	601000	唐山港	183,400	744,604.00	0.24

105	00177	江苏宁沪高速公路	38,000	383,967.43	0.12
105	600377	宁沪高速	22,300	342,082.00	0.11
106	601579	会稽山	36,300	722,733.00	0.23
107	601318	中国平安	9,300	515,964.00	0.17
107	02318	中国平安	4,500	204,573.18	0.07
108	600176	中国巨石	63,000	718,200.00	0.23
109	688526	科前生物	45,800	713,564.00	0.23
110	002081	金螳螂	204,800	702,464.00	0.23
111	300643	万通智控	32,000	684,160.00	0.22
112	600350	山东高速	62,600	667,316.00	0.21
113	601128	常熟银行	90,290	665,437.30	0.21
114	00883	中国海洋石油	32,000	517,112.13	0.17
114	600938	中国海油	5,500	143,605.00	0.05
115	000521	长虹美菱	94,200	653,748.00	0.21
116	000962	东方钽业	39,700	651,477.00	0.21
117	600583	海油工程	119,300	651,378.00	0.21
118	603968	醋化股份	55,900	635,583.00	0.20
119	00941	中国移动	8,000	635,446.76	0.20
120	002048	宁波华翔	34,300	631,463.00	0.20
121	02016	浙商银行	145,000	390,086.61	0.13
121	601916	浙商银行	71,100	241,029.00	0.08
122	603730	岱美股份	109,400	622,486.00	0.20
123	300859	西域旅游	15,400	620,158.00	0.20
124	000538	云南白药	11,100	619,269.00	0.20
125	601006	大秦铁路	93,100	614,460.00	0.20
126	601872	招商轮船	97,300	609,098.00	0.20
127	300010	豆神教育	73,400	608,486.00	0.20
128	000921	海信家电	23,400	601,380.00	0.19
129	600710	苏美达	62,200	597,742.00	0.19
130	002233	塔牌集团	80,000	592,000.00	0.19
131	03311	中国建筑国际	54,000	583,064.35	0.19
132	603373	安邦护卫	11,800	581,504.00	0.19
133	600295	鄂尔多斯	66,700	580,957.00	0.19
134	002367	康力电梯	80,200	563,806.00	0.18
135	002027	分众传媒	76,900	561,370.00	0.18
136	03360	远东宏信	90,000	559,754.91	0.18
137	600223	福瑞达	67,900	558,138.00	0.18
138	00836	华润电力	32,000	552,714.66	0.18
139	002648	卫星化学	31,800	551,094.00	0.18
140	605599	菜百股份	33,700	550,995.00	0.18
141	603885	吉祥航空	40,800	549,576.00	0.18
142	03969	中国通号	185,000	544,935.72	0.18
143	603444	吉比特	1,800	543,510.00	0.17

144	601156	东航物流	41,300	540,617.00	0.17
145	601021	春秋航空	9,700	539,805.00	0.17
146	002468	申通快递	50,000	534,500.00	0.17
147	603587	地素时尚	42,900	532,818.00	0.17
148	600479	千金药业	51,000	530,400.00	0.17
149	600572	康恩贝	121,000	529,980.00	0.17
150	600887	伊利股份	19,000	529,720.00	0.17
151	601688	华泰证券	18,500	329,485.00	0.11
151	06886	华泰证券	13,800	200,100.07	0.06
152	688375	国博电子	8,800	528,088.00	0.17
153	600210	紫江企业	77,300	527,959.00	0.17
154	600900	长江电力	17,500	527,450.00	0.17
155	600483	福能股份	54,700	527,308.00	0.17
156	002697	红旗连锁	98,300	525,905.00	0.17
157	000963	华东医药	13,000	524,680.00	0.17
158	600908	无锡银行	83,000	523,730.00	0.17
159	600741	华域汽车	29,600	522,440.00	0.17
160	002352	顺丰控股	10,700	521,732.00	0.17
161	02232	晶苑国际	122,500	521,703.80	0.17
162	002839	张家港行	115,900	521,550.00	0.17
163	00005	汇丰控股	6,000	519,537.92	0.17
164	02382	舜宇光学科技	8,200	518,598.61	0.17
165	000338	潍柴动力	33,700	518,306.00	0.17
166	002057	中钢天源	55,600	516,524.00	0.17
167	00564	中创智领	38,000	514,959.93	0.17
168	00728	中国电信	60,000	305,320.86	0.10
168	601728	中国电信	27,000	209,250.00	0.07
169	002170	芭田股份	49,700	509,425.00	0.16
170	601138	工业富联	23,800	508,844.00	0.16
171	01071	华电国际电力股份	134,000	508,357.41	0.16
172	600285	羚锐制药	22,400	507,808.00	0.16
173	00552	中国通信服务	130,000	503,852.38	0.16
174	603697	有友食品	38,000	501,220.00	0.16
175	603619	中曼石油	24,100	483,687.00	0.16
176	000951	中国重汽	27,300	479,934.00	0.15
177	601567	三星医疗	21,400	479,788.00	0.15
178	603309	维力医疗	37,700	479,544.00	0.15
179	000596	古井贡酒	3,600	479,340.00	0.15
180	301029	怡合达	20,900	477,774.00	0.15
181	600256	广汇能源	78,900	474,978.00	0.15
182	002543	万和电气	42,600	473,286.00	0.15
183	600690	海尔智家	19,000	470,820.00	0.15
184	600704	物产中大	89,200	470,084.00	0.15

