广发质量优选股票型证券投资基金

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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 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 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 15
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 15
6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 19
7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 53
7.12 投资组合报告附注 53

8 基金份额持有人信息 54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 54
9 开放式基金份额变动 55
10 重大事件揭示 55
10.1 基金份额持有人大会决议 55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 55
10.4 基金投资策略的改变 55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 56
10.8 其他重大事件 58
11 影响投资者决策的其他重要信息 58
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 58
12 备查文件目录 59
12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发质量优选股票型证券投资基金	
基金简称	广发质量优选股票	
基金主代码	025788	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 23 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	2,584,614,765.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发质量优选股票 A	广发质量优选股票 C
下属分级基金的交易代码	025788	025789
报告期末下属分级基金的份额总额	2,029,705,293.99 份	554,909,471.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过精选优质上市公司股票，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。在境内股票和香港股票方面，本基金将综合考虑以下因素进行两地股票的配置： 1、宏观经济因素； 2、估值因素； 3、政策因素（如财政政策、货币政策等）； 4、流动性因素等。 具体包括：1、大类资产配置策略；2、股票（含存托凭证）投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。 本基金资产若投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时

	卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国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	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	广发质量优选股票 A	广发质量优选股票 C
本期已实现收益	-26,573,490.21	-9,394,477.74
本期利润	-56,413,595.54	-17,198,620.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0206	-0.0229
本期加权平均净值利润率	-2.08%	-2.32%
本期基金份额净值增长率	-2.46%	-2.70%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发质量优选股票 A	广发质量优选股票 C
期末可供分配利润	-58,835,178.78	-17,480,889.14
期末可供分配基金份额利润	-0.0290	-0.0315
期末基金资产净值	1,970,870,115.21	537,428,582.00
期末基金份额净值	0.9710	0.9685
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发质量优选股票 A	广发质量优选股票 C
基金份额累计净值增长率	-2.90%	-3.15%

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

广发质量优选股票 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	1.44%	0.87%	9.90%	1.20%	-8.46%	-0.33%
过去六个月	-2.46%	0.73%	10.12%	1.24%	-12.58%	-0.51%

自基金合同生效起至今	-2.90%	0.71%	11.80%	1.20%	-14.70%	-0.49%

广发质量优选股票 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	1.32%	0.87%	9.90%	1.20%	-8.58%	-0.33%
过去六个月	-2.70%	0.73%	10.12%	1.24%	-12.82%	-0.51%
自基金合同生效起至今	-3.15%	0.71%	11.80%	1.20%	-14.95%	-0.49%

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

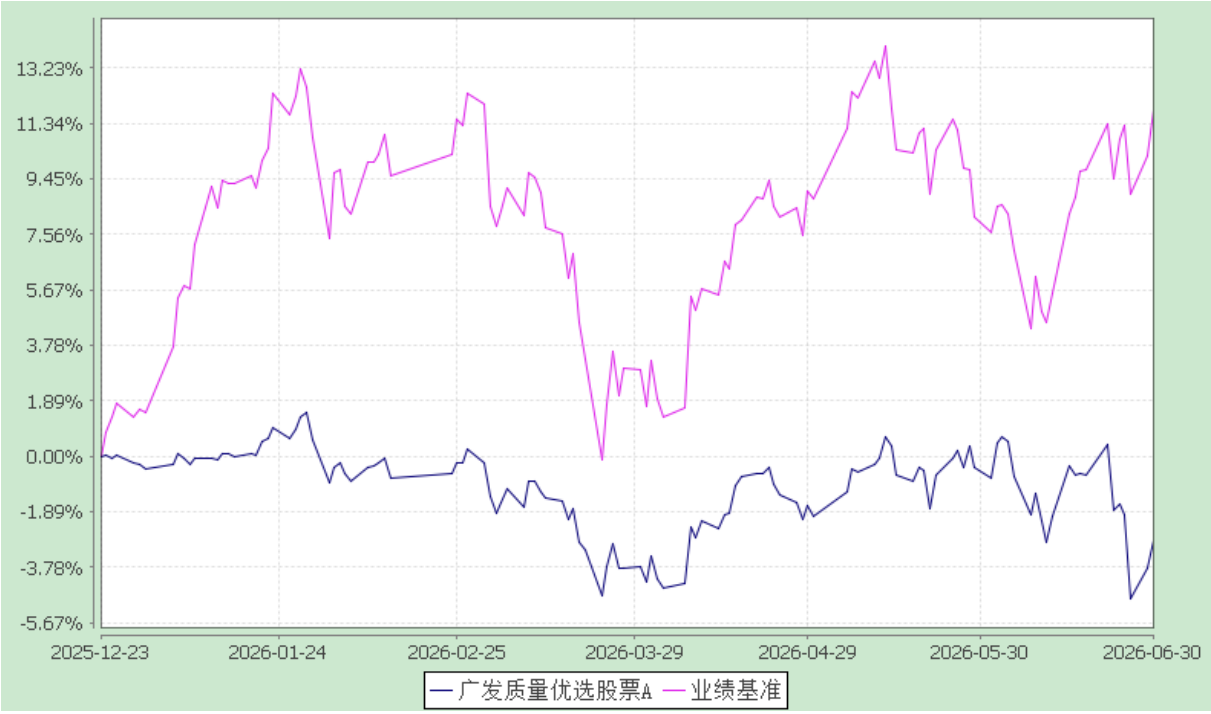
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发质量优选股票型证券投资基金

