

广发聚富开放式证券投资基金
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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46

8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 盈利投资者数量占比	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	51
10.8 其他重大事件	54
11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发聚富开放式证券投资基金	
基金简称	广发聚富混合	
基金主代码	270001	
交易代码	270001(前端)	270011(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 12 月 3 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,102,776,499.27 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金。依托高速发展的宏观经济和资本市场，通过基金管理人科学研究，审慎投资，在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	积极投资策略，在资产配置层面，重视股票资产和债券资产的动态平衡配置；在行业配置层面，根据不同行业的发展前景进行行业优化配置；在个股选择层面，在深入把握上市公司基本面的基础上挖掘价格尚未完全反映投资价值的潜力股的投资机会。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金。

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	50,204,835.13
本期利润	2,151,035.13
加权平均基金份额本期利润	0.0019
本期加权平均净值利润率	0.16%
本期基金份额净值增长率	0.04%
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	84,334,950.86

期末可供分配基金份额利润	0.0765
期末基金资产净值	1,251,401,899.18
期末基金份额净值	1.1348
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	919.68%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.36%	0.88%	9.78%	1.01%	-5.42%	-0.13%
过去六个月	0.04%	0.89%	6.58%	0.91%	-6.54%	-0.02%
过去一年	13.23%	0.85%	21.34%	0.81%	-8.11%	0.04%
过去三年	5.01%	0.95%	27.34%	0.89%	-22.33%	0.06%
过去五年	2.33%	0.98%	2.03%	0.89%	0.30%	0.09%
过去七年	73.21%	1.02%	33.93%	0.93%	39.28%	0.09%
过去十年	80.00%	1.01%	60.81%	0.92%	19.19%	0.09%
自基金合同生效起至今	919.68%	1.24%	355.71%	1.24%	563.97%	0.00%

注：（1）自 2015 年 11 月 2 日起，本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率×80%+ 中信标普全债指数收益率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

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

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

广发聚富开放式证券投资基金

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

(2003 年 12 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：自 2015 年 11 月 2 日起，本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

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；广发多	2018-11-05	-	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

	策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；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				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)。
陈宇庭	本基金的基金经理；广发消费品精选混合型证券投资基金的基金经理；广发消费智选混合型证券投资基金的基金经理	2025-09-30	-	10.5 年	陈宇庭先生，中国籍，理学和金融学双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任海富通基金管理有限公司量化投资部投资经理助理，广发基金管理有限公司量化投资部研究员、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 2 月 25 日至 2020 年 5 月 6 日)、广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 2 月 25 日至 2020 年 5 月 6 日)、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 7 月 22 日至 2020 年 10 月 19 日)、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理(自 2020 年 5 月 6 日至 2023 年 7 月 6 日)、广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 5 月 6 日至 2023 年 7 月 6 日)、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 8 月 16 日至 2024 年 4 月 10 日)。

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

2. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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 股市场在 AI 产业趋势+海外地缘冲突的背景下震荡上行，同时也呈现出非常明显的结构分化特征。在流动性充裕的情况下，机构的配置特征仍然延续景气投资的思路，量化资金以及短线游资等同样开始缩圈在科技主升趋势板块中，由此对其他板块形成了非常明显的压力。

在其他资产层面，利率中枢维持低位震荡，整体机会更多来自于券种的配置，而不在于久期的轮动；可转债市场则在正股市场表现强势的带动下，呈现出一定的结构性机会，同时整体估值也逐步回升。基于此，本产品在本报告期内根据各类资产风险收益比的变化，维持了对可转债资产的较高配置比例。我们认为，可转债作为具备天然“不对称收益”特征的资产，在当前市场分化较大的情况下，有助于在保持一定进攻性的同时，避免出现净值的极端回撤。

我们认为，市场是动态变化的复杂系统，不存在任何一类资产、任何一个策略能永远战胜市场，而充分利用不同资产、不同策略各自的优势和差异性，是实现稳健投资目标的重要方式。在此认知下，可转债资产凭借其“下有债底保护、上有转股弹性”的非对称收益特征，成为我们打通多资产配置、平滑净值曲线的关键枢纽。

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 0.04%，同期业绩比较基准收益率为 6.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，外部环境和国内经济走势的不确定性仍然存在，AI 产业趋势也还处于景气之中，但同时我们已经可以看到，在经历了上半年的震荡上行之后，市场风格和板块的分化已经处于历史较高分位数的位置。我们认为，接下来的市场有望迎来风格和板块的再平衡。科技板块的继续上行需要在当前已经高预期的情况下进一步超预期，这并非易事；而其他板块已经开始有细分方向呈现基本面的边际改善，一旦市场趋势发生变化，这些方向将迎来资金的青睐。

产品运作层面，我们将基于对各类资产的跟踪分析结果、对市场风格变化的判断、以及景气方向的基本面验证，继续努力实现相对基准可累积的稳健超额收益。往后看，我们认为市场的投资机