185	000786	北新建材	17,700	468,696.00	0.15
186	603508	思维列控	17,600	466,048.00	0.15
187	603277	银都股份	29,075	465,200.00	0.15
188	601900	南方传媒	29,700	464,508.00	0.15
189	01766	中国中车	72,000	311,230.30	0.10
189	601766	中国中车	20,900	147,136.00	0.05
190	601601	中国太保	12,200	457,622.00	0.15
191	601225	陕西煤业	23,300	448,292.00	0.14
192	002091	江苏国泰	61,500	447,105.00	0.14
193	601600	中国铝业	56,300	396,352.00	0.13
193	02600	中国铝业	10,000	48,150.96	0.02
194	600873	梅花生物	41,400	442,566.00	0.14
195	002080	中材科技	22,200	432,900.00	0.14
196	000725	京东方 A	107,900	430,521.00	0.14
197	600985	淮北矿业	37,600	426,384.00	0.14
198	605009	豪悦护理	10,700	425,646.00	0.14
199	600998	九州通	82,100	421,994.00	0.14
200	01138	中远海能	70,000	415,575.62	0.13
201	002990	盛视科技	13,600	398,616.00	0.13
202	301200	大族数控	9,300	394,971.00	0.13
203	300435	中泰股份	25,900	393,162.00	0.13
204	03668	兖煤澳大利亚	14,300	385,358.15	0.12
205	600971	恒源煤电	55,920	369,072.00	0.12
206	601117	中国化学	48,100	368,927.00	0.12
207	000928	中钢国际	58,100	364,868.00	0.12
208	01330	绿色动力环保	77,000	363,740.38	0.12
209	601168	西部矿业	21,800	362,534.00	0.12
210	01177	中国生物制药	75,000	359,764.28	0.12
211	603995	甬金股份	20,300	358,904.00	0.12
212	00546	阜丰集团	57,000	358,150.12	0.12
213	000090	天健集团	100,700	356,478.00	0.11
214	600578	京能电力	79,200	355,608.00	0.11
215	002563	森马服饰	66,600	350,316.00	0.11
216	834599	同力股份	16,331	349,483.40	0.11
217	002318	久立特材	14,700	343,833.00	0.11
218	00019	太古股份公司 A	5,500	337,307.51	0.11
219	02367	巨子生物	6,400	336,764.90	0.11
220	300748	金力永磁	14,100	336,144.00	0.11
221	01055	中国南方航空股份	50,000	183,301.95	0.06
221	600029	南方航空	25,500	150,450.00	0.05
222	002690	美亚光电	19,700	332,339.00	0.11
223	688366	昊海生科	6,472	331,625.28	0.11
224	01186	中国铁建	36,000	178,267.99	0.06

224	601186	中国铁建	18,800	150,588.00	0.05
225	600685	中船防务	12,000	326,280.00	0.10
226	01157	中联重科	61,200	325,380.11	0.10
227	000823	超声电子	26,900	318,765.00	0.10
228	002821	凯莱英	2,200	194,150.00	0.06
228	06821	凯莱英	1,700	122,009.79	0.04
229	001207	联科科技	12,800	314,112.00	0.10
230	02099	中国黄金国际	4,800	310,792.56	0.10
231	300627	华测导航	8,848	309,680.00	0.10
232	601339	百隆东方	64,800	305,856.00	0.10
233	002171	楚江新材	31,400	305,522.00	0.10
234	002396	星网锐捷	13,600	305,320.00	0.10
235	002155	湖南黄金	17,000	303,450.00	0.10
236	600970	中材国际	35,300	302,874.00	0.10
237	603456	九洲药业	19,900	302,679.00	0.10
238	601827	三峰环境	36,000	302,400.00	0.10
239	002034	旺能环境	18,000	302,220.00	0.10
240	605016	百龙创园	14,560	300,372.80	0.10
241	600188	兖矿能源	24,400	296,948.00	0.10
242	688026	洁特生物	18,000	295,200.00	0.09
243	600925	苏能股份	55,600	290,788.00	0.09
244	600050	中国联通	54,300	289,962.00	0.09
245	600909	华安证券	49,700	289,751.00	0.09
246	002258	利尔化学	26,200	289,248.00	0.09
247	603061	金海通	3,400	287,470.00	0.09
248	000983	山西焦煤	44,900	287,360.00	0.09
249	601002	晋亿实业	57,800	284,954.00	0.09
250	601555	东吴证券	32,200	281,750.00	0.09
251	002126	银轮股份	11,500	279,220.00	0.09
252	000686	东北证券	36,500	278,495.00	0.09
253	600866	星湖科技	40,100	277,091.00	0.09
254	002545	东方铁塔	30,900	274,701.00	0.09
255	601369	陕鼓动力	31,300	274,501.00	0.09
256	000425	徐工机械	35,100	272,727.00	0.09
257	000589	贵州轮胎	59,400	271,458.00	0.09
258	600795	国电电力	56,000	271,040.00	0.09
259	000932	华菱钢铁	61,300	269,720.00	0.09
260	600584	长电科技	8,000	269,520.00	0.09
261	01093	石药集团	38,000	266,836.57	0.09
262	601019	山东出版	28,100	266,107.00	0.09
263	002371	北方华创	600	265,326.00	0.09
264	002001	新和成	12,300	261,621.00	0.08
265	603129	春风动力	1,200	259,800.00	0.08
266	603360	百傲化学	11,540	259,303.80	0.08

267	002517	恺英网络	13,400	258,754.00	0.08
268	600962	国投中鲁	19,200	257,856.00	0.08
269	002926	华西证券	28,800	257,472.00	0.08
270	601101	昊华能源	35,420	256,440.80	0.08
271	01686	新意网集团	37,000	255,090.65	0.08
272	688005	容百科技	11,400	254,448.00	0.08
273	000701	厦门信达	38,300	254,312.00	0.08
274	002611	东方精工	21,000	253,260.00	0.08
275	600713	南京医药	49,900	252,494.00	0.08
276	01070	TCL 电子	29,000	252,300.09	0.08
277	600236	桂冠电力	40,100	251,427.00	0.08
278	301302	华如科技	9,100	250,341.00	0.08
279	002255	海陆重工	29,000	244,180.00	0.08
280	601699	潞安环能	22,700	239,485.00	0.08
281	601636	旗滨集团	47,800	239,478.00	0.08
282	601222	林洋能源	41,800	238,260.00	0.08
283	688722	同益中	11,200	238,224.00	0.08
284	300360	炬华科技	15,100	237,825.00	0.08
285	002736	国信证券	20,600	237,312.00	0.08
286	603368	柳药集团	14,000	236,740.00	0.08
287	600863	内蒙华电	57,600	236,736.00	0.08
288	601158	重庆水务	50,900	236,176.00	0.08
289	003027	同兴科技	13,300	236,075.00	0.08
290	000650	仁和药业	43,400	235,228.00	0.08
291	000019	深粮控股	35,300	235,098.00	0.08
292	603969	银龙股份	31,900	233,827.00	0.08
293	002588	史丹利	26,500	233,465.00	0.08
294	002594	比亚迪	700	232,337.00	0.07
295	603173	福斯达	6,500	231,075.00	0.07
296	000987	越秀资本	33,600	230,496.00	0.07
297	000708	中信特钢	19,500	229,320.00	0.07
298	600814	杭州解百	28,800	224,352.00	0.07
299	06030	中信证券	6,000	129,679.29	0.04
299	600030	中信证券	3,400	93,908.00	0.03
300	600067	冠城新材	74,800	222,904.00	0.07
301	603031	安孚科技	7,500	221,925.00	0.07
302	002398	垒知集团	44,900	221,806.00	0.07
303	01347	华虹半导体	7,000	221,512.66	0.07
304	300383	光环新网	15,400	220,220.00	0.07
305	600328	中盐化工	28,700	219,555.00	0.07
306	603203	快克智能	8,800	218,856.00	0.07
307	002436	兴森科技	16,500	218,460.00	0.07
308	000887	中鼎股份	12,400	218,116.00	0.07
309	002913	奥士康	7,400	217,634.00	0.07

