

广发制造智选股票型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55

8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4 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的情况	57
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	57
9 开放式基金份额变动	58
10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	60
11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 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	60
12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发制造智选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	广发制造智选股票发起式	
基金主代码	023524	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 12 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	136,035,716.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发制造智选股票发起式 A	广发制造智选股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	023524	023525
报告期末下属分级基金的份额总额	39,114,188.67 份	96,921,527.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注制造行业上市公司的投资机会，在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，精选个股，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金界定的制造行业是指在中国经济和制造行业转型升级的大背景下，运用先进技术、材料工艺以及生产方式，能够提高生产运营效率，提升生活质量的制造行业，以及为这类行业提供服务和原材料的相关行业。 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： 1、宏观经济因素； 2、估值因素； 3、政策因素（如财政政策、货币政策等）； 4、流动性因素等。 具体包括：1、大类资产配置策略；2、股票（含存托凭证）投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	申银万国制造业指数收益率×80%+人民币计价的恒生指数收益率×10%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金资产可投资于港股，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（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股

	股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。
--	--

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	王茵
	联系电话	020-83936666	010-63639180
	电子邮箱	xiangji@gffunds.com.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		95105828	95595
传真		020-34281105	010-63639132
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层; 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	北京市西城区太平桥大街25号 中国光大中心
邮政编码		510308	100033
法定代表人		葛长伟	吴利军

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层; 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168号星河湾中心28-38层; 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	广发制造智选股票发起式 A	广发制造智选股票发起式 C
本期已实现收益	12,448,853.27	38,224,807.13
本期利润	14,802,485.29	45,059,489.83
加权平均基金份额本期利润	0.3126	0.2791
本期加权平均净值利润率	20.15%	18.25%
本期基金份额净值增长率	23.42%	23.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发制造智选股票发起式 A	广发制造智选股票发起式 C
期末可供分配利润	23,129,944.52	56,066,647.22
期末可供分配基金份额利润	0.5913	0.5785
期末基金资产净值	68,837,844.42	169,250,633.76
期末基金份额净值	1.7599	1.7463
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发制造智选股票发起式 A	广发制造智选股票发起式 C
基金份额累计净值增长率	84.11%	82.69%

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

广发制造智选股票发起式 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
过去三个月	23.12%	1.93%	31.26%	1.73%	-8.14%	0.20%
过去六个月	23.42%	1.76%	30.54%	1.61%	-7.12%	0.15%
过去一年	68.73%	1.49%	71.40%	1.46%	-2.67%	0.03%
自基金合同生效起至今	84.11%	1.39%	66.84%	1.49%	17.27%	-0.10%

广发制造智选股票发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	22.94%	1.93%	31.26%	1.73%	-8.32%	0.20%
过去六个月	23.05%	1.76%	30.54%	1.61%	-7.49%	0.15%
过去一年	67.71%	1.49%	71.40%	1.46%	-3.69%	0.03%
自基金合同生效起至今	82.69%	1.39%	66.84%	1.49%	15.85%	-0.10%

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

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

广发制造智选股票型发起式证券投资基金

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
(2025 年 3 月 12 日至 2026 年 6 月 30 日)

广发制造智选股票发起式 A



广发制造智选股票发起式 C



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

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		
杨冬	本基金的基金经理；广发多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发价值领航一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发稳健策略混合型证券投资基金的基金经理；广发均衡成长混合型证券投资基金的基金经理；广发科技智选股票型发起式证券投资基金的基金经理；广发资源智选股票型发起式证券投资基金的基金经理；广发质量优选股票型证券投资基金的基金经理；广发研究智选混合型证券投资	2025-03-12	-	20 年	杨冬先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、权益投资二部副总经理、权益投资二部总经理、专户投资部副总经理、广发瑞誉一年持有期混合型证券投资基金基金经理(自 2022 年 1 月 19 日至 2025 年 9 月 18 日)、广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2023 年 8 月 21 日至 2025 年 11 月 5 日)、广发成长智选混合型证券投资基金基金经理(自 2025 年 11 月 6 日至 2026 年 3 月 12 日)。

	资基金的基金经 理；公司总经理 助理、主动量化 投资部总经理				
胡英粲	本基金的基金经 理；广发成长智 选混合型证券投 资基金的基金经 理；广发资源智 选股票型发起式 证券投资基金的 基金经理；广发 瑞誉一年持有期 混合型证券投资 基金的基金经理	2026-03-12	-	9 年	胡英粲先生，中国籍，金融 硕士，持有中国证券投资基金 业从业证书。曾任东北证 券股份有限公司研究所分析 师，中信建投证券股份有限 公司研究所分析师，广发基 金管理有限公司研究发展部 行业研究员、专户投资部投 资助理。

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 77 次，其中 76 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

2026 年上半年，国内经济延续“温和修复、结构分化”的运行特征。上半年国内生产总值同比增长 4.7%，实现“十五五”开局之年的良好开端。制造业采购经理指数在一季度经历春节季节性波动后逐步修复，二季度 4 月至 6 月分别录得 50.3%、50.0% 和 50.3%，整体维持在扩张区间附近，反映出制造业景气度总体稳定。与此同时，非制造业商务活动指数与综合 PMI 产出指数也在二季度末分别升至 50.2% 和 50.6%，表明内需修复和服务业改善对整体经济形成支撑。价格端修复趋势更加明确，工业生产者出厂价格指数同比从年初负增长区间持续回升，工业品价格进入较为确定的上行通道，为制造企业盈利修复和库存周期改善提供了基础。外部环境方面，全球主要经济体货币政策路径进一步分化，贸易增长预期有所下调，供应链本土化、区域化趋势持续强化，国内制造业在产业链自主可控、技术升级和国产替代方面的重要性进一步凸显。

政策层面，2026 年上半年国内延续“更加积极的财政政策”与“适度宽松的货币政策”总基调，并在支持制造业高质量发展方面持续加码。3 月召开的全国两会明确全年 5% 左右的经济增长目标，部署扩内需、发展新质生产力、深化改革开放等重点任务；4 月 28 日召开的中央政治局会议在肯定一季度经济“起步有力、主要指标好于预期”的基础上，进一步强调“精准有效实施”政策，首次系统部署水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等“六网”重大工程建设，并明确“全面实施人工智能+行动”。这些政策不仅有助于扩大有效投资，也将直接带动工程机械、工业设备、电网设备、通信设备、电子元器件、基础材料等制造链条需求。6 月陆家嘴论坛期间，央行、证监会等部门进一步释放金融支持硬科技与资本市场改革信号，优化流动性环境、拓宽

制造业尤其是高端制造与科技制造企业融资渠道，科创板第五套标准拓展至 AI 大模型企业，量子科技、具身智能、生物制造等前沿方向获得更多资本市场支持。总体来看，上半年政策脉络清晰围绕稳增长、扩投资、促更新、强制造四大方向协同发力，为制造业主题投资提供了较为有利的制度环境。