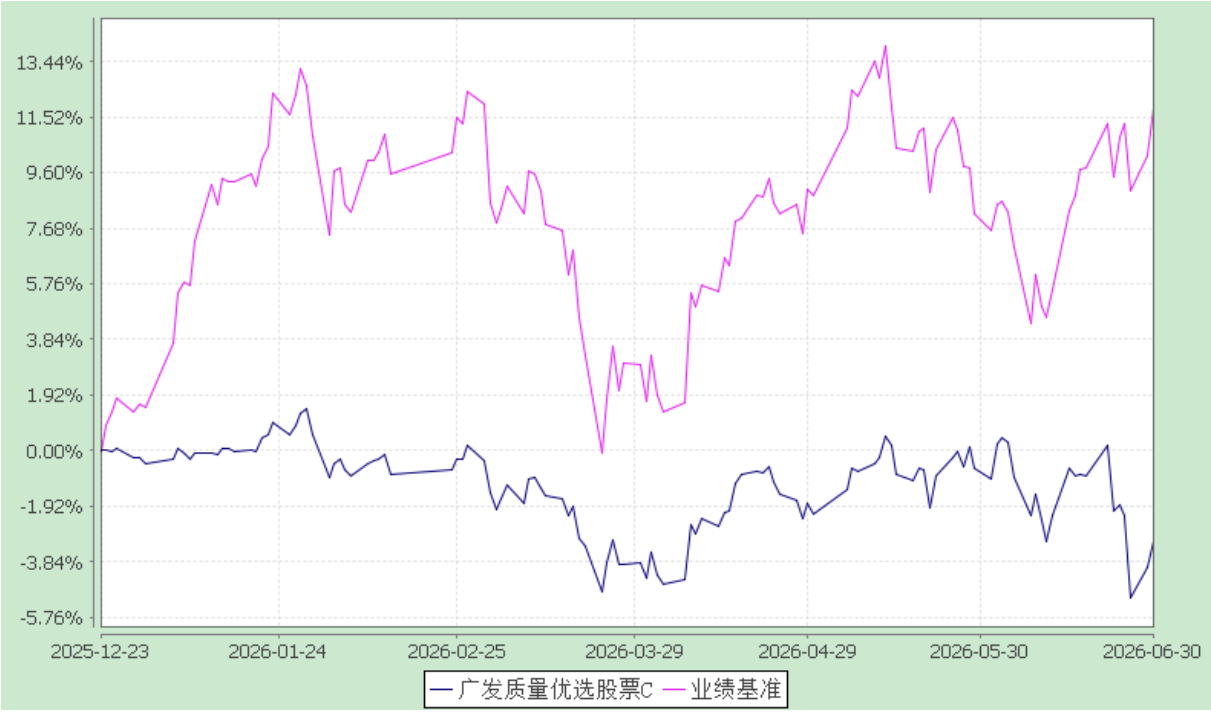
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2025 年 12 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发质量优选股票 A



广发质量优选股票 C



注：（1）本基金合同生效日期为 2025 年 12 月 23 日，至报告期末未满一年。

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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨冬	本基金的基金经	2025-12-23	-	20 年	杨冬先生，中国籍，经济学

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

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济呈现“温和修复、结构分化”的运行特征。上半年国内生产总值同比增长 4.7%，实现“十五五”开局之年的良好开端。制造业采购经理指数在一季度经历春节季节性波动后逐步修复，二季度 4 月至 6 月分别录得 50.3%、50.0%和 50.3%，整体维持在扩张区间附近；非制造业商务活动指数与综合 PMI 产出指数在二季度末分别升至 50.2%和 50.6%，服务业景气持续修复。价格端修复趋势更加明确，工业生产者出厂价格指数同比从年初的负增长区间持续修复，工业品价格进入较为确定的上行通道，为企业盈利端的持续修复提供了坚实基础。国际环境方面，全球主要经济体货币政策路径进一步分化，外部环境不确定性阶段性上升，全球贸易增长预期有所下调，供应链本土化与区域化趋势更加突出，国内政策自主性与内生动能的重要性进一步凸显。

政策方面，2026 年上半年国内延续了“更加积极的财政政策”与“适度宽松的货币政策”总基调，同时在结构性发力上密集释放信号。3 月召开的全国两会明确了全年 5%左右的经济增长目标，部署了扩内需、发展新质生产力、深化改革开放等重点任务；4 月 28 日召开的中央政治局会议肯定一季度经济“起步有力、主要指标好于预期”，新增“精准有效实施”的政策表述，首次系统部署水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等“六网”重大工程建设，明确“全面实施人工智能+行动”，并新增“稳定和增强资本市场信心”的政策目标；6 月 17 日至 18 日举行的陆家嘴论坛集中释放金融支持硬科技与资本市场改革信号，央行落地优化短端利率调控、创设境外央行回购工具、启动上海自贸区离岸人民币外汇交易试点、出台离岸金融行动方案等六项新政策，进一步疏通市场流动性；证监会将科创板第五套上市标准拓展至 AI 大模型企业，扶持量子科技、具身智能、生物制造等前沿硬科技企业登陆资本市场。上半年政策脉络清晰围绕货币宽松、硬科技融资、资本市场改革、金融对外开放四大方向形成合力，为权益市场的中期运行提供了较为坚实的制度环境。