310	03692	翰森制药	8,000	217,044.10	0.07
311	002281	光迅科技	4,400	217,008.00	0.07
312	603529	爱玛科技	6,300	216,720.00	0.07
313	601216	君正集团	39,100	215,832.00	0.07
314	603706	东方环宇	10,000	215,400.00	0.07
315	002461	珠江啤酒	19,000	214,510.00	0.07
316	01801	信达生物	3,000	214,490.64	0.07
317	603489	八方股份	7,900	214,406.00	0.07
318	601231	环旭电子	14,600	213,598.00	0.07
319	300124	汇川技术	3,300	213,081.00	0.07
320	002600	领益智造	24,800	213,032.00	0.07
321	600058	五矿发展	27,400	211,802.00	0.07
322	600348	华阳股份	31,700	211,122.00	0.07
323	300327	中颖电子	8,700	210,714.00	0.07
324	600536	中国软件	4,500	210,465.00	0.07
325	600968	海油发展	51,400	209,712.00	0.07
326	600649	城投控股	48,500	208,065.00	0.07
327	600699	均胜电子	11,900	207,536.00	0.07
328	603179	新泉股份	4,400	206,668.00	0.07
329	600729	重庆百货	6,900	205,827.00	0.07
330	600380	健康元	18,600	205,158.00	0.07
331	601677	明泰铝业	16,500	204,930.00	0.07
332	605050	福然德	14,800	203,500.00	0.07
333	000893	亚钾国际	6,700	201,938.00	0.06
334	000042	中洲控股	28,300	201,213.00	0.06
335	601811	新华文轩	13,800	201,066.00	0.06
336	002558	巨人网络	8,500	200,175.00	0.06
337	600674	川投能源	12,400	198,896.00	0.06
338	000925	众合科技	25,800	198,144.00	0.06
339	600780	通宝能源	33,300	197,469.00	0.06
340	300171	东富龙	14,800	196,692.00	0.06
341	688571	杭华股份	25,000	192,750.00	0.06
342	601326	秦港股份	33,900	109,497.00	0.04
342	03369	秦港股份	38,500	81,806.47	0.03
343	603929	亚翔集成	5,400	189,540.00	0.06
344	01357	美图公司	23,000	189,402.90	0.06
345	600266	城建发展	41,700	189,318.00	0.06
346	002668	TCL 智家	19,300	188,561.00	0.06
347	001914	招商积余	15,200	188,024.00	0.06
348	000957	中通客车	17,200	187,996.00	0.06
349	002353	杰瑞股份	5,300	185,500.00	0.06
350	002739	万达电影	16,200	185,166.00	0.06
351	601989	中国重工	39,200	181,888.00	0.06
352	600233	圆通速递	14,100	181,749.00	0.06

353	000683	博源化工	37,900	181,541.00	0.06
354	02666	环球医疗	35,500	181,295.66	0.06
355	600160	巨化股份	6,300	180,684.00	0.06
356	603288	海天味业	4,600	178,986.00	0.06
357	01164	中广核矿业	80,000	177,283.08	0.06
358	601018	宁波港	48,400	177,144.00	0.06
359	02057	中通快递-W	1,400	176,827.11	0.06
360	00392	北京控股	6,000	176,735.91	0.06
361	00293	国泰航空	18,000	175,641.57	0.06
362	600389	江山股份	9,400	174,840.00	0.06
363	300979	华利集团	3,300	173,481.00	0.06
364	000959	首钢股份	50,900	173,060.00	0.06
365	605368	蓝天燃气	17,500	172,200.00	0.06
366	02268	药明合联	4,500	170,717.04	0.05
367	600023	浙能电力	32,100	170,130.00	0.05
368	000783	长江证券	24,200	167,706.00	0.05
369	002026	山东威达	13,800	167,670.00	0.05
370	688037	芯源微	1,563	167,553.60	0.05
371	600066	宇通客车	6,700	166,562.00	0.05
372	688425	铁建重工	40,400	164,832.00	0.05
373	605008	长鸿高科	10,400	163,800.00	0.05
374	603132	金徽股份	12,300	163,221.00	0.05
375	688566	吉贝尔	6,000	163,140.00	0.05
376	601595	上海电影	5,500	163,020.00	0.05
377	002043	兔宝宝	16,600	162,680.00	0.05
378	688128	中国电研	6,600	161,700.00	0.05
379	06618	京东健康	4,100	160,776.79	0.05
380	301135	瑞德智能	6,000	160,380.00	0.05
381	600395	盘江股份	33,800	159,874.00	0.05
382	600123	兰花科创	24,500	159,740.00	0.05
383	300446	航天智造	9,200	159,344.00	0.05
384	601666	平煤股份	21,400	158,574.00	0.05
385	605499	东鹏饮料	500	157,025.00	0.05
386	688652	京仪装备	2,739	156,999.48	0.05
387	301268	铭利达	8,400	155,820.00	0.05
388	603067	振华股份	10,220	155,752.80	0.05
389	600983	惠而浦	15,000	155,700.00	0.05
390	605056	咸亨国际	10,100	155,540.00	0.05
391	688055	龙腾光电	42,000	155,400.00	0.05
392	300015	爱尔眼科	12,400	154,752.00	0.05
393	00992	联想集团	18,000	154,630.24	0.05
394	688400	凌云光	5,600	154,392.00	0.05
395	002429	兆驰股份	35,200	154,176.00	0.05
396	688429	时创能源	10,600	154,124.00	0.05