会将从单一主线的集中演绎，向更加多元、更加均衡的结构性行情演变，我们的资产、风格和板块的配置将更加均衡。具体到资产类别上，当前我们认为可转债资产的配置性价比仍然相对较高，后续也将继续是我们的关注重点。

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：广发聚富开放式证券投资基金

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	97,856,581.91	8,088,624.22
结算备付金		4,344,442.25	2,469,446.37
存出保证金		517,344.01	155,386.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,149,868,668.24	1,370,145,705.79
其中：股票投资		294,262,157.50	348,748,109.95
基金投资		-	-
债券投资		855,606,510.74	1,021,397,595.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		3,591,898.50	3,772,585.01
应收股利		-	-
应收申购款		214,076.84	76,968.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,256,393,011.75	1,384,708,716.96
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		36,368.51	1,445,576.59
应付赎回款		2,043,441.38	2,672,255.98
应付管理人报酬		1,245,583.86	1,378,973.75
应付托管费		207,597.31	229,828.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,984.43	3,210.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,441,137.08	1,258,596.15
负债合计		4,991,112.57	6,988,441.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,102,776,499.27	1,214,501,906.67
未分配利润	6.4.7.9	148,625,399.91	163,218,368.75
净资产合计		1,251,401,899.18	1,377,720,275.42
负债和净资产总计		1,256,393,011.75	1,384,708,716.96

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.1348 元，基金份额总额 1,102,776,499.27 份。

6.2 利润表

会计主体：广发聚富开放式证券投资基金

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,463,205.44	7,235,191.50
1. 利息收入		117,318.42	111,123.76
其中：存款利息收入	6.4.7.10	117,318.42	111,123.76
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）		59,361,894.73	25,840,755.23
其中：股票投资收益	6.4.7.11	9,297,179.73	-9,835,407.05
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	48,619,335.19	33,912,271.92
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	1,445,379.81	1,763,890.36
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	-48,053,800.00	-18,751,419.02
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	37,792.29	34,731.53
减：二、营业总支出		9,312,170.31	9,631,379.47
1. 管理人报酬		7,877,260.78	8,152,516.14
2. 托管费		1,312,876.76	1,358,752.70
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		12,588.59	3,615.30
8. 其他费用	6.4.7.21	109,444.18	116,495.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		2,151,035.13	-2,396,187.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,151,035.13	-2,396,187.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,151,035.13	-2,396,187.97

6.3 净资产变动表

会计主体：广发聚富开放式证券投资基金

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	1,214,501,906.67	163,218,368.75	1,377,720,275.42
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,214,501,906.67	163,218,368.75	1,377,720,275.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-111,725,407.40	-14,592,968.84	-126,318,376.24
（一）、综合收益总额	-	2,151,035.13	2,151,035.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-111,725,407.40	-16,744,003.97	-128,469,411.37
其中：1. 基金申购款	26,168,198.58	4,000,890.83	30,169,089.41
2. 基金赎回款	-137,893,605.98	-20,744,894.80	-158,638,500.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,102,776,499.27	148,625,399.91	1,251,401,899.18
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	1,419,277,628.89	4,609,638.06	1,423,887,266.95
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,419,277,628.89	4,609,638.06	1,423,887,266.95

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,944,604.90	-1,540,099.60	-53,484,704.50
（一）、综合收益总额	-	-2,396,187.97	-2,396,187.97
（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）	-51,944,604.90	856,088.37	-51,088,516.53
其中：1.基金申购款	24,514,440.34	-453,832.20	24,060,608.14
2.基金赎回款	-76,459,045.24	1,309,920.57	-75,149,124.67
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,367,333,023.99	3,069,538.46	1,370,402,562.45

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

广发聚富开放式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监基金字[2003]121 号文《关于同意广发聚富证券投资基金设立的批复》的批准，由广发基金管理有限公司作为发起人，于 2003 年 10 月 31 日向社会公开发行募集并于 2003 年 12 月 3 日正式成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 3,131,907,040.29 份基金份额。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 2003 年 10 月 31 日至 2003 年 12 月 1 日，募集资金总额为人民币 3,131,907,040.29 元，其中募集资金的银行存款利息扣除认购费用为人民币 428,430.37 元，上述资金业经深圳天健信德会计师事务所验资。

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	97,856,581.91
等于：本金	97,850,706.50
加：应计利息	5,875.41
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	97,856,581.91

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		302,467,504.15	-	294,262,157.50	-8,205,346.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	647,350,538.14	3,160,745.63	649,679,529.92	-831,753.85
	银行间市场	202,489,520.00	2,918,980.82	205,926,980.82	518,480.00
	合计	849,840,058.14	6,079,726.45	855,606,510.74	-313,273.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	1,152,307,562.29	6,079,726.45	1,149,868,668.24	-8,518,620.50
----	------------------	--------------	------------------	---------------

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	500,000.00
应付赎回费	1,255.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	843,305.26
其中：交易所市场	843,305.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,576.39
合计	1,441,137.08

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	1,214,501,906.67	1,214,501,906.67
本期申购	26,168,198.58	26,168,198.58
本期赎回（以“-”号填列）	-137,893,605.98	-137,893,605.98
本期末	1,102,776,499.27	1,102,776,499.27

