

广发多策略灵活配置混合型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
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	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53

8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	55
9 开放式基金份额变动	55
10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	56
10.8 其他重大事件	59
11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发多策略混合
基金主代码	001763
交易代码	001763
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 9 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	231,558,722.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过大类资产的合理配置，结合市场环境灵活调整投资策略，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数+50%×中证全债指数
风险收益特征	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和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	郭明
	联系电话	020-83936666	(010) 66105799
	电子邮箱	xiangji@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-34281105	(010) 66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	葛长伟	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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）
本期已实现收益	43,229,979.78
本期利润	20,665,693.85
加权平均基金份额本期利润	0.0734
本期加权平均净值利润率	4.01%
本期基金份额净值增长率	2.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	136,549,727.36

期末可供分配基金份额利润	0.5897
期末基金资产净值	425,621,979.17
期末基金份额净值	1.838
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	83.80%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.37%	1.07%	6.60%	0.63%	1.77%	0.44%
过去六个月	2.91%	1.18%	5.04%	0.57%	-2.13%	0.61%
过去一年	17.37%	1.06%	13.76%	0.51%	3.61%	0.55%
过去三年	4.02%	1.22%	23.16%	0.55%	-19.14%	0.67%
过去五年	5.03%	1.17%	11.67%	0.55%	-6.64%	0.62%
过去七年	103.54%	1.19%	37.28%	0.57%	66.26%	0.62%
过去十年	92.66%	1.14%	61.24%	0.57%	31.42%	0.57%
自基金合同生效起至今	83.80%	1.14%	53.39%	0.59%	30.41%	0.55%

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

广发多策略灵活配置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
(2015 年 12 月 9 日至 2026 年 6 月 30 日)



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		
林英睿	本基金的基金 经理；广发睿 毅领先混合型 证券投资基金的 基金经理； 广发聚富开放	2016-12-1 6	-	15 年	林英睿先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任瑞银证券研究员，中欧基金管理有限公司基金经理助理兼研究员、基金经理，广发基金管理有限公司权益投资一部研究员、广

	式证券投资基金的基金经理；广发价值领先混合型证券投资基金的基金经理；广发集祥债券型证券投资基金的基金经理；稳健策略部总经理				发鑫睿一年持有期混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 9 日至 2026 年 6 月 3 日)、广发睿恒进取一年持有期混合型证券投资基金基金经理(自 2022 年 2 月 8 日至 2026 年 6 月 3 日)、广发睿合混合型证券投资基金基金经理(自 2022 年 3 月 25 日至 2026 年 6 月 3 日)、广发消费品精选混合型证券投资基金基金经理(自 2024 年 3 月 29 日至 2026 年 6 月 3 日)。
丁一凡	本基金的基金经理	2025-10-16	-	8 年	丁一凡先生，中国籍，金融硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，广发基金管理有限公司价值投资部研究员、稳健策略部投资经理。

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

3.自 2026 年 7 月 10 日起，林英睿不再担任本基金的基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
林英睿	公募基金	5	4,837,207,155.05	2016-12-16
	私募资产管理计划	1	322,253,565.97	2023-04-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	5,159,460,721.02	

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，A 股市场整体呈现震荡上行走势，但内部结构分化极为显著。一季度，受海外地缘政治局势反复及国际油价上涨等因素影响，市场宽幅震荡；二季度，随着地缘政治紧张格局阶段性缓和，风险偏好有所修复，指数震荡回升。市场回升主要由人工智能产业链等高景气成长板块引领，红利价值及顺周期板块整体表现偏弱。

当前，市场估值已升至历史中高分位，整体继续快速上行的空间相对有限。宏观层面，海外地缘政治与能源价格仍存不确定性，全球通胀预期虽有波动但仍处相对高位，主要经济体货币政策的宽松节奏面临一定制约。国内方面，稳增长政策持续发力，经济呈现边际企稳迹象，但复苏的基础尚不牢固，企业盈利的修复仍需时间验证。

“分散化是投资中唯一的免费午餐”，我们秉持这一理念，采用多策略配置的方法，通过配置多个低相关且长期表现优秀的策略，以降低组合的波动，平滑组合的业绩表现，期望在任何市场环境下都能实现稳定的超额收益。

具体而言，我们通过基本面逻辑和定量相结合的方法，筛选投资逻辑清晰、长期具备超额收益的风格策略，并对各策略进行持续的优化和迭代，使其在特定风格内部具备稳定的选股 alpha，同时在风格占优时具备足够的弹性。在此基础上，我们综合考虑各策略的风险收益特征及相关性，通过系统化的组合管理进行均衡配置，构建相对稳健的超额收益曲线。

相较于纯 alpha 策略，通过风格配置方法获取的超额收益可能长期存在而不易衰减，但其超额的波动相对会更大，阶段性的回撤也会更多。因此，在均衡配置策略的基础上，我们通过自上而下的宏观和市场的定量分析，动态的调整策略配比或者增加新的策略类别，在牛市中增强组合的弹性，在熊市中有效控制波动与回撤。

本产品定位为中高波动的灵活配置型产品。我们将根据宏观周期变化及市场交易特征，灵活调整股票与债券等大类资产的配置比例，以优化组合的风险收益结构，努力为投资者提供具备较高风险收益性价比的产品表现。

报告期内，根据宏观和市场数据给出的信号，产品阶段性地提高了权益仓位，以增加收益的弹性。6 月份以来，部分高景气板块的交易拥挤度和估值水平再度抬升，市场结构脆弱性有所增加。基于风险控制考虑，我们适时将组合仓位调整至中枢水平，并对内部结构进行再平衡，整体配置更加均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 2.91%，同期业绩比较基准收益率为 5.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，极端的结构分化难以长期持续，市场风格有望逐步趋于收敛与再平衡。一方面，以人工智能为核心的科技成长板块经过前期持续演绎后，部分细分领域的估值已接近历史高位，对未来业绩兑现的要求显著提高，其投资逻辑将从预期驱动转向业绩驱动，波动与分化或将进一步加剧。另一方面，传统周期及价值类板块的估值仍处相对低位，随着国内稳地产、促消费等政策效果逐步显现，以及部分行业供需格局和库存周期的边际改善，其基本面有望迎来修复契机，当前定价所隐含的悲观预期存在修正空间，风险收益比优势正在显现。

总体而言，下半年市场的投资机会有望从单一主线的集中演绎，向更加多元、更加均衡的结构行情过渡。在此环境下，我们将继续秉持多资产、多策略的分散化配置理念，保持组合的整体均