从权益市场来看，2026 年上半年 A 股主要指数普涨，但结构分化极为显著，市场整体呈现“科技链条强势、制造升级受益、传统消费承压”的特征。行业层面，电子、通信、机械设备、建筑材料等与高端制造、产业升级和新型基础设施相关的板块表现相对较好，体现出资本市场对先进制造、产业链自主可控和工业升级方向的持续定价；而商贸零售、食品饮料、农林牧渔、美容护理等偏消费属性行业则整体承压。上半年行情的核心驱动虽集中在 AI 算力产业趋势，但其影响并不局限于纯科技板块，而是进一步向制造环节延伸，带动了服务器、PCB、覆铜板、MLCC、半导体设备与材料、工业自动化、电力设备、通信设备等制造业中上游环节的景气修复。与此同时，随着工业品价格回升、企业资本开支预期改善以及政策对设备更新、产业升级的持续支持，具备技术壁垒、供给能力和盈利韧性的优质制造企业有望率先受益。

报告期内，本基金坚持制造业主题投资框架，紧密围绕“高端化、智能化、绿色化、国产化”主线进行组合配置，重点布局具备核心技术优势、下游需求明确、业绩兑现能力较强的制造业龙头企业。具体操作上，本基金适度减配了部分受资源价格波动影响较大、业绩弹性较强但持续性相对不足的行业，并根据制造业景气变化，增配了电子、通信等受益于智能制造、产业升级和新型基础设施建设的相关制造环节，同时在机械设备、工业自动化、基础材料等方向保持重点关注。总体来看，本基金在报告期内继续坚持制造业主题的核心配置思路，优选具备产业趋势支撑、盈利改善确定性较强、估值具备吸引力的制造业优质资产，力求在结构性行情中把握制造升级带来的中长期投资机会。报告期内，本基金减配有色金属、国防军工、机械等行业，增配电子、通信等行业。

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 23.42%，C 类基金份额净值增长率为 23.05%，同期业绩比较基准收益率为 30.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在当下时点来看，2026 年下半年 A 股市场仍具备较为积极的中期投资机会，结构性行情有望延续，但方向上更强调业绩兑现度、估值匹配度以及产业趋势的可持续性。展望下半年，我们关注以下几方面的机会。

其一，AI 算力与硬科技自主可控主线仍是中长期核心配置方向。上半年 AI 产业链景气度从下

游算力芯片向上游存储、光模块与 CPO、AI 服务器高速 PCB、MLCC、覆铜板、半导体设备与材料等中上游全面扩散，海外主要存储与 AI 芯片厂商季报显示营收超预期高增长且供需紧张格局或延续至 2027 年之后，国产大模型深度适配昇腾等国产算力体系，产业链景气与订单能见度较高。陆家嘴论坛后证监会拓展科创板第五套上市标准至 AI 大模型企业，进一步优化了硬科技企业的融资环境，中长期产业逻辑清晰。下半年伴随中报业绩披露与全年业绩预期修正，AI 算力链的业绩兑现将成为最重要的观察窗口，具备订单能见度与业绩兑现能力的中上游龙头值得重点关注，同时应当适度警惕短期估值扩张过快、业绩兑现节奏跟不上的品种。

其二，制造业内部的结构升级与国产替代机会值得重点关注。随着稳增长政策持续发力以及新一轮设备更新、技术改造和产业升级推进，制造业板块下半年的投资主线有望继续围绕高端化、智能化、绿色化展开。具备核心技术壁垒、较强国产替代能力、订单增长明确且盈利改善持续的细分领域，仍是制造业主题基金的重要配置方向，尤其包括高端装备、工业自动化、机器人、半导体设备、新能源装备、检测仪器、先进材料等方向。这类资产不仅契合制造业转型升级的大趋势，也更符合中期业绩兑现与产业逻辑验证的要求。与此同时，对于短期受主题催化较多、但基本面兑现尚不充分的品种，应保持适度审慎，优先选择景气度与盈利改善能够同步验证的龙头企业。

其三，新质生产力与新型基础设施主题空间广阔。中央政治局会议部署的“六网”建设涵盖水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等重大工程，配合“人工智能+”行动的持续推进，新型电网、电力设备、机械设备、建筑材料等中游制造方向直接受益于结构性投资扩张，上半年建筑材料板块已呈现明显的资金关注度提升，未来空间仍值得深挖。此外，机器人、具身智能、生物制造、量子科技等前沿硬科技领域获得资本市场的政策倾斜，具备较长的产业成长周期，是下半年值得战略布局的中期主题方向。

总的来说，宏观基本面温和修复、流动性充裕延续、AI 产业趋势主导的市场逻辑并未发生根本变化，下半年结构性机会突出，围绕业绩兑现与估值匹配的龙头标的具备较好的中期配置价值，同时兼顾低估值蓝筹的均衡配置与新质生产力主题的前瞻布局，有助于应对分化极致环境下的组合波动，把握 A 股中期上行趋势中的高质量机会。

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

本基金为发起式基金且截至本报告期末，合同生效不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的披露规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在广发制造智选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

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

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

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：广发制造智选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,694,166.69	62,593,634.55
结算备付金		2,974,273.08	1,103,291.42
存出保证金		292,726.59	131,003.63
交易性金融资产	6.4.7.2	224,677,025.39	260,998,427.62
其中：股票投资		218,679,421.60	259,739,800.88
基金投资		-	-
债券投资		5,997,603.79	1,258,626.74
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		1,916,134.62	-
应收股利		-	-
应收申购款		683,309.80	3,452,672.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		242,237,636.17	328,279,029.80
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		2,199,176.11	42,471,120.04
应付赎回款		1,098,823.64	5,777,556.44
应付管理人报酬		234,680.90	218,308.16
应付托管费		39,113.47	36,384.69
应付销售服务费		83,205.51	73,429.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		159.09	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	493,999.27	363,138.05
负债合计		4,149,157.99	48,939,936.42
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	136,035,716.08	196,600,416.77
未分配利润	6.4.7.9	102,052,762.10	82,738,676.61
净资产合计		238,088,478.18	279,339,093.38
负债和净资产总计		242,237,636.17	328,279,029.80

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发制造智选股票发起式 A 基金份额净值人民币 1.7599 元，基金份额总额 39,114,188.67 份；广发制造智选股票发起式 C 基金份额净值人民币 1.7463 元，基金份额总额 96,921,527.41 份；总份额总额 136,035,716.08 份。

6.2 利润表

会计主体：广发制造智选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 12 日（基 金合同生效日）至 2025
----	-----	--	---

			年 6 月 30 日
一、营业总收入		62,913,429.32	8,666,604.21
1. 利息收入		40,094.18	89,245.43
其中：存款利息收入	6.4.7.10	40,094.18	89,245.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,374,416.23	6,142,032.03
其中：股票投资收益	6.4.7.11	52,539,949.33	5,445,316.75
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	22,767.61	763.84
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	811,699.29	695,951.44
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	9,188,314.72	2,395,322.59
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	310,604.19	40,004.16
减：二、营业总支出		3,051,454.20	620,680.93
1. 管理人报酬		1,918,345.80	379,208.88
2. 托管费		319,724.29	63,201.45
3. 销售服务费		740,280.30	130,083.45
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		57.08	-
8. 其他费用	6.4.7.21	73,046.73	48,187.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		59,861,975.12	8,045,923.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		59,861,975.12	8,045,923.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		59,861,975.12	8,045,923.28