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	40,990,462.07	122,227,906.68	163,218,368.75
本期期初	40,990,462.07	122,227,906.68	163,218,368.75
本期利润	50,204,835.13	-48,053,800.00	2,151,035.13
本期基金份额交易产生的变动数	-6,860,346.34	-9,883,657.63	-16,744,003.97
其中：基金申购款	1,505,830.79	2,495,060.04	4,000,890.83
基金赎回款	-8,366,177.13	-12,378,717.67	-20,744,894.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,334,950.86	64,290,449.05	148,625,399.91

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	109,274.02
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	7,198.86
其他	845.54
合计	117,318.42

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	9,297,179.73
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	9,297,179.73

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	1,398,606,039.97
减：卖出股票成本总额	1,387,221,115.68
减：交易费用	2,087,744.56
买卖股票差价收入	9,297,179.73

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	5,713,915.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	42,905,419.33
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	48,619,335.19

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	3,587,555,565.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,528,195,679.45
减：应计利息总额	16,203,089.12
减：交易费用	251,377.90
买卖债券差价收入	42,905,419.33

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	1,445,379.81
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	1,445,379.81

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	-48,053,800.00
——股票投资	-47,703,103.43
——债券投资	-350,696.57
——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	-48,053,800.00

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	34,545.27
基金转换费收入	3,247.02
合计	37,792.29

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	27,769.02
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,567.79
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	109,444.18

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	10,238.00	0.00%	761,076.44	0.13%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	330,800.00	0.00%	200.00	0.00%

司				
---	--	--	--	--

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	-	-	-	-
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	289.20	0.12%	0.86	0.00%

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	7,877,260.78	8,152,516.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,502,789.28	2,470,423.16
应支付基金管理人的净管理费	5,374,471.50	5,682,092.98

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	1,312,876.76	1,358,752.70

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 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	
	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	97,856,581.91	109,274.02	8,639,541.53	107,153.92

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

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	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	39,641.00	400,770.51	400,770.51	-
688781	视涯科技-UW	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,844.00	36,289.92	260,907.56	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	新股流通受限	10.11	10.11	16,989.00	171,758.79	171,758.79	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
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	-
68863	长进	2026-0	6 个月	新股	40.98	308.19	128.00	5,245.	39,448	-

5	光子	5-20		流通受限				44	.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	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
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	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285.00	15,179.10	16,740.90	-
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	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
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	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
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	-
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	-

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
123274	维科转债	2026-06-26	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.00	3,308.00	330,800.00	330,807.25	-

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
300214	日科化学	2026-06-29	重大事项停牌	10.25	2026-07-13	12.30	22,000.00	221,393.00	225,500.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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	65,284,264.44	73,136,855.10
合计	65,284,264.44	73,136,855.10

- 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	37,118,406.34	47,530,029.57
AAA 以下	547,276,859.14	696,508,124.88
未评级	205,926,980.82	204,222,586.29
合计	790,322,246.30	948,260,740.74

- 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，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	97,856,581.91	-	-	-	97,856,581.91
结算备付金	4,344,442.25	-	-	-	4,344,442.25
存出保证金	517,344.01	-	-	-	517,344.01
交易性金融资产	649,679,529.92	205,926,980.82	-	294,262,157.50	1,149,868,668.24
应收清算款	-	-	-	3,591,898.50	3,591,898.50
应收申购款	-	-	-	214,076.84	214,076.84
资产总计	752,397,898.09	205,926,980.82	-	298,068,132.84	1,256,393,011.75
负债					
应付清算款	-	-	-	36,368.51	36,368.51
应付赎回款	-	-	-	2,043,441.38	2,043,441.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,245,583.86	1,245,583.86
应付托管费	-	-	-	207,597.31	207,597.31
应交税费	-	-	-	16,984.43	16,984.43
其他负债	-	-	-	1,441,137.08	1,441,137.08
负债总计	-	-	-	4,991,112.57	4,991,112.57
利率敏感度缺口	752,397,898.09	205,926,980.82	-	293,077,020.27	1,251,401,899.18
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	8,088,624.22	-	-	-	8,088,624.22
结算备付金	2,469,446.37	-	-	-	2,469,446.37
存出保证金	155,386.65	-	-	-	155,386.65
交易性金融资产	817,175,009.55	204,222,586.29	-	348,748,109.95	1,370,145,705.79
应收清算款	-	-	-	3,772,585.01	3,772,585.01
应收申购款	-	-	-	76,968.92	76,968.92
资产总计	827,888,466.79	204,222,586.29	-	352,597,663.88	1,384,708,716.96
负债					
应付清算款	-	-	-	1,445,576.59	1,445,576.59
应付赎回款	-	-	-	2,672,255.98	2,672,255.98
应付管理人报酬	-	-	-	1,378,973.75	1,378,973.75
应付托管费	-	-	-	229,828.93	229,828.93
应交税费	-	-	-	3,210.14	3,210.14
其他负债	-	-	-	1,258,596.15	1,258,596.15
负债总计	-	-	-	6,988,441.54	6,988,441.54
利率敏感度缺口	827,888,466.79	204,222,586.29	-	345,609,222.34	1,377,720,275.42