397	605138	盛泰集团	23,000	154,100.00	0.05
398	603071	物产环能	12,100	154,033.00	0.05
399	601211	国泰海通	4,800	91,968.00	0.03
399	02611	国泰海通	5,400	62,049.08	0.02
400	600662	外服控股	30,000	153,300.00	0.05
401	600569	安阳钢铁	78,100	153,076.00	0.05
402	600517	国网英大	30,000	153,000.00	0.05
403	603515	欧普照明	8,500	152,915.00	0.05
404	000906	浙商中拓	24,000	152,880.00	0.05
405	601990	南京证券	18,900	152,712.00	0.05
406	600408	安泰集团	74,100	152,646.00	0.05
407	000031	大悦城	57,600	152,640.00	0.05
408	002636	金安国纪	16,100	152,628.00	0.05
409	600104	上汽集团	9,500	152,475.00	0.05
410	301286	侨源股份	6,100	152,439.00	0.05
411	600497	驰宏锌锗	28,800	152,352.00	0.05
412	000553	安道麦 A	21,100	152,342.00	0.05
413	600740	山西焦化	41,000	152,110.00	0.05
414	601336	新华保险	1,600	93,600.00	0.03
414	01336	新华保险	1,500	58,478.79	0.02
415	601061	中信金属	19,200	151,872.00	0.05
416	601801	皖新传媒	22,200	151,626.00	0.05
417	688169	石头科技	968	151,540.40	0.05
418	600299	安迪苏	15,700	151,505.00	0.05
419	300810	中科海讯	3,300	151,173.00	0.05
420	601179	中国西电	24,600	151,044.00	0.05
421	600508	上海能源	12,900	150,930.00	0.05
422	600675	中华企业	52,400	150,912.00	0.05
423	603103	横店影视	9,400	150,870.00	0.05
424	001979	招商蛇口	17,200	150,844.00	0.05
425	600758	辽宁能源	40,300	150,722.00	0.05
426	600084	中信尼雅	27,100	150,676.00	0.05
427	600048	保利发展	18,600	150,660.00	0.05
428	600861	北京人力	7,800	150,540.00	0.05
429	688582	芯动联科	2,240	150,528.00	0.05
430	01675	亚信科技	18,400	150,012.13	0.05
431	600305	恒顺醋业	19,400	149,962.00	0.05
432	600231	凌钢股份	85,800	149,292.00	0.05
433	06990	科伦博泰生物-B	500	149,195.02	0.05
434	300409	道氏技术	8,800	149,072.00	0.05
434	002266	浙富控股	48,400	149,072.00	0.05
435	001289	龙源电力	9,200	148,856.00	0.05
436	300080	易成新能	35,600	148,808.00	0.05
437	002818	富森美	11,900	148,512.00	0.05

438	002078	太阳纸业	11,000	148,060.00	0.05
439	600125	铁龙物流	26,100	147,726.00	0.05
440	600905	三峡能源	34,500	146,970.00	0.05
441	000571	新大洲 A	32,500	146,900.00	0.05
442	603676	卫信康	14,500	146,885.00	0.05
443	002003	伟星股份	13,400	146,194.00	0.05
444	688016	心脉医疗	1,636	144,655.12	0.05
445	600926	杭州银行	8,600	144,652.00	0.05
446	600956	新天绿能	18,700	144,364.00	0.05
447	01478	丘钛科技	19,000	143,814.52	0.05
448	600790	轻纺城	38,500	143,605.00	0.05
449	601528	瑞丰银行	24,700	143,013.00	0.05
450	600025	华能水电	14,900	142,295.00	0.05
451	002182	宝武镁业	11,600	141,984.00	0.05
452	01530	三生制药	6,500	140,189.51	0.05
453	605333	沪光股份	5,000	137,250.00	0.04
454	603997	继峰股份	10,500	136,920.00	0.04
455	002120	韵达股份	20,300	136,010.00	0.04
456	688517	金冠电气	9,400	135,172.00	0.04
457	601015	陕西黑猫	41,200	135,136.00	0.04
458	601127	赛力斯	1,000	134,320.00	0.04
459	688057	金达莱	11,000	134,200.00	0.04
460	03347	泰格医药	3,800	132,551.93	0.04
461	601001	晋控煤业	10,800	131,976.00	0.04
462	000630	铜陵有色	38,700	129,258.00	0.04
463	601702	华峰铝业	8,100	128,709.00	0.04
464	601208	东材科技	13,430	127,316.40	0.04
465	688076	ST 诺泰	3,365	125,245.30	0.04
466	000598	兴蓉环境	17,300	124,733.00	0.04
467	600426	华鲁恒升	5,700	123,519.00	0.04
468	002286	保龄宝	10,600	120,098.00	0.04
469	688616	西力科技	9,400	119,568.00	0.04
470	00762	中国联通	14,000	118,735.89	0.04
471	301078	孩子王	9,000	117,630.00	0.04
472	600079	人福医药	5,500	115,390.00	0.04
473	601188	龙江交通	32,500	114,075.00	0.04
474	00220	统一企业中国	13,000	112,625.83	0.04
475	02018	瑞声科技	3,000	111,349.10	0.04
476	601096	宏盛华源	26,800	110,952.00	0.04
477	01810	小米集团-W	2,000	109,342.81	0.04
478	002345	潮宏基	7,400	108,262.00	0.03
479	603889	新澳股份	18,600	107,880.00	0.03
480	600755	厦门国贸	17,600	106,480.00	0.03
481	000552	甘肃能化	43,100	106,457.00	0.03

482	688266	泽璟制药-U	989	106,327.39	0.03
483	605589	圣泉集团	3,800	105,450.00	0.03
484	000803	山高环能	17,100	105,336.00	0.03
485	600170	上海建工	44,000	105,160.00	0.03
486	301102	兆讯传媒	9,600	104,832.00	0.03
487	688636	智明达	3,094	104,546.26	0.03
488	603822	嘉澳环保	2,000	104,260.00	0.03
489	600031	三一重工	5,800	104,110.00	0.03
490	300910	瑞丰新材	1,800	103,950.00	0.03
491	01787	山东黄金	3,000	74,551.91	0.02
491	600547	山东黄金	900	28,737.00	0.01
492	600681	百川能源	29,400	103,194.00	0.03
493	688300	联瑞新材	2,200	102,410.00	0.03
494	603299	苏盐井神	10,800	102,276.00	0.03
495	002064	华峰化学	15,300	101,133.00	0.03
496	01415	高伟电子	4,000	99,402.55	0.03
497	301090	华润材料	13,200	99,396.00	0.03
498	002372	伟星新材	9,500	98,420.00	0.03
499	09992	泡泡玛特	400	97,250.35	0.03
500	300059	东方财富	4,200	97,146.00	0.03
501	00189	东岳集团	10,000	95,572.36	0.03
502	601881	中国银河	5,500	94,325.00	0.03
503	00168	青岛啤酒股份	2,000	93,474.88	0.03
504	600963	岳阳林纸	21,000	93,030.00	0.03
505	603939	益丰药房	3,800	92,986.00	0.03
506	601828	美凯龙	32,100	92,769.00	0.03
507	600958	东方证券	9,400	90,992.00	0.03
507	600415	小商品城	4,400	90,992.00	0.03
508	000526	学大教育	1,900	90,725.00	0.03
509	688455	科捷智能	6,400	90,048.00	0.03
510	832522	纳科诺尔	1,773	89,749.26	0.03
511	300633	开立医疗	3,000	89,160.00	0.03
512	688326	经纬恒润-W	975	87,009.00	0.03
513	002609	捷顺科技	7,400	86,432.00	0.03
514	601100	恒立液压	1,200	86,400.00	0.03
515	688617	惠泰医疗	290	86,130.00	0.03
516	01339	中国人民保险集团	10,000	54,443.42	0.02
516	601319	中国人保	3,600	31,356.00	0.01
517	603708	家家悦	8,400	85,680.00	0.03
518	301093	华兰股份	2,700	85,536.00	0.03
519	01952	云顶新耀	1,500	85,084.94	0.03
520	300821	东岳硅材	10,800	84,888.00	0.03
521	600546	山煤国际	9,400	82,062.00	0.03

