

广发量化多因子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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58

8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 盈利投资者数量占比	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
9 开放式基金份额变动	61
10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
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	62
10.8 其他重大事件	64
11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	广发量化多因子混合	
基金主代码	005225	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 21 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,325,269,197.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发量化多因子混合 A	广发量化多因子混合 C
下属分级基金的交易代码	005225	025645
报告期末下属分级基金的份额总额	1,256,294,476.33 份	68,974,721.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过量化模型构建股票组合，力争实现超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观环境、政策因素、资金供求因素、证券市场基本面等角度进行综合分析，判断各类资产的市场趋势和预期风险收益，在严格控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	王小飞
	联系电话	020-83936666	021-6063 7103
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828	021-60637228
传真		020-34281105	021-60635778

注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510308	100033
法定代表人	葛长伟	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	广发量化多因子混合 A	广发量化多因子混合 C
本期已实现收益	176,605,945.36	22,513,080.71
本期利润	-113,541,779.71	-4,209,525.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0587	-0.0293

本期加权平均净值利润率	-2.38%	-1.18%
本期基金份额净值增长率	-1.74%	-1.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发量化多因子混合 A	广发量化多因子混合 C
期末可供分配利润	1,623,500,563.81	88,546,417.41
期末可供分配基金份额利润	1.2923	1.2838
期末基金资产净值	2,893,456,004.18	158,297,506.88
期末基金份额净值	2.3032	2.2950
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发量化多因子混合 A	广发量化多因子混合 C
基金份额累计净值增长率	130.32%	2.08%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发量化多因子混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.88%	1.30%	12.46%	1.55%	-15.34%	-0.25%
过去六个月	-1.74%	1.33%	13.22%	1.58%	-14.96%	-0.25%
过去一年	21.81%	1.14%	34.04%	1.35%	-12.23%	-0.21%
过去三年	69.92%	1.62%	56.91%	1.47%	13.01%	0.15%
过去五年	16.34%	1.45%	19.43%	1.31%	-3.09%	0.14%
过去七年	117.37%	1.41%	58.77%	1.26%	58.60%	0.15%
自基金合同生效起至今	130.32%	1.38%	50.43%	1.27%	79.89%	0.11%

广发量化多因子混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.00%	1.30%	12.46%	1.55%	-15.46%	-0.25%
过去六个月	-1.98%	1.33%	13.22%	1.58%	-15.20%	-0.25%

自基金合同生效起至今	2.08%	1.22%	15.21%	1.44%	-13.13%	-0.22%
------------	-------	-------	--------	-------	---------	--------

注：（1）自 2024 年 5 月 29 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%”变更为“国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

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

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

广发量化多因子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
(2018 年 3 月 21 日至 2026 年 6 月 30 日)

广发量化多因子混合 A



广发量化多因子混合 C



注：自 2024 年 5 月 29 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%”变更为“国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易威	本基金的基金经理；广发中证	2023-07-06	-	13 年	易威先生，中国籍，应用统计硕士，持有中国证券投资

	A500 指数增强型证券投资基金的基金经理；广发成长智选混合型证券投资基金的基金经理；广发汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理				基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司中央交易部股票交易员、量化投资部量化研究员、量化投资部投资经理、广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2023 年 7 月 6 日至 2025 年 11 月 5 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 2023 年 7 月 6 日至 2025 年 11 月 20 日)。
李育鑫	本基金的基金经理；广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理；广发智选启航混合型证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金的基金经理；广发汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理	2023-10-23	-	7 年	李育鑫先生，中国籍，统计学博士，持有中国证券投资基金从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司资产配置部量化研究员、量化投资部量化研究员。

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 77 次，其中 76 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年市场整体上涨，沪深 300、中证 500、中证 1000 与中证 2000 指数分别上涨 7.55%、20.97%、15.99% 与 9.10%。根据申万一级行业分类，电子、通信行业分别上涨 86.29% 与 73.59%，大

幅领先于其他行业；而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、钢铁和传媒行业跌幅超过 18%。市场呈现出典型的二八分化行情，AI 硬件相关板块与非 AI 板块的市场表现跷跷板效应明显。量化策略持股高度分散，在今年上半年尤其是第二季度超额表现承压明显。

报告期内，产品根据数据和模型进行决策，避免人为情绪、偏见和主观判断的干扰。通过对大量历史数据的分析，量化模型能够更客观地评估股票的价值和潜力。量化策略模型整体偏向于反转、低波动、低估值风格，这在历史长期规律中能获得较好的超额表现，但在今年上半年的强动量行情中承压明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-1.74%，C 类基金份额净值增长率为-1.98%，同期业绩比较基准收益率为 13.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为上半年极致分化的行情有望逐步收敛，AI 硬件等强势板块与其他行业之间的表现差异或将缩小。随着宏观经济持续温和修复，政策支持有望进一步向消费、制造等相对滞后的领域扩散，市场资金有望从拥挤赛道流向估值更具性价比、景气修复更明确的方向，这些方向或迎来更多补涨机会。我们将继续保持耐心，坚持既定量化模型，动态跟踪市场结构变化与风格切换节奏，力求在风格转换中把握超额收益修复的窗口。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

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：广发量化多因子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	350,389,849.78	391,821,893.22
结算备付金		50,721,012.56	52,964,441.70
存出保证金		1,129,589.37	995,996.69
交易性金融资产	6.4.7.2	2,727,563,210.74	3,450,099,199.43
其中：股票投资		2,724,110,569.51	3,433,698,922.31
基金投资		-	-
债券投资		3,452,641.23	16,400,277.12
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		39,828,746.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,988,828.86	21,151,474.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,171,621,237.74	3,917,033,005.85
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		-	39,182,874.78
应付赎回款		107,892,835.32	39,964,789.39
应付管理人报酬		3,027,518.11	3,157,756.49

应付托管费		605,503.64	631,551.30
应付销售服务费		78,461.24	56,776.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8.48	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	8,263,399.89	7,050,184.55
负债合计		119,867,726.68	90,043,933.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,325,269,197.79	1,632,879,901.71
未分配利润	6.4.7.9	1,726,484,313.27	2,194,109,170.87
净资产合计		3,051,753,511.06	3,826,989,072.58
负债和净资产总计		3,171,621,237.74	3,917,033,005.85

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发量化多因子混合 A 基金份额净值人民币 2.3032 元，基金份额总额 1,256,294,476.33 份；广发量化多因子混合 C 基金份额净值人民币 2.2950 元，基金份额总额 68,974,721.46 份；总份额总额 1,325,269,197.79 份。

6.2 利润表

会计主体：广发量化多因子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 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		-86,057,118.51	88,007,063.94
1. 利息收入		1,190,820.49	67,334.33
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,190,820.49	64,189.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,144.67
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		217,256,329.26	60,457,566.24
其中：股票投资收益	6.4.7.11	195,248,533.95	56,345,615.19
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	103,052.06	35,453.07
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	-	218,320.46
股利收益	6.4.7.17	21,904,743.25	3,858,177.52
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	-316,870,331.05	26,639,556.35
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	12,366,062.79	842,607.02
减：二、营业总支出		31,694,186.47	2,191,249.06
1. 管理人报酬		25,579,989.53	1,762,029.15
2. 托管费		5,115,997.93	352,405.82
3. 销售服务费		895,891.23	-
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		3.51	797.17
8. 其他费用	6.4.7.21	102,304.27	76,016.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-117,751,304.98	85,815,814.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-117,751,304.98	85,815,814.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-117,751,304.98	85,815,814.88

6.3 净资产变动表

会计主体：广发量化多因子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	1,632,879,901.71	2,194,109,170.87	3,826,989,072.58
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,632,879,901.71	2,194,109,170.87	3,826,989,072.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-307,610,703.92	-467,624,857.60	-775,235,561.52
（一）、综合收益总额	-	-117,751,304.98	-117,751,304.98