衡，并动态跟踪宏观环境与市场估值的变化，关注基本面出现边际改善且估值合理的方向，力求在控制组合波动的前提下，实现更为稳健的绝对收益与超额收益。

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

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

了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发多策略灵活配置混合型证券投资基金

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	118,020,036.66	61,402,604.96
结算备付金		20,731,322.33	21,885,512.30
存出保证金		2,844,133.37	100,548.79
交易性金融资产	6.4.7.2	290,623,552.60	614,793,840.32
其中：股票投资		290,567,648.04	614,789,559.31
基金投资		-	-
债券投资		55,904.56	4,281.01
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		6,472.94	2,122,242.99
应收股利		-	-
应收申购款		40,846.37	158,653.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		432,266,364.27	700,463,402.38
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		3,103.75	-
应付赎回款		5,438,513.10	1,917,666.14
应付管理人报酬		436,789.07	674,772.85
应付托管费		72,798.16	112,462.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.21	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	693,180.81	630,168.22
负债合计		6,644,385.10	3,335,069.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	231,558,722.64	390,325,952.74
未分配利润	6.4.7.9	194,063,256.53	306,802,380.28
净资产合计		425,621,979.17	697,128,333.02
负债和净资产总计		432,266,364.27	700,463,402.38

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.838 元，基金份额总额 231,558,722.64 份。

6.2 利润表

会计主体：广发多策略灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		24,344,773.44	-16,199,450.79
1. 利息收入		193,345.31	269,982.26
其中：存款利息收入	6.4.7.10	193,345.31	269,982.26
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）		46,185,511.95	-8,625,892.44
其中：股票投资收益	6.4.7.11	44,072,262.47	-4,623,641.46
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5.56	88,514.07
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	-609,458.52	-5,356,301.31
股利收益	6.4.7.17	2,722,702.44	1,265,536.26
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	-22,564,285.93	-7,942,265.12
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	530,202.11	98,724.51
减：二、营业总支出		3,679,079.59	4,632,031.96
1. 管理人报酬		3,070,423.35	3,879,783.95
2. 托管费		511,737.16	646,630.68
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.02	8,726.41
8. 其他费用	6.4.7.21	96,919.06	96,890.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		20,665,693.85	-20,831,482.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,665,693.85	-20,831,482.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,665,693.85	-20,831,482.75

6.3 净资产变动表

会计主体：广发多策略灵活配置混合型证券投资基金

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	390,325,952.74	306,802,380.28	697,128,333.02
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	390,325,952.74	306,802,380.28	697,128,333.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-158,767,230.10	-112,739,123.75	-271,506,353.85
（一）、综合收益总额	-	20,665,693.85	20,665,693.85
（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）	-158,767,230.10	-133,404,817.60	-292,172,047.70
其中：1. 基金申购款	13,606,468.27	11,231,237.97	24,837,706.24
2. 基金赎回款	-172,373,698.37	-144,636,055.57	-317,009,753.94
（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	231,558,722.64	194,063,256.53	425,621,979.17
项目	上年度可比期间 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	448,486,271.98	273,848,463.91	722,334,735.89
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	448,486,271.98	273,848,463.91	722,334,735.89

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,539,703.23	-49,563,965.53	-102,103,668.76
（一）、综合收益总额	-	-20,831,482.75	-20,831,482.75
（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）	-52,539,703.23	-28,732,482.78	-81,272,186.01
其中：1.基金申购款	34,016,257.16	19,480,754.02	53,497,011.18
2.基金赎回款	-86,555,960.39	-48,213,236.80	-134,769,197.19
（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	395,946,568.75	224,284,498.38	620,231,067.13

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

广发多策略灵活配置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[2015]1759 号《关于准予广发多策略灵活配置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《广发多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2015 年 11 月 09 日向社会公开发行人募集并于 2015 年 12 月 09 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2015 年 11 月 09 日至 2015 年 12 月 04 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 5,613,599,931.88 元，有效认购户数为 70,190 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 859,508.63 元，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。上述资金业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	118,020,036.66
等于：本金	118,009,408.00
加：应计利息	10,628.66
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	118,020,036.66

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		300,060,827.83	-	290,567,648.04	-9,493,179.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	55,000.00	6.96	55,904.56	897.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	55,000.00	6.96	55,904.56	897.60

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	300,115,827.83	6.96	290,623,552.60	-9,492,282.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	18,872,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	18,872,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,872,040.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2607	IM2607	11.00	19,117,120.00	245,080.00
合计	-	-	-	245,080.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	245,080.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为期货投资。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。

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	11,630.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	593,739.23
其中：交易所市场	593,739.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,810.68
合计	693,180.81

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	390,325,952.74	390,325,952.74
本期申购	13,606,468.27	13,606,468.27
本期赎回（以“-”号填列）	-172,373,698.37	-172,373,698.37
本期末	231,558,722.64	231,558,722.64

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	168,925,736.87	137,876,643.41	306,802,380.28
本期期初	168,925,736.87	137,876,643.41	306,802,380.28
本期利润	43,229,979.78	-22,564,285.93	20,665,693.85
本期基金份额交易产生的变动数	-75,605,989.29	-57,798,828.31	-133,404,817.60
其中：基金申购款	6,497,248.79	4,733,989.18	11,231,237.97
基金赎回款	-82,103,238.08	-62,532,817.49	-144,636,055.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,549,727.36	57,513,529.17	194,063,256.53

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	112,370.27
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	80,346.29
其他	628.75
合计	193,345.31

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	44,072,262.47
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	44,072,262.47

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	1,661,430,399.09
减：卖出股票成本总额	1,615,040,619.26
减：交易费用	2,317,517.36
买卖股票差价收入	44,072,262.47

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	5.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	5.56

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	-609,458.52

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	2,722,702.44
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	2,722,702.44

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	-22,809,365.93
——股票投资	-22,808,983.73
——债券投资	-382.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	245,080.00
——权证投资	-
——股指期货投资	245,080.00
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	-22,564,285.93

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	516,422.50
基金转换费收入	13,779.61
合计	530,202.11

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	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,608.38
账户维护费	9,000.00
合计	96,919.06

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的子公司

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	4,296,916.47	0.14%	626,090.26	0.05%

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	-	-	83,000.00	7.36%

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 2026 年 1 月 1 日 至 2026 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	1,628.20	0.13%	924.44	0.16%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 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	237.91	0.04%	-	-

- 注：1、本基金的交易佣金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、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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,070,423.35	3,879,783.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,009,211.74	1,146,050.24
应支付基金管理人的净管理费	2,061,211.61	2,733,733.71