注：本基金合同生效日为 2025 年 3 月 12 日，上年度可比期间不完整。

6.3 净资产变动表

会计主体：广发制造智选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	196,600,416.77	82,738,676.61	279,339,093.38
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	196,600,416.77	82,738,676.61	279,339,093.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,564,700.69	19,314,085.49	-41,250,615.20
（一）、综合收益总额	-	59,861,975.12	59,861,975.12
（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）	-60,564,700.69	-40,547,889.63	-101,112,590.32
其中：1.基金申购款	213,459,386.47	113,324,745.38	326,784,131.85
2.基金赎回款	-274,024,087.16	-153,872,635.01	-427,896,722.17
（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	136,035,716.08	102,052,762.10	238,088,478.18
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 12 日（基金合同生效日）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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	121,843,110.06	-	121,843,110.06

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,410,350.48	6,522,638.60	-42,887,711.88
（一）、综合收益总额	-	8,045,923.28	8,045,923.28
（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）	-49,410,350.48	-1,523,284.68	-50,933,635.16
其中：1.基金申购款	11,958,584.38	419,484.20	12,378,068.58
2.基金赎回款	-61,368,934.86	-1,942,768.88	-63,311,703.74
（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	72,432,759.58	6,522,638.60	78,955,398.18

注：本基金合同生效日为 2025 年 3 月 12 日，上年度可比期间不完整。

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

广发制造智选股票型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2025]283 号文准予注册，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《广发制造智选股票型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2025 年 3 月 3 日向社会公开发行募集并于 2025 年 3 月 12 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金募集期间为自 2025 年 3 月 3 日至 2025 年 3 月 10 日止，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 121,843,110.06 元，有效认购户数为 3,390 户。其中，本基金 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 34,429,990.20 元，认购资金在募集期间

产生的利息为人民币 2,464.85 元，利息结转基金份额 2,464.85 份；本基金 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 87,407,104.72 元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币 3,550.29 元，利息结转基金份额 3,550.29 份。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。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 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

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》，财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干

优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81 号《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〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《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》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕127 号《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》、财税〔2016〕140 号《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》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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，暂（可选择）适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入及金融同业往来利息收入免征增值税，通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，未发生实物交割的，免征增值税。但自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。

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。

（2）企业所得税、个人所得税

对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提供的投资者名册，按照 20% 的税率代扣个人所得税；通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(3) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳，自 2023 年 8 月 28 日起减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	11,694,166.69
等于：本金	11,692,864.68
加：应计利息	1,302.01
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	11,694,166.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	206,256,134.26	-	218,679,421.60	12,423,287.34
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	5,708,110.00	44,079.61	5,997,603.79	245,414.18
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,708,110.00	44,079.61	5,997,603.79	245,414.18
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		211,964,244.26	44,079.61	224,677,025.39	12,668,701.52

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	622.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	420,481.21
其中：交易所市场	420,481.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,895.94
合计	493,999.27

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发制造智选股票发起式 A

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,034,885.69	48,034,885.69
本期申购	17,491,742.63	17,491,742.63
本期赎回（以“-”号填列）	-26,412,439.65	-26,412,439.65
本期末	39,114,188.67	39,114,188.67

金额单位：人民币元

广发制造智选股票发起式 C		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,565,531.08	148,565,531.08
本期申购	195,967,643.84	195,967,643.84
本期赎回（以“-”号填列）	-247,611,647.51	-247,611,647.51
本期末	96,921,527.41	96,921,527.41

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

广发制造智选股票发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,767,831.66	4,694,655.11	20,462,486.77
本期期初	15,767,831.66	4,694,655.11	20,462,486.77
本期利润	12,448,853.27	2,353,632.02	14,802,485.29
本期基金份额交易产生的变动数	-5,086,740.41	-454,575.90	-5,541,316.31
其中：基金申购款	7,416,636.30	1,991,336.38	9,407,972.68
基金赎回款	-12,503,376.71	-2,445,912.28	-14,949,288.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,129,944.52	6,593,711.23	29,723,655.75

单位：人民币元

广发制造智选股票发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,789,718.52	14,486,471.32	62,276,189.84
本期期初	47,789,718.52	14,486,471.32	62,276,189.84
本期利润	38,224,807.13	6,834,682.70	45,059,489.83
本期基金份额交易产生的变动数	-29,947,878.43	-5,058,694.89	-35,006,573.32
其中：基金申购款	81,697,846.21	22,218,926.49	103,916,772.70
基金赎回款	-111,645,724.64	-27,277,621.38	-138,923,346.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,066,647.22	16,262,459.13	72,329,106.35

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,144.70
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	4,469.96
其他	1,479.52
合计	40,094.18

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	52,539,949.33
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	52,539,949.33

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,086,971,396.14
减：卖出股票成本总额	2,032,313,025.80
减：交易费用	2,118,421.01
买卖股票差价收入	52,539,949.33

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	22,475.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	292.00
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	22,767.61

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,721,610.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,699,708.00
减：应计利息总额	21,610.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	292.00

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	811,699.29
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	811,699.29

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	9,188,314.72
——股票投资	8,957,003.74
——债券投资	231,310.98
——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	9,188,314.72

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	282,761.24
基金转换费收入	27,842.95
合计	310,604.19

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	150.79
合计	73,046.73

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、关联关系

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

中国光大银行股份有限公司	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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年3月12日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,918,345.80	379,208.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	732,765.20	134,427.62
应支付基金管理人的净管理费	1,185,580.60	244,781.26

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年3月12日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	319,724.29	63,201.45

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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发制造智选股票发起式 A	广发制造智选股票发起式 C	合计
广发基金管理有限公司	-	29,366.37	29,366.37
中国光大银行股份有限公司	-	467,191.03	467,191.03
合计	-	496,557.40	496,557.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年3月12日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发制造智选股票发起式A	广发制造智选股票发起式C	合计
广发基金管理有限公司	-	824.24	824.24
中国光大银行股份有限公司	-	112,616.77	112,616.77
合计	-	113,441.01	113,441.01

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的约定年费率计提，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 0.60%。

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。

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

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年3月12日（基金合同生效日）至2025 年6月30日	
	广发制造智选股票 发起式A	广发制造智选股票 发起式C	广发制造智选股票 发起式A	广发制造智选股票 发起式C
基金合同生效日 （2025年3月12日） 持有的基金份额	-	-	10,002,289.03	-
报告期初持有的基 金份额	10,472,380.23	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	10,472,380.23	-	10,002,289.03	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	26.77%	-	34.66%	-

注：基金管理人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。

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

广发制造智选股票发起式 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。

广发制造智选股票发起式 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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年3月12日（基金合同生效 日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	11,694,166.69	34,144.70	7,676,852.23	88,132.71