（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）	-307,610,703.92	-349,873,552.62	-657,484,256.54
其中：1.基金申购款	1,849,870,918.90	2,807,120,730.79	4,656,991,649.69
2.基金赎回款	-2,157,481,622.82	-3,156,994,283.41	-5,314,475,906.23
（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	1,325,269,197.79	1,726,484,313.27	3,051,753,511.06
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	69,205,099.59	37,012,336.67	106,217,436.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	69,205,099.59	37,012,336.67	106,217,436.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	373,213,464.32	357,097,807.18	730,311,271.50
（一）、综合收益总额	-	85,815,814.88	85,815,814.88
（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）	373,213,464.32	271,281,992.30	644,495,456.62
其中：1.基金申购款	475,061,326.90	343,901,924.36	818,963,251.26
2.基金赎回款	-101,847,862.58	-72,619,932.06	-174,467,794.64
（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	442,418,563.91	394,110,143.85	836,528,707.76

产			
---	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发量化多因子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〔2017〕1514 号《关于准予广发量化多因子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《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 2 月 12 日向社会公开发行募集并于 2018 年 3 月 21 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 2 月 12 日至 2018 年 3 月 16 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 237,368,420.96 元，有效认购户数为 1,851 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 48,803.01 元，折合基金份额 48,803.01 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金自 2025 年 10 月 9 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

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	350,389,849.78
等于：本金	350,356,335.62

加：应计利息	33,514.16
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	350,389,849.78

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		3,081,621,028.82	-	2,724,110,569.51	-357,510,459.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,043,700.00	1,009.72	3,452,641.23	1,407,931.51
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,043,700.00	1,009.72	3,452,641.23	1,407,931.51
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,083,664,728.82	1,009.72	2,727,563,210.74	-356,102,527.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	153,378.57
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,022,744.93
其中：交易所市场	8,022,744.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,276.39
合计	8,263,399.89

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发量化多因子混合 A		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,529,773,014.32	1,529,773,014.32
本期申购	1,588,037,414.92	1,588,037,414.92
本期赎回（以“-”号填列）	-1,861,515,952.91	-1,861,515,952.91
本期末	1,256,294,476.33	1,256,294,476.33

金额单位：人民币元

广发量化多因子混合 C		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	103,106,887.39	103,106,887.39
本期申购	261,833,503.98	261,833,503.98
本期赎回（以“-”号填列）	-295,965,669.91	-295,965,669.91
本期末	68,974,721.46	68,974,721.46

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发量化多因子混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,843,430,158.17	212,371,402.65	2,055,801,560.82
本期期初	1,843,430,158.17	212,371,402.65	2,055,801,560.82

本期利润	176,605,945.36	-290,147,725.07	-113,541,779.71
本期基金份额交易产生的变动数	-396,535,539.72	91,437,286.46	-305,098,253.26
其中：基金申购款	2,090,771,970.65	321,821,700.24	2,412,593,670.89
基金赎回款	-2,487,307,510.37	-230,384,413.78	-2,717,691,924.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,623,500,563.81	13,660,964.04	1,637,161,527.85

单位：人民币元

广发量化多因子混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	123,996,246.46	14,311,363.59	138,307,610.05
本期期初	123,996,246.46	14,311,363.59	138,307,610.05
本期利润	22,513,080.71	-26,722,605.98	-4,209,525.27
本期基金份额交易产生的变动数	-57,962,909.76	13,187,610.40	-44,775,299.36
其中：基金申购款	342,373,983.41	52,153,076.49	394,527,059.90
基金赎回款	-400,336,893.17	-38,965,466.09	-439,302,359.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,546,417.41	776,368.01	89,322,785.42

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	930,128.66
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	243,629.45
其他	17,062.38
合计	1,190,820.49

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	195,248,533.95
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	195,248,533.95

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	20,725,179,586.11
减：卖出股票成本总额	20,499,148,431.87
减：交易费用	30,782,620.29
买卖股票差价收入	195,248,533.95

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	61,804.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	41,247.16
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	103,052.06

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	16,520,782.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,259,045.00
减：应计利息总额	220,486.34
减：交易费用	4.00
买卖债券差价收入	41,247.16

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	21,904,743.25
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	21,904,743.25

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	-316,870,331.05
——股票投资	-318,258,692.56
——债券投资	1,388,361.51
——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	-316,870,331.05

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	10,426,574.88
基金转换费收入	1,939,487.91
合计	12,366,062.79

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	15,027.88
合计	102,304.27

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
中国建设银行股份有限公司	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 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	365,712,724.86	0.90%	561,320,746.28	16.28%

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	1,975,700.00	90.54%	16,530,840.97	79.52%

6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	-	-	23,828,000.00	85.63%

6.4.10.1.5 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	159,450.69	0.90%	-	-
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	244,735.87	16.28%	244,735.87	22.31%

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	25,579,989.53	1,762,029.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,997,897.78	409,558.34
应支付基金管理人的净管理费	15,582,091.75	1,352,470.81

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 1.00%。

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	5,115,997.93	352,405.82

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

约定年费率为 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发量化多因子混合 A	广发量化多因子混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	107,436.43	107,436.43
广发证券股份有限公司	-	25,578.49	25,578.49
合计	-	133,014.92	133,014.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发量化多因子混	广发量化多因子混合C	合计

	合A		
广发基金管理有限公司	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 C 类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.50%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	广发量化多因子混 合A	广发量化多因子混 合C	广发量化多因子混 合A	广发量化多因子混 合C
报告期初持有的基 金份额	-	-	22,434,938.68	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基	-	-	22,434,938.68	-

金份额				
报告期末持有的基金 份额占基金总份 额比例	-	-	5.07%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发量化多因子混合 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发量化多因子混合 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国建设银行股份有限公司	350,389,849.78	930,128.66	24,849,236.40	38,302.70

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设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
001248	华润新能	2026-06-24	6 个月	新股流通	10.11	10.11	58,873.00	595,206.03	595,206.03	-

	源			受限						
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	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688790	昂瑞微-UW	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319.00	192,616.14	293,237.55	-
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	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	新股流通受限	10.11	10.11	25,231.00	255,085.41	255,085.41	-
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	-
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	-
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	-
688781	视涯科技-UW	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,300.00	29,484.00	61,893.00	-
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	-
60345	红板	2026-0	6 个月	新股	17.70	84.32	330.00	5,841.	27,825	-

9	科技	3-31		流通受限				00	.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	-
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	-
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	-
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	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	234.00	4,099.68	8,405.28	-
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	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内 (含)	新股流通受限	19.28	19.28	300.00	5,784.00	5,784.00	-

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	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内(含)	新股流通受限	8.52	8.52	300.00	2,556.00	2,556.00	-
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
118072	鼎通转债	2026-06-25	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.00	590.00	59,000.00	59,001.81	-

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
300332	天壕能源	2026-06-26	重大事项停牌	4.30	2026-07-09	4.64	3,477,500.00	17,961,287.36	14,953,250.00	-

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	-	16,364,303.35
合计	-	16,364,303.35

- 注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
- 2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	3,452,641.23	35,973.77
未评级	-	-
合计	3,452,641.23	35,973.77

- 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	350,389,849.78	-	-	-	350,389,849.78
结算备付金	50,721,012.56	-	-	-	50,721,012.56
存出保证金	1,129,589.37	-	-	-	1,129,589.37
交易性金融资产	3,452,641.23	-	-	2,724,110,569.51	2,727,563,210.74
应收清算款	-	-	-	39,828,746.43	39,828,746.43
应收申购款	-	-	-	1,988,828.86	1,988,828.86
资产总计	405,693,092.94	-	-	2,765,928,144.80	3,171,621,237.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	107,892,835.32	107,892,835.32
应付管理人报酬	-	-	-	3,027,518.11	3,027,518.11
应付托管费	-	-	-	605,503.64	605,503.64
应付销售服务费	-	-	-	78,461.24	78,461.24
应交税费	-	-	-	8.48	8.48
其他负债	-	-	-	8,263,399.89	8,263,399.89
负债总计	-	-	-	119,867,726.68	119,867,726.68
利率敏感度缺口	405,693,092.94	-	-	2,646,060,418.12	3,051,753,511.06
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	391,821,893.22	-	-	-	391,821,893.22
结算备付金	52,964,441.70	-	-	-	52,964,441.70
存出保证金	995,996.69	-	-	-	995,996.69
交易性金融资产	16,400,277.12	-	-	3,433,698,922.31	3,450,099,199.43
应收申购款	-	-	-	21,151,474.81	21,151,474.81
资产总计	462,182,608.73	-	-	3,454,850,397.12	3,917,033,005.85
负债					
应付清算款	-	-	-	39,182,874.78	39,182,874.78
应付赎回款	-	-	-	39,964,789.39	39,964,789.39
应付管理人报酬	-	-	-	3,157,756.49	3,157,756.49
应付托管费	-	-	-	631,551.30	631,551.30
应付销售服务费	-	-	-	56,776.76	56,776.76
其他负债	-	-	-	7,050,184.55	7,050,184.55
负债总计	-	-	-	90,043,933.27	90,043,933.27
利率敏感度缺口	462,182,608.73	-	-	3,364,806,463.85	3,826,989,072.58

