

广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 2 月 10 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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
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	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54

7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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情况	56
9 开放式基金份额变动	57
10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8 其他重大事件	59
11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	广发中证 500 指数量化增强	
基金主代码	026109	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 10 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,984,520,515.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中证 500 指数量化增强 A	广发中证 500 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	026109	026110
报告期末下属分级基金的份额总额	557,628,007.67 份	2,426,892,507.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法及基本面分析进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%，主要投资策略包括：（1）股票投资策略；（2）债券投资策略；（3）资产支持证券投资策略；（4）金融衍生品投资策略；（5）参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票指数增强型基金，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露	姓名	项军	冯萌

负责人	联系电话	020-83936666	021-52629999-213310
	电子邮箱	xiangji@gffunds.com.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		95105828	95561
传真		020-34281105	021-62159217
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		510308	200120
法定代表人		葛长伟	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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 2 月 10 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500 指数量化增强 A	广发中证 500 指数量化增强 C
本期已实现收益	37,467,240.58	164,483,990.22
本期利润	30,263,243.73	147,271,997.19
加权平均基金份额本期利润	0.0379	0.0376
本期加权平均净值利润率	3.80%	3.78%
本期基金份额净值增长率	3.73%	3.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500 指数量化增强 A	广发中证 500 指数量化增强 C
期末可供分配利润	20,807,839.91	86,660,735.15
期末可供分配基金份额利润	0.0373	0.0357
期末基金资产净值	578,435,847.58	2,513,553,242.56
期末基金份额净值	1.0373	1.0357
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500 指数量化增强 A	广发中证 500 指数量化增强 C
基金份额累计净值增长率	3.73%	3.57%

注：（1）本基金合同生效日为 2026 年 2 月 10 日，至报告期末不满半年。

（2）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。

（3）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。

（4）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

广发中证 500 指数量化增强 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	9.21%	1.26%	17.61%	1.56%	-8.40%	-0.30%
自基金合同生效起至今	3.73%	1.19%	8.29%	1.59%	-4.56%	-0.40%

广发中证 500 指数量化增强 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	9.10%	1.26%	17.61%	1.56%	-8.51%	-0.30%

自基金合同生效起至今	3.57%	1.19%	8.29%	1.59%	-4.72%	-0.40%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

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

广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金

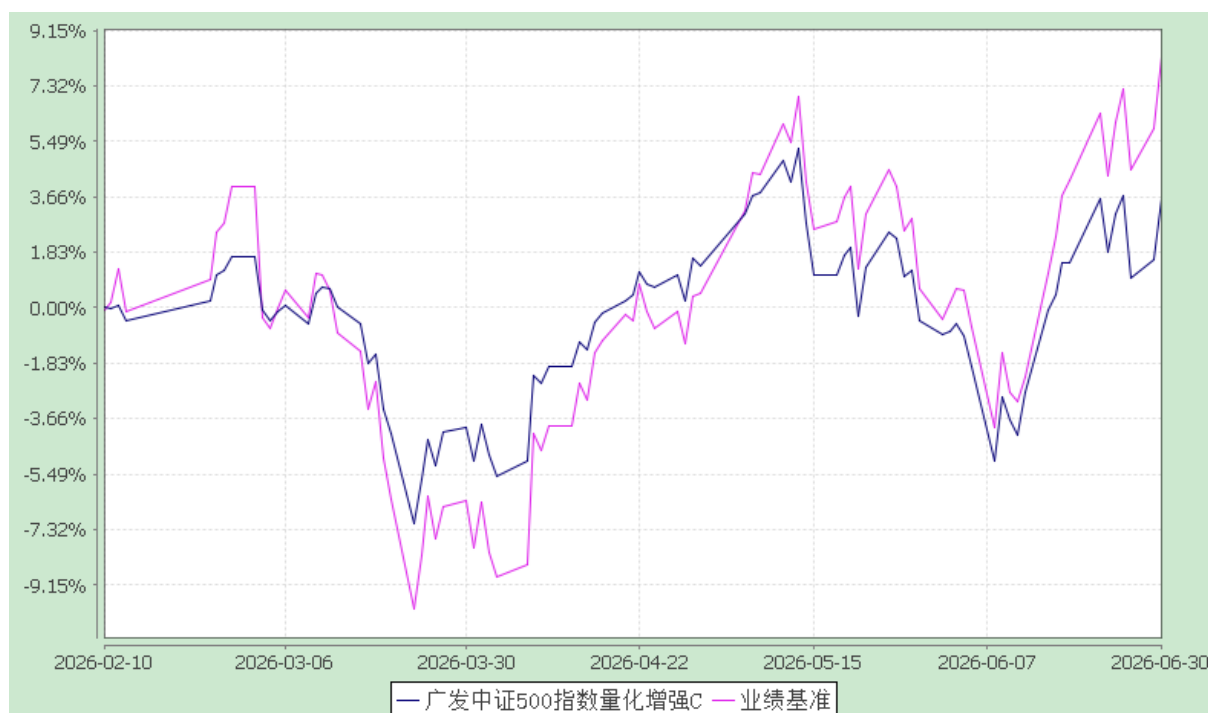
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2026 年 2 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发中证 500 指数量化增强 A