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1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	511,737.16	646,630.68

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%。

6.4.10.3 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

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

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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1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
中国工商银行股份有限公司	118,020,036.66	112,370.27	70,694,726.26	176,624.85

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

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	688.00	31,703.04	318,771.04	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通	22.68	42.16	4,571.00	103,670.28	192,713.36	-

	-UW			受限						
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	116.00	9,498.08	183,782.28	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	13,855.00	140,074.05	140,074.05	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	666.00	13,106.88	94,232.34	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	172.00	7,664.32	80,611.24	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	466.00	32,461.56	74,587.96	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	2,271.00	22,982.52	62,974.83	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内 (含)	新股流通受限	10.11	10.11	5,937.00	60,023.07	60,023.07	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
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	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	299.00	5,292.30	25,211.68	-
68881	有研	2026-0	6 个月	新股	6.41	24.13	834.00	5,345.	20,124	-

1	复材	4-01		流通受限				94	.42	
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	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	503.00	13,676.57	15,748.93	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
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	-
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	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	353.00	10,724.14	13,763.47	-
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	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	210.00	11,184.60	12,335.40	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	623.00	6,965.14	10,958.57	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
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	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-

603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
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
118069	爱科转债	2026-06-12	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	520.00	52,000.00	52,004.56	-

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

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	1,470.00	736,829.88	1,292,909.10	-
603137	恒尚节能	2026-06-16	重大事项停牌	12.94	2026-07-01	14.23	36,500.00	434,200.00	472,310.00	-
688121	卓然股份	2026-05-06	重大事项停牌	6.48	2026-07-07	5.18	34,730.00	339,453.85	225,050.40	-

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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

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	55,904.56	4,281.01
未评级	-	-

合计	55,904.56	4,281.01
----	-----------	----------

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	118,020,036.66	-	-	-	118,020,036.66
结算备付金	20,731,322.33	-	-	-	20,731,322.33
存出保证金	2,844,133.37	-	-	-	2,844,133.37
交易性金融资产	55,904.56	-	-	290,567,648.04	290,623,552.60
应收清算款	-	-	-	6,472.94	6,472.94
应收申购款	-	-	-	40,846.37	40,846.37
资产总计	141,651,396.92	-	-	290,614,967.35	432,266,364.27
负债					
应付清算款	-	-	-	3,103.75	3,103.75
应付赎回款	-	-	-	5,438,513.10	5,438,513.10
应付管理人报酬	-	-	-	436,789.07	436,789.07
应付托管费	-	-	-	72,798.16	72,798.16
应交税费	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	693,180.81	693,180.81
负债总计	-	-	-	6,644,385.10	6,644,385.10
利率敏感度缺口	141,651,396.92	-	-	283,970,582.25	425,621,979.17
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	61,402,604.96	-	-	-	61,402,604.96
结算备付金	21,885,512.30	-	-	-	21,885,512.30
存出保证金	100,548.79	-	-	-	100,548.79
交易性金融资产	4,281.01	-	-	614,789,559.31	614,793,840.32

应收清算款	-	-	-	2,122,242.99	2,122,242.99
应收申购款	-	-	-	158,653.02	158,653.02
资产总计	83,392,947.06	-	-	617,070,455.32	700,463,402.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,917,666.14	1,917,666.14
应付管理人报酬	-	-	-	674,772.85	674,772.85
应付托管费	-	-	-	112,462.15	112,462.15
其他负债	-	-	-	630,168.22	630,168.22
负债总计	-	-	-	3,335,069.36	3,335,069.36
利率敏感度缺口	83,392,947.06	-	-	613,735,385.96	697,128,333.02

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

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

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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	290,567,648.04	68.27	614,789,559.31	88.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	55,904.56	0.01	4,281.01	0.00
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	290,623,552.60	68.28	614,793,840.32	88.19

注：其他包含在期货交易所的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。

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%	15,828,015.48	33,068,615.36
	下降 5%	-15,828,015.48	-33,068,615.36

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	286,800,339.69
第二层次	2,242,371.18
第三层次	1,580,841.73
合计	290,623,552.60

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	290,567,648.04	67.22
	其中：股票	290,567,648.04	67.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,904.56	0.01
	其中：债券	55,904.56	0.01
	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	138,751,358.99	32.10
8	其他各项资产	2,891,452.68	0.67
9	合计	432,266,364.27	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	2,922,875.00	0.69
B	采矿业	8,393,190.82	1.97
C	制造业	162,032,548.86	38.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,334,349.12	2.90
E	建筑业	4,102,686.00	0.96
F	批发和零售业	8,549,002.00	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	17,015,337.49	4.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,099,177.40	3.55
J	金融业	41,787,076.10	9.82
K	房地产业	3,538,122.00	0.83
L	租赁和商务服务业	1,695,161.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	6,210,991.25	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	5,687,140.00	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	406,260.00	0.10
Q	卫生和社会工作	793,731.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	290,567,648.04	68.27

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	300308	中际旭创	2,300	2,921,000.00	0.69
2	603986	兆易创新	3,500	2,852,500.00	0.67
3	300750	宁德时代	5,400	2,122,254.00	0.50
4	002384	东山精密	7,000	1,836,450.00	0.43
5	300475	香农芯创	6,000	1,800,000.00	0.42
6	600487	亨通光电	16,400	1,793,176.00	0.42
7	301377	鼎泰高科	3,200	1,762,880.00	0.41
8	600177	雅戈尔	219,500	1,652,835.00	0.39
9	600900	长江电力	61,200	1,619,964.00	0.38
10	300666	江丰电子	4,100	1,511,260.00	0.36
11	000651	格力电器	40,300	1,511,250.00	0.36
12	601988	中国银行	261,500	1,495,780.00	0.35
13	688630	芯碁微装	2,636	1,448,192.04	0.34
14	600176	中国巨石	19,700	1,435,736.00	0.34
15	601000	唐山港	343,900	1,427,185.00	0.34
16	601211	国泰海通	74,200	1,350,440.00	0.32
17	601166	兴业银行	81,200	1,344,672.00	0.32
18	688256	寒武纪	840	1,340,262.00	0.31
19	600023	浙能电力	253,500	1,333,410.00	0.31
20	688368	晶丰明源	6,103	1,321,421.56	0.31
21	301200	大族数控	3,600	1,298,340.00	0.31
22	601088	中国神华	33,200	1,296,128.00	0.30
23	688002	睿创微纳	8,370	1,294,755.30	0.30
24	001965	招商公路	141,200	1,293,392.00	0.30
25	688072	拓荆科技	1,470	1,292,909.10	0.30
26	600008	首创环保	465,600	1,266,432.00	0.30
27	600150	中国船舶	37,000	1,250,230.00	0.29
28	688308	欧科亿	6,843	1,244,125.83	0.29
29	600015	华夏银行	192,800	1,231,992.00	0.29
30	300054	鼎龙股份	11,600	1,229,252.00	0.29
31	001309	德明利	1,300	1,225,770.00	0.29
32	002837	英维克	15,380	1,223,632.80	0.29
33	601318	中国平安	25,600	1,222,144.00	0.29
34	688525	佰维存储	2,383	1,178,941.59	0.28
35	688498	源杰科技	624	1,176,864.00	0.28
36	600036	招商银行	32,900	1,167,950.00	0.27
37	601577	长沙银行	133,400	1,161,914.00	0.27
38	002839	张家港行	294,600	1,148,940.00	0.27
39	601229	上海银行	130,600	1,133,608.00	0.27
40	300201	海伦哲	53,600	1,129,352.00	0.27
41	002807	江阴银行	301,950	1,120,234.50	0.26
42	601208	东材科技	15,800	1,118,482.00	0.26