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国光大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。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
301666	大普微-UW	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	549.00	25,297.92	254,368.17	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	93.00	7,614.84	147,342.69	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	7,458.00	75,400.38	75,400.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	523.00	10,292.64	73,999.27	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	902.00	8,541.94	63,266.28	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	339.00	23,614.74	54,260.34	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	91.00	4,054.96	42,648.97	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	120.00	4,917.60	36,982.80	-
68878	恒运	2026-0	6 个月	新股	92.18	463.15	75.00	6,913.	34,736	-

5	昌	1-20		流通受限				50	.25	
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,200.00	12,144.00	33,276.00	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	新股流通受限	10.11	10.11	3,195.00	32,301.45	32,301.45	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,523.00	11,909.86	31,587.02	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	235.00	4,159.50	19,815.20	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	506.00	3,582.48	14,370.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	158.00	3,464.94	12,289.24	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	80.00	6,270.40	9,741.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	294.00	7,993.86	9,205.14	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	206.00	6,258.28	8,031.94	-

001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	122.00	6,497.72	7,166.28	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	124.00	6,937.80	7,080.40	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	195.00	3,416.40	7,004.40	-
688781	视涯科技-UW	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	113.00	2,562.84	5,379.93	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	279.00	3,119.22	4,907.61	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	67.00	2,243.83	2,273.31	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	131.00	2,407.78	2,198.18	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	77.00	1,684.76	1,965.04	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123274	维科转债	2026-06-26	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.00	2,041.00	204,100.00	204,104.47	-

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 2026 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权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2026 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 2026 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 2026 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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,448,138.03	1,212,962.63
合计	5,448,138.03	1,212,962.63

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	549,465.76	45,664.11
未评级	-	-
合计	549,465.76	45,664.11

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

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回

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。

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 2026 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	11,694,166.69	-	-	-	11,694,166.69
结算备付金	2,974,273.08	-	-	-	2,974,273.08
存出保证金	292,726.59	-	-	-	292,726.59
交易性金融资产	5,997,603.79	-	-	218,679,421.60	224,677,025.39
应收清算款	-	-	-	1,916,134.62	1,916,134.62
应收申购款	-	-	-	683,309.80	683,309.80
资产总计	20,958,770.15	-	-	221,278,866.02	242,237,636.17
负债					
应付清算款	-	-	-	2,199,176.11	2,199,176.11
应付赎回款	-	-	-	1,098,823.64	1,098,823.64
应付管理人报酬	-	-	-	234,680.90	234,680.90
应付托管费	-	-	-	39,113.47	39,113.47

应付销售服务费	-	-	-	83,205.51	83,205.51
应交税费	-	-	-	159.09	159.09
其他负债	-	-	-	493,999.27	493,999.27
负债总计	-	-	-	4,149,157.99	4,149,157.99
利率敏感度缺口	20,958,770.15	-	-	217,129,708.03	238,088,478.18
上年度末 2025 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	62,593,634.55	-	-	-	62,593,634.55
结算备付金	1,103,291.42	-	-	-	1,103,291.42
存出保证金	131,003.63	-	-	-	131,003.63
交易性金融资产	1,258,626.74	-	-	259,739,800.88	260,998,427.62
应收申购款	-	-	-	3,452,672.58	3,452,672.58
资产总计	65,086,556.34	-	-	263,192,473.46	328,279,029.80
负债					
应付清算款	-	-	-	42,471,120.04	42,471,120.04
应付赎回款	-	-	-	5,777,556.44	5,777,556.44
应付管理人报酬	-	-	-	218,308.16	218,308.16
应付托管费	-	-	-	36,384.69	36,384.69
应付销售服务费	-	-	-	73,429.04	73,429.04
其他负债	-	-	-	363,138.05	363,138.05
负债总计	-	-	-	48,939,936.42	48,939,936.42
利率敏感度缺口	65,086,556.34	-	-	214,252,537.04	279,339,093.38

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		
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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-5,166.72	-372.39
	市场利率下降 25 个基点	5,178.54	372.83

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 2026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				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-
项目	上年度末 2025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	-	3,524,545.08	-	3,524,545.08
资产合计	-	3,524,545.08	-	3,524,545.08
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	-	3,524,545.08	-	3,524,545.08

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		
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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	-	176,227.25
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-176,227.25

注：本基金本报告期末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	218,679,421.60	91.85	259,739,800.88	92.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	549,465.76	0.23	45,664.11	0.02
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	219,228,887.36	92.08	259,785,464.99	93.00

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		
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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上升 5%	13,126,147.55	13,140,197.41
	下降 5%	-13,126,147.55	-13,140,197.41

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	217,901,687.73
第二层次	5,759,944.33
第三层次	1,015,393.33
合计	224,677,025.39

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	218,679,421.60	90.27
	其中：股票	218,679,421.60	90.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,997,603.79	2.48
	其中：债券	5,997,603.79	2.48
	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	14,668,439.77	6.06
8	其他各项资产	2,892,171.01	1.19
9	合计	242,237,636.17	100.00

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	-	-

B	采矿业	31,587.02	0.01
C	制造业	204,461,283.93	85.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,701.83	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,348,652.50	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,226,537.86	5.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	502,075.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	218,679,421.60	91.85

7.2.2 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。

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	002353	杰瑞股份	69,000	10,522,500.00	4.42
2	300308	中际旭创	7,700	9,779,000.00	4.11
3	300750	宁德时代	18,655	7,331,601.55	3.08
4	002475	立讯精密	102,400	7,208,960.00	3.03
5	300502	新易盛	8,420	5,110,940.00	2.15
6	688256	寒武纪	2,737	4,367,020.35	1.83
7	002384	东山精密	16,200	4,250,070.00	1.79
8	300476	胜宏科技	9,400	3,256,442.00	1.37
9	300857	协创数据	8,800	2,991,120.00	1.26