广发中证 500 指数量化增强 C



注：（1）本基金合同生效日期为 2026 年 2 月 10 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，至报告期末本基金仍处于建仓期。

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		
李育鑫	本基金的基金经 理；广发量化多因 子灵活配置混合型 证券投资基金的基 金经理；广发上证	2026-02-10	-	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业从业证书。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。

	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；广发汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理				
--	--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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，产品通过优化器严格控制相对于基准的行业和风格偏离，根据多因子模型，结合各个信息维度对股票进行综合打分，并依此进行股票组合的构建。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 3.73%，C 类基金份额净值增长率为 3.57%，同期业绩比较基准收益率为 8.29%。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	416,008,799.41
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,720,583,165.29
其中：股票投资		2,720,583,165.29

基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收股利		-
应收申购款		1,744,972.14
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,138,336,936.84
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		42,713,768.94
应付管理人报酬		2,181,012.73
应付托管费		408,939.85
应付销售服务费		890,993.55
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	153,131.63
负债合计		46,347,846.70
净资产：		
实收基金	6.4.7.8	2,984,520,515.08
未分配利润	6.4.7.9	107,468,575.06
净资产合计		3,091,989,090.14
负债和净资产总计		3,138,336,936.84

注：（1）报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发中证 500 指数量化增强 A 基金份额净值人民币 1.0373 元，基金份额总额 557,628,007.67 份；广发中证 500 指数量化增强 C 基金份额净值人民币 1.0357 元，基金份额总额 2,426,892,507.41 份；总份额总额 2,984,520,515.08 份。

(2) 本会计期间为 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		200,889,544.36
1. 利息收入		1,724,125.52
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,724,125.52
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		223,408,595.07
其中：股票投资收益	6.4.7.11	203,853,515.07
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	19,555,080.00
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	-24,415,989.88
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	172,813.65
减：二、营业总支出		23,354,303.44
1. 管理人报酬		14,520,032.84
2. 托管费		2,722,506.13
3. 销售服务费		6,031,417.40
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		-
8. 其他费用	6.4.7.21	80,347.07

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		177,535,240.92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		177,535,240.92
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		177,535,240.92

6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	5,605,035,858.61	-	5,605,035,858.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,620,515,343.53	107,468,575.06	-2,513,046,768.47
（一）、综合收益总额	-	177,535,240.92	177,535,240.92
（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）	-2,620,515,343.53	-70,066,665.86	-2,690,582,009.39
其中：1.基金申购款	183,674,071.25	2,121,546.86	185,795,618.11
2.基金赎回款	-2,804,189,414.78	-72,188,212.72	-2,876,377,627.50
（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	2,984,520,515.08	107,468,575.06	3,091,989,090.14

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

广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金（“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]2497 号《关于准予广发中证 500 指数量化增强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《广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金于 2026 年 1 月 28 日至 2026 年 2 月 6 日止期间募集资金总额共计人民币 5,603,600,703.75 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 1,435,154.86 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，《广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2026 年 2 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,605,035,858.61 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日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。本会计期间为 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 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赁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。

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。本基金收益以现金形式分配，投资者持有的场外份额可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资。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	58,031,874.11
等于：本金	58,018,981.44
加：应计利息	12,892.67
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	357,976,925.30
等于：本金	357,966,082.87
加：应计利息	10,842.43
合计	416,008,799.41

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		2,744,999,155.17	-	2,720,583,165.29	-24,415,989.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,744,999,155.17	-	2,720,583,165.29	-24,415,989.88

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	3,145.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,754.28
其他	76,232.00
合计	153,131.63

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发中证 500 指数量化增强 A		
项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	912,736,987.24	912,736,987.24
本期申购	16,501,462.80	16,501,462.80
本期赎回（以“-”号填列）	-371,610,442.37	-371,610,442.37
本期末	557,628,007.67	557,628,007.67

金额单位：人民币元

广发中证 500 指数量化增强 C	
项目	本期

	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,692,298,871.37	4,692,298,871.37
本期申购	167,172,608.45	167,172,608.45
本期赎回（以“-”号填列）	-2,432,578,972.41	-2,432,578,972.41
本期末	2,426,892,507.41	2,426,892,507.41

注：1、本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额情况，详见于附注

6.4.1“基金基本情况”之说明。

2、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

广发中证 500 指数量化增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	37,467,240.58	-7,203,996.85	30,263,243.73
本期基金份额交易产生的变动数	-6,892,936.44	-2,562,467.38	-9,455,403.82
其中：基金申购款	348,396.92	-150,941.59	197,455.33
基金赎回款	-7,241,333.36	-2,411,525.79	-9,652,859.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,574,304.14	-9,766,464.23	20,807,839.91