43	601328	交通银行	171,600	1,103,388.00	0.26
44	601838	成都银行	62,300	1,102,710.00	0.26
45	000429	粤高速 A	80,400	1,097,460.00	0.26
46	600901	江苏金租	190,100	1,093,075.00	0.26
47	002371	北方华创	1,235	1,092,431.60	0.26
48	600887	伊利股份	45,100	1,080,596.00	0.25
49	000001	平安银行	107,300	1,078,365.00	0.25
50	688012	中微公司	2,300	1,077,550.00	0.25
51	301536	星宸科技	8,300	1,068,293.00	0.25
52	300037	新宙邦	11,500	1,067,775.00	0.25
53	601899	紫金矿业	42,300	1,063,422.00	0.25
54	601668	中国建筑	242,700	1,053,318.00	0.25
55	688392	骄成超声	4,612	1,047,754.16	0.25
56	600350	山东高速	93,700	1,042,881.00	0.25
57	000895	双汇发展	46,300	1,037,120.00	0.24
58	688652	京仪装备	5,171	1,035,079.07	0.24
59	601916	浙商银行	390,200	1,026,226.00	0.24
60	600522	中天科技	16,900	1,025,492.00	0.24
61	688008	澜起科技	3,300	1,022,670.00	0.24
62	601658	邮储银行	207,400	1,022,482.00	0.24
63	002851	麦格米特	6,100	1,019,798.00	0.24
64	002080	中材科技	11,300	1,017,000.00	0.24
65	600461	洪城环境	112,200	1,016,532.00	0.24
66	601818	光大银行	351,000	1,014,390.00	0.24
67	600674	川投能源	71,100	1,007,487.00	0.24
68	688531	日联科技	5,626	1,000,527.84	0.24
69	600820	隧道股份	190,100	990,421.00	0.23
70	601985	中国核电	109,300	986,979.00	0.23
71	601939	建设银行	102,000	982,260.00	0.23
72	688059	华锐精密	4,916	981,774.36	0.23
73	603588	高能环境	50,800	975,360.00	0.23
74	688388	嘉元科技	22,121	973,324.00	0.23
75	601997	贵阳银行	189,500	972,135.00	0.23
76	000333	美的集团	12,800	966,784.00	0.23
77	600016	民生银行	299,300	963,746.00	0.23
78	601825	沪农商行	128,300	960,967.00	0.23
79	688025	杰普特	2,028	953,160.00	0.22
80	001389	广合科技	4,000	949,000.00	0.22
81	600908	无锡银行	186,700	948,436.00	0.22
82	600941	中国移动	11,010	948,291.30	0.22
83	601128	常熟银行	162,250	944,295.00	0.22
84	600999	招商证券	44,100	930,510.00	0.22
85	000538	云南白药	19,600	928,452.00	0.22
86	688981	中芯国际	5,800	921,156.00	0.22

87	003816	中国广核	233,900	914,549.00	0.21
88	603259	药明康德	7,300	908,923.00	0.21
89	601963	重庆银行	89,500	902,160.00	0.21
90	300861	美畅股份	35,780	901,298.20	0.21
91	601169	北京银行	183,500	899,150.00	0.21
92	601998	中信银行	129,200	895,356.00	0.21
93	688041	海光信息	2,400	888,720.00	0.21
94	688536	思瑞浦	2,434	886,195.06	0.21
95	600919	江苏银行	82,000	883,960.00	0.21
96	601187	厦门银行	128,300	876,289.00	0.21
97	002966	苏州银行	125,500	873,480.00	0.21
98	000088	盐田港	212,200	867,898.00	0.20
99	603323	苏农银行	224,180	867,576.60	0.20
100	600352	浙江龙盛	71,500	865,865.00	0.20
101	000975	山金国际	50,861	864,637.00	0.20
102	601006	大秦铁路	187,400	863,914.00	0.20
103	600063	皖维高新	112,700	856,520.00	0.20
104	600030	中信证券	29,700	853,281.00	0.20
105	601009	南京银行	86,200	852,518.00	0.20
106	002008	大族激光	5,600	840,616.00	0.20
107	688083	中望软件	12,924	836,829.00	0.20
108	600028	中国石化	184,400	822,424.00	0.19
109	601298	青岛港	101,900	820,295.00	0.19
110	001286	陕西能源	80,700	818,298.00	0.19
111	600377	宁沪高速	70,600	816,842.00	0.19
112	601728	中国电信	155,800	808,602.00	0.19
113	601766	中国中车	154,200	801,840.00	0.19
114	600018	上港集团	168,600	795,792.00	0.19
115	603195	公牛集团	20,000	783,000.00	0.18
116	301548	崇德科技	8,800	781,176.00	0.18
117	002958	青农商行	284,800	780,352.00	0.18
118	600000	浦发银行	89,800	773,178.00	0.18
119	600064	南京高科	108,200	771,466.00	0.18
120	601288	农业银行	126,900	770,283.00	0.18
121	300274	阳光电源	4,800	763,296.00	0.18
122	600886	国投电力	56,000	745,360.00	0.18
123	000988	华工科技	4,000	738,440.00	0.17
124	601077	渝农商行	120,700	737,477.00	0.17
125	601233	桐昆股份	33,800	731,770.00	0.17
126	600926	杭州银行	50,300	726,835.00	0.17
127	603992	松霖科技	22,400	725,760.00	0.17
128	600269	赣粤高速	179,200	713,216.00	0.17
129	600323	瀚蓝环境	25,800	708,468.00	0.17
130	000938	紫光股份	24,200	698,412.00	0.16