从权益市场来看，2026 年上半年 A 股主要指数普涨，但内部分化极为显著，市场呈现“科技主线绝对独秀、消费与传统蓝筹深度承压”的极端结构性行情。宽基指数中，科创 50 上半年累计上涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，深证成指上涨 19.82%，中证 A500 上涨 11.91%，沪深 300 上涨 7.55%，上证指数上涨 3.16%，而上证 50 下跌 1.38%成为唯一收跌的宽基指数，科技成长指数与大盘价值指数之间的剪刀差达到近年来的极值水平。行业层面，电子上半年累计上涨 86.29%，通信上涨 73.59%，建筑材料上涨 46.26%，机械设备上涨 22.60%，高端制造与 AI 算力方向大幅领涨，而商贸零售下跌 29.42%，农林牧渔下跌 25.26%，美容护理下跌 24.86%，食品饮料下跌 19.52%，钢铁下跌 19.01%，消费与顺周期板块深度回调，31 个申万一级行业中仅有 10 个行业录得正收益。上半年 A 股行情的核心驱动力清晰指向 AI 算力产业趋势的加速兑现——DeepSeek V4 在 4 月发布并深度适配国产昇腾算力体系，标志着国产“模型—芯片—云”全栈协同闭环初步成型，海外主要存储与 AI 芯片厂商季报显示营收超预期高增长且供需紧张格局或延续至 2027 年之后，AI 服务器高速 PCB 价格环比上涨 30%-50%，MLCC 产品报价接近翻倍，产业链景气从下游算力芯片向存储、光模块与 CPO、AI 服务器高速 PCB、MLCC、覆铜板、半导体设备与材料等中上游全面扩散。与此同时，A 股两融余额从年初约 2.3 万亿元一路攀升至 6 月末历史性首度突破 3 万亿元，杠杆资金增量高度集中于电子、通信等硬科技赛道，进一步强化了科技主线的赚钱效应。报告期内，本基金调整持仓结构，减配有色金属等行业，增配医药生物、家用电器等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-2.46%，C 类基金份额净值增长率为-2.70%，

同期业绩比较基准收益率为 10.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

其一，AI 算力与硬科技自主可控主线仍是中长期核心配置方向。上半年 AI 产业链景气度从下游算力芯片向上游存储、光模块与 CPO、AI 服务器高速 PCB、MLCC、覆铜板、半导体设备与材料等中上游全面扩散，海外主要存储与 AI 芯片厂商季报显示营收超预期高增长且供需紧张格局或延续至 2027 年之后，国产大模型深度适配昇腾等国产算力体系，产业链景气与订单能见度较高。陆家嘴论坛后证监会拓展科创板第五套上市标准至 AI 大模型企业，进一步优化了硬科技企业的融资环境，中长期产业逻辑清晰。下半年伴随中报业绩披露与全年业绩预期修正，AI 算力链的业绩兑现将成为最重要的观察窗口，具备订单能见度与业绩兑现能力的中上游龙头值得重点关注，同时应当适度警惕短期估值扩张过快、业绩兑现节奏跟不上的品种。

其二，低估值蓝筹与稳定股息资产存在中期结构性修复机会。当前沪深 300 滚动市盈率仍处于历史中枢偏低位置，具备较高的安全边际。在市场广度显著收窄、成长板块估值已抬升至较高分位的背景下，下半年若出现风格再平衡，前期滞涨的低估值蓝筹存在阶段性均值回归的机会，具备稳定分红与盈利韧性的标的可作为组合中期底仓，尤其是在长端利率维持低位的环境下，红利资产的类固收替代价值进一步凸显。

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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的真实、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：广发质量优选股票型证券投资基金

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	217,475,004.94	2,751,336,847.82
结算备付金		8,649,873.86	-
存出保证金		1,100,730.51	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,383,906,624.45	926,915,424.66
其中：股票投资		2,382,799,798.92	926,915,424.66
基金投资		-	-
债券投资		1,106,825.53	-
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		19,318,276.36	65,105,875.35
应收股利		2,495,488.13	-
应收申购款		418,325.47	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,633,364,323.72	3,743,358,147.83
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		67,351,886.63	-
应付赎回款		42,412,133.27	-
应付管理人报酬		2,833,013.08	494,088.55
应付托管费		464,951.20	164,696.18
应付销售服务费		243,997.68	89,545.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.99	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	11,759,641.66	962,757.14
负债合计		125,065,626.51	1,711,087.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	2,584,614,765.13	3,758,737,792.21
未分配利润	6.4.7.9	-76,316,067.92	-17,090,731.60
净资产合计		2,508,298,697.21	3,741,647,060.61
负债和净资产总计		2,633,364,323.72	3,743,358,147.83

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发质量优选股票 A 基金份额净值（暂估超额管理费前）人民币 0.9710 元，基金份额总额 2,029,705,293.99 份，基金资产净值（暂估超额管理费前）人民币 1,970,870,115.21 元，暂估超额管理费人民币 0.00 元，基金资产净值（暂估超额管理费后）人民币 1,970,870,115.21 元；广发质量优选股票 C 基金份额净值（暂估超额管理费前）人民币 0.9685 元，基金份额总额 554,909,471.14 份，基金资产净值（暂估超额管理费前）人民币 537,428,582.00 元，暂估超额管理费人民币 0.00 元，基金资产净值（暂估超额管理费后）人民币 537,428,582.00 元；总份额总额 2,584,614,765.13 份。实际计提时的超额管理费金额可能会与此处暂估超额管理费金额有差异。

6.2 利润表

会计主体：广发质量优选股票型证券投资基金

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
一、营业总收入		-47,646,947.25
1．利息收入		3,854,822.41
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,530,465.03
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		324,357.38
其他利息收入		-
2．投资收益（损失以“-”填列）		-15,617,610.63
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-29,568,569.03
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	134.91
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	13,950,823.49
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	-37,644,247.87
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	1,760,088.84
减：二、营业总支出		25,965,268.57
1．管理人报酬		13,179,465.35
2．托管费		3,430,130.51
3．销售服务费		1,845,720.18
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		10.54
8．其他费用	6.4.7.21	7,509,941.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-73,612,215.82**
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-73,612,215.82**
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-73,612,215.82