10	000338	潍柴动力	107,500	2,929,375.00	1.23
11	001389	广合科技	11,900	2,823,275.00	1.19
12	301536	星宸科技	21,000	2,702,910.00	1.14
13	600590	泰豪科技	240,200	2,426,020.00	1.02
14	002600	领益智造	128,400	2,226,456.00	0.94
15	300879	大叶股份	138,700	2,174,816.00	0.91
16	001309	德明利	2,300	2,168,670.00	0.91
17	688041	海光信息	5,627	2,083,678.10	0.88
18	300604	长川科技	5,900	2,014,378.00	0.85
19	301502	华阳智能	28,800	2,002,176.00	0.84
20	000977	浪潮信息	28,200	1,974,000.00	0.83
21	688008	澜起科技	6,312	1,956,088.80	0.82
22	603986	兆易创新	2,300	1,874,500.00	0.79
23	300602	飞荣达	36,200	1,853,440.00	0.78
24	600460	士兰微	32,700	1,787,382.00	0.75
25	002156	通富微电	23,300	1,767,771.00	0.74
26	301603	乔锋智能	11,700	1,682,460.00	0.71
27	600183	生益科技	9,700	1,681,980.00	0.71
28	605111	新洁能	16,800	1,665,552.00	0.70
29	300843	胜蓝股份	10,400	1,625,000.00	0.68
30	002947	恒铭达	21,200	1,612,260.00	0.68
31	301499	维科精密	53,900	1,572,802.00	0.66
32	300786	国林科技	61,100	1,531,777.00	0.64
33	603679	华体科技	75,744	1,528,513.92	0.64
34	300576	容大感光	29,760	1,524,307.20	0.64
35	600601	方正科技	109,600	1,516,864.00	0.64
36	603083	剑桥科技	5,900	1,503,733.00	0.63
37	301086	鸿富瀚	7,080	1,481,702.40	0.62
38	002913	奥士康	23,000	1,470,620.00	0.62
39	000922	佳电股份	104,340	1,456,586.40	0.61
40	300461	田中精机	38,000	1,407,520.00	0.59
41	300394	天孚通信	4,600	1,392,328.00	0.58
42	603228	景旺电子	18,900	1,368,549.00	0.57
43	002805	丰元股份	47,400	1,355,166.00	0.57
44	002851	麦格米特	7,900	1,320,722.00	0.55
45	301295	美硕科技	30,500	1,286,490.00	0.54
46	603931	格林达	21,400	1,271,160.00	0.53
47	600584	长电科技	12,000	1,242,600.00	0.52
48	300408	三环集团	7,200	1,201,680.00	0.50
49	300553	集智股份	18,700	1,147,993.00	0.48
50	600893	航发动力	29,800	1,142,532.00	0.48
51	600150	中国船舶	33,300	1,125,207.00	0.47
52	688378	奥来德	17,856	1,107,072.00	0.46
53	300939	秋田微	15,800	1,093,360.00	0.46

54	002273	水晶光电	30,700	1,089,236.00	0.46
55	002463	沪电股份	7,100	1,084,880.00	0.46
56	002990	盛视科技	13,600	1,074,400.00	0.45
57	300686	智动力	58,400	1,051,784.00	0.44
58	300775	三角防务	47,385	1,044,365.40	0.44
59	002916	深南电路	2,280	1,044,012.00	0.44
60	300681	英搏尔	36,000	1,030,320.00	0.43
61	300853	申昊科技	33,100	1,022,459.00	0.43
62	300837	浙矿股份	42,800	1,016,928.00	0.43
63	002158	汉钟精机	27,300	1,012,284.00	0.43
64	300427	红相股份	150,500	1,009,855.00	0.42
65	300613	富瀚微	12,600	1,009,008.00	0.42
66	002903	宇环数控	22,200	1,008,324.00	0.42
67	605117	德业股份	9,400	998,092.00	0.42
68	301326	捷邦科技	7,000	975,590.00	0.41
69	688660	电气风电	108,432	934,683.84	0.39
70	300745	欣锐科技	22,100	933,062.00	0.39
71	301328	维峰电子	12,900	918,480.00	0.39
72	002484	江海股份	8,600	903,000.00	0.38
73	600875	东方电气	29,800	857,346.00	0.36
74	000988	华工科技	4,600	849,206.00	0.36
75	688525	佰维存储	1,701	841,535.73	0.35
76	688536	思瑞浦	2,286	832,309.74	0.35
77	600487	亨通光电	7,600	830,984.00	0.35
78	301566	达利凯普	22,200	823,176.00	0.35
79	001339	智微智能	7,930	811,080.40	0.34
80	688498	源杰科技	400	754,400.00	0.32
81	001266	宏英智能	15,200	746,320.00	0.31
82	300810	中科海讯	28,710	728,659.80	0.31
83	002415	海康威视	21,200	725,040.00	0.30
84	300491	通合科技	18,000	687,420.00	0.29
85	002079	苏州固锟	45,400	682,362.00	0.29
86	002938	鹏鼎控股	6,200	653,356.00	0.27
87	603660	苏州科达	53,200	651,700.00	0.27
88	600105	永鼎股份	9,600	647,808.00	0.27
89	300475	香农芯创	2,100	630,000.00	0.26
90	300870	欧陆通	1,800	622,242.00	0.26
91	002281	光迅科技	2,400	616,656.00	0.26
92	002487	大金重工	10,600	614,482.00	0.26
93	688110	东芯股份	3,005	612,118.50	0.26
94	688141	杰华特	3,966	608,781.00	0.26
95	688797	臻宝科技	907	605,778.73	0.25
96	002049	紫光国微	6,800	603,500.00	0.25
97	002134	天津普林	19,700	599,274.00	0.25

98	688508	芯朋微	6,443	598,941.28	0.25
99	603296	华勤技术	8,000	594,160.00	0.25
100	301117	佳缘科技	25,160	587,486.00	0.25
101	300818	耐普矿机	30,900	584,010.00	0.25
102	300115	长盈精密	20,700	578,358.00	0.24
103	688528	秦川物联	62,998	575,801.72	0.24
104	601100	恒立液压	5,300	570,068.00	0.24
105	688020	方邦股份	2,277	568,339.20	0.24
106	000425	徐工机械	69,700	563,873.00	0.24
107	002636	金安国纪	4,700	563,859.00	0.24
108	002222	福晶科技	6,100	562,908.00	0.24
109	002402	和而泰	21,700	560,511.00	0.24
110	603659	璞泰来	19,300	558,349.00	0.23
111	300757	罗博特科	900	557,100.00	0.23
112	300458	全志科技	14,100	556,386.00	0.23
113	301377	鼎泰高科	1,000	550,900.00	0.23
114	688388	嘉元科技	12,461	548,284.00	0.23
115	601231	环旭电子	16,900	547,560.00	0.23
116	601869	长飞光纤	1,000	545,900.00	0.23
117	301238	瑞泰新材	22,200	541,680.00	0.23
118	688262	国芯科技	12,517	541,109.91	0.23
119	301369	联动科技	2,200	539,000.00	0.23
120	688416	恒烁股份	3,848	538,720.00	0.23
121	601698	中国卫通	17,700	535,425.00	0.22
122	688779	五矿新能	65,679	532,656.69	0.22
123	600562	国睿科技	25,100	532,622.00	0.22
124	688045	必易微	6,571	530,805.38	0.22
125	002643	万润股份	25,300	530,035.00	0.22
126	002979	雷赛智能	9,500	529,910.00	0.22
127	300548	长芯博创	1,900	528,200.00	0.22
128	300903	科翔股份	5,200	526,812.00	0.22
129	002414	高德红外	39,700	526,422.00	0.22
130	001314	亿道信息	8,500	525,300.00	0.22
131	688125	安达智能	3,201	523,363.50	0.22
132	002865	钧达股份	8,700	519,216.00	0.22
133	603063	禾望电气	9,800	518,322.00	0.22
134	603186	华正新材	2,300	518,190.00	0.22
135	301176	逸豪新材	7,600	516,800.00	0.22
136	688778	厦钨新能	9,488	516,147.20	0.22
137	688059	华锐精密	2,584	516,050.64	0.22
138	002518	科士达	9,600	514,464.00	0.22
139	688309	恒誉环保	8,434	513,461.92	0.22
140	002283	天润工业	53,100	512,415.00	0.22
141	600499	科达制造	37,000	510,600.00	0.21