131	601699	潞安环能	48,600	694,008.00	0.16
132	920077	吉林碳谷	39,079	693,261.46	0.16
133	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	0.16
134	688009	中国通号	145,300	691,628.00	0.16
135	603638	艾迪精密	29,000	680,050.00	0.16
136	603876	鼎胜新材	26,100	678,861.00	0.16
137	601018	宁波港	212,300	668,745.00	0.16
138	688439	振华风光	14,344	662,692.80	0.16
139	600189	泉阳泉	87,200	656,616.00	0.15
140	600332	白云山	32,700	655,308.00	0.15
141	600017	日照港	261,100	652,750.00	0.15
142	002928	华夏航空	93,167	651,237.33	0.15
143	002558	巨人网络	23,400	644,904.00	0.15
144	002810	山东赫达	26,100	644,670.00	0.15
145	002948	青岛银行	126,700	643,636.00	0.15
146	601860	紫金银行	263,300	637,186.00	0.15
147	688258	卓易信息	5,372	636,796.88	0.15
148	002250	联化科技	45,900	627,453.00	0.15
149	603901	永创智能	57,600	626,112.00	0.15
150	002838	道恩股份	20,400	624,648.00	0.15
151	300604	长川科技	1,800	614,556.00	0.14
152	000858	五粮液	8,300	614,200.00	0.14
153	002466	天齐锂业	10,000	613,200.00	0.14
154	603091	众鑫股份	12,460	607,674.20	0.14
155	600882	妙可蓝多	37,800	604,422.00	0.14
156	002120	韵达股份	95,000	604,200.00	0.14
157	300124	汇川技术	9,100	603,603.00	0.14
158	002812	恩捷股份	9,000	602,190.00	0.14
159	301219	腾远钴业	10,920	598,416.00	0.14
160	300953	震裕科技	4,460	596,302.00	0.14
161	002922	伊戈尔	18,000	590,400.00	0.14
162	002493	荣盛石化	54,900	590,175.00	0.14
163	601816	京沪高铁	129,700	587,541.00	0.14
164	600874	创业环保	109,000	584,240.00	0.14
165	600511	国药股份	22,400	583,296.00	0.14
166	000598	兴蓉环境	90,700	582,294.00	0.14
167	300073	当升科技	12,100	581,284.00	0.14
168	300857	协创数据	1,700	577,830.00	0.14
169	000949	新乡化纤	91,100	577,574.00	0.14
170	600037	歌华有线	91,700	574,959.00	0.14
171	600346	恒力石化	32,400	573,804.00	0.13
172	603799	华友钴业	11,700	564,642.00	0.13
173	301358	湖南裕能	7,400	561,438.00	0.13
174	600309	万华化学	8,200	560,962.00	0.13

175	600584	长电科技	5,400	559,170.00	0.13
176	688095	福昕软件	9,377	557,275.11	0.13
177	600598	北大荒	51,200	555,008.00	0.13
178	002028	思源电气	3,200	553,600.00	0.13
179	600033	福建高速	171,500	552,230.00	0.13
180	002156	通富微电	7,200	546,264.00	0.13
181	688226	威腾电气	12,672	542,741.76	0.13
182	300919	中伟新材	12,400	542,500.00	0.13
183	600928	西安银行	164,300	537,261.00	0.13
184	600595	中孚实业	95,400	536,148.00	0.13
185	002780	三夫户外	44,000	534,160.00	0.13
186	000973	佛塑科技	37,000	530,950.00	0.12
187	000807	云铝股份	23,900	529,146.00	0.12
188	002497	雅化集团	25,700	523,509.00	0.12
189	002738	中矿资源	8,800	519,112.00	0.12
190	002487	大金重工	8,900	515,933.00	0.12
191	301187	欧圣电气	35,800	512,298.00	0.12
192	601319	中国人保	75,200	508,352.00	0.12
193	603885	吉祥航空	49,030	504,518.70	0.12
194	002179	中航光电	10,900	503,580.00	0.12
195	002600	领益智造	28,900	501,126.00	0.12
196	605117	德业股份	4,700	499,046.00	0.12
197	601225	陕西煤业	24,500	498,575.00	0.12
198	002049	紫光国微	5,600	497,000.00	0.12
199	688670	金迪克	29,300	496,342.00	0.12
200	601568	北元化工	145,400	494,360.00	0.12
201	000563	陕国投 A	178,900	493,764.00	0.12
202	601069	西部黄金	21,900	481,800.00	0.11
203	600460	士兰微	8,800	481,008.00	0.11
204	000568	泸州老窖	6,200	480,624.00	0.11
205	600938	中国海油	17,700	480,555.00	0.11
206	002422	科伦药业	12,400	477,648.00	0.11
207	688469	芯联集成-U	44,700	474,267.00	0.11
208	603137	恒尚节能	36,500	472,310.00	0.11
209	601127	赛力斯	7,600	465,500.00	0.11
210	300568	星源材质	24,800	464,256.00	0.11
211	002078	太阳纸业	37,100	463,379.00	0.11
212	600025	华能水电	52,000	462,280.00	0.11
213	600885	宏发股份	13,400	462,166.00	0.11
214	002027	分众传媒	95,400	461,736.00	0.11
215	688213	思特威-W	4,307	461,150.49	0.11
216	601607	上海医药	29,800	458,920.00	0.11
217	600489	中金黄金	25,300	456,665.00	0.11
218	000625	长安汽车	62,900	450,993.00	0.11