6.3 净资产变动表

会计主体：广发质量优选股票型证券投资基金

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	3,758,737,792.21	-17,090,731.60	3,741,647,060.61
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	3,758,737,792.21	-17,090,731.60	3,741,647,060.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,174,123,027.08	-59,225,336.32	-1,233,348,363.40
（一）、综合收益总额	-	-73,612,215.82	-73,612,215.82
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,174,123,027.08	14,386,879.50	-1,159,736,147.58
其中：1.基金申购款	32,416,944.17	-535,135.81	31,881,808.36
2.基金赎回款	-1,206,539,971.25	14,922,015.31	-1,191,617,955.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,584,614,765.13	-76,316,067.92	2,508,298,697.21

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

广发质量优选股票型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2025]2177 号《关于准予广发质量优选股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《广发质量优选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金于 2025 年 12 月 1 日至 2025 年 12 月 19 日止期间募集资金总额共计人民币 3,757,393,157.83 元（不含认购资金利息），认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,344,634.38 元，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证。经向中国证监会备案，《广发质量优选股票型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,758,737,792.21 份。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要包含货币资金、买入返售金融资产和其他应收科目等。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

本基金持有的以摊余成本计量的金融负债主要包括卖出回购金融资产款和其他应付科目等。

（3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时

本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已经开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。对于存在分级份额调整的基金，上述申购和赎回包括因级别调整而引起的分级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入（若有）、转出（若有）及红利再投资（若有）等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

（5）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（6）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（7）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（8）黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租借合同约定的费率和计算方法逐日确认；

（9）黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

（10）其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。本基金的管理人报酬由固定管理费、或有管理费和超额管理费组成，其中或有管理费和超额管理费取决于每笔基金份额的持有时长和持有期间收益率水平。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为现金分红。基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配并应满足基金合同对收益分配次数、比例等方面的要求。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现

重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

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	217,475,004.94
等于：本金	217,430,877.03
加：应计利息	44,127.91
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	217,475,004.94

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		2,432,607,893.84	-	2,382,799,798.92	-49,808,094.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,024,800.00	138.69	1,106,825.53	81,886.84
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,024,800.00	138.69	1,106,825.53	81,886.84
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,433,632,693.84	138.69	2,383,906,624.45	-49,726,208.08

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	35,817.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,741,637.98
其中：交易所市场	3,741,637.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
其他	7,895,406.12
合计	11,759,641.66

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发质量优选股票 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	2,941,256,381.74	2,941,256,381.74
本期申购	14,022,161.27	14,022,161.27
本期赎回（以“-”号填列）	-925,573,249.02	-925,573,249.02
本期末	2,029,705,293.99	2,029,705,293.99

金额单位：人民币元

广发质量优选股票 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	817,481,410.47	817,481,410.47
本期申购	18,394,782.90	18,394,782.90
本期赎回（以“-”号填列）	-280,966,722.23	-280,966,722.23
本期末	554,909,471.14	554,909,471.14

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

广发质量优选股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,849,419.77	-9,454,455.96	-13,303,875.73
本期期初	-3,849,419.77	-9,454,455.96	-13,303,875.73
本期利润	-26,573,490.21	-29,840,105.33	-56,413,595.54
本期基金份额交易产生的变动数	11,733,727.72	-851,435.23	10,882,292.49
其中：基金申购款	-177,529.68	-47,143.88	-224,673.56
基金赎回款	11,911,257.40	-804,291.35	11,106,966.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,689,182.26	-40,145,996.52	-58,835,178.78

单位：人民币元

广发质量优选股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,159,351.62	-2,627,504.25	-3,786,855.87
本期期初	-1,159,351.62	-2,627,504.25	-3,786,855.87
本期利润	-9,394,477.74	-7,804,142.54	-17,198,620.28
本期基金份额交易产生的变动数	4,021,963.52	-517,376.51	3,504,587.01
其中：基金申购款	-268,427.06	-42,035.19	-310,462.25
基金赎回款	4,290,390.58	-475,341.32	3,815,049.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,531,865.84	-10,949,023.30	-17,480,889.14

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	3,492,350.23
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	37,071.46
其他	1,043.34
合计	3,530,465.03

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	-29,568,569.03
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	-29,568,569.03

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	5,640,608,094.54
减：卖出股票成本总额	5,659,497,172.82
减：交易费用	10,679,490.75
买卖股票差价收入	-29,568,569.03

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	134.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	134.91

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

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	13,950,823.49
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	13,950,823.49

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	-37,644,247.87
——股票投资	-37,726,134.71
——债券投资	81,886.84
——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	-37,644,247.87

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	1,574,175.85
基金转换费收入	185,912.99
合计	1,760,088.84

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	10,087.07

暂估或有管理费	7,401,317.57
其他	11,756.90
合计	7,509,941.99

注：暂估或有管理费金额为期间计提的尚未确认归属的或有管理费金额减去期间按本基金合同约定应转出的或有管理费金额，可能因期间转出金额大于计提金额而列报为负数。本基金的或有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。当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时：若该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天，且该笔份额持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率在-3%及以下，则该笔基金份额持有期内计提的或有管理费将全额转出随赎回款（或清算款）一并返还给投资者；在其他情形下，该笔基金份额持有期内计提的暂估或有管理费将转为应由管理人收取的已确认或有管理费。

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	
	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	1,704,982,608.34	13.33%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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	
	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	114,800.00	11.20%