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	-1,071,024.80	-1,396,644.21
	市场利率下降 25 个基点	1,078,858.57	1,408,201.61

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	294,262,157.50	23.51	348,748,109.95	25.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	584,395,265.48	46.70	744,038,154.45	54.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	878,657,422.98	70.21	1,092,786,264.40	79.32

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%	35,389,562.49	32,925,079.46
	下降 5%	-35,389,562.49	-32,925,079.46

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	875,433,069.19
第二层次	272,340,081.81
第三层次	2,095,517.24
合计	1,149,868,668.24

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售等情况，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	294,262,157.50	23.42
	其中：股票	294,262,157.50	23.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	855,606,510.74	68.10
	其中：债券	855,606,510.74	68.10
	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	102,201,024.16	8.13
8	其他各项资产	4,323,319.35	0.34
9	合计	1,256,393,011.75	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	3,494,382.80	0.28
B	采矿业	8,199,744.82	0.66
C	制造业	224,919,411.76	17.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,178,471.30	0.41
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,961,544.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	3,364,987.46	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,671,453.36	1.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,617,928.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	6,110,958.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	6,850,596.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	508,400.00	0.04
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,384,280.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	294,262,157.50	23.51

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	300689	澄天伟业	47,200	3,312,496.00	0.26
2	300903	科翔股份	31,700	3,211,527.00	0.26
3	300063	天龙集团	358,200	3,109,176.00	0.25
4	300890	翔丰华	92,400	3,064,908.00	0.24
5	300164	通源石油	379,400	3,035,200.00	0.24
6	300427	红相股份	451,100	3,026,881.00	0.24
7	300986	志特新材	175,900	3,016,685.00	0.24
8	300086	康芝药业	510,500	3,011,950.00	0.24
9	300189	神农种业	692,900	2,993,328.00	0.24
10	300111	向日葵	1,037,300	2,987,424.00	0.24
11	301117	佳缘科技	127,100	2,967,785.00	0.24
12	300840	酷特智能	143,300	2,956,279.00	0.24
13	688202	美迪西	35,200	2,840,992.00	0.23
14	301328	维峰电子	39,700	2,826,640.00	0.23
15	301136	招标股份	256,900	2,820,762.00	0.23
16	603726	朗迪集团	81,000	2,774,250.00	0.22
17	002079	苏州固锝	182,700	2,745,981.00	0.22
18	688620	安凯微	169,400	2,744,280.00	0.22
19	002805	丰元股份	92,900	2,656,011.00	0.21
20	688653	康希通信	152,800	2,655,664.00	0.21
21	603032	德新科技	98,700	2,655,030.00	0.21
22	688173	希荻微	138,400	2,648,976.00	0.21
23	688648	中邮科技	72,400	2,646,220.00	0.21
24	605018	长华集团	177,000	2,639,070.00	0.21
25	300139	晓程科技	72,000	2,631,600.00	0.21
26	688305	科德数控	40,200	2,623,854.00	0.21
27	002471	中超控股	430,700	2,597,121.00	0.21
28	688277	天智航-U	151,200	2,585,520.00	0.21
29	300429	强力新材	145,700	2,581,804.00	0.21
30	603200	上海洗霸	59,500	2,579,920.00	0.21
31	001314	亿道信息	41,400	2,558,520.00	0.20
32	603538	美诺华	77,940	2,536,947.00	0.20
33	300145	南方泵业	465,400	2,536,430.00	0.20
34	300681	英搏尔	88,250	2,525,715.00	0.20