219	603019	中科曙光	4,200	450,366.00	0.11
220	600104	上汽集团	46,100	449,936.00	0.11
221	600547	山东黄金	19,300	445,637.00	0.10
222	000960	锡业股份	10,400	443,976.00	0.10
223	002185	华天科技	19,800	441,738.00	0.10
224	600989	宝丰能源	21,700	441,161.00	0.10
225	002828	贝肯能源	41,700	440,769.00	0.10
226	000066	中国长城	23,000	438,150.00	0.10
227	600436	片仔癀	4,000	437,120.00	0.10
228	300017	网宿科技	33,500	435,835.00	0.10
229	002195	岩山科技	66,600	435,564.00	0.10
230	300001	特锐德	11,500	435,045.00	0.10
231	301390	经纬股份	13,400	432,284.00	0.10
232	600897	厦门空港	29,600	432,160.00	0.10
233	300724	捷佳伟创	6,100	430,660.00	0.10
234	600717	天津港	110,700	430,623.00	0.10
235	300778	新城市	45,000	429,750.00	0.10
236	300635	中达安	35,300	429,601.00	0.10
237	605177	东亚药业	25,000	427,750.00	0.10
238	002131	利欧股份	89,900	427,025.00	0.10
239	300564	筑博设计	35,500	426,355.00	0.10
240	600418	江淮汽车	16,500	426,195.00	0.10
241	300640	德艺文创	75,700	426,191.00	0.10
242	300838	浙江力诺	31,900	425,865.00	0.10
243	300694	蠡湖股份	44,300	425,280.00	0.10
244	301336	趣睡科技	10,580	422,671.00	0.10
245	300803	指南针	4,600	421,682.00	0.10
246	000547	航天发展	22,000	421,300.00	0.10
247	300169	天晟新材	84,100	419,659.00	0.10
248	300118	东方日升	33,700	419,565.00	0.10
249	301355	南王科技	42,800	418,584.00	0.10
250	002595	豪迈科技	8,945	416,837.00	0.10
251	600426	华鲁恒升	17,400	416,208.00	0.10
252	300003	乐普医疗	35,100	415,935.00	0.10
253	300923	研奥股份	18,600	414,408.00	0.10
254	002155	湖南黄金	17,300	412,951.00	0.10
255	688573	信宇人	23,300	412,876.00	0.10
256	688078	龙软科技	19,600	412,580.00	0.10
257	600497	驰宏锌锗	33,900	410,529.00	0.10
258	300612	宣亚国际	37,500	409,875.00	0.10
259	002760	凤形股份	24,900	408,858.00	0.10
260	002266	浙富控股	80,800	408,848.00	0.10
261	688118	普元信息	20,300	408,436.00	0.10
262	300823	建科智能	28,000	408,240.00	0.10

263	688701	卓锦股份	54,200	408,126.00	0.10
264	300122	智飞生物	34,900	407,981.00	0.10
265	688132	邦彦技术	31,000	407,650.00	0.10
266	688217	睿昂基因	19,700	407,002.00	0.10
267	603177	德创环保	49,200	406,884.00	0.10
268	688395	正弦电气	18,400	406,640.00	0.10
269	603860	中公高科	16,800	406,392.00	0.10
270	601567	三星电气	27,200	406,368.00	0.10
271	600455	博通股份	18,500	406,260.00	0.10
272	301163	宏德股份	18,300	405,894.00	0.10
273	300514	友讯达	43,400	405,790.00	0.10
274	300176	鸿特科技	83,600	405,460.00	0.10
275	688393	安必平	22,800	405,384.00	0.10
276	300417	南华仪器	39,500	405,270.00	0.10
277	300937	药易购	21,000	405,090.00	0.10
278	301515	港通医疗	23,100	404,943.00	0.10
279	688060	云涌科技	12,300	404,547.00	0.10
280	688420	美腾科技	19,200	404,544.00	0.10
281	002873	新天药业	55,200	404,064.00	0.09
282	301010	晶雪节能	24,800	403,992.00	0.09
283	688695	中创股份	21,600	403,920.00	0.09
284	000702	正虹科技	81,400	403,744.00	0.09
285	300112	万讯自控	65,200	403,588.00	0.09
286	600515	海南机场	147,200	403,328.00	0.09
287	600149	廊坊发展	89,800	403,202.00	0.09
288	600303	曙光股份	161,800	402,882.00	0.09
289	300605	恒锋信息	43,600	402,864.00	0.09
289	301130	西点药业	16,800	402,864.00	0.09
290	688681	科汇股份	28,800	402,624.00	0.09
291	300645	正元智慧	34,200	402,534.00	0.09
292	000733	振华科技	7,100	402,144.00	0.09
293	688613	奥精医疗	28,500	402,135.00	0.09
294	688638	誉辰智能	12,900	402,093.00	0.09
295	301272	英华特	12,200	401,868.00	0.09
296	603392	万泰生物	14,900	401,853.00	0.09
297	301049	超越科技	22,500	401,850.00	0.09
298	688058	宝兰德	19,200	401,664.00	0.09
299	301006	迈拓股份	32,000	401,600.00	0.09
300	002820	桂发祥	47,800	401,520.00	0.09
301	688092	爱科科技	18,900	401,436.00	0.09
302	603900	莱绅通灵	71,300	401,419.00	0.09
303	002188	中天服务	81,900	401,310.00	0.09
304	002535	林州重机	182,400	401,280.00	0.09
305	300642	透景生命	34,000	401,200.00	0.09

306	300896	爱美客	4,600	401,120.00	0.09
307	300549	优德精密	30,800	401,016.00	0.09
308	002968	新大正	47,400	401,004.00	0.09
309	688067	爱威科技	19,900	400,985.00	0.09
310	688616	西力科技	39,700	400,970.00	0.09
311	301505	苏州规划	24,900	400,890.00	0.09
312	000932	华菱钢铁	115,500	400,785.00	0.09
313	300621	维业股份	63,100	400,685.00	0.09
314	301065	本立科技	22,700	400,655.00	0.09
315	600778	友好集团	81,900	400,491.00	0.09
316	600697	欧亚集团	41,200	400,464.00	0.09
317	300405	科隆股份	77,300	400,414.00	0.09
318	000856	冀东装备	56,000	400,400.00	0.09
319	002817	黄山胶囊	68,300	400,238.00	0.09
320	301359	东南电子	25,200	400,176.00	0.09
321	300886	华业香料	20,100	399,990.00	0.09
322	300949	奥雅股份	19,825	399,870.25	0.09
323	688288	鸿泉技术	22,500	399,825.00	0.09
324	603214	爱婴室	33,000	399,630.00	0.09
325	301429	森泰股份	25,500	399,585.00	0.09
326	002949	华阳国际	40,400	399,556.00	0.09
327	002622	皓宸医疗	193,000	399,510.00	0.09
328	002629	仁智股份	92,900	399,470.00	0.09
329	300929	华骐环保	37,900	399,466.00	0.09
330	300535	达威股份	29,300	399,359.00	0.09
331	300074	华平股份	117,400	399,160.00	0.09
332	603208	江山欧派	37,300	399,110.00	0.09
333	603151	邦基科技	36,300	398,937.00	0.09
334	301063	海锅股份	23,800	398,888.00	0.09
335	600540	新赛股份	120,500	398,855.00	0.09
336	603168	莎普爱思	84,500	398,840.00	0.09
337	000663	永安林业	78,200	398,820.00	0.09
338	688004	博汇科技	21,900	398,580.00	0.09
339	300030	阳普医疗	68,600	398,566.00	0.09
340	688528	秦川物联	43,600	398,504.00	0.09
341	600241	时代万恒	61,400	398,486.00	0.09
342	301126	达嘉维康	46,600	398,430.00	0.09
343	300851	交大思诺	17,900	398,275.00	0.09
344	002513	蓝丰生化	83,300	398,174.00	0.09
345	300519	新光药业	33,600	398,160.00	0.09
346	688296	和达科技	34,800	398,112.00	0.09
347	603073	彩蝶实业	26,700	398,097.00	0.09
348	603709	中源家居	29,400	398,076.00	0.09
349	600051	宁波联合	70,700	398,041.00	0.09