522	00425	敏实集团	4,000	81,710.72	0.03
523	000778	新兴铸管	21,600	80,352.00	0.03
524	00669	创科实业	1,000	78,701.29	0.03
525	01299	友邦保险	1,200	77,041.54	0.02
526	688271	联影医疗	600	76,644.00	0.02
527	002709	天赐材料	4,200	76,104.00	0.02
528	00817	中国金茂	70,000	75,965.44	0.02
529	603267	鸿远电子	1,500	75,405.00	0.02
530	01024	快手-W	1,300	75,044.37	0.02
531	688190	云路股份	800	74,048.00	0.02
532	300221	银禧科技	8,900	73,870.00	0.02
533	600728	佳都科技	13,500	73,575.00	0.02
534	603657	春光科技	2,200	73,480.00	0.02
535	000910	大亚圣象	9,700	73,332.00	0.02
536	00991	大唐发电	40,000	72,956.00	0.02
537	01908	建发国际集团	5,000	72,408.83	0.02
538	301125	腾亚精工	4,100	72,283.00	0.02
539	00881	中升控股	6,500	71,724.87	0.02
540	600488	津药药业	17,200	71,724.00	0.02
541	688179	阿拉丁	5,600	71,232.00	0.02
542	600717	天津港	15,600	71,136.00	0.02
543	02588	中银航空租赁	1,200	71,132.10	0.02
544	001309	德明利	600	71,004.00	0.02
545	688558	国盛智科	2,800	70,672.00	0.02
546	601568	北元集团	17,000	70,550.00	0.02
547	600933	爱柯迪	4,400	70,444.00	0.02
548	688257	新锐股份	4,800	70,320.00	0.02
549	09988	阿里巴巴-W	700	70,092.48	0.02
550	688638	誉辰智能	1,800	69,948.00	0.02
551	688200	华峰测控	485	69,937.00	0.02
552	000544	中原环保	8,600	69,918.00	0.02
553	00358	江西铜业股份	5,000	69,490.59	0.02
554	603712	七一二	3,300	69,333.00	0.02
555	600874	创业环保	11,600	69,252.00	0.02
556	01519	极兔速递-W	11,200	69,249.84	0.02
557	00179	德昌电机控股	3,500	68,943.42	0.02
558	02273	固生堂	2,200	68,916.06	0.02
559	600020	中原高速	14,400	68,832.00	0.02
560	688370	从麟科技	3,600	68,796.00	0.02
561	600489	中金黄金	4,700	68,761.00	0.02
562	688334	西高院	4,000	68,720.00	0.02
563	688335	复洁环保	5,600	68,320.00	0.02
564	688479	友车科技	3,600	68,040.00	0.02
565	688468	科美诊断	9,200	67,712.00	0.02

566	600315	上海家化	3,200	67,424.00	0.02
567	603983	丸美生物	1,600	67,408.00	0.02
568	688389	普门科技	5,200	67,184.00	0.02
569	688588	凌志软件	4,600	67,022.00	0.02
570	688092	爱科科技	3,000	66,900.00	0.02
571	688697	纽威数控	5,000	66,700.00	0.02
572	688015	交控科技	3,200	66,688.00	0.02
573	06969	思摩尔国际	4,000	66,535.87	0.02
574	603993	洛阳钼业	5,300	44,626.00	0.01
574	03993	洛阳钼业	3,000	21,832.08	0.01
575	601033	永兴股份	4,200	66,402.00	0.02
576	600153	建发股份	6,400	66,368.00	0.02
577	300957	贝泰妮	1,500	66,330.00	0.02
578	00257	光大环境	19,000	66,189.33	0.02
579	600323	瀚蓝环境	2,700	65,745.00	0.02
580	003816	中国广核	18,000	65,520.00	0.02
581	301129	瑞纳智能	2,400	65,184.00	0.02
582	300102	乾照光电	5,600	64,792.00	0.02
583	01880	中国中免	1,300	61,766.37	0.02
584	603699	纽威股份	1,900	59,223.00	0.02
585	605180	华生科技	4,000	59,200.00	0.02
586	301056	森赫股份	5,600	59,136.00	0.02
587	300813	泰林生物	2,700	57,807.00	0.02
588	688701	卓锦股份	7,000	57,680.00	0.02
589	03877	中国船舶租赁	30,000	57,452.85	0.02
590	01378	中国宏桥	3,500	57,389.01	0.02
591	688234	天岳先进	980	57,379.00	0.02
592	688565	力源科技	6,200	57,350.00	0.02
593	688485	九州一轨	5,200	56,628.00	0.02
594	688466	金科环境	3,200	56,576.00	0.02
595	600325	华发股份	11,500	56,005.00	0.02
596	300500	启迪设计	4,600	55,890.00	0.02
597	01208	五矿资源	16,000	55,884.30	0.02
598	688659	元琛科技	6,400	55,872.00	0.02
599	603839	安正时尚	7,600	55,784.00	0.02
600	871857	泓禧科技	2,800	55,720.00	0.02
601	688203	海正生材	4,400	55,704.00	0.02
602	000586	汇源通信	5,000	55,600.00	0.02
603	301212	联盛化学	2,100	55,587.00	0.02
604	600639	浦东金桥	5,249	55,586.91	0.02
605	002442	龙星科技	8,700	55,506.00	0.02
606	300800	力合科技	5,000	55,450.00	0.02
606	300517	海波重科	5,000	55,450.00	0.02
607	002718	友邦吊顶	3,500	55,440.00	0.02