35	301280	珠城科技	49,800	2,518,386.00	0.20
36	300740	水羊股份	136,400	2,511,124.00	0.20
37	300129	泰胜风能	292,500	2,500,875.00	0.20
38	300905	宝丽迪	49,400	2,499,640.00	0.20
39	002284	亚太股份	263,200	2,497,768.00	0.20
40	300191	潜能恒信	90,300	2,496,795.00	0.20
41	000922	佳电股份	177,600	2,479,296.00	0.20
42	002703	浙江世宝	174,200	2,478,866.00	0.20
43	301251	威尔高	46,500	2,477,520.00	0.20
44	002218	拓日新能	645,100	2,477,184.00	0.20
45	001208	华菱线缆	174,500	2,476,155.00	0.20
46	300943	春晖智控	55,000	2,472,250.00	0.20
47	688199	久日新材	71,200	2,458,536.00	0.20
48	603181	皇马科技	151,500	2,457,330.00	0.20
49	002885	京泉华	60,100	2,455,686.00	0.20
50	688109	品茗科技	32,400	2,452,680.00	0.20
51	603686	福龙马	189,500	2,448,340.00	0.20
52	002803	吉宏股份	94,700	2,447,048.00	0.20
53	600189	泉阳泉	323,700	2,437,461.00	0.19
54	002708	光洋股份	184,700	2,436,193.00	0.19
55	002328	新朋股份	331,200	2,431,008.00	0.19
56	688228	开普云	31,400	2,428,476.00	0.19
57	600693	东百集团	309,700	2,428,048.00	0.19
58	002455	百川股份	336,200	2,420,640.00	0.19
59	002111	威海广泰	268,700	2,418,300.00	0.19
60	603016	新宏泰	71,600	2,417,216.00	0.19
61	300279	和晶科技	398,800	2,412,740.00	0.19
62	002112	三变科技	147,000	2,409,330.00	0.19
63	002440	闰土股份	234,800	2,406,700.00	0.19
64	603122	合富中国	219,400	2,404,624.00	0.19
65	002034	旺能环境	158,600	2,402,790.00	0.19
66	688212	澳华内镜	81,400	2,393,160.00	0.19
67	603897	长城科技	73,700	2,392,302.00	0.19
68	002154	报喜鸟	671,900	2,391,964.00	0.19
69	600400	红豆股份	726,600	2,390,514.00	0.19
70	600793	宜宾纸业	198,600	2,389,158.00	0.19
71	000892	欢瑞世纪	716,000	2,384,280.00	0.19
72	301326	捷邦科技	17,100	2,383,227.00	0.19
73	002788	鹭燕医药	237,600	2,383,128.00	0.19
74	603112	华翔股份	142,400	2,382,352.00	0.19
75	002870	香山股份	61,600	2,374,064.00	0.19
76	002757	南兴股份	130,500	2,355,525.00	0.19
77	600714	金瑞矿业	114,700	2,354,791.00	0.19
78	002682	龙洲股份	554,350	2,350,444.00	0.19

79	002454	松芝股份	489,260	2,338,662.80	0.19
80	002278	神开股份	308,700	2,327,598.00	0.19
81	603216	梦天家居	113,000	2,324,410.00	0.19
82	605299	舒华体育	174,100	2,324,235.00	0.19
83	300700	岱勒新材	108,800	2,315,264.00	0.19
84	002054	德美化工	346,800	2,306,220.00	0.18
85	600230	沧州大化	175,800	2,288,916.00	0.18
86	600903	贵州燃气	331,800	2,203,152.00	0.18
87	300696	爱乐达	83,300	2,168,299.00	0.17
88	603085	天成自控	199,100	2,164,217.00	0.17
89	002983	芯瑞达	62,000	1,716,160.00	0.14
90	301159	三维天地	56,700	1,649,970.00	0.13
91	300939	秋田微	21,700	1,501,640.00	0.12
92	301357	北方长龙	17,800	1,407,802.00	0.11
93	688013	天臣医疗	56,800	1,401,256.00	0.11
94	688378	奥来德	22,600	1,401,200.00	0.11
95	605058	澳弘电子	36,100	1,305,376.00	0.10
96	600785	新华百货	132,520	1,298,696.00	0.10
97	002899	英派斯	51,400	1,120,520.00	0.09
98	688148	芳源股份	124,600	1,069,068.00	0.09
99	300067	安诺其	141,000	764,220.00	0.06
100	301045	天禄科技	8,500	757,180.00	0.06
101	300259	新天科技	101,200	670,956.00	0.05
102	300393	中来股份	90,500	659,745.00	0.05
103	300270	中威电子	50,700	659,607.00	0.05
104	300006	莱美药业	123,700	634,581.00	0.05
105	300547	川环科技	18,700	624,393.00	0.05
106	300491	通合科技	16,200	618,678.00	0.05
107	603271	永杰新材	13,900	617,855.00	0.05
108	300043	星辉娱乐	141,900	617,265.00	0.05
109	300948	冠中生态	23,000	612,490.00	0.05
110	300269	联建光电	110,800	610,508.00	0.05
111	300745	欣锐科技	14,400	607,968.00	0.05
112	300161	华中数控	20,600	599,872.00	0.05
113	300421	力星股份	32,100	594,171.00	0.05
114	300300	海峡创新	75,900	592,779.00	0.05
115	300508	维宏股份	10,300	591,529.00	0.05
116	002580	圣阳股份	29,300	590,688.00	0.05
117	300121	阳谷华泰	46,600	587,160.00	0.05
118	301285	鸿日达	5,300	584,749.00	0.05
119	300590	移为通信	40,200	576,870.00	0.05
120	300786	国林科技	23,000	576,610.00	0.05
121	300785	值得买	15,700	575,719.00	0.05
122	001248	华润新能源	56,630	572,529.30	0.05