350	603183	建研院	112,100	397,955.00	0.09
351	000633	合金投资	83,600	397,936.00	0.09
352	300387	富邦科技	58,600	397,894.00	0.09
353	300614	百川畅银	41,100	397,848.00	0.09
354	002494	华斯股份	89,600	397,824.00	0.09
355	600287	苏豪时尚	90,200	397,782.00	0.09
356	301167	建研设计	32,100	397,719.00	0.09
357	301098	金埔园林	48,500	397,700.00	0.09
358	001231	农心科技	21,800	397,632.00	0.09
359	002205	国统股份	39,400	397,546.00	0.09
360	300517	海波重科	42,200	397,524.00	0.09
360	002247	聚力文化	188,400	397,524.00	0.09
361	603810	丰山集团	35,700	397,341.00	0.09
362	600444	国机通用	30,600	397,188.00	0.09
363	300675	建科院	33,500	396,975.00	0.09
364	301539	宏鑫科技	30,300	396,930.00	0.09
365	600202	哈空调	88,600	396,928.00	0.09
366	000637	茂化实华	113,400	396,900.00	0.09
366	301192	泰祥股份	21,000	396,900.00	0.09
367	600774	汉商集团	63,400	396,884.00	0.09
368	301298	东利机械	34,300	396,851.00	0.09
369	001278	一彬科技	25,800	396,804.00	0.09
370	301113	雅艺科技	26,610	396,755.10	0.09
371	002105	信隆健康	80,300	396,682.00	0.09
372	002696	百洋股份	79,800	396,606.00	0.09
373	301001	凯淳股份	18,300	396,561.00	0.09
374	300947	德必集团	31,100	396,525.00	0.09
375	603029	天鹅股份	28,200	396,492.00	0.09
376	603041	美思德	38,200	396,134.00	0.09
377	688329	艾隆科技	19,600	396,116.00	0.09
378	600137	浪莎股份	24,400	396,012.00	0.09
379	003003	天元股份	39,800	396,010.00	0.09
380	002144	宏达高科	40,200	395,970.00	0.09
381	300126	锐奇股份	68,500	395,930.00	0.09
382	300958	建工修复	37,200	395,808.00	0.09
383	000953	中哲精化	76,700	395,772.00	0.09
384	300240	飞力达	79,300	395,707.00	0.09
385	688659	元琛科技	37,900	395,676.00	0.09
386	002495	佳隆股份	193,000	395,650.00	0.09
387	002679	福建金森	50,200	395,576.00	0.09
388	002891	中宠股份	14,800	395,456.00	0.09
389	603968	醋化股份	42,700	395,402.00	0.09
390	002999	天禾股份	74,300	395,276.00	0.09
391	002743	富煌钢构	102,400	395,264.00	0.09

392	000995	皇台酒业	41,600	395,200.00	0.09
393	301131	聚赛龙	12,300	395,199.00	0.09
394	688466	金科环境	30,800	395,164.00	0.09
395	600235	民丰特纸	79,500	395,115.00	0.09
396	301519	舜禹股份	36,400	394,940.00	0.09
397	003042	中农联合	32,500	394,875.00	0.09
398	600883	博闻科技	56,400	394,800.00	0.09
399	600802	福建水泥	95,800	394,696.00	0.09
400	000757	浩物股份	115,700	394,537.00	0.09
401	002799	环球印务	65,200	394,460.00	0.09
402	600706	曲江文旅	58,600	394,378.00	0.09
403	600371	万向德农	63,100	394,375.00	0.09
404	300597	吉大通信	55,700	394,356.00	0.09
405	000619	海螺新材	89,600	394,240.00	0.09
406	002524	光正眼科	119,100	394,221.00	0.09
407	600692	亚通股份	72,600	394,218.00	0.09
408	600099	林海股份	49,400	394,212.00	0.09
408	002909	集泰股份	79,800	394,212.00	0.09
409	000952	广济药业	72,700	394,034.00	0.09
410	605567	春雪食品	49,300	393,907.00	0.09
411	300500	启迪设计	44,600	393,818.00	0.09
412	300220	金运激光	37,900	393,781.00	0.09
413	600448	华纺股份	156,200	393,624.00	0.09
414	301037	保立佳	32,800	393,600.00	0.09
415	605122	四方新材	36,500	393,470.00	0.09
416	603536	惠发食品	50,500	393,395.00	0.09
417	603385	惠达卫浴	80,600	393,328.00	0.09
418	000605	渤海股份	73,500	393,225.00	0.09
419	002133	广宇集团	164,500	393,155.00	0.09
420	600097	开创国际	50,500	392,890.00	0.09
421	001260	坤泰股份	25,100	392,815.00	0.09
422	300892	品渥食品	20,900	392,502.00	0.09
423	600493	凤竹纺织	74,900	392,476.00	0.09
424	603282	亚光股份	27,500	392,425.00	0.09
425	001366	播恩集团	36,200	392,408.00	0.09
426	600128	苏豪弘业	51,700	392,403.00	0.09
427	688565	力源科技	41,500	392,175.00	0.09
428	300615	欣天科技	39,100	392,173.00	0.09
429	600561	江西长运	79,200	392,040.00	0.09
430	001336	楚环科技	17,800	391,956.00	0.09
431	000985	大庆华科	27,500	391,325.00	0.09
432	688021	奥福科技	20,200	391,072.00	0.09
433	003008	开普检测	22,900	390,903.00	0.09
434	600159	大龙地产	176,800	390,728.00	0.09