142	603897	长城科技	15,700	509,622.00	0.21
143	300222	科大智能	36,600	506,910.00	0.21
144	688516	奥特维	8,827	506,581.53	0.21
145	688628	优利德	5,119	506,473.86	0.21
146	688002	睿创微纳	3,271	505,990.99	0.21
147	301082	久盛电气	56,300	504,448.00	0.21
148	000039	中集集团	62,200	504,442.00	0.21
149	301072	中捷精工	12,300	504,423.00	0.21
150	300940	南极光	33,400	503,672.00	0.21
151	002104	恒宝股份	48,800	503,128.00	0.21
152	301631	壹连科技	7,000	503,020.00	0.21
153	002131	利欧股份	105,700	502,075.00	0.21
154	002028	思源电气	2,900	501,700.00	0.21
155	600793	宜宾纸业	41,700	501,651.00	0.21
156	605196	华通线缆	19,200	501,120.00	0.21
157	600363	联创光电	14,000	500,920.00	0.21
158	001208	华菱线缆	35,200	499,488.00	0.21
159	002531	天顺风能	59,100	498,213.00	0.21
160	001311	多利科技	30,800	496,804.00	0.21
161	688521	芯原股份	1,334	495,100.76	0.21
162	300943	春晖智控	11,000	494,450.00	0.21
163	300551	古鳌科技	50,100	492,984.00	0.21
164	600841	动力新科	80,600	491,660.00	0.21
165	301568	思泰克	4,400	491,040.00	0.21
166	002757	南兴股份	27,200	490,960.00	0.21
167	301020	密封科技	22,400	489,216.00	0.21
168	688081	兴图新科	11,914	487,044.32	0.20
169	002535	林州重机	220,100	484,220.00	0.20
170	603121	华培动力	41,200	484,100.00	0.20
171	600320	振华重工	117,200	484,036.00	0.20
172	300590	移为通信	32,400	464,940.00	0.20
173	605222	起帆电缆	19,900	464,068.00	0.19
174	300504	天邑股份	28,400	458,092.00	0.19
175	000890	法尔胜	54,500	439,270.00	0.18
176	688648	中邮科技	11,767	430,083.85	0.18
177	603507	振江股份	12,900	424,281.00	0.18
178	002046	国机精工	5,700	419,805.00	0.18
179	300270	中威电子	31,600	411,116.00	0.17
180	001298	好上好	19,750	409,812.50	0.17
181	002972	科安达	20,700	404,892.00	0.17
182	002595	豪迈科技	8,155	380,023.00	0.16
183	300432	富临精工	18,700	375,683.00	0.16
184	603283	赛腾股份	4,540	367,649.20	0.15
185	300373	扬杰科技	2,300	361,629.00	0.15

186	003040	楚天龙	33,900	360,018.00	0.15
187	002270	华明装备	18,400	346,840.00	0.15
188	002774	快意电梯	23,300	331,093.00	0.14
189	301002	崧盛股份	8,300	320,380.00	0.13
190	688061	灿瑞科技	6,392	317,490.64	0.13
191	002885	京泉华	7,700	314,622.00	0.13
192	601126	四方股份	4,800	303,360.00	0.13
193	603061	金海通	600	301,332.00	0.13
194	002328	新朋股份	40,200	295,068.00	0.12
195	002436	兴森科技	5,700	290,415.00	0.12
196	605068	明新旭腾	15,200	255,056.00	0.11
197	301666	大普微-UW	549	254,368.17	0.11
198	688559	海目星	2,871	240,934.32	0.10
199	301045	天禄科技	2,700	240,516.00	0.10
200	002843	泰嘉股份	11,100	238,317.00	0.10
201	301387	光大同创	2,300	212,566.00	0.09
202	300965	恒宇信通	4,700	199,092.00	0.08
203	300985	致远新能	5,000	192,500.00	0.08
204	300001	特锐德	4,900	185,367.00	0.08
205	002371	北方华创	200	176,912.00	0.07
206	001287	中电港	5,600	174,440.00	0.07
207	603806	福斯特	10,000	167,900.00	0.07
208	301357	北方长龙	1,900	150,271.00	0.06
209	688808	联讯仪器	93	147,342.69	0.06
210	300790	宇瞳光学	5,300	138,383.00	0.06
211	605056	咸亨国际	8,400	134,400.00	0.06
212	600482	中国动力	4,000	131,200.00	0.06
213	688981	中芯国际	786	124,832.52	0.05
214	002284	亚太股份	12,300	116,727.00	0.05
215	000811	冰轮环境	2,000	112,440.00	0.05
216	002409	雅克科技	500	112,250.00	0.05
217	001248	华润新能源	10,653	107,701.83	0.05
218	688012	中微公司	225	105,412.50	0.04
219	002645	华宏科技	3,200	88,032.00	0.04
220	002849	威星智能	5,200	87,984.00	0.04
221	002236	大华股份	4,900	80,801.00	0.03
222	688820	盛合晶微	523	73,999.27	0.03
223	688818	电科蓝天	902	63,266.28	0.03
224	301682	宏明电子	339	54,260.34	0.02
225	601689	拓普集团	800	45,136.00	0.02
226	601608	中信重工	8,900	42,453.00	0.02
227	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.02
228	688635	长进光子	120	36,982.80	0.02
229	688809	强一股份	58	36,134.00	0.02

230	002943	宇晶股份	800	35,384.00	0.01
231	301321	翰博高新	800	35,320.00	0.01
232	688785	恒运昌	75	34,736.25	0.01
233	301273	瑞晨环保	1,100	34,661.00	0.01
234	001399	惠科股份	1,200	33,276.00	0.01
235	001257	盛龙股份	1,523	31,587.02	0.01
236	002130	沃尔核材	1,600	30,336.00	0.01
237	300628	亿联网络	700	23,674.00	0.01
238	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
239	603459	红板科技	235	19,815.20	0.01
240	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
241	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
242	301669	高特电子	506	14,370.40	0.01
243	603991	领先股份	100	14,115.00	0.01
244	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.01
245	300382	斯莱克	600	13,866.00	0.01
246	688220	翱捷科技-U	107	13,302.24	0.01
247	301680	固德电材	117	13,122.72	0.01
248	301687	新广益	158	12,289.24	0.01
249	300260	新莱应材	100	10,046.00	0.00
250	301683	慧谷新材	80	9,741.60	0.00
251	001365	天海电子	294	9,205.14	0.00
252	300700	岱勒新材	421	8,958.88	0.00
253	001393	维通利	206	8,031.94	0.00
254	688216	气派科技	188	7,897.88	0.00
255	300863	卡倍亿	100	7,663.00	0.00
256	001237	惠康科技	122	7,166.28	0.00
257	688816	易思维	124	7,080.40	0.00
258	920086	科马材料	300	7,038.00	0.00
259	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
260	688712	北芯生命	195	7,004.40	0.00
261	300699	光威复材	200	5,730.00	0.00
262	688781	视涯科技-UW	113	5,379.93	0.00
263	601112	振石股份	279	4,907.61	0.00
264	001369	双欣材料	323	4,366.96	0.00
265	002876	三利谱	100	3,521.00	0.00
266	920076	国亮新材	280	3,455.20	0.00
267	300102	乾照光电	100	2,604.00	0.00
268	603293	埃泰克	67	2,273.31	0.00
269	001312	福恩股份	131	2,198.18	0.00
270	603352	至信股份	77	1,965.04	0.00
271	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
272	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
273	300823	建科智能	100	1,458.00	0.00