608	430476	海能技术	3,000	55,380.00	0.02
609	002972	科安达	4,500	55,305.00	0.02
610	603311	金海高科	5,000	55,300.00	0.02
611	301192	泰祥股份	2,400	55,248.00	0.02
612	603700	宁水集团	4,600	55,108.00	0.02
613	300030	阳普医疗	8,000	54,960.00	0.02
614	300929	华骐环保	5,200	54,912.00	0.02
615	300519	新光药业	3,700	54,908.00	0.02
616	002012	凯恩股份	9,700	54,902.00	0.02
617	605189	富春染织	4,420	54,896.40	0.02
618	300877	金春股份	3,400	54,876.00	0.02
618	300626	华瑞股份	5,100	54,876.00	0.02
619	600768	宁波富邦	4,800	54,864.00	0.02
619	002830	名雕股份	3,600	54,864.00	0.02
620	301365	矩阵股份	3,200	54,848.00	0.02
621	301081	严牌股份	5,680	54,812.00	0.02
622	001210	金房能源	4,000	54,760.00	0.02
623	300535	达威股份	3,300	54,747.00	0.02
624	300610	晨化股份	4,800	54,720.00	0.02
625	605055	迎丰股份	7,500	54,675.00	0.02
626	603122	合富中国	8,000	54,640.00	0.02
627	002836	新宏泽	5,800	54,636.00	0.02
628	603976	正川股份	3,000	54,630.00	0.02
629	301059	金三江	4,800	54,624.00	0.02
630	002817	黄山胶囊	7,400	54,612.00	0.02
631	832000	安徽凤凰	2,500	54,600.00	0.02
632	603909	建发合诚	5,600	54,544.00	0.02
633	002871	伟隆股份	4,900	54,537.00	0.02
634	603272	联翔股份	3,200	54,528.00	0.02
635	300371	汇中股份	4,700	54,520.00	0.02
636	002893	京能热力	5,100	54,519.00	0.02
637	002774	快意电梯	6,200	54,498.00	0.02
638	603282	亚光股份	3,200	54,496.00	0.02
639	603617	君禾股份	7,600	54,492.00	0.02
640	002188	中天服务	9,800	54,488.00	0.02
641	688718	唯赛勃	4,400	54,472.00	0.02
642	688585	上纬新材	7,000	54,460.00	0.02
643	301006	迈拓股份	3,500	54,390.00	0.02
644	301113	雅艺科技	2,600	54,366.00	0.02
645	836395	朗鸿科技	3,700	54,353.00	0.02
646	300246	宝莱特	6,800	54,332.00	0.02
647	002394	联发股份	6,600	54,318.00	0.02
648	002687	乔治白	11,700	54,288.00	0.02
649	301057	汇隆新材	3,300	54,252.00	0.02

650	430718	合肥高科	3,000	54,210.00	0.02
651	603172	万丰股份	3,400	54,162.00	0.02
652	871245	威博液压	1,700	54,145.00	0.02
653	003018	金富科技	4,800	54,096.00	0.02
654	600493	凤竹纺织	8,500	54,060.00	0.02
655	002381	双箭股份	8,000	54,000.00	0.02
656	301395	仁信新材	4,000	53,960.00	0.02
657	001299	美能能源	4,800	53,952.00	0.02
658	600356	恒丰纸业	6,700	53,935.00	0.02
659	603903	中持股份	6,900	53,889.00	0.02
660	002671	龙泉股份	11,700	53,820.00	0.02
660	603321	梅轮电梯	6,900	53,820.00	0.02
661	002790	瑞尔特	7,400	53,798.00	0.02
662	603385	惠达卫浴	8,100	53,784.00	0.02
663	600235	民丰特纸	8,600	53,750.00	0.02
664	002247	聚力文化	19,900	53,730.00	0.02
665	300658	延江股份	8,300	53,701.00	0.02
666	830974	凯大催化	6,200	53,692.00	0.02
667	603177	德创环保	5,900	53,690.00	0.02
668	300234	开尔新材	10,800	53,676.00	0.02
669	834765	美之高	3,000	53,610.00	0.02
670	603159	上海亚虹	3,200	53,536.00	0.02
671	603201	常润股份	2,900	53,505.00	0.02
672	002679	福建金森	5,600	53,480.00	0.02
673	600533	栖霞建设	21,200	53,424.00	0.02
674	000548	湖南投资	10,000	53,400.00	0.02
675	600883	博闻科技	6,800	53,380.00	0.02
676	831278	泰德股份	4,200	53,340.00	0.02
677	605500	森林包装	7,200	53,208.00	0.02
678	688681	科汇股份	3,800	53,200.00	0.02
679	300966	共同药业	2,900	53,157.00	0.02
680	831834	三维装备	4,300	53,105.00	0.02
681	834261	一诺威	3,500	53,025.00	0.02
682	000593	德龙汇能	8,800	52,976.00	0.02
683	300828	锐新科技	3,200	52,896.00	0.02
684	002694	顾地科技	10,800	52,812.00	0.02
685	688573	信宇人	1,515	52,419.00	0.02
686	002556	辉隆股份	8,500	50,575.00	0.02
687	002422	科伦药业	1,400	50,288.00	0.02
688	300450	先导智能	2,000	49,700.00	0.02
689	601199	江南水务	9,400	49,632.00	0.02
690	601377	兴业证券	8,000	49,520.00	0.02
691	601886	江河集团	8,000	49,200.00	0.02
692	02618	京东物流	4,100	49,130.39	0.02

693	603225	新凤鸣	4,600	48,990.00	0.02
694	603663	三祥新材	1,800	47,412.00	0.02
695	01316	耐世特	9,000	46,783.04	0.02
696	688411	海博思创	560	46,754.40	0.02
697	06127	昭衍新药	2,900	46,017.00	0.01
698	603477	巨星农牧	2,200	45,276.00	0.01
699	03759	康龙化成	2,900	43,848.38	0.01
700	688550	瑞联新材	1,000	43,010.00	0.01
701	01972	太古地产	2,400	42,898.13	0.01
702	002108	沧州明珠	10,800	41,688.00	0.01
703	06060	众安在线	2,500	41,630.52	0.01
704	00016	新鸿基地产	500	41,060.55	0.01
705	688183	生益电子	800	40,960.00	0.01
706	688392	骄成超声	600	40,878.00	0.01
707	06160	百济神州	300	40,435.86	0.01
708	300476	胜宏科技	300	40,314.00	0.01
709	603568	伟明环保	2,100	40,068.00	0.01
710	603759	海天股份	4,700	39,903.00	0.01
711	01318	毛戈平	400	39,505.67	0.01
712	000563	陕国投 A	10,500	37,485.00	0.01
713	688668	鼎通科技	600	37,476.00	0.01
714	00683	嘉里建设	2,000	36,933.98	0.01
715	600993	马应龙	1,300	36,764.00	0.01
716	000423	东阿阿胶	700	36,610.00	0.01
717	02899	紫金矿业	2,000	36,569.20	0.01
718	601619	嘉泽新能	10,200	36,516.00	0.01
719	300390	天华新能	1,900	36,233.00	0.01
720	603170	宝立食品	2,900	36,163.00	0.01
721	300972	万辰集团	200	36,048.00	0.01
722	003012	东鹏控股	6,300	36,036.00	0.01
723	600422	昆药集团	2,500	35,775.00	0.01
724	002532	天山铝业	4,300	35,733.00	0.01
725	002478	常宝股份	6,800	35,700.00	0.01
726	300502	新易盛	280	35,565.60	0.01
727	300856	科思股份	2,340	35,451.00	0.01
728	02269	药明生物	1,500	35,087.28	0.01
729	603833	欧派家居	600	33,870.00	0.01
730	002662	峰璟股份	9,900	33,858.00	0.01
731	688775	影石创新	200	33,688.00	0.01
732	002734	利民股份	1,800	32,940.00	0.01
733	688008	澜起科技	400	32,800.00	0.01
734	300803	指南针	400	32,264.00	0.01
735	300850	新强联	900	32,238.00	0.01
736	300765	新诺威	620	32,047.80	0.01