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	743,372.38	13.33%	743,372.38	19.87%

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
当期发生的基金应支付的管理费	13,179,465.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,458,039.87
应支付基金管理人的净管理费	6,721,425.48

注：（1）本基金根据每笔基金份额的持有期限与持有期间年化收益率，在赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时确定该笔基金份额对应的管理费。当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，持有期限不足一年（即 365 天，下同），则按 1.20%年费率收取管理费；持有期限达到一年及以上，则根据持有期间年化收益率分为以下三种情况，分别确定对应的管理费

率档位：若持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率在-3%及以下，按 0.60%年费率确认管理费；若持有期间的年化超额收益率（扣除超额管理费后）超过 6%且持有收益率（扣除超额管理费后）为正，按 1.50%年费率确认管理费；其他情形按 1.20%年费率确认管理费。具体而言，本基金的管理费包含固定管理费、或有管理费和超额管理费，约定年费率分别为 0.6%、0.6%和 0.3%。

（2）本基金的固定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：日固定管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

（3）本基金的或有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。当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天，且该笔份额持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率在-3%及以下，则该笔基金份额持有期内计提的或有管理费将全额随赎回款（或清算款）一并返还给投资者，管理人对该笔份额实际收取的或有管理费为 0；在其他情形下，该笔基金份额持有期内计提的或有管理费应确认为应由管理人收取的管理费，按月支付。其计算公式为：日或有管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

（4）本基金的超额管理费按前一日基金资产净值的约定年费率每日预估计算，但不从基金资产中实际计提，逐日累计。当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天、持有期间的年化收益率大于 0 且相对业绩比较基准的年化超额收益率大于 6%，同时拟扣除超额管理费后也满足前述收益条件，则将从该笔基金份额的赎回款（或清算款）中扣除 0.30%年费率的超额管理费，并随已计提的或有管理费一同确认为应由管理人收取的管理费，基金托管人将按照与基金管理人双方协商一致的方式支付；在其他情形下，无应由管理人收取的超额管理费。其计算公式为：日超额管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,430,130.51

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		
	广发质量优选股票 A	广发质量优选股票 C	合计
广发基金管理有限公司	-	6,274.67	6,274.67
中国建设银行股份有限公司	-	975,126.62	975,126.62
广发证券股份有限公司	-	3,316.08	3,316.08
合计	-	984,717.37	984,717.37

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发质量优选股票 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。

广发质量优选股票 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	
	期末余额	当期利息收入

中国建设银行股份有限公司	217,475,004.94	3,492,350.23

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
601702	华峰铝业	2026-01-15	6 个月	大宗买入流通受限	18.78	13.80	2,100,000.00	39,438,000.00	28,980,000.00	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873.00	595,206.03	595,206.03	-
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	-
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	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-

				受限						
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	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	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	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
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	-
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	-
30168	固德	2026-0	6 个月	新股	58.00	112.16	117.00	6,786.	13,122	-

0	电材	2-27		流通受限				00	.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	-
688781	视涯科技-UW	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	217.00	4,921.56	10,331.37	-
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	-
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	-
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
113703	翔 26 转债	2026-06-09	1 个月内（含）	新债流通受限	100.00	100.01	5,700.00	570,000.00	570,057.47	-
113706	金帝转债	2026-06-16	1 个月内（含）	新债流通受限	100.00	100.01	3,400.00	340,000.00	340,023.85	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回

购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,106,825.53	-
未评级	-	-
合计	1,106,825.53	-

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最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	217,475,004.94	-	-	-	217,475,004.94
结算备付金	8,649,873.86	-	-	-	8,649,873.86
存出保证金	1,100,730.51	-	-	-	1,100,730.51
交易性金融资产	1,106,825.53	-	-	2,382,799,798.92	2,383,906,624.45
应收清算款	-	-	-	19,318,276.36	19,318,276.36
应收股利	-	-	-	2,495,488.13	2,495,488.13
应收申购款	-	-	-	418,325.47	418,325.47
资产总计	228,332,434.84	-	-	2,405,031,888.88	2,633,364,323.72
负债					
应付清算款	-	-	-	67,351,886.63	67,351,886.63
应付赎回款	-	-	-	42,412,133.27	42,412,133.27
应付管理人报酬	-	-	-	2,833,013.08	2,833,013.08
应付托管费	-	-	-	464,951.20	464,951.20
应付销售服务费	-	-	-	243,997.68	243,997.68
应交税费	-	-	-	2.99	2.99
其他负债	-	-	-	11,759,641.66	11,759,641.66
负债总计	-	-	-	125,065,626.51	125,065,626.51
利率敏感度缺口	228,332,434.84	-	-	2,279,966,262.37	2,508,298,697.21
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	2,751,336,847.82	-	-	-	2,751,336,847.82
交易性金融资产	-	-	-	926,915,424.66	926,915,424.66
应收清算款	-	-	-	65,105,875.35	65,105,875.35
资产总计	2,751,336,847.82	-	-	992,021,300.01	3,743,358,147.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	494,088.55	494,088.55

应付托管费	-	-	-	164,696.18	164,696.18
应付销售服务费	-	-	-	89,545.35	89,545.35
其他负债	-	-	-	962,757.14	962,757.14
负债总计	-	-	-	1,711,087.22	1,711,087.22
利率敏感度缺口	2,751,336,847.82	-	-	990,310,212.79	3,741,647,060.61