435	603506	南都物业	41,800	390,412.00	0.09
436	002802	洪汇新材	37,100	390,292.00	0.09
437	603908	牧高笛	23,100	389,928.00	0.09
438	603182	嘉华股份	34,200	389,880.00	0.09
439	002809	红墙股份	52,370	389,632.80	0.09
440	603028	赛福天	60,200	389,494.00	0.09
441	603022	新通联	48,700	389,113.00	0.09
442	002715	登云股份	29,300	388,225.00	0.09
443	002591	恒大高新	63,400	388,008.00	0.09
444	603717	天域生物	66,900	387,351.00	0.09
445	688051	佳华科技	16,800	386,064.00	0.09
446	603833	欧派家居	12,800	385,408.00	0.09
447	000039	中集集团	47,500	385,225.00	0.09
448	600325	华发股份	165,900	383,229.00	0.09
449	600026	中远海能	21,300	382,122.00	0.09
450	003011	海象新材	21,000	381,570.00	0.09
451	600125	铁龙物流	75,200	381,264.00	0.09
452	000089	深圳机场	56,500	340,695.00	0.08
453	000166	申万宏源	75,600	332,640.00	0.08
454	301666	大普微-UW	688	318,771.04	0.07
455	605499	东鹏饮料	2,500	308,575.00	0.07
456	002821	凯莱英	1,900	307,800.00	0.07
457	601880	辽港股份	216,700	299,046.00	0.07
458	002461	珠江啤酒	38,700	292,959.00	0.07
459	600519	贵州茅台	200	237,098.00	0.06
460	688121	卓然股份	34,730	225,050.40	0.05
461	001248	华润新能源	19,792	200,097.12	0.05
462	688781	视涯科技-UW	4,571	192,713.36	0.05
463	688808	联讯仪器	116	183,782.28	0.04
464	002176	江特电机	16,600	166,166.00	0.04
465	600893	航发动力	3,800	145,692.00	0.03
466	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.03
467	688820	盛合晶微	666	94,232.34	0.02
468	688797	臻宝科技	172	80,611.24	0.02
469	301682	宏明电子	466	74,587.96	0.02
470	001399	惠科股份	2,271	62,974.83	0.01
471	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
472	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
473	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
474	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
475	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
476	920181	赛英电子	300	32,913.00	0.01
477	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.01
478	603459	红板科技	299	25,211.68	0.01

479	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
480	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
481	001365	天海电子	503	15,748.93	0.00
482	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
483	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
484	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
485	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
486	001393	维通利	353	13,763.47	0.00
487	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
488	001237	惠康科技	210	12,335.40	0.00
489	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
490	601112	振石股份	623	10,958.57	0.00
491	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
492	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
493	920218	新天力	300	5,460.00	0.00
494	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
495	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
496	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
497	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
498	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	601688	华泰证券	16,597,531.00	2.38
2	601899	紫金矿业	7,927,770.11	1.14
3	300308	中际旭创	7,161,249.00	1.03
4	688002	睿创微纳	6,000,148.07	0.86
5	000408	藏格矿业	5,316,451.60	0.76
6	603986	兆易创新	5,219,145.00	0.75
7	600176	中国巨石	5,191,128.00	0.74
8	002384	东山精密	5,175,603.00	0.74
9	001309	德明利	5,133,258.00	0.74
10	688008	澜起科技	4,995,431.16	0.72
11	002780	三夫户外	4,583,610.80	0.66
12	600150	中国船舶	4,517,644.00	0.65
13	002008	大族激光	4,494,135.00	0.64
14	603259	药明康德	4,403,264.00	0.63
15	002028	思源电气	4,349,209.00	0.62

16	300476	胜宏科技	4,209,503.00	0.60
17	000792	盐湖股份	4,188,375.00	0.60
18	601088	中国神华	4,021,843.00	0.58
19	300502	新易盛	3,999,643.00	0.57
20	688012	中微公司	3,901,453.30	0.56

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	001316	润贝航科	47,782,099.44	6.85
2	601021	春秋航空	44,639,307.18	6.40
3	002928	华夏航空	40,579,011.00	5.82
4	601211	国泰海通	27,609,615.40	3.96
5	601377	兴业证券	25,219,779.00	3.62
6	601688	华泰证券	14,674,786.16	2.11
7	600958	东方证券	13,282,714.54	1.91
8	603885	吉祥航空	12,808,065.00	1.84
9	688498	源杰科技	8,441,419.70	1.21
10	601899	紫金矿业	7,784,017.83	1.12
11	300308	中际旭创	7,538,524.00	1.08
12	300502	新易盛	7,461,367.80	1.07
13	002558	巨人网络	7,280,267.90	1.04
14	301511	德福科技	7,175,169.13	1.03
15	301200	大族数控	7,145,406.00	1.02
16	300604	长川科技	7,056,447.80	1.01
17	002414	高德红外	6,988,053.00	1.00
18	301031	中熔电气	6,632,033.00	0.95
19	603256	宏和科技	6,630,447.00	0.95
20	688008	澜起科技	6,375,374.61	0.91

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	1,313,627,691.72
卖出股票收入（成交）总额	1,661,430,399.09

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	-	-
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）	55,904.56	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,904.56	0.01

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	118069.SH	爱科转债	520	52,004.56	0.01
2	113696.SH	伯 25 转债	30	3,900.00	0.00

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风

险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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

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	2,844,133.37
2	应收清算款	6,472.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,846.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,891,452.68

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	3,900.00	0.00
---	-----------	---------	----------	------

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

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
144,945	1,597.56	15,467,937.01	6.68%	216,090,785.63	93.32%

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	97.50%

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	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	198,861.26	0.0859%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 12 月 9 日）基金份额总额	5,613,599,931.88
本报告期期初基金份额总额	390,325,952.74
本报告期基金总申购份额	13,606,468.27
减：本报告期基金总赎回份额	172,373,698.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	231,558,722.64

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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	
华泰证券	5	821,399,942.43	27.63%	358,130.41	27.64%	-
信达证券	2	538,167,702.27	18.10%	234,645.51	18.11%	-
国泰海通	4	490,996,786.10	16.52%	214,074.73	16.52%	-
申万宏源证券	3	325,077,898.07	10.94%	141,736.35	10.94%	-
国海证券	1	312,457,199.43	10.51%	136,233.25	10.51%	-
西南证券	2	309,035,853.22	10.40%	134,740.40	10.40%	-
东方证券	2	171,334,556.90	5.76%	74,701.87	5.76%	-
广发证券	8	4,296,916.47	0.14%	1,628.20	0.13%	-
平安证券	1	-	-	-	-	减少 3 个
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
高盛中国	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	减少 2 个
国金证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	52,000.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

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
3	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
4	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金调整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	2026-06-26

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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人自 2026 年 7 月 27 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下部分基金调整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

- 1.中国证监会批准广发多策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

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