737	688143	长盈通	800	31,200.00	0.01
738	301230	泓博医药	900	30,978.00	0.01
739	600882	妙可蓝多	1,000	30,530.00	0.01
740	688313	仕佳光子	800	30,440.00	0.01
741	603893	瑞芯微	200	30,372.00	0.01
742	600673	东阳光	2,600	30,238.00	0.01
743	600183	生益科技	1,000	30,150.00	0.01
744	688591	泰凌微	624	29,889.60	0.01
745	688150	莱特光电	1,200	29,664.00	0.01
746	002487	大金重工	900	29,610.00	0.01
747	300570	太辰光	300	28,914.00	0.01
748	600611	大众交通	4,600	28,612.00	0.01
749	601111	中国国航	3,600	28,404.00	0.01
750	300251	光线传媒	1,400	28,378.00	0.01
751	00856	伟仕佳杰	4,000	28,343.41	0.01
752	000603	盛达资源	1,900	28,291.00	0.01
753	688041	海光信息	200	28,258.00	0.01
754	002292	奥飞娱乐	2,900	28,188.00	0.01
755	00268	金蝶国际	2,000	28,161.02	0.01
756	300913	兆龙互连	600	28,092.00	0.01
757	688270	臻镭科技	600	27,936.00	0.01
758	300702	天宇股份	1,200	27,912.00	0.01
759	01818	招金矿业	1,500	27,905.67	0.01
760	300602	飞荣达	1,300	27,573.00	0.01
761	603612	索通发展	1,500	27,570.00	0.01
762	600111	北方稀土	1,100	27,390.00	0.01
763	688095	福昕软件	400	27,164.00	0.01
764	603063	禾望电气	800	27,088.00	0.01
765	688525	佰维存储	400	26,960.00	0.01
766	688768	容知日新	600	26,634.00	0.01
767	688793	倍轻松	800	26,632.00	0.01
768	603043	广州酒家	1,700	26,486.00	0.01
769	300001	特锐德	1,100	26,367.00	0.01
770	600166	福田汽车	9,700	26,287.00	0.01
771	000600	建投能源	3,800	26,258.00	0.01
772	600150	中国船舶	800	26,032.00	0.01
773	000100	TCL 科技	6,000	25,980.00	0.01
774	688545	兴福电子	957	25,791.15	0.01
775	300796	贝斯美	2,500	25,775.00	0.01
776	300353	东土科技	1,200	25,620.00	0.01
777	001208	华菱线缆	2,400	25,560.00	0.01
778	603766	隆鑫通用	2,000	25,520.00	0.01
779	301220	亚香股份	560	25,144.00	0.01
780	00966	中国太平	1,800	25,115.10	0.01

781	300990	同飞股份	500	24,950.00	0.01
782	600460	士兰微	1,000	24,820.00	0.01
783	603166	福达股份	1,600	24,752.00	0.01
784	002970	锐明技术	500	24,700.00	0.01
785	688035	德邦科技	600	24,372.00	0.01
786	002284	亚太股份	2,200	24,310.00	0.01
787	688049	炬芯科技	400	24,200.00	0.01
788	600771	广誉远	1,200	24,192.00	0.01
789	603379	三美股份	500	24,060.00	0.01
790	301033	迈普医学	400	24,024.00	0.01
791	600186	莲花控股	4,000	24,000.00	0.01
792	002230	科大讯飞	500	23,940.00	0.01
793	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
794	300824	北鼎股份	2,000	23,860.00	0.01
795	688333	铂力特	400	23,824.00	0.01
796	600143	金发科技	2,300	23,713.00	0.01
797	689009	九号公司	400	23,668.00	0.01
798	301031	中熔电气	296	23,576.40	0.01
799	002881	美格智能	500	23,200.00	0.01
800	688696	极米科技	200	22,872.00	0.01
801	300760	迈瑞医疗	100	22,475.00	0.01
802	002068	黑猫股份	2,200	22,462.00	0.01
803	300666	江丰电子	300	22,230.00	0.01
804	002555	三七互娱	1,200	20,748.00	0.01
805	600141	兴发集团	1,000	20,530.00	0.01
806	00101	恒隆地产	3,000	20,491.52	0.01
807	688213	思特威-W	200	20,444.00	0.01
808	002731	萃华珠宝	1,400	20,440.00	0.01
809	09863	零跑汽车	400	19,953.47	0.01
810	603919	金徽酒	1,100	19,910.00	0.01
811	300181	佐力药业	1,100	19,063.00	0.01
812	601860	紫金银行	6,200	18,600.00	0.01
813	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
814	603599	广信股份	1,600	17,072.00	0.01
815	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
816	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
817	000582	北部湾港	1,900	15,675.00	0.01
818	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
819	301275	汉朔科技	265	14,890.35	0.00
820	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
821	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
822	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
823	000027	深圳能源	2,100	13,398.00	0.00
824	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00