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	-	-11,282.56
	市场利率下降 25 个基点	-	11,298.65

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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	2,724,110,569.51	89.26	3,433,698,922.31	89.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,452,641.23	0.11	35,973.77	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	2,727,563,210.74	89.38	3,433,734,896.08	89.72

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%	127,249,617.70	173,761,980.00
	下降 5%	-127,249,617.70	-173,761,980.00

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	2,709,270,530.54
第二层次	15,870,883.25
第三层次	2,421,796.95
合计	2,727,563,210.74

6.4.14.2 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	2,724,110,569.51	85.89
	其中：股票	2,724,110,569.51	85.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,452,641.23	0.11
	其中：债券	3,452,641.23	0.11
	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	401,110,862.34	12.65
8	其他各项资产	42,947,164.66	1.35
9	合计	3,171,621,237.74	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	17,301,554.47	0.57
B	采矿业	40,533,917.82	1.33
C	制造业	1,869,261,178.12	61.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	150,140,552.45	4.92
E	建筑业	46,958,715.00	1.54
F	批发和零售业	75,531,763.45	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	57,122,105.46	1.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	222,333,564.22	7.29
J	金融业	29,207,526.00	0.96
K	房地产业	79,298,180.60	2.60
L	租赁和商务服务业	34,498,745.72	1.13
M	科学研究和技术服务业	16,234,645.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	51,729,363.20	1.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,178,085.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	27,780,673.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	2,724,110,569.51	89.26

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	688025	杰普特	53,158	24,984,260.00	0.82
2	603901	永创智能	2,259,293	24,558,514.91	0.80
3	600595	中孚实业	4,214,100	23,683,242.00	0.78

4	300022	吉峰科技	2,980,100	23,155,377.00	0.76
5	300098	高新兴	5,035,300	23,112,027.00	0.76
6	688498	源杰科技	11,990	22,613,140.00	0.74
7	600320	振华重工	5,453,652	22,523,582.76	0.74
8	002738	中矿资源	377,100	22,245,129.00	0.73
9	002266	浙富控股	4,319,300	21,855,658.00	0.72
10	000036	华联控股	4,844,600	21,170,902.00	0.69
11	300933	中辰股份	3,388,800	20,603,904.00	0.68
12	000683	博源化工	3,487,100	20,085,696.00	0.66
13	001286	陕西能源	1,909,200	19,359,288.00	0.63
14	000949	新乡化纤	2,989,800	18,955,332.00	0.62
15	000938	紫光股份	651,300	18,796,518.00	0.62
16	002064	华峰化学	1,979,600	18,786,404.00	0.62
17	002246	北化股份	981,900	18,459,720.00	0.60
18	002025	航天电器	239,782	18,276,184.04	0.60
19	002284	亚太股份	1,916,600	18,188,534.00	0.60
20	300842	帝科股份	201,400	17,958,838.00	0.59
21	300358	楚天科技	2,219,450	17,755,600.00	0.58
22	300213	佳讯飞鸿	2,921,100	17,701,866.00	0.58
23	300271	华宇软件	3,638,288	17,536,548.16	0.57
24	000676	智度股份	3,385,100	17,297,861.00	0.57
25	600115	中国东航	4,518,300	17,214,723.00	0.56
26	002398	垒知集团	4,541,300	17,029,875.00	0.56
27	688173	希荻微	882,540	16,891,815.60	0.55
28	601700	风范股份	3,866,300	16,857,068.00	0.55
29	002271	东方雨虹	1,410,200	16,739,074.00	0.55
30	601608	中信重工	3,502,700	16,707,879.00	0.55
31	600963	岳阳林纸	5,485,500	16,675,920.00	0.55
32	600502	安徽建工	3,785,400	16,466,490.00	0.54
33	002593	日上集团	4,124,400	16,456,356.00	0.54
34	300672	国科微	55,600	16,402,000.00	0.54
35	002458	益生股份	2,109,311	16,389,346.47	0.54
36	300168	万达信息	3,559,910	16,339,986.90	0.54
37	601068	中铝国际	3,764,100	16,260,912.00	0.53
38	000990	诚志股份	1,986,000	16,245,480.00	0.53
39	000425	徐工机械	1,990,200	16,100,718.00	0.53
40	300490	华自科技	1,214,300	16,065,189.00	0.53
41	300323	华灿光电	787,334	16,061,613.60	0.53
42	000852	石化机械	3,207,800	15,910,688.00	0.52
43	300806	斯迪克	140,500	15,736,000.00	0.52
44	300408	三环集团	94,100	15,705,290.00	0.51
45	002532	天山铝业	1,457,600	15,640,048.00	0.51
46	002488	金固股份	1,745,700	15,554,187.00	0.51
47	002054	德美化工	2,336,500	15,537,725.00	0.51

48	002204	大连重工	2,923,600	15,436,608.00	0.51
49	002454	松芝股份	3,229,380	15,436,436.40	0.51
50	002752	昇兴股份	2,789,300	15,396,936.00	0.50
51	000420	吉林化纤	3,786,700	15,336,135.00	0.50
52	000567	海德股份	2,522,600	15,059,922.00	0.49
53	300919	中伟新材	341,920	14,959,000.00	0.49
54	300332	天壕能源	3,477,500	14,953,250.00	0.49
55	601766	中国中车	2,875,400	14,952,080.00	0.49
56	301606	绿联科技	244,900	14,943,798.00	0.49
57	600271	航天信息	2,268,100	14,924,098.00	0.49
58	300006	莱美药业	2,904,200	14,898,546.00	0.49
59	300253	卫宁健康	2,207,400	14,855,802.00	0.49
60	000100	TCL 科技	2,540,000	14,782,800.00	0.48
61	600674	川投能源	1,037,121	14,696,004.57	0.48
62	001389	广合科技	61,800	14,662,050.00	0.48
63	002382	蓝帆医疗	2,859,800	14,527,784.00	0.48
64	300034	钢研高纳	846,280	14,505,239.20	0.48
65	000933	神火股份	679,000	14,394,800.00	0.47
66	000059	华锦股份	3,823,200	14,337,000.00	0.47
67	002493	荣盛石化	1,328,825	14,284,868.75	0.47
68	300369	绿盟科技	2,620,800	14,257,152.00	0.47
69	002120	韵达股份	2,211,900	14,067,684.00	0.46
70	000553	安道麦 A	2,625,900	14,048,565.00	0.46
71	002016	世荣兆业	3,504,900	14,019,600.00	0.46
72	600166	福田汽车	4,801,200	13,971,492.00	0.46
73	600266	城建发展	3,570,000	13,958,700.00	0.46
74	600482	中国动力	410,600	13,467,680.00	0.44
75	600426	华鲁恒升	555,200	13,280,384.00	0.44
76	000045	深纺织 A	1,252,000	13,196,080.00	0.43
77	601058	赛轮轮胎	1,144,000	13,190,320.00	0.43
78	003816	中国广核	3,281,000	12,828,710.00	0.42
79	300322	硕贝德	508,800	12,821,760.00	0.42
80	301189	奥尼电子	215,940	12,725,344.20	0.42
81	601096	宏盛华源	2,924,000	12,690,160.00	0.42
82	002166	莱茵生物	2,004,430	12,587,820.40	0.41
83	301608	博实结	245,781	12,352,953.06	0.40
84	600989	宝丰能源	606,900	12,338,277.00	0.40
85	000906	浙商中拓	2,414,493	12,169,044.72	0.40
86	300128	锦富技术	2,017,700	11,944,784.00	0.39
87	300432	富临精工	587,500	11,802,875.00	0.39
88	000027	深圳能源	1,895,200	11,750,240.00	0.39
89	002948	青岛银行	2,297,400	11,670,792.00	0.38
90	000031	大悦城	5,400,080	11,448,169.60	0.38
91	000402	金融街	4,747,900	11,442,439.00	0.37