274	688776	国光电气	14	858.76	0.00
275	300154	瑞凌股份	100	752.00	0.00
276	688307	中润光学	1	79.95	0.00
277	002925	盈趣科技	3	73.98	0.00
278	688385	复旦微电	1	71.29	0.00
279	688223	晶科能源	14	66.50	0.00
280	688380	中微半导	1	65.91	0.00
281	688711	宏微科技	1	45.45	0.00
282	000157	中联重科	6	41.82	0.00
283	688303	大全能源	2	34.86	0.00
284	002340	格林美	4	26.44	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	002488	金固股份	18,771,925.00	6.72
2	002475	立讯精密	16,035,803.00	5.74
3	300750	宁德时代	14,313,771.00	5.12
4	300274	阳光电源	12,617,744.88	4.52
5	002463	沪电股份	12,338,076.00	4.42
6	300699	光威复材	12,117,831.00	4.34
7	688085	三友医疗	12,003,989.11	4.30
8	002353	杰瑞股份	11,769,860.50	4.21
9	688531	日联科技	11,222,912.58	4.02
10	01530	三生制药	10,950,344.71	3.92
11	688256	寒武纪	10,869,447.64	3.89
12	300308	中际旭创	10,723,144.00	3.84
13	601799	星宇股份	10,532,280.10	3.77
14	601615	明阳智能	9,992,944.00	3.58
15	600150	中国船舶	9,724,651.92	3.48
16	688012	中微公司	9,264,755.35	3.32
17	300975	商络电子	9,217,522.48	3.30
18	002371	北方华创	8,869,268.00	3.18
19	688002	睿创微纳	8,853,121.26	3.17
20	300857	协创数据	8,824,238.60	3.16
21	603986	兆易创新	8,507,293.00	3.05
22	002916	深南电路	8,453,366.20	3.03
23	688041	海光信息	8,423,965.27	3.02
24	600183	生益科技	8,378,735.00	3.00

25	002156	通富微电	8,257,724.00	2.96
26	688008	澜起科技	8,074,860.62	2.89
27	001389	广合科技	7,849,773.00	2.81
28	603328	依顿电子	7,700,415.00	2.76
29	300259	新天科技	7,699,779.00	2.76
30	600482	中国动力	7,647,039.00	2.74
31	600066	宇通客车	7,534,318.00	2.70
32	000338	潍柴动力	7,430,536.00	2.66
33	002384	东山精密	7,381,359.00	2.64
34	000425	徐工机械	7,348,506.00	2.63
35	300263	隆华科技	7,320,611.00	2.62
36	002534	西子洁能	7,296,825.00	2.61
37	600584	长电科技	7,243,230.00	2.59
38	002590	万安科技	7,202,789.00	2.58
39	002273	水晶光电	7,111,799.00	2.55
40	300476	胜宏科技	7,106,640.00	2.54
41	001287	中电港	6,982,856.00	2.50
42	300296	利亚德	6,859,766.00	2.46
43	300323	华灿光电	6,856,078.00	2.45
44	002284	亚太股份	6,836,747.00	2.45
45	600361	创新新材	6,819,919.00	2.44
46	300232	洲明科技	6,728,414.00	2.41
47	300319	麦捷科技	6,718,081.00	2.40
48	002079	苏州固锟	6,691,072.00	2.40
49	002028	思源电气	6,672,724.00	2.39
50	300539	横河精密	6,627,921.40	2.37
51	000049	德赛电池	6,583,555.20	2.36
52	002436	兴森科技	6,569,266.00	2.35
53	688390	固德威	6,482,077.52	2.32
54	300438	鹏辉能源	6,375,962.00	2.28
55	603659	璞泰来	6,261,182.10	2.24
56	600552	凯盛科技	6,247,611.00	2.24
57	300696	爱乐达	6,180,585.00	2.21
58	002913	奥士康	6,094,039.00	2.18
59	600398	海澜之家	6,062,378.00	2.17
60	300776	帝尔激光	6,058,708.00	2.17
61	688375	国博电子	5,928,175.06	2.12
62	002865	钧达股份	5,920,496.00	2.12
63	000519	中兵红箭	5,913,175.00	2.12
64	688187	时代电气	5,896,099.25	2.11
65	002851	麦格米特	5,893,644.00	2.11
66	603083	剑桥科技	5,853,758.00	2.10
67	603606	东方电缆	5,833,572.65	2.09
68	301517	陕西华达	5,830,806.00	2.09

69	002782	可立克	5,795,458.00	2.07
70	300227	光韵达	5,761,037.00	2.06
71	301566	达利凯普	5,734,087.00	2.05
72	002925	盈趣科技	5,724,672.00	2.05
73	000768	中航西飞	5,721,117.00	2.05
74	002158	汉钟精机	5,701,520.00	2.04
75	300473	德尔股份	5,693,486.00	2.04
76	002415	海康威视	5,654,743.00	2.02
77	300604	长川科技	5,639,565.90	2.02

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（成交单价乘以成交数量）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	002475	立讯精密	18,107,054.00	6.48
2	002488	金固股份	16,540,100.00	5.92
3	600176	中国巨石	13,665,251.86	4.89
4	300274	阳光电源	12,682,335.20	4.54
5	002463	沪电股份	12,562,695.96	4.50
6	300308	中际旭创	11,922,471.00	4.27
7	300699	光威复材	11,720,709.00	4.20
8	688531	日联科技	11,463,106.12	4.10
9	688256	寒武纪	10,670,710.78	3.82
10	601615	明阳智能	10,231,570.00	3.66
11	300263	隆华科技	10,089,451.00	3.61
12	300975	商络电子	10,030,357.00	3.59
13	01530	三生制药	10,013,630.46	3.58
14	603328	依顿电子	9,922,400.00	3.55
15	600361	创新新材	9,705,434.00	3.47
16	688012	中微公司	9,674,741.34	3.46
17	688085	三友医疗	9,663,649.53	3.46
18	000049	德赛电池	9,541,282.20	3.42
19	601799	星宇股份	9,224,344.00	3.30
20	600183	生益科技	9,105,889.00	3.26
21	688002	睿创微纳	9,000,830.87	3.22
22	603986	兆易创新	8,986,421.00	3.22
23	300776	帝尔激光	8,979,418.20	3.21