825	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
826	000755	山西高速	2,500	12,175.00	0.00
827	301501	恒鑫生活	255	11,531.10	0.00
828	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
829	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
830	301590	优优绿能	69	9,624.12	0.00
831	603920	世运电路	300	9,153.00	0.00
832	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
833	603195	公牛集团	180	8,685.00	0.00
834	000655	金岭矿业	1,200	8,472.00	0.00
835	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
836	000761	本钢板材	2,200	7,920.00	0.00
837	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
838	603511	爱慕股份	500	7,695.00	0.00
839	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
840	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
841	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
842	603014	威高血净	153	5,000.04	0.00
843	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
844	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
845	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
846	603202	天有为	44	3,989.04	0.00
847	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
848	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
849	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
850	603998	方盛制药	300	2,946.00	0.00
851	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
852	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
853	301312	智立方	60	2,382.00	0.00
854	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
855	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
856	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
857	600163	中闽能源	400	2,048.00	0.00
858	600388	龙净环保	100	1,200.00	0.00
859	000528	柳工	100	961.00	0.00
860	000156	华数传媒	100	794.00	0.00
861	002154	报喜鸟	200	752.00	0.00
862	002958	青农商行	200	722.00	0.00
863	002677	浙江美大	100	691.00	0.00
864	600167	联美控股	100	562.00	0.00
865	600477	杭萧钢构	200	530.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	01088	中国神华	4,124,448.64	1.30
1	601088	中国神华	2,912,029.00	0.92
2	601658	邮储银行	4,768,312.00	1.51
2	01658	邮储银行	1,925,287.59	0.61
3	01919	中远海控	2,733,646.37	0.86
3	601919	中远海控	2,382,576.00	0.75
4	00998	中信银行	2,538,633.70	0.80
4	601998	中信银行	2,450,304.00	0.77
5	601898	中煤能源	2,716,721.00	0.86
5	01898	中煤能源	1,804,575.38	0.57
6	06198	青岛港	2,498,672.32	0.79
6	601298	青岛港	1,229,114.00	0.39
7	00857	中国石油股份	1,787,187.98	0.56
7	601857	中国石油	1,761,459.00	0.56
8	601717	中创智领	1,735,884.00	0.55
8	00564	中创智领	1,451,897.17	0.46
9	601827	三峰环境	3,156,423.00	1.00
10	01988	民生银行	1,781,276.93	0.56
10	600016	民生银行	1,297,999.00	0.41
11	01398	工商银行	2,445,146.41	0.77
11	601398	工商银行	613,709.00	0.19
12	601077	渝农商行	1,933,798.00	0.61
12	03618	重庆农村商业银行	950,071.49	0.30
13	601916	浙商银行	1,728,721.00	0.55
13	02016	浙商银行	1,153,425.32	0.36
14	601318	中国平安	1,523,184.00	0.48
14	02318	中国平安	1,270,694.74	0.40
15	000333	美的集团	2,789,717.00	0.88
16	600350	山东高速	2,676,874.00	0.85
17	00939	建设银行	1,846,816.78	0.58
17	601939	建设银行	770,210.00	0.24
18	601872	招商轮船	2,558,898.00	0.81
19	601818	光大银行	1,558,364.00	0.49
19	06818	中国光大银行	964,985.07	0.30
20	01513	丽珠医药	1,734,810.51	0.55
20	000513	丽珠集团	779,397.00	0.25

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601088	中国神华	5,917,562.00	1.87
1	01088	中国神华	2,037,923.95	0.64
2	601658	邮储银行	4,232,860.00	1.34
2	01658	邮储银行	1,796,715.06	0.57
3	00998	中信银行	3,260,448.99	1.03
3	601998	中信银行	2,178,529.00	0.69
4	601919	中远海控	3,325,103.00	1.05
4	01919	中远海控	1,935,527.72	0.61
5	601077	渝农商行	2,523,008.00	0.80
5	03618	重庆农村商业银行	2,051,895.79	0.65
6	600350	山东高速	4,444,634.19	1.40
7	601898	中煤能源	2,650,246.00	0.84
7	01898	中煤能源	1,328,475.23	0.42
8	601298	青岛港	2,870,351.00	0.91
8	06198	青岛港	1,099,356.61	0.35
9	601916	浙商银行	3,012,952.00	0.95
9	02016	浙商银行	744,261.84	0.23
10	601939	建设银行	3,209,302.00	1.01
10	00939	建设银行	209,932.48	0.07
11	601717	中创智领	2,292,649.00	0.72
11	00564	中创智领	1,114,311.43	0.35
12	601857	中国石油	2,555,591.00	0.81
12	00857	中国石油股份	815,562.21	0.26
13	601988	中国银行	2,717,303.00	0.86
13	03988	中国银行	515,050.55	0.16
14	601827	三峰环境	3,172,273.00	1.00
15	601328	交通银行	1,829,233.00	0.58
15	03328	交通银行	1,312,413.23	0.41
16	601318	中国平安	2,107,879.00	0.67
16	02318	中国平安	963,551.05	0.30
17	601398	工商银行	2,911,666.00	0.92
17	01398	工商银行	125,054.08	0.04

18	600016	民生银行	1,496,358.00	0.47
18	01988	民生银行	1,447,829.80	0.46
19	601009	南京银行	2,915,592.00	0.92
20	600028	中国石化	1,939,855.00	0.61
20	00386	中国石油化工股份	933,467.58	0.29

7.4.3 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	531,943,150.12
卖出股票收入（成交）总额	550,553,306.63

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。中国建筑股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方交通运输局、

地方住房和城乡建设厅的处罚。中国石油天然气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,477.95
2	应收清算款	3,805,484.97
3	应收股利	721,861.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,002,905.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,566,729.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户	户均持有的	持有人结构

	数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发高股息优享混合 A	3,741	54,962.36	78,200,47 2.25	38.03%	127,413,7 03.69	61.97%
广发高股息优享混合 C	3,183	19,510.49	7,441,088 .64	11.98%	54,660,78 7.12	88.02%
合计	6,924	38,664.94	85,641,56 0.89	31.99%	182,074,4 90.81	68.01%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发高股息优享混合 A	571.34	0.0003%
	广发高股息优享混合 C	185,727.38	0.2991%
	合计	186,298.72	0.0696%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	广发高股息优享混合 A	0
	广发高股息优享混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	广发高股息优享混合 A	0~10
	广发高股息优享混合 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
基金合同生效日(2020年1月20)	3,557,926,568.23	1,215,585,451.87

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	228,624,113.54	61,031,902.57
本报告期基金总申购份额	4,313,057.83	20,374,424.63
减: 本报告期基金总赎回份额	27,322,995.43	19,304,451.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,614,175.94	62,101,875.76

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
国盛证券	1	612,281,147.72	56.64%	266,954.57	56.67%	-
中泰证券	2	243,150,189.64	22.49%	106,015.52	22.51%	-
华创证券	2	180,313,035.42	16.68%	78,617.62	16.69%	-
中航证券	2	36,795,455.28	3.40%	16,043.06	3.41%	-
招商证券	1	5,537,553.50	0.51%	2,104.27	0.45%	-
广发证券	3	2,991,232.62	0.28%	1,304.21	0.28%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

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、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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国盛证券	143,902.41	100.00%	6,200,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
2	关于广发高股息优享混合型证券投资基金变更业绩比较基准并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	2025-03-13
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-29
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金基金合同、招募说明书（更新）等规定，为维护基金份额持有人的利益，以更科学、合理的业绩比较基准评价本基金的业绩表现，基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 14 日起变更本基金的业绩比较基准，并根据最新法律法规对《广发高股息优享混合型证券投资基金基金合同》进行了相应修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发高股息优享混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发高股息优享混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发高股息优享混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发高股息优享混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书

12.2 存放地点

广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

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司
二〇二五年八月三十日