92	600489	中金黄金	628,000	11,335,400.00	0.37
93	301025	读客文化	1,457,000	11,306,320.00	0.37
94	600886	国投电力	843,000	11,220,330.00	0.37
95	300855	图南股份	354,300	11,075,418.00	0.36
96	002887	绿茵生态	1,025,600	10,738,032.00	0.35
97	300575	中旗股份	2,180,900	10,730,028.00	0.35
98	300932	三友联众	1,012,120	10,728,472.00	0.35
99	600037	歌华有线	1,699,400	10,655,238.00	0.35
100	002798	帝欧水华	2,132,300	10,640,177.00	0.35
101	300233	金城医药	839,600	10,411,040.00	0.34
102	688678	福立旺	423,530	10,236,720.10	0.34
103	600288	大恒科技	767,600	10,209,080.00	0.33
104	600738	丽尚国潮	2,835,100	10,206,360.00	0.33
105	688627	精智达	14,200	10,153,000.00	0.33
106	600230	沧州大化	756,000	9,843,120.00	0.32
107	002152	广电运通	1,044,500	9,797,410.00	0.32
108	300133	华策影视	1,338,200	9,474,456.00	0.31
109	601872	招商轮船	537,600	9,445,632.00	0.31
110	002953	日丰股份	1,068,400	9,316,448.00	0.31
111	002090	金智科技	1,044,700	9,235,148.00	0.30
112	688167	炬光科技	26,051	9,227,524.71	0.30
113	000338	潍柴动力	337,100	9,185,975.00	0.30
114	600135	乐凯胶片	1,141,472	9,120,361.28	0.30
115	002558	巨人网络	325,000	8,957,000.00	0.29
116	600590	泰豪科技	876,500	8,852,650.00	0.29
117	000680	山推股份	880,800	8,852,040.00	0.29
118	002396	星网锐捷	457,800	8,776,026.00	0.29
119	002441	众业达	1,107,400	8,637,720.00	0.28
120	688148	芳源股份	1,005,011	8,622,994.38	0.28
121	601231	环旭电子	255,000	8,262,000.00	0.27
122	688653	康希通信	474,603	8,248,600.14	0.27
123	601619	嘉泽新能	1,901,800	8,177,740.00	0.27
124	301082	久盛电气	911,160	8,163,993.60	0.27
125	600026	中远海能	444,700	7,977,918.00	0.26
126	600966	博汇纸业	1,650,300	7,888,434.00	0.26
127	300510	金冠股份	2,510,200	7,831,824.00	0.26
128	300324	旋极信息	2,102,900	7,822,788.00	0.26
129	300389	艾比森	607,800	7,791,996.00	0.26
130	688275	万润新能	60,504	7,717,285.20	0.25
131	300532	今天国际	1,238,120	7,713,487.60	0.25
132	300414	中光防雷	695,509	7,664,509.18	0.25
133	300073	当升科技	158,700	7,623,948.00	0.25
134	605287	德才股份	181,200	7,517,988.00	0.25
135	301048	金鹰重工	869,800	7,488,978.00	0.25

136	000807	云铝股份	333,100	7,374,834.00	0.24
137	002292	奥飞娱乐	1,119,700	7,345,232.00	0.24
138	301536	星宸科技	56,900	7,323,599.00	0.24
139	301012	扬电科技	305,000	7,164,450.00	0.23
140	002479	富春环保	1,693,000	7,127,530.00	0.23
141	300187	永清环保	1,373,900	6,938,195.00	0.23
142	000155	川能动力	579,100	6,937,618.00	0.23
143	002264	新华都	1,229,800	6,936,072.00	0.23
144	600105	永鼎股份	102,700	6,930,196.00	0.23
145	002273	水晶光电	190,600	6,762,488.00	0.22
146	300868	杰美特	45,800	6,719,318.00	0.22
147	002609	捷顺科技	844,100	6,432,042.00	0.21
148	688766	普冉股份	8,353	6,403,409.80	0.21
149	002078	太阳纸业	510,300	6,373,647.00	0.21
150	301219	腾远钴业	114,890	6,295,972.00	0.21
151	300948	冠中生态	235,500	6,271,365.00	0.21
152	000589	贵州轮胎	1,535,800	6,235,348.00	0.20
153	301057	汇隆新材	261,300	6,009,900.00	0.20
154	002497	雅化集团	293,900	5,986,743.00	0.20
155	688668	鼎通科技	16,000	5,972,800.00	0.20
156	002648	卫星化学	253,900	5,964,111.00	0.20
157	300903	科翔股份	58,500	5,926,635.00	0.19
158	002947	恒铭达	77,900	5,924,295.00	0.19
159	301237	和顺科技	79,900	5,918,992.00	0.19
160	603799	华友钴业	120,600	5,820,156.00	0.19
161	301558	三态股份	909,400	5,610,998.00	0.18
162	002483	润邦股份	1,132,100	5,592,574.00	0.18
163	301051	信濠光电	284,800	5,525,120.00	0.18
164	600201	生物股份	474,200	5,524,430.00	0.18
165	002643	万润股份	260,000	5,447,000.00	0.18
166	002587	奥拓电子	696,000	5,435,760.00	0.18
167	300572	安车检测	185,700	5,268,309.00	0.17
168	601968	宝钢包装	1,336,000	5,237,120.00	0.17
169	300968	格林精密	537,700	5,183,428.00	0.17
170	300154	瑞凌股份	686,900	5,165,488.00	0.17
171	301216	万凯新材	223,063	5,128,218.37	0.17
172	301190	善水科技	314,700	5,044,641.00	0.17
173	300016	北陆药业	657,100	5,039,957.00	0.17
174	002401	中远海科	433,960	5,038,275.60	0.17
175	601121	宝地矿业	891,400	5,027,496.00	0.16
176	601226	华电科工	787,300	5,007,228.00	0.16
177	603882	金域医学	222,200	4,995,056.00	0.16
178	300587	天铁科技	1,296,200	4,990,370.00	0.16
179	300711	广哈通信	302,800	4,965,920.00	0.16

180	002419	天虹股份	1,130,402	4,781,600.46	0.16
181	605007	五洲特纸	356,300	4,770,857.00	0.16
182	002841	视源股份	137,634	4,752,502.02	0.16
183	688630	芯碁微装	8,512	4,676,407.68	0.15
184	301062	上海艾录	813,400	4,644,514.00	0.15
185	300523	辰安科技	248,200	4,561,916.00	0.15
186	000703	恒逸石化	333,000	4,518,810.00	0.15
187	000514	渝开发	1,257,400	4,501,492.00	0.15
188	603926	铁流股份	253,500	4,484,415.00	0.15
189	301045	天禄科技	50,300	4,480,724.00	0.15
190	600025	华能水电	501,100	4,454,779.00	0.15
191	600617	国新能源	1,649,000	4,419,320.00	0.14
192	601168	西部矿业	160,900	4,366,826.00	0.14
193	000975	山金国际	255,000	4,335,000.00	0.14
194	301060	兰卫医学	529,400	4,325,198.00	0.14
195	002838	道恩股份	141,100	4,320,482.00	0.14
196	300887	谱尼测试	607,100	4,225,416.00	0.14
197	601969	海南矿业	518,500	4,101,335.00	0.13
198	300848	美瑞新材	287,300	4,007,835.00	0.13
199	688536	思瑞浦	11,000	4,004,990.00	0.13
200	300308	中际旭创	3,100	3,937,000.00	0.13
201	600880	博瑞传播	1,059,700	3,920,890.00	0.13
202	002683	广东宏大	132,700	3,886,783.00	0.13
203	601002	晋亿实业	886,500	3,829,680.00	0.13
204	300184	力源信息	216,500	3,799,575.00	0.12
205	603112	华翔股份	227,100	3,799,383.00	0.12
206	002376	新北洋	650,700	3,741,525.00	0.12
207	002833	弘亚数控	192,700	3,717,183.00	0.12
208	600167	联美控股	661,800	3,699,462.00	0.12
209	000688	国城矿业	106,700	3,652,341.00	0.12
210	688593	新相微	93,461	3,637,502.12	0.12
211	601975	招商南油	958,600	3,575,578.00	0.12
212	300480	光力科技	82,900	3,538,172.00	0.12
213	601117	中国化学	480,400	3,530,940.00	0.12
214	300489	光智科技	11,200	3,493,840.00	0.11
215	002414	高德红外	261,000	3,460,860.00	0.11
216	601038	一拖股份	322,400	3,414,216.00	0.11
217	000883	湖北能源	789,202	3,409,352.64	0.11
218	002358	森源电气	614,000	3,407,700.00	0.11
219	300422	博世科	802,700	3,379,367.00	0.11
220	002979	雷赛智能	60,400	3,369,112.00	0.11
221	603381	永臻股份	217,200	3,347,052.00	0.11
222	300793	佳禾智能	295,700	3,326,625.00	0.11
223	301002	崧盛股份	85,608	3,304,468.80	0.11