123	688719	爱科赛博	7,400	569,800.00	0.05
124	300767	震安科技	25,500	568,395.00	0.05
125	301002	崧盛股份	14,700	567,420.00	0.05
126	300606	金太阳	13,300	566,048.00	0.05
127	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.05
128	301321	翰博高新	12,800	565,120.00	0.05
129	300261	雅本化学	125,400	560,538.00	0.04
130	300286	安科瑞	23,200	560,280.00	0.04
131	300424	航新科技	35,400	557,196.00	0.04
132	301210	金杨精密	18,540	556,200.00	0.04
133	300663	科蓝软件	83,500	556,110.00	0.04
134	301322	绿通科技	10,400	554,840.00	0.04
135	300715	凯伦股份	33,700	554,702.00	0.04
136	300539	横河精密	27,200	554,064.00	0.04
137	300478	杭州高新	15,100	554,019.00	0.04
138	301397	溯联股份	17,100	553,356.00	0.04
139	301273	瑞晨环保	17,500	551,425.00	0.04
140	301555	惠柏新材	12,100	549,461.00	0.04
141	300780	德恩精工	16,100	548,366.00	0.04
142	301085	亚康股份	9,000	545,490.00	0.04
143	300461	田中精机	14,700	544,488.00	0.04
144	300250	初灵信息	37,292	543,717.36	0.04
145	300448	浩云科技	94,200	542,592.00	0.04
146	300589	江龙船艇	45,600	538,080.00	0.04
147	300921	南凌科技	26,400	536,184.00	0.04
148	300686	智动力	29,700	534,897.00	0.04
149	301079	邵阳液压	15,900	534,876.00	0.04
150	300062	中能电气	95,300	534,633.00	0.04
151	301111	粤万年青	20,600	533,128.00	0.04
152	300940	南极光	35,300	532,324.00	0.04
153	300157	新锦动力	143,100	528,039.00	0.04
154	301538	骏鼎达	10,480	527,877.60	0.04
155	301360	荣旗科技	7,700	527,373.00	0.04
156	300051	璘升科技	60,200	527,352.00	0.04
157	301003	江苏博云	9,800	524,300.00	0.04
158	301026	浩通科技	25,900	523,698.00	0.04
159	301055	张小泉	12,200	518,134.00	0.04
160	301168	通灵股份	11,500	516,465.00	0.04
161	301172	君逸数码	19,900	516,405.00	0.04
162	300350	华鹏飞	130,000	516,100.00	0.04
163	300591	万里马	76,500	514,845.00	0.04
164	301356	天振股份	19,500	512,265.00	0.04
165	300658	延江股份	44,800	512,064.00	0.04
166	301252	同星科技	12,600	510,678.00	0.04

167	300163	先锋新材	95,300	508,902.00	0.04
168	301169	零点有数	7,200	508,752.00	0.04
169	300736	百邦科技	16,400	508,400.00	0.04
170	301329	信音电子	20,900	507,661.00	0.04
171	301198	喜悦智行	37,800	506,520.00	0.04
172	300879	大叶股份	32,300	506,464.00	0.04
173	300880	迦南智能	23,800	505,750.00	0.04
174	300774	倍杰特	47,000	505,250.00	0.04
175	300553	集智股份	8,200	503,398.00	0.04
176	301636	泽润新能	11,900	501,109.00	0.04
177	300970	华绿生物	27,410	501,054.80	0.04
178	300437	清水源	44,400	499,944.00	0.04
179	300013	新宁物流	127,400	496,860.00	0.04
180	300941	创识科技	36,100	495,653.00	0.04
181	301118	恒光股份	18,200	495,586.00	0.04
182	300942	易瑞生物	85,700	495,346.00	0.04
183	300106	西部牧业	50,200	493,968.00	0.04
184	300530	领湃科技	29,100	490,335.00	0.04
185	300154	瑞凌股份	65,100	489,552.00	0.04
186	301011	华立科技	34,500	487,830.00	0.04
187	300422	博世科	115,200	484,992.00	0.04
188	301499	维科精密	16,500	481,470.00	0.04
189	300616	尚品宅配	46,100	480,362.00	0.04
190	300837	浙矿股份	20,200	479,952.00	0.04
191	300922	天秦装备	31,600	478,740.00	0.04
192	300960	通业科技	30,700	477,385.00	0.04
193	301233	盛帮股份	12,040	450,055.20	0.04
194	301024	霍普股份	12,200	449,204.00	0.04
195	300290	ST 荣科	59,000	392,350.00	0.03
196	688781	视涯科技-UW	6,335	267,083.60	0.02
197	688820	盛合晶微	1,844	260,907.56	0.02
198	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
199	300214	日科化学	22,000	225,500.00	0.02
200	301305	朗坤科技	7,700	219,604.00	0.02
201	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
202	002886	沃特股份	6,380	179,214.20	0.01
203	300667	必创科技	9,200	156,860.00	0.01
204	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
205	301004	嘉益股份	3,300	102,300.00	0.01
206	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
207	603095	越剑智能	6,000	85,920.00	0.01
208	688699	明微电子	1,000	81,950.00	0.01
209	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
210	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00