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	612,169,756.41	-	612,169,756.41
应收股利	1,033,917.03	608,134.30	-	1,642,051.33
资产合计	**1,033,917.03**	**612,777,890.71**	**-**	**613,811,807.74**
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	**1,033,917.03**	**612,777,890.71**	**-**	**613,811,807.74**
项目	**上年度末 2025年12月31日**			
	美元 折合人民币	**港币 折合人民币**	**其他币种 折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	30,690,590.39	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-30,690,590.39	-

注：本基金上年度末未持有外汇资产。

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	2,382,799,798.92	95.00	926,915,424.66	24.77
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,106,825.53	0.04	-	-
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	2,383,906,624.45	95.04	926,915,424.66	24.77

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%	130,137,121.95	40,320,024.27
	下降 5%	-130,137,121.95	-40,320,024.27

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	2,351,284,936.72
第二层次	1,760,372.76
第三层次	30,861,314.97
合计	2,383,906,624.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,382,799,798.92	90.49
	其中：股票	2,382,799,798.92	90.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,106,825.53	0.04

	其中：债券	1,106,825.53	0.04
	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	226,124,878.80	8.59
8	其他各项资产	23,332,820.47	0.89
9	合计	2,633,364,323.72	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 612,169,756.41 元，占基金资产净值比例 24.41%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	118,556,118.68	4.73
C	制造业	1,154,510,649.05	46.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,976,097.44	0.72
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,697,020.80	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	43,369,966.50	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,796,322.04	0.47
J	金融业	282,328,694.00	11.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,627,176.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	127,099,808.00	5.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,668,190.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,770,630,042.51	70.59

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	15,181,401.95	0.61
非日常生活消费品	312,593,967.79	12.46
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	157,475,624.48	6.28
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	126,918,762.19	5.06
合计	612,169,756.41	24.41

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09988	阿里巴巴-W	2,961,000	238,789,452.67	9.52
2	300308	中际旭创	148,200	188,214,000.00	7.50
3	603259	药明康德	1,020,800	127,099,808.00	5.07
4	02423	贝壳-W	3,890,500	126,918,762.19	5.06
5	002475	立讯精密	1,463,500	103,030,400.00	4.11
6	601211	国泰海通	3,486,900	63,461,580.00	2.53
6	02611	国泰海通	2,169,800	27,986,009.88	1.12
7	600060	海信视像	2,939,900	81,935,013.00	3.27
8	00175	吉利汽车	5,040,000	73,804,515.12	2.94
9	300201	海伦哲	3,407,400	71,793,918.00	2.86
10	601628	中国人寿	805,400	28,470,890.00	1.14
10	02628	中国人寿	1,038,000	24,035,453.63	0.96
11	601318	中国平安	1,074,900	51,315,726.00	2.05
12	00966	中国太平	3,153,800	49,360,978.48	1.97
13	000338	潍柴动力	1,803,800	49,153,550.00	1.96
14	300502	新易盛	77,668	47,144,476.00	1.88

15	300274	阳光电源	293,100	46,608,762.00	1.86
16	002353	杰瑞股份	234,000	35,685,000.00	1.42
17	601899	紫金矿业	1,313,500	33,021,390.00	1.32
18	601702	华峰铝业	2,334,700	32,289,270.00	1.29
19	000039	中集集团	2,188,824	17,751,362.64	0.71
19	02039	中集集团	1,918,100	12,378,125.56	0.49
20	03908	中金公司	1,582,400	28,862,263.92	1.15
21	605117	德业股份	267,600	28,413,768.00	1.13
22	002850	科达利	149,000	28,205,700.00	1.12
23	600233	圆通速递	1,784,454	28,105,150.50	1.12
24	600938	中国海油	1,019,700	27,684,855.00	1.10
25	06066	中信建投证券	2,604,000	27,230,918.57	1.09
26	600426	华鲁恒升	1,121,400	26,823,888.00	1.07
27	002532	天山铝业	2,499,500	26,819,635.00	1.07
28	000921	海信家电	974,800	26,631,536.00	1.06
29	000001	平安银行	2,553,500	25,662,675.00	1.02
30	601166	兴业银行	1,543,500	25,560,360.00	1.02
31	601601	中国太保	882,900	25,180,308.00	1.00
32	002488	金固股份	2,759,400	24,586,254.00	0.98
33	601101	昊华能源	2,147,200	22,674,432.00	0.90
34	600030	中信证券	629,500	18,085,535.00	0.72
35	300750	宁德时代	45,800	17,999,858.00	0.72
36	600988	赤峰黄金	672,200	17,692,304.00	0.71
37	601857	中国石油	2,009,600	17,443,328.00	0.70
38	601600	中国铝业	2,099,900	17,261,178.00	0.69
39	601077	渝农商行	2,815,200	17,200,872.00	0.69
40	688012	中微公司	34,904	16,352,524.00	0.65
41	600999	招商证券	751,900	15,865,090.00	0.63
42	301308	江波龙	22,100	15,553,980.00	0.62
43	601872	招商轮船	868,800	15,264,816.00	0.61
44	002463	沪电股份	98,700	15,081,360.00	0.60
45	600183	生益科技	85,700	14,860,380.00	0.59
46	000792	盐湖股份	403,500	12,181,665.00	0.49
47	300628	亿联网络	356,320	12,050,742.40	0.48
48	003816	中国广核	2,996,300	11,715,533.00	0.47
49	600989	宝丰能源	574,127	11,672,001.91	0.47
50	000708	中信特钢	921,700	11,631,854.00	0.46
51	002001	新和成	405,700	11,529,994.00	0.46
52	002142	宁波银行	388,200	11,525,658.00	0.46
53	000425	徐工机械	1,413,200	11,432,788.00	0.46
54	000807	云铝股份	516,200	11,428,668.00	0.46
55	301362	民爆光电	51,040	9,387,276.80	0.37
56	000977	浪潮信息	100,400	7,028,000.00	0.28
57	002838	道恩股份	212,800	6,515,936.00	0.26