224	300738	奥飞数据	163,000	3,295,860.00	0.11
225	600662	外服控股	799,300	3,221,179.00	0.11
226	002296	辉煌科技	352,400	3,129,312.00	0.10
227	000690	宝新能源	665,350	3,127,145.00	0.10
228	002556	辉隆股份	693,600	3,107,328.00	0.10
229	600601	方正科技	223,700	3,096,008.00	0.10
230	001378	德冠新材	172,120	3,082,669.20	0.10
231	300857	协创数据	9,000	3,059,100.00	0.10
232	000561	烽火电子	410,000	3,034,000.00	0.10
233	603083	剑桥科技	11,900	3,032,953.00	0.10
234	301085	亚康股份	49,500	3,000,195.00	0.10
235	300834	星辉环材	70,800	2,959,440.00	0.10
236	002392	北京利尔	361,800	2,919,726.00	0.10
237	300661	圣邦股份	20,300	2,912,644.00	0.10
238	002876	三利谱	80,700	2,841,447.00	0.09
239	600452	涪陵电力	304,300	2,839,119.00	0.09
240	600893	航发动力	73,600	2,821,824.00	0.09
241	300548	长芯博创	10,100	2,807,800.00	0.09
242	300206	理邦仪器	224,900	2,750,527.00	0.09
243	600523	贵航股份	259,840	2,741,312.00	0.09
244	002468	申通快递	186,300	2,712,528.00	0.09
245	300458	全志科技	68,600	2,706,956.00	0.09
246	300817	双飞集团	172,900	2,697,240.00	0.09
247	688518	联赢激光	86,746	2,680,451.40	0.09
248	301307	美利信	35,400	2,665,266.00	0.09
249	301358	湖南裕能	34,800	2,640,276.00	0.09
250	002440	闰土股份	256,900	2,633,225.00	0.09
251	688378	奥来德	42,468	2,633,016.00	0.09
252	603111	康尼机电	464,200	2,627,372.00	0.09
253	603928	兴业股份	175,460	2,596,808.00	0.09
254	300236	上海新阳	19,300	2,537,950.00	0.08
255	600795	国电电力	537,200	2,508,724.00	0.08
256	001289	龙源电力	158,700	2,480,481.00	0.08
257	000166	申万宏源	558,600	2,457,840.00	0.08
258	600372	中航机载	226,000	2,452,100.00	0.08
259	688146	中船特气	7,000	2,449,930.00	0.08
260	603396	金辰股份	92,200	2,443,300.00	0.08
261	301377	鼎泰高科	4,400	2,423,960.00	0.08
262	688359	三孚新科	12,200	2,420,968.00	0.08
263	002843	泰嘉股份	112,100	2,406,787.00	0.08
264	002161	远望谷	446,900	2,404,322.00	0.08
265	688209	英集芯	82,476	2,398,402.08	0.08
266	600875	东方电气	82,700	2,379,279.00	0.08
267	600740	山西焦化	733,500	2,339,865.00	0.08

268	000404	长虹华意	297,500	2,338,350.00	0.08
269	300278	华昌达	598,500	2,322,180.00	0.08
270	600526	菲达环保	563,900	2,317,629.00	0.08
271	600330	天通股份	74,600	2,300,664.00	0.08
272	002111	威海广泰	255,500	2,299,500.00	0.08
273	002922	伊戈尔	70,000	2,296,000.00	0.08
274	002448	中原内配	184,600	2,270,580.00	0.07
275	300393	中来股份	310,500	2,263,545.00	0.07
276	000156	华数传媒	357,600	2,256,456.00	0.07
277	300984	金沃股份	41,960	2,254,510.80	0.07
278	301153	中科江南	137,760	2,244,110.40	0.07
279	301567	贝隆精密	64,500	2,232,345.00	0.07
280	300438	鹏辉能源	26,900	2,228,665.00	0.07
281	600556	天下秀	499,153	2,206,256.26	0.07
282	688779	五矿新能	271,907	2,205,165.77	0.07
283	600741	华域汽车	140,580	2,181,801.60	0.07
284	300434	金石亚药	194,100	2,179,743.00	0.07
285	300971	博亚精工	116,500	2,173,890.00	0.07
286	002545	东方铁塔	133,900	2,171,858.00	0.07
287	688717	艾罗能源	25,842	2,133,773.94	0.07
288	300590	移为通信	148,500	2,130,975.00	0.07
289	603768	常青股份	232,400	2,121,812.00	0.07
290	301526	国际复材	45,400	2,118,818.00	0.07
291	600361	创新新材	583,200	2,099,520.00	0.07
292	600509	天富能源	246,300	2,081,235.00	0.07
293	688560	明冠新材	175,600	2,080,860.00	0.07
294	688410	山外山	144,879	2,080,462.44	0.07
295	002895	川恒股份	70,600	2,061,520.00	0.07
296	002187	广百股份	429,900	2,011,932.00	0.07
297	301587	中瑞股份	91,500	2,008,425.00	0.07
298	603817	海峡环保	389,700	1,991,367.00	0.07
299	300381	溢多利	352,000	1,978,240.00	0.06
300	301507	民生健康	163,500	1,966,905.00	0.06
301	688035	德邦科技	21,400	1,964,520.00	0.06
302	600233	圆通速递	124,500	1,960,875.00	0.06
303	603489	八方股份	69,900	1,954,404.00	0.06
304	002011	盾安环境	183,300	1,944,813.00	0.06
305	300599	雄塑科技	189,200	1,905,244.00	0.06
306	002943	宇晶股份	42,900	1,897,467.00	0.06
307	002375	亚厦股份	557,400	1,884,012.00	0.06
308	601061	中信金属	174,000	1,873,980.00	0.06
309	600727	鲁北化工	278,100	1,868,832.00	0.06
310	300457	赢合科技	87,700	1,848,716.00	0.06
311	600098	广州发展	312,100	1,844,511.00	0.06