211	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
212	688136	科兴制药	1,600	33,136.00	0.00
213	920181	赛英电子	300	32,913.00	0.00
214	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
215	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
216	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
217	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
218	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
219	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
220	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
221	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
222	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
223	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
224	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
225	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
226	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
227	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
228	920069	普昂医疗	100	3,409.00	0.00
229	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
230	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
231	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
232	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
233	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	601211	国泰海通	27,746,814.00	2.01
2	601688	华泰证券	13,860,109.00	1.01
3	301328	维峰电子	7,332,904.83	0.53
4	300711	广哈通信	6,508,243.00	0.47
5	300905	宝丽迪	6,461,708.39	0.47
6	300351	永贵电器	6,443,680.00	0.47
7	300086	康芝药业	6,325,946.00	0.46
8	301499	维科精密	6,307,720.00	0.46
9	300063	天龙集团	6,250,372.00	0.45
10	301279	金道科技	6,156,544.50	0.45
11	301329	信音电子	6,048,532.00	0.44
12	600784	鲁银投资	5,839,243.00	0.42

13	002886	沃特股份	5,838,440.80	0.42
14	002111	威海广泰	5,778,484.00	0.42
15	300111	向日葵	5,767,365.00	0.42
16	301117	佳缘科技	5,722,820.40	0.42
17	002483	润邦股份	5,658,509.00	0.41
18	300279	和晶科技	5,612,241.00	0.41
19	300540	蜀道装备	5,586,875.00	0.41
20	002250	联化科技	5,497,127.00	0.40

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	601021	春秋航空	94,521,710.82	6.86
2	001316	润贝航科	67,330,093.62	4.89
3	002928	华夏航空	58,282,218.90	4.23
4	601211	国泰海通	46,075,540.90	3.34
5	601377	兴业证券	26,745,419.50	1.94
6	603885	吉祥航空	18,311,178.72	1.33
7	601688	华泰证券	12,216,861.00	0.89
8	301328	维峰电子	6,848,782.30	0.50
9	002886	沃特股份	6,274,907.00	0.46
10	301279	金道科技	6,104,949.31	0.44
11	300540	蜀道装备	6,042,854.58	0.44
12	300905	宝丽迪	6,021,610.00	0.44
13	300351	永贵电器	5,871,508.00	0.43
14	600784	鲁银投资	5,784,077.00	0.42
15	002976	瑞玛精密	5,711,004.20	0.41
16	300711	广哈通信	5,679,872.00	0.41
17	603081	大丰实业	5,582,233.00	0.41
18	301499	维科精密	5,530,019.00	0.40
19	300930	屹通新材	5,515,113.00	0.40
20	300302	同有科技	5,486,407.00	0.40

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	1,380,438,266.66
卖出股票收入（成交）总额	1,398,606,039.97

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	65,284,264.44	5.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,926,980.82	16.46
	其中：政策性金融债	205,926,980.82	16.46
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）	584,395,265.48	46.70
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	855,606,510.74	68.37

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	019792.SH	25 国债 19	646,000	65,284,264.44	5.22
2	230415.IB	23 农发 15	400,000	41,823,583.56	3.34
3	230315.IB	23 进出 15	400,000	41,806,849.32	3.34
4	230407.IB	23 农发 07	400,000	41,001,172.60	3.28
5	250423.IB	25 农发 23	400,000	40,750,717.81	3.26

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，中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。中国进出口银行、中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。

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	517,344.01
2	应收清算款	3,591,898.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	214,076.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,323,319.35

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	118040.SH	宏微转债	18,019,821.34	1.44
2	123187.SZ	超达转债	17,038,384.82	1.36
3	118044.SH	赛特转债	16,705,843.40	1.33
4	123188.SZ	水羊转债	16,596,831.29	1.33
5	123243.SZ	严牌转债	16,470,465.46	1.32
6	118053.SH	正帆转债	15,728,930.58	1.26
7	123251.SZ	华医转债	14,319,220.68	1.14
8	123241.SZ	欧通转债	13,972,290.65	1.12
9	110077.SH	洪城转债	12,824,635.18	1.02
10	123178.SZ	花园转债	12,619,798.22	1.01
11	113624.SH	正川转债	10,879,798.73	0.87
12	123109.SZ	昌红转债	10,506,777.04	0.84
13	118015.SH	芯海转债	10,503,005.90	0.84
14	113680.SH	丽岛转债	10,445,096.65	0.83
15	123122.SZ	富瀚转债	10,440,514.49	0.83
16	113636.SH	甬金转债	10,437,622.52	0.83
17	113681.SH	镇洋转债	10,306,485.70	0.82
18	127034.SZ	绿茵转债	10,195,567.47	0.81
19	123216.SZ	科顺转债	10,187,543.72	0.81
20	110075.SH	南航转债	10,149,184.74	0.81
21	123157.SZ	科蓝转债	10,128,803.65	0.81
22	113650.SH	博 22 转债	10,069,654.20	0.80
23	123154.SZ	火星转债	10,002,224.11	0.80
24	123171.SZ	共同转债	9,853,571.36	0.79
25	110084.SH	贵燃转债	9,751,471.71	0.78
26	123222.SZ	博俊转债	9,219,385.74	0.74
27	113056.SH	重银转债	9,164,463.73	0.73
28	123247.SZ	万凯转债	9,016,190.75	0.72
29	128142.SZ	新乳转债	8,837,739.90	0.71
30	127110.SZ	广核转债	8,277,914.77	0.66
31	113673.SH	岱美转债	7,671,899.84	0.61
32	113658.SH	密卫转债	7,405,573.01	0.59
33	123255.SZ	鼎龙转债	7,230,488.81	0.58
34	123176.SZ	精测转 2	7,043,712.07	0.56
35	123076.SZ	强力转债	7,018,656.47	0.56
36	128136.SZ	立讯转债	6,995,111.94	0.56
37	123258.SZ	胜蓝转 02	6,959,302.32	0.56
38	123179.SZ	立高转债	6,884,100.49	0.55
39	118051.SH	皓元转债	6,861,434.66	0.55