58	688279	峰岹科技	25,516	5,726,811.04	0.23
59	300976	达瑞电子	67,300	5,360,445.00	0.21
60	300790	宇瞳光学	203,000	5,300,330.00	0.21
61	002079	苏州固锝	345,300	5,189,859.00	0.21
62	000905	厦门港务	632,100	4,905,096.00	0.20
63	688717	艾罗能源	59,224	4,890,125.68	0.19
64	600903	贵州燃气	729,700	4,845,208.00	0.19
65	002402	和而泰	141,500	3,654,945.00	0.15
66	688049	炬芯科技	76,871	3,606,018.61	0.14
67	002396	星网锐捷	186,300	3,571,371.00	0.14
68	300623	捷捷微电	79,000	3,554,210.00	0.14
69	300590	移为通信	241,000	3,458,350.00	0.14
70	002487	大金重工	58,135	3,370,085.95	0.13
71	300031	宝通科技	117,700	3,362,689.00	0.13
72	301631	壹连科技	46,480	3,340,052.80	0.13
73	603112	华翔股份	198,600	3,322,578.00	0.13
74	600320	振华重工	792,400	3,272,612.00	0.13
75	301028	鼎熔岩	176,000	2,808,960.00	0.11
76	02208	金风科技	306,800	2,803,276.39	0.11
77	002823	凯中精密	196,000	2,791,040.00	0.11
78	301608	博实结	55,331	2,780,936.06	0.11
79	603966	法兰泰克	335,106	2,731,113.90	0.11
80	688531	日联科技	13,436	2,389,458.24	0.10
81	603726	朗迪集团	67,000	2,294,750.00	0.09
82	688209	英集芯	65,078	1,892,468.24	0.08
83	688518	联赢激光	60,845	1,880,110.50	0.07
84	000034	神州数码	64,240	1,782,660.00	0.07
85	001314	亿道信息	28,500	1,761,300.00	0.07
86	301280	珠城科技	34,620	1,750,733.40	0.07
87	300073	当升科技	36,300	1,743,852.00	0.07
88	300905	宝丽迪	34,400	1,740,640.00	0.07
89	001287	中电港	55,800	1,738,170.00	0.07
90	002077	大港股份	90,100	1,738,029.00	0.07
91	002158	汉钟精机	46,500	1,724,220.00	0.07
92	603125	常青科技	52,251	1,710,697.74	0.07
93	300740	水羊股份	92,500	1,702,925.00	0.07
94	605058	澳弘电子	46,600	1,685,056.00	0.07
95	300681	英搏尔	58,700	1,679,994.00	0.07
96	600590	泰豪科技	166,000	1,676,600.00	0.07
97	000922	佳电股份	120,060	1,676,037.60	0.07
98	600150	中国船舶	49,400	1,669,226.00	0.07
99	002328	新朋股份	224,900	1,650,766.00	0.07
100	300286	安科瑞	67,600	1,632,540.00	0.07
101	603373	安邦护卫	44,900	1,627,176.00	0.06

102	002264	新华都	286,900	1,618,116.00	0.06
103	600875	东方电气	56,100	1,613,997.00	0.06
104	603507	振江股份	49,000	1,611,610.00	0.06
105	002803	吉宏股份	62,345	1,610,994.80	0.06
106	002154	报喜鸟	445,100	1,584,556.00	0.06
107	301150	中一科技	24,900	1,571,439.00	0.06
108	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.06
109	688697	纽威数控	84,140	1,143,462.60	0.05
110	605056	咸亨国际	70,100	1,121,600.00	0.04
111	002266	浙富控股	220,900	1,117,754.00	0.04
112	603897	长城科技	33,700	1,093,902.00	0.04
113	000682	东方电子	86,200	1,088,706.00	0.04
114	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
115	688689	银河微电	9,690	627,136.80	0.03
116	300596	利安隆	11,400	598,272.00	0.02
117	603311	金海高科	16,000	586,400.00	0.02
118	688636	智明达	16,052	581,563.96	0.02
119	603270	金帝股份	17,000	569,670.00	0.02
120	002925	盈趣科技	23,079	569,128.14	0.02
121	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.02
122	603223	恒通股份	43,300	565,065.00	0.02
123	600522	中天科技	9,300	564,324.00	0.02
124	002415	海康威视	16,400	560,880.00	0.02
125	002810	山东赫达	22,700	560,690.00	0.02
126	002284	亚太股份	58,100	551,369.00	0.02
127	300919	中伟新材	12,600	551,250.00	0.02
128	002534	西子洁能	29,700	550,935.00	0.02
129	301305	朗坤科技	19,300	550,436.00	0.02
130	300049	福瑞医科	14,000	544,320.00	0.02
131	601061	中信金属	50,000	538,500.00	0.02
132	601179	中国西电	36,000	537,120.00	0.02
133	603790	雅运股份	24,900	531,366.00	0.02
134	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
135	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
136	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
137	002273	水晶光电	4,500	159,660.00	0.01
138	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
139	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
140	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
141	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
142	920119	美德乐	700	35,749.00	0.00
143	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
144	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
145	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00