312	002373	千方科技	254,900	1,830,182.00	0.06
313	601777	千里科技	222,100	1,812,336.00	0.06
314	002919	名臣健康	95,000	1,804,050.00	0.06
315	688390	固德威	16,600	1,801,266.00	0.06
316	300757	罗博特科	2,900	1,795,100.00	0.06
317	600019	宝钢股份	329,800	1,790,814.00	0.06
318	601139	深圳燃气	315,600	1,786,296.00	0.06
319	603708	家家悦	205,600	1,764,048.00	0.06
320	000810	创维数字	132,700	1,758,275.00	0.06
321	301086	鸿富瀚	8,240	1,724,467.20	0.06
322	301396	宏景科技	5,180	1,717,688.00	0.06
323	688521	芯原股份	4,600	1,707,244.00	0.06
324	002810	山东赫达	68,200	1,684,540.00	0.06
325	301386	未来电器	81,500	1,679,715.00	0.06
326	001379	腾达科技	106,700	1,675,190.00	0.05
327	688692	达梦数据	6,800	1,661,172.00	0.05
328	600150	中国船舶	49,119	1,659,731.01	0.05
329	600027	华电国际	369,300	1,643,385.00	0.05
330	603322	超讯科技	57,900	1,643,202.00	0.05
331	002035	华帝股份	363,200	1,641,664.00	0.05
332	600312	平高电气	92,900	1,640,614.00	0.05
333	002811	郑中设计	144,100	1,612,479.00	0.05
334	600336	澳柯玛	258,500	1,610,455.00	0.05
335	002911	佛燃能源	167,800	1,592,422.00	0.05
336	300230	永利股份	375,500	1,577,100.00	0.05
337	603719	良品铺子	182,000	1,574,300.00	0.05
338	603588	高能环境	81,800	1,570,560.00	0.05
339	300171	东富龙	138,300	1,529,598.00	0.05
340	688503	聚和材料	11,526	1,529,500.20	0.05
341	600203	福日电子	123,200	1,496,880.00	0.05
342	300797	钢研纳克	112,600	1,493,076.00	0.05
343	688238	和元生物	273,130	1,480,364.60	0.05
344	002465	海格通信	114,900	1,467,273.00	0.05
345	002531	天顺风能	173,400	1,461,762.00	0.05
346	002590	万安科技	142,400	1,424,000.00	0.05
347	002588	史丹利	179,700	1,419,630.00	0.05
348	603889	新澳股份	276,100	1,410,871.00	0.05
349	000534	万泽股份	51,500	1,409,040.00	0.05
350	301087	可孚医疗	29,050	1,384,232.50	0.05
351	301095	广立微	11,700	1,381,185.00	0.05
352	000967	盈峰环境	130,200	1,371,006.00	0.04
353	603876	鼎胜新材	52,500	1,365,525.00	0.04
354	600226	亨通股份	142,300	1,364,657.00	0.04
355	002017	东信和平	92,900	1,359,127.00	0.04

356	600955	维远股份	92,100	1,355,712.00	0.04
357	301339	通行宝	132,400	1,354,452.00	0.04
358	000415	渤海租赁	331,600	1,349,612.00	0.04
359	001309	德明利	1,400	1,320,060.00	0.04
360	688195	腾景科技	6,800	1,309,544.00	0.04
361	600970	中材国际	182,100	1,298,373.00	0.04
362	300787	海能实业	141,200	1,287,744.00	0.04
363	301295	美硕科技	30,200	1,273,836.00	0.04
364	300563	神宇股份	44,100	1,251,999.00	0.04
365	600210	紫江企业	201,900	1,251,780.00	0.04
366	688110	东芯股份	6,145	1,251,736.50	0.04
367	002020	京新药业	99,600	1,244,004.00	0.04
368	300048	合康新能	262,600	1,226,342.00	0.04
369	300578	会畅科技	69,500	1,208,605.00	0.04
370	301326	捷邦科技	8,500	1,184,645.00	0.04
371	603663	三祥新材	12,200	1,174,860.00	0.04
372	300407	凯发电气	108,000	1,166,400.00	0.04
373	300170	汉得信息	75,900	1,156,716.00	0.04
374	300426	华智数媒	228,100	1,154,186.00	0.04
375	300227	光韵达	94,200	1,120,980.00	0.04
376	300232	洲明科技	195,600	1,120,788.00	0.04
377	600748	上实发展	293,500	1,091,820.00	0.04
378	301571	国科天成	16,700	1,088,506.00	0.04
379	002653	海思科	16,400	1,087,976.00	0.04
380	002666	德联集团	273,000	1,078,350.00	0.04
381	300830	金现代	134,700	1,069,518.00	0.04
382	001376	百通能源	102,700	1,068,080.00	0.03
383	002048	宁波华翔	46,415	1,067,545.00	0.03
384	688519	南亚新材	2,800	1,064,112.00	0.03
385	002722	物产金轮	90,200	1,063,458.00	0.03
386	600273	嘉化能源	162,500	1,059,500.00	0.03
387	300975	商络电子	20,400	1,055,700.00	0.03
388	603018	华设集团	204,360	1,050,410.40	0.03
389	688472	阿特斯	95,480	1,033,093.60	0.03
390	605577	龙版传媒	116,200	1,023,722.00	0.03
391	300620	光库科技	2,700	1,021,140.00	0.03
392	301321	翰博高新	22,837	1,008,253.55	0.03
393	600496	精工钢构	320,508	993,574.80	0.03
394	688387	信科移动-U	49,600	984,064.00	0.03
395	603738	泰晶科技	16,300	978,815.00	0.03
396	300320	海达股份	102,500	977,850.00	0.03
397	002899	英派斯	44,600	972,280.00	0.03
398	600353	旭光电子	21,300	971,280.00	0.03
399	688257	新锐股份	9,417	959,592.30	0.03

400	688416	恒烁股份	6,846	958,440.00	0.03
401	600716	凤凰股份	283,900	953,904.00	0.03
402	688368	晶丰明源	4,400	952,688.00	0.03
403	300223	北京君正	3,800	945,820.00	0.03
404	300084	海默科技	78,000	938,340.00	0.03
405	688586	江航装备	79,448	928,747.12	0.03
406	600259	中稀有色	9,100	924,651.00	0.03
407	300691	联合光电	58,383	923,035.23	0.03
408	300131	英唐智控	48,400	921,052.00	0.03
409	300567	精测电子	2,900	921,040.00	0.03
410	300613	富瀚微	11,500	920,920.00	0.03
411	002772	众兴菌业	80,300	912,208.00	0.03
412	301345	涛涛车业	3,800	877,800.00	0.03
413	000875	电投绿能	169,900	874,985.00	0.03
414	300302	同有科技	17,000	869,890.00	0.03
415	600973	宝胜股份	120,400	853,636.00	0.03
416	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
417	301380	挖金客	30,800	849,772.00	0.03
418	300694	蠡湖股份	87,300	838,080.00	0.03
419	300884	狄耐克	83,300	826,336.00	0.03
420	688693	锆威特	7,900	821,205.00	0.03
421	002636	金安国纪	6,800	815,796.00	0.03
422	000968	蓝焰控股	135,200	809,848.00	0.03
423	002250	联化科技	57,600	787,392.00	0.03
424	300447	全信股份	52,600	785,318.00	0.03
425	300617	安靠智电	14,700	778,953.00	0.03
426	688556	高测股份	57,820	767,849.60	0.03
427	688059	华锐精密	3,800	758,898.00	0.02
428	002511	中顺洁柔	113,500	754,775.00	0.02
429	300448	浩云科技	129,900	748,224.00	0.02
430	301175	中科环保	150,900	746,955.00	0.02
431	603308	应流股份	12,300	742,920.00	0.02
432	300466	赛摩智能	104,900	738,496.00	0.02
433	001330	博纳影业	130,600	733,972.00	0.02
434	300986	志特新材	42,700	732,305.00	0.02
435	301280	珠城科技	13,800	697,866.00	0.02
436	301096	百诚医药	12,100	691,999.00	0.02
437	002879	长缆科技	48,000	630,240.00	0.02
438	002478	常宝股份	101,119	624,915.42	0.02
439	688702	盛科通信-U	1,600	623,984.00	0.02
440	300428	立中集团	33,529	609,557.22	0.02
441	300890	翔丰华	18,200	603,694.00	0.02
442	603085	天成自控	54,800	595,676.00	0.02
443	002916	深南电路	1,300	595,270.00	0.02