40	123213.SZ	天源转债	6,854,024.25	0.55
41	113605.SH	大参转债	6,784,757.55	0.54
42	118022.SH	锂科转债	6,768,268.27	0.54
43	118030.SH	睿创转债	6,547,353.12	0.52
44	118060.SH	瑞可转债	6,540,521.12	0.52
45	113048.SH	晶科转债	6,519,090.86	0.52
46	127092.SZ	运机转债	6,433,286.88	0.51
47	123090.SZ	三诺转债	6,347,105.59	0.51
48	123193.SZ	海能转债	6,269,036.40	0.50
49	127025.SZ	冀东转债	6,196,292.18	0.50
50	113697.SH	应流转债	6,189,289.60	0.49
51	123165.SZ	回天转债	6,137,634.98	0.49
52	127044.SZ	蒙娜转债	5,907,923.83	0.47
53	123138.SZ	丝路转债	5,761,326.10	0.46
54	127030.SZ	盛虹转债	5,508,526.69	0.44
55	123071.SZ	天能转债	4,928,285.65	0.39
56	110099.SH	福能转债	4,596,090.97	0.37
57	118012.SH	微芯转债	3,601,890.06	0.29
58	127038.SZ	国微转债	3,548,863.50	0.28
59	127103.SZ	东南转债	3,447,411.53	0.28
60	123214.SZ	东宝转债	3,436,403.38	0.27
61	128135.SZ	洽洽转债	3,424,585.57	0.27
62	123088.SZ	威唐转债	3,416,500.84	0.27
63	113691.SH	和邦转债	3,395,879.16	0.27
64	123150.SZ	九强转债	3,353,872.06	0.27
65	113054.SH	绿动转债	3,222,011.40	0.26
66	127056.SZ	中特转债	3,174,590.23	0.25
67	111022.SH	锡振转债	3,165,641.37	0.25
68	113661.SH	福 22 转债	2,808,922.43	0.22
69	123261.SZ	普联转债	2,616,054.24	0.21
70	128134.SZ	鸿路转债	2,399,364.42	0.19
71	123155.SZ	中陆转债	2,266,147.56	0.18
72	113652.SH	伟 22 转债	1,697,400.66	0.14
73	123235.SZ	亿田转债	1,573,414.90	0.13
74	123183.SZ	海顺转债	787,432.86	0.06
75	113042.SH	上银转债	155,960.69	0.01

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
66,166	16,666.82	8,556,742.40	0.78%	1,094,219,756.87	99.22%

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	96.97%

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	80.88	0.0000%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003 年 12 月 3 日）基金份额总额	3,131,907,040.29
本报告期期初基金份额总额	1,214,501,906.67
本报告期基金总申购份额	26,168,198.58
减：本报告期基金总赎回份额	137,893,605.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,102,776,499.27

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	
东北证券	2	699,572,969.51	25.20%	305,013.87	25.20%	-
浙商证券	1	554,682,305.76	19.98%	241,846.16	19.98%	-
兴业证券	3	486,065,430.53	17.51%	211,926.04	17.51%	-
国泰海通	4	475,912,908.91	17.14%	207,499.63	17.14%	-
申万宏源证券	3	373,124,891.74	13.44%	162,686.12	13.44%	-
东方证券	2	89,358,586.32	3.22%	38,960.33	3.22%	-
高盛中国	1	55,870,520.86	2.01%	24,359.57	2.01%	-
天风证券	3	41,606,923.00	1.50%	18,140.62	1.50%	-
广发证券	8	10,238.00	0.00%	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
信达证券	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	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

国投证券	5	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	减少 3 个
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中信建投证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
东北证券	2,529,698,74 3.32	36.33%	-	-	-	-
浙商证券	1,750,748,63 9.46	25.14%	-	-	-	-
兴业证券	543,408,010. 27	7.80%	-	-	-	-
国泰海通	704,822,960. 74	10.12%	-	-	-	-
申万宏源证券	457,796,495. 76	6.57%	-	-	-	-
东方证券	296,169,760. 61	4.25%	-	-	-	-
高盛中国	152,092,030. 88	2.18%	-	-	-	-
天风证券	528,232,097. 65	7.59%	-	-	-	-
广发证券	330,800.00	0.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

国投证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

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

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。

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聚富开放式证券投资基金设立的文件
- 2.《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》
- 3.《广发聚富开放式证券投资基金托管协议》
- 4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
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和营业执照

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