146	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
147	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
148	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
149	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
150	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
151	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
152	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
153	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
154	688781	视涯科技-UW	217	10,331.37	0.00
155	920159	农大科技	300	8,280.00	0.00
156	920086	科马材料	300	7,038.00	0.00
157	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
158	000811	冰轮环境	90	5,059.80	0.00
159	603979	金诚信	62	3,659.86	0.00
160	920076	国亮新材	280	3,455.20	0.00
161	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
162	001312	福恩股份	134	2,248.52	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	09988	阿里巴巴-W	313,439,979.11	8.38
2	000923	河钢资源	161,277,895.63	4.31
3	300502	新易盛	151,751,858.27	4.06
4	03690	美团-W	145,467,011.85	3.89
5	02423	贝壳-W	144,842,299.85	3.87
6	00700	腾讯控股	127,803,639.86	3.42
7	603259	药明康德	126,094,190.20	3.37
8	601211	国泰海通	92,154,062.49	2.46
8	02611	国泰海通	27,512,662.59	0.74
9	300308	中际旭创	108,365,693.20	2.90
10	002475	立讯精密	102,528,505.10	2.74
11	601318	中国平安	84,970,669.11	2.27
12	00175	吉利汽车	83,729,701.12	2.24
13	300750	宁德时代	82,801,987.20	2.21
14	000039	中集集团	63,105,321.28	1.69
14	02039	中集集团	19,407,141.50	0.52
15	600060	海信视像	82,381,284.14	2.20
16	601702	华峰铝业	74,921,267.00	2.00

17	688085	三友医疗	74,701,692.80	2.00
18	601628	中国人寿	40,204,444.50	1.07
18	02628	中国人寿	27,008,316.05	0.72
19	000157	中联重科	65,131,865.00	1.74
20	600030	中信证券	64,868,639.34	1.73

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	300502	新易盛	212,883,346.49	5.69
2	000923	河钢资源	157,736,645.02	4.22
3	03690	美团-W	132,137,075.04	3.53
4	600389	江山股份	104,859,189.30	2.80
5	00700	腾讯控股	99,786,623.94	2.67
6	002384	东山精密	75,859,763.00	2.03
7	000811	冰轮环境	72,702,878.31	1.94
8	301155	海力风电	70,971,134.45	1.90
9	000157	中联重科	68,564,915.11	1.83
10	300750	宁德时代	63,572,956.00	1.70
11	002126	银轮股份	63,536,462.00	1.70
12	601166	兴业银行	63,300,176.12	1.69
13	688085	三友医疗	59,017,295.46	1.58
14	603979	金诚信	58,518,886.42	1.56
15	603993	洛阳钼业	51,795,468.00	1.38
16	000333	美的集团	48,287,323.70	1.29
17	600030	中信证券	48,278,600.00	1.29
18	601898	中煤能源	47,554,968.01	1.27
19	688630	芯碁微装	45,447,146.49	1.21
20	002315	焦点科技	44,499,488.00	1.19

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	7,153,107,681.79
卖出股票收入（成交）总额	5,640,608,094.54

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）	1,106,825.53	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,106,825.53	0.04

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	113703.SH	翔 26 转债	5,700	570,057.47	0.02
2	113706.SH	金帝转债	3,400	340,023.85	0.01
3	127113.SZ	长高转债	1,148	196,744.21	0.01

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

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。中国人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,100,730.51
2	应收清算款	19,318,276.36
3	应收股利	2,495,488.13
4	应收利息	-
5	应收申购款	418,325.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,332,820.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(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
广发质量优选股票 A	10,805	187,848.71	8,570,184.94	0.42%	2,021,135,109.05	99.58%
广发质量优选股票 C	6,164	90,024.25	8,163,102.38	1.47%	546,746,368.76	98.53%
合计	16,969	152,313.91	16,733,287.32	0.65%	2,567,881,477.81	99.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发质量优选股票 A	10,010.28	0.0005%
	广发质量优选股票 C	10,293.28	0.0019%
	合计	20,303.56	0.0008%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发质量优选股票 A	0
	广发质量优选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发质量优选股票 A	0
	广发质量优选股票 C	0

	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发质量优选股票 A	广发质量优选股票 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 23 日）基金份额总额	2,941,256,381.74	817,481,410.47
本报告期期初基金份额总额	2,941,256,381.74	817,481,410.47
本报告期基金总申购份额	14,022,161.27	18,394,782.90
减：本报告期基金总赎回份额	925,573,249.02	280,966,722.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,029,705,293.99	554,909,471.14

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	
开源证券	2	4,467,294,218.84	34.93%	1,947,756.81	34.93%	-
天风证券	2	1,955,040,829.29	15.28%	852,400.12	15.28%	-
国海证券	2	1,926,680,717.83	15.06%	840,033.89	15.06%	-
广发证券	4	1,704,982,608.34	13.33%	743,372.38	13.33%	-
招商证券	2	670,511,248.75	5.24%	292,342.94	5.24%	-
中金公司	2	603,820,321.52	4.72%	263,265.69	4.72%	-
中信证券	5	481,909,925.28	3.77%	210,108.01	3.77%	-
江海证券	1	458,940,314.71	3.59%	200,097.99	3.59%	-
国泰海通	3	306,453,712.50	2.40%	133,599.17	2.40%	-
中信建投证券	2	215,197,726.99	1.68%	93,826.19	1.68%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-

华安证券	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
开源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	1,100,000,000.00	100.00%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	114,800.00	11.20%	-	-	-	-
招商证券	570,000.00	55.62%	-	-	-	-
中金公司	340,000.00	33.18%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

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	关于广发质量优选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-18
2	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-01
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22
4	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-21
5	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

（一）中国证监会注册广发质量优选股票型证券投资基金募集的文件
（二）《广发质量优选股票型证券投资基金基金合同》
（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
（四）《广发质量优选股票型证券投资基金托管协议》
（五）法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 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