444	301103	何氏眼科	39,100	585,718.00	0.02
445	688205	德科立	2,800	582,932.00	0.02
446	300987	川网传媒	47,200	580,560.00	0.02
447	688311	盟升电子	21,886	573,194.34	0.02
448	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.02
449	603992	松霖科技	17,400	563,760.00	0.02
450	301308	江波龙	800	563,040.00	0.02
451	300800	力合科技	59,500	550,375.00	0.02
452	300172	中电环保	132,600	547,638.00	0.02
453	300342	天银机电	11,600	545,200.00	0.02
454	002378	章源钨业	16,100	539,028.00	0.02
455	600628	新世界	93,773	527,941.99	0.02
456	688629	华丰科技	2,800	525,028.00	0.02
457	300179	四方达	8,800	522,984.00	0.02
458	600099	林海股份	65,200	520,296.00	0.02
459	002322	理工能科	53,600	519,920.00	0.02
460	300244	迪安诊断	27,400	513,476.00	0.02
461	300373	扬杰科技	3,200	503,136.00	0.02
462	688549	中巨芯-U	13,600	500,616.00	0.02
463	301099	雅创电子	5,200	496,600.00	0.02
464	000950	重药控股	95,300	477,453.00	0.02
465	300636	同和药业	74,150	472,335.50	0.02
466	002391	长青股份	94,300	459,241.00	0.02
467	000682	东方电子	36,300	458,469.00	0.02
468	001267	汇绿生态	8,500	454,750.00	0.01
469	300005	探路者	19,800	447,480.00	0.01
470	301516	中远通	31,100	440,065.00	0.01
471	301205	联特科技	1,300	434,330.00	0.01
472	600395	盘江股份	95,000	433,200.00	0.01
473	601212	白银有色	82,600	419,608.00	0.01
474	000969	安泰科技	16,800	412,272.00	0.01
475	002967	广电计量	22,400	404,320.00	0.01
476	300055	万邦达	62,400	401,232.00	0.01
477	002975	博杰股份	2,800	397,600.00	0.01
478	688700	东威科技	4,384	391,929.60	0.01
479	002408	齐翔腾达	81,200	380,828.00	0.01
480	001287	中电港	12,200	380,030.00	0.01
481	300769	德方纳米	5,600	372,400.00	0.01
482	300475	香农芯创	1,200	360,000.00	0.01
483	301116	益客食品	41,900	358,664.00	0.01
484	300504	天邑股份	22,000	354,860.00	0.01
485	603618	杭电股份	7,000	349,160.00	0.01
486	601069	西部黄金	15,700	345,400.00	0.01
487	300872	天阳科技	21,800	344,440.00	0.01

488	002174	游族网络	27,300	344,253.00	0.01
489	000922	佳电股份	24,464	341,517.44	0.01
490	688548	广钢气体	6,544	340,942.40	0.01
491	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
492	600692	亚通股份	62,200	337,746.00	0.01
493	601869	长飞光纤	600	327,540.00	0.01
494	002849	威星智能	19,100	323,172.00	0.01
495	301150	中一科技	5,000	315,550.00	0.01
496	300843	胜蓝股份	2,000	312,500.00	0.01
497	002238	天威视讯	57,400	309,960.00	0.01
498	000905	厦门港务	39,600	307,296.00	0.01
499	688790	昂瑞微-UW	2,319	293,237.55	0.01
500	688603	天承科技	1,400	291,130.00	0.01
501	300378	鼎捷数智	8,000	288,800.00	0.01
502	688048	长光华芯	566	284,132.00	0.01
503	603915	国茂股份	20,000	283,800.00	0.01
504	600100	同方股份	41,200	282,220.00	0.01
505	605196	华通线缆	10,800	281,880.00	0.01
506	000603	盛达资源	12,200	281,820.00	0.01
507	300327	中颖电子	8,700	278,835.00	0.01
508	688628	优利德	2,800	277,032.00	0.01
509	300835	龙磁科技	1,200	275,388.00	0.01
510	600726	华电能源	38,600	274,832.00	0.01
511	688226	威腾电气	6,400	274,112.00	0.01
512	002206	海利得	52,600	271,942.00	0.01
513	300938	信测标准	5,400	269,352.00	0.01
514	688365	光云科技	16,920	266,828.40	0.01
515	301500	飞南资源	10,000	260,500.00	0.01
516	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
517	688333	铂力特	2,512	257,228.80	0.01
518	300497	富祥股份	11,600	257,056.00	0.01
519	300766	每日互动	12,000	256,800.00	0.01
520	001339	智微智能	2,500	255,700.00	0.01
521	300502	新易盛	420	254,940.00	0.01
522	301489	思泉新材	1,542	253,782.36	0.01
523	603982	泉峰汽车	44,500	248,755.00	0.01
524	300041	回天新材	15,800	245,532.00	0.01
525	601003	柳钢股份	69,700	234,889.00	0.01
526	002449	国星光电	30,100	233,275.00	0.01
527	300837	浙矿股份	9,700	230,472.00	0.01
528	300582	英飞特	18,900	230,202.00	0.01
529	002342	巨力索具	21,800	229,118.00	0.01
530	601890	亚星锚链	28,000	228,760.00	0.01
531	000797	中国武夷	103,700	227,103.00	0.01

532	002339	积成电子	32,600	225,918.00	0.01
533	000636	风华高科	3,100	223,944.00	0.01
534	002929	润建股份	3,300	220,704.00	0.01
535	688127	蓝特光学	2,216	216,281.60	0.01
536	002745	木林森	17,200	215,860.00	0.01
537	002885	京泉华	5,200	212,472.00	0.01
538	603063	禾望电气	3,900	206,271.00	0.01
539	688239	航宇科技	3,400	203,422.00	0.01
540	688221	前沿生物-U	9,000	201,600.00	0.01
541	688400	凌云光	3,038	201,115.60	0.01
542	002539	云图控股	17,700	200,364.00	0.01
543	300854	中兰环保	10,500	200,340.00	0.01
544	300706	阿石创	2,300	198,605.00	0.01
545	688321	微芯生物	7,303	192,287.99	0.01
546	688609	九联科技	17,135	188,656.35	0.01
547	300846	首都在线	8,800	186,648.00	0.01
548	603496	恒为科技	7,900	181,542.00	0.01
549	600835	上海机电	8,800	181,280.00	0.01
550	300185	通裕重工	66,000	180,180.00	0.01
551	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
552	301031	中熔电气	1,500	179,175.00	0.01
553	603538	美诺华	5,500	179,025.00	0.01
554	002239	奥特佳	72,300	178,581.00	0.01
555	000612	焦作万方	16,700	176,853.00	0.01
556	688005	容百科技	5,665	173,349.00	0.01
557	300026	红日药业	59,600	172,840.00	0.01
558	300776	帝尔激光	800	171,968.00	0.01
559	603689	皖天然气	24,800	171,864.00	0.01
560	600664	哈药股份	57,100	170,729.00	0.01
561	301040	中环海陆	7,000	170,590.00	0.01
562	603317	天味食品	13,100	170,431.00	0.01
563	603613	国联股份	9,100	167,622.00	0.01
564	002563	森马服饰	33,200	167,328.00	0.01
565	601801	皖新传媒	33,900	167,127.00	0.01
566	002716	湖南白银	20,500	165,845.00	0.01
567	601326	秦港股份	52,400	165,584.00	0.01
568	600651	飞乐音响	29,500	164,905.00	0.01
569	002004	华邦健康	41,700	163,881.00	0.01
570	000927	中国铁物	72,100	163,667.00	0.01
571	600067	冠城新材	55,400	160,660.00	0.01
572	600654	中安科	60,200	160,132.00	0.01
573	002221	东华能源	29,900	157,274.00	0.01
574	688612	威迈斯	5,222	154,518.98	0.01
575	688303	大全能源	8,505	148,242.15	0.00