24	002371	北方华创	8,895,195.00	3.18
25	300323	华灿光电	8,835,309.00	3.16
26	300319	麦捷科技	8,788,756.00	3.15
27	002916	深南电路	8,629,825.00	3.09
28	002273	水晶光电	8,618,857.00	3.09
29	002913	奥士康	8,519,166.90	3.05
30	001287	中电港	8,512,857.00	3.05
31	001389	广合科技	8,405,313.00	3.01
32	600482	中国动力	8,381,899.00	3.00
33	002993	奥海科技	8,225,114.50	2.94
34	002028	思源电气	8,149,450.00	2.92
35	002590	万安科技	8,118,310.00	2.91
36	002534	西子洁能	8,094,996.00	2.90
37	600166	福田汽车	8,043,452.00	2.88
38	600320	振华重工	7,925,689.00	2.84
39	002340	格林美	7,886,816.00	2.82
40	002156	通富微电	7,866,933.00	2.82
41	600150	中国船舶	7,859,700.00	2.81
42	002782	可立克	7,840,353.00	2.81
43	000157	中联重科	7,834,532.50	2.80
44	300232	洲明科技	7,729,467.00	2.77
45	300857	协创数据	7,697,395.00	2.76
46	002815	崇达技术	7,694,680.00	2.75
47	300775	三角防务	7,558,989.95	2.71
48	000951	中国重汽	7,432,446.00	2.66
49	600372	中航机载	7,425,289.00	2.66
50	600066	宇通客车	7,382,523.00	2.64
51	688041	海光信息	7,243,379.23	2.59
52	300296	利亚德	7,220,580.00	2.58
53	002284	亚太股份	7,096,293.00	2.54
54	000733	振华科技	7,029,587.88	2.52
55	600584	长电科技	6,965,310.22	2.49
56	688008	澜起科技	6,857,889.93	2.46
57	688390	固德威	6,854,415.61	2.45
58	300539	横河精密	6,851,851.00	2.45
59	002236	大华股份	6,796,064.48	2.43
60	300408	三环集团	6,701,419.00	2.40
61	002436	兴森科技	6,646,235.00	2.38
62	002106	莱宝高科	6,593,788.00	2.36
63	600741	华域汽车	6,524,187.00	2.34
64	000425	徐工机械	6,460,849.00	2.31
65	002415	海康威视	6,420,575.00	2.30
66	300438	鹏辉能源	6,387,799.00	2.29
67	600031	三一重工	6,371,687.00	2.28

68	603298	杭叉集团	6,256,717.07	2.24
69	300750	宁德时代	6,239,357.00	2.23
70	603659	璞泰来	6,216,184.00	2.23
71	003031	中瓷电子	6,213,462.00	2.22
72	600552	凯盛科技	6,188,537.00	2.22
73	301566	达利凯普	6,175,879.00	2.21
74	603985	恒润股份	6,104,382.00	2.19
75	000338	潍柴动力	6,071,292.00	2.17
76	300696	爱乐达	6,068,513.00	2.17
77	300473	德尔股份	6,041,013.00	2.16
78	002079	苏州固锝	6,038,327.00	2.16
79	301517	陕西华达	5,998,892.00	2.15
80	600660	福耀玻璃	5,990,103.15	2.14
81	000823	超声电子	5,941,197.00	2.13
82	688375	国博电子	5,938,104.12	2.13
83	300259	新天科技	5,899,938.00	2.11
84	002465	海格通信	5,889,913.00	2.11
85	300604	长川科技	5,875,617.00	2.10
86	603606	东方电缆	5,866,851.60	2.10
87	603915	国茂股份	5,767,458.00	2.06
88	600398	海澜之家	5,762,163.00	2.06
89	603267	鸿远电子	5,691,552.00	2.04
90	000050	深天马 A	5,679,665.24	2.03
91	002925	盈趣科技	5,663,904.94	2.03
92	688187	时代电气	5,639,445.45	2.02
93	300671	富满微	5,615,800.40	2.01
94	601717	中创智领	5,604,188.00	2.01
95	300227	光韵达	5,593,408.00	2.00

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	1,982,295,642.78
卖出股票收入（成交）总额	2,086,971,396.14

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	5,448,138.03	2.29
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	549,465.76	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,997,603.79	2.52

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827.SH	26 国债 01	26,000	2,616,852.99	1.10
2	019792.SH	25 国债 19	20,000	2,021,184.66	0.85
3	019785.SH	25 国债 13	8,000	810,100.38	0.34
4	123267.SZ	珂玛转债	691	303,761.29	0.13
5	123274.SZ	维科转债	2,041	204,104.47	0.09

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，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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。

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约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	292,726.59
2	应收清算款	1,916,134.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	683,309.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,892,171.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113696.SH	伯 25 转债	41,600.00	0.02

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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发制造智选股票发起式 A	924	42,331.37	10,476,703.44	26.78%	28,637,485.23	73.22%
广发制造智选股票发起式 C	2,450	39,559.81	9,810,328.75	10.12%	87,111,198.66	89.88%
合计	3,374	40,318.83	20,287,032.19	14.91%	115,748,683.89	85.09%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	89.57%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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	广发制造智选股票发起	194,058.12	0.4961%

有本基金	式 A		
	广发制造智选股票发起 式 C	254,876.92	0.2630%
	合计	448,935.04	0.3300%

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发制造智选股票发起 式 A	0
	广发制造智选股票发起 式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发制造智选股票发起 式 A	0
	广发制造智选股票发起 式 C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,472,380.23	7.70%	10,002,289.03	7.35%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	32,550.49	0.02%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,504,930.72	7.72%	10,002,289.03	7.35%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发制造智选股票发起式 A	广发制造智选股票发起式 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 12 日）基金份额总额	34,432,455.05	87,410,655.01
本报告期期初基金份额总额	48,034,885.69	148,565,531.08
本报告期基金总申购份额	17,491,742.63	195,967,643.84
减：本报告期基金总赎回份额	26,412,439.65	247,611,647.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,114,188.67	96,921,527.41

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

本基金管理人于 2026 年 2 月 14 日发布公告，自 2026 年 2 月 13 日起，傅友兴先生离任公司副总经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及本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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
长江证券	2	3,901,630,273.84	95.92%	721,813.49	90.88%	-
中国银河	2	166,065,844.46	4.08%	72,404.70	9.12%	-
国泰海通	1	5,650.00	0.00%	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
中信建投证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

注：1、选择标准

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；
- (2) 内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；
- (3) 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；
- (4) 具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；
- (5) 具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；
- (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。

10.7.2 基金租用或者通过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
长江证券	5,932,832.70	95.60%	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	273,200.00	4.40%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发制造智选股票型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-12
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
4	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-01
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22
6	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-21
7	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-------	----------------	------------

类别	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	20260101-20260115,20260304-20260415	42,170,368.29	16,720,171.21	58,890,539.50	-	-
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会注册广发制造智选股票型发起式证券投资基金募集的文件
- （二）《广发制造智选股票型发起式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）《广发制造智选股票型发起式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 168 号星河湾中心 28-38 层；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

二〇二六年八月三十一日