576	300036	超图软件	12,800	144,256.00	0.00
577	600185	珠免集团	30,500	137,250.00	0.00
578	600933	爱柯迪	8,800	130,064.00	0.00
579	603170	宝立食品	11,400	128,820.00	0.00
580	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
581	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
582	600062	华润双鹤	6,300	101,052.00	0.00
583	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
584	600848	上海临港	12,500	93,625.00	0.00
585	300633	开立医疗	4,700	86,433.00	0.00
586	002484	江海股份	800	84,000.00	0.00
587	002622	皓宸医疗	40,500	83,835.00	0.00
588	000707	双环科技	18,119	76,462.18	0.00
589	600267	海正药业	7,300	73,803.00	0.00
590	300112	万讯自控	11,800	73,042.00	0.00
591	300138	晨光生物	8,000	72,000.00	0.00
592	600420	国药现代	8,500	67,575.00	0.00
593	688207	格灵深瞳	3,200	64,320.00	0.00
594	688781	视涯科技-UW	1,300	61,893.00	0.00
595	000426	兴业银锡	1,800	59,328.00	0.00
596	300554	三超新材	2,100	57,645.00	0.00
597	603867	新化股份	1,657	55,492.93	0.00
598	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
599	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
600	002746	仙坛股份	10,000	51,000.00	0.00
601	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
602	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
603	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
604	600796	钱江生化	7,600	35,264.00	0.00
605	600649	城投控股	9,000	31,050.00	0.00
606	603566	普莱柯	3,100	30,349.00	0.00
607	002293	罗莱生活	3,000	29,670.00	0.00
608	600582	天地科技	6,600	29,370.00	0.00
609	002487	大金重工	500	28,985.00	0.00
610	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
611	920156	海昌智能	500	24,390.00	0.00
612	603998	方盛制药	2,700	24,381.00	0.00
613	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
614	601200	上海环境	3,400	22,440.00	0.00
615	600675	中华企业	10,500	21,630.00	0.00
616	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
617	600011	华能国际	2,600	19,734.00	0.00
618	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
619	920161	龙辰科技	500	17,225.00	0.00

620	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
621	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
622	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
623	000009	中国宝安	2,400	14,952.00	0.00
624	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
625	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
626	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
627	920028	新恒泰	700	12,460.00	0.00
628	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
629	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
630	605117	德业股份	80	8,494.40	0.00
631	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
632	920036	觅睿科技	200	7,468.00	0.00
633	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
634	301332	德尔玛	900	6,885.00	0.00
635	001230	劲旅环境	420	6,451.20	0.00
636	920078	族兴新材	200	5,860.00	0.00
637	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
638	920177	恒道科技	200	5,018.00	0.00
639	920206	彩客科技	100	4,996.00	0.00
640	920180	爱得科技	400	4,944.00	0.00
641	600803	新奥股份	300	4,740.00	0.00
642	000001	平安银行	400	4,020.00	0.00
643	301298	东利机械	300	3,471.00	0.00
644	920076	国亮新材	280	3,455.20	0.00
645	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
646	301026	浩通科技	140	2,830.80	0.00
647	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
648	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
649	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
650	600114	东睦股份	55	2,076.80	0.00
651	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
652	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
653	002236	大华股份	90	1,484.10	0.00
654	300909	汇创达	18	1,047.96	0.00
655	300101	振芯科技	54	873.18	0.00
656	300596	利安隆	16	839.68	0.00
657	603185	弘元绿能	40	667.60	0.00
658	300942	易瑞生物	54	312.12	0.00
659	603135	中重科技	20	242.00	0.00
660	600101	明星电力	20	157.80	0.00
661	603733	仙鹤股份	1	27.01	0.00
662	002345	潮宏基	1	9.17	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	002497	雅化集团	106,436,843.10	2.78
2	002709	天赐材料	100,856,439.38	2.64
3	688498	源杰科技	98,550,697.80	2.58
4	600595	中孚实业	97,929,133.00	2.56
5	000036	华联控股	95,839,708.00	2.50
6	300358	楚天科技	93,615,070.00	2.45
7	300759	康龙化成	91,892,248.40	2.40
8	000519	中兵红箭	90,023,790.40	2.35
9	002558	巨人网络	88,149,196.00	2.30
10	601117	中国化学	87,738,566.00	2.29
11	600115	中国东航	85,406,112.50	2.23
12	600353	旭光电子	85,389,136.00	2.23
13	000933	神火股份	82,529,183.00	2.16
14	301358	湖南裕能	81,857,136.40	2.14
15	002392	北京利尔	80,525,290.00	2.10
16	002414	高德红外	78,583,316.20	2.05
17	301536	星辰科技	74,227,239.00	1.94
18	002373	千方科技	74,137,195.00	1.94
19	300369	绿盟科技	73,356,147.63	1.92
20	301606	绿联科技	73,312,595.00	1.92

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	601117	中国化学	112,172,111.89	2.93
2	002497	雅化集团	101,702,692.20	2.66
3	300219	鸿利智汇	100,809,511.35	2.63
4	002709	天赐材料	99,853,561.15	2.61

5	000519	中兵红箭	94,782,103.19	2.48
6	002414	高德红外	94,442,375.24	2.47
7	301606	绿联科技	92,965,845.52	2.43
8	300759	康龙化成	92,630,465.12	2.42
9	002392	北京利尔	92,243,877.00	2.41
10	301358	湖南裕能	91,043,617.02	2.38
11	688498	源杰科技	89,949,251.77	2.35
12	301536	星宸科技	85,867,769.00	2.24
13	300438	鹏辉能源	83,408,037.50	2.18
14	600353	旭光电子	81,281,361.00	2.12
15	300145	南方泵业	80,816,264.00	2.11
16	002057	中钢天源	80,547,432.74	2.10
17	300358	楚天科技	78,944,695.10	2.06
18	603890	春秋电子	75,796,643.21	1.98
19	002386	天原股份	73,953,461.48	1.93
20	600011	华能国际	73,086,992.13	1.91

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	20,107,818,771.63
卖出股票收入（成交）总额	20,725,179,586.11

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）	3,452,641.23	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	3,452,641.23	0.11
----	----	--------------	------

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	127113.SZ	长高转债	19,597	3,358,533.32	0.11
2	118072.SH	鼎通转债	590	59,001.81	0.00
3	110099.SH	福能转债	250	35,106.10	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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，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	1,129,589.37
2	应收清算款	39,828,746.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,988,828.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,947,164.66

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	110099.SH	福能转债	35,106.10	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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发量化多因子混合 A	64,567	19,457.22	187,859,728.84	14.95%	1,068,434,747.49	85.05%
广发量化多因	12,703	5,429.80	16,312,78	23.65%	52,661,93	76.35%

子混合 C			7.22		4.24	
合计	77,270	17,151.15	204,172,5 16.06	15.41%	1,121,096, 681.73	84.59%

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	59.18%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

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

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

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发量化多因子混合 A	5,541,556.93	0.4411%
	广发量化多因子混合 C	1,713.77	0.0025%
	合计	5,543,270.70	0.4183%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发量化多因子混合 A	>100
	广发量化多因子混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发量化多因子混合 A	>100
	广发量化多因子混合 C	0
	合计	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发量化多因子混合 A	广发量化多因子混合 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 21 日）基金份额总额	237,368,420.96	-
本报告期期初基金份额总额	1,529,773,014.32	103,106,887.39
本报告期基金总申购份额	1,588,037,414.92	261,833,503.98
减：本报告期基金总赎回份额	1,861,515,952.91	295,965,669.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,256,294,476.33	68,974,721.46

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	9,210,998,332.85	22.56%	4,016,030.16	22.56%	-
招商证券	2	7,644,645,532.69	18.72%	3,333,091.92	18.72%	-
国泰海通	3	5,034,506,990.51	12.33%	2,194,865.32	12.33%	-
中信证券	5	4,995,721,758.87	12.24%	2,178,151.93	12.24%	-
东方证券	1	3,455,511,423.97	8.46%	1,506,602.99	8.46%	-
申万宏源证券	1	3,125,497,575.50	7.65%	1,362,737.69	7.66%	-
国海证券	2	2,994,751,455.86	7.33%	1,305,716.03	7.33%	-
中信建投证券	2	1,561,490,027.75	3.82%	680,813.91	3.82%	-
国投证券	4	1,407,563,062.72	3.45%	613,701.28	3.45%	-
华西证券	2	1,033,202,844.22	2.53%	450,487.05	2.53%	-
广发证券	4	365,712,724.86	0.90%	159,450.69	0.90%	减少 2 个
中金公司	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	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
天风证券	74,952.50	3.44%	-	-	-	-
招商证券	47,000.00	2.15%	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	59,000.00	2.70%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	25,360.00	1.16%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,975,700.00	90.54%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

中航证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

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.中国证监会注册广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发量化多因子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.《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日