单位：人民币元

广发中证 500 指数量化增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	164,483,990.22	-17,211,993.03	147,271,997.19
本期基金份额交易产生的变动数	-35,326,346.99	-25,284,915.05	-60,611,262.04
其中：基金申购款	3,395,036.50	-1,470,944.97	1,924,091.53
基金赎回款	-38,721,383.49	-23,813,970.08	-62,535,353.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,157,643.23	-42,496,908.08	86,660,735.15

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
活期存款利息收入	1,562,308.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	160,862.18
结算备付金利息收入	-

其他	954.93
合计	1,724,125.52

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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	203,853,515.07
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	203,853,515.07

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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,782,757,809.93
减：卖出股票成本总额	6,571,824,826.21
减：交易费用	7,079,468.65
买卖股票差价收入	203,853,515.07

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,555,080.00
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	19,555,080.00

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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-24,415,989.88
——股票投资	-24,415,989.88
——债券投资	-
——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	-24,415,989.88

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	169,873.83
基金转换费收入	2,939.82
合计	172,813.65

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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	26,031.42

信息披露费	47,722.86
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,187.21
其他	405.58
合计	80,347.07

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
兴业银行股份有限公司	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2月10日（基金合同生效日）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	16,097,521,394.51	100.00%

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 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2月10日（基金合同生效日）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	2,655,878.88	100.00%	-	-
------------	--------------	---------	---	---

注：1、本基金的交易佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,520,032.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,215,631.45
应支付基金管理人的净管理费	7,304,401.39

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 0.80%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,722,506.13

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 0.15%。

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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 500 指数量化增强 A	广发中证 500 指数量化增强 C	合计

兴业银行股份有限公司	-	5,469,742.59	5,469,742.59
广发证券股份有限公司	-	375,295.44	375,295.44
合计	-	5,845,038.03	5,845,038.03

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 0.40%。

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

广发中证 500 指数量化增强 A

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发中证 500 指数量化增强 C

本报告期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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	58,031,874.11	1,562,308.41
广发证券股份有限公司	357,976,925.30	160,862.18

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司、证券经纪商广发证券股份有限公司保管，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
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	-
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	-
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	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-

				受限						
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	-
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	-
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	-
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	-

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债券和权证。

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。本基金本报告期末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

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	416,008,799.41	-	-	-	416,008,799.41
交易性金融资产	-	-	-	2,720,583,165.29	2,720,583,165.29
应收申购款	-	-	-	1,744,972.14	1,744,972.14
资产总计	416,008,799.41	-	-	2,722,328,137.43	3,138,336,936.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,713,768.94	42,713,768.94

应付管理人报酬	-	-	-	2,181,012.73	2,181,012.73
应付托管费	-	-	-	408,939.85	408,939.85
应付销售服务费	-	-	-	890,993.55	890,993.55
其他负债	-	-	-	153,131.63	153,131.63
负债总计	-	-	-	46,347,846.70	46,347,846.70
利率敏感度缺口	416,008,799.41	-	-	2,675,980,290.73	3,091,989,090.14

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,720,583,165.29	87.99
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	2,720,583,165.29	87.99

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

	上升 5%	151,036,114.87
	下降 5%	-151,036,114.87

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	2,718,398,557.97
第二层次	852,847.44
第三层次	1,331,759.88
合计	2,720,583,165.29

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	2,720,583,165.29	86.69
	其中：股票	2,720,583,165.29	86.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	416,008,799.41	13.26
8	其他各项资产	1,744,972.14	0.06
9	合计	3,138,336,936.84	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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,753,892.00	0.12
B	采矿业	51,802,917.78	1.68
C	制造业	1,712,753,786.39	55.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,797,305.00	2.42
E	建筑业	8,775,108.00	0.28
F	批发和零售业	56,093,184.35	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	16,300,481.00	0.53

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,660,168.69	4.13
J	金融业	88,654,876.00	2.87
K	房地产业	17,309,294.00	0.56
L	租赁和商务服务业	21,377,119.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	17,468,517.00	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	18,832,906.00	0.61
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	195,840.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	2,215,775,395.21	71.66

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	7,172,700.80	0.23
B	采矿业	11,017,435.00	0.36
C	制造业	340,137,721.90	11.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,130,787.44	0.17
E	建筑业	8,220,264.00	0.27
F	批发和零售业	24,768,785.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	13,222,081.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,302,748.00	1.63
J	金融业	21,786,367.94	0.70
K	房地产业	11,422,871.00	0.37
L	租赁和商务服务业	2,391,480.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	1,978,702.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	836,580.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,016,994.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	858,256.00	0.03
S	综合	543,996.00	0.02
	合计	504,807,770.08	16.33

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

7.3.1 期末指数投资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	300604	长川科技	120,200	41,038,684.00	1.33
2	688498	源杰科技	19,400	36,588,400.00	1.18
3	300857	协创数据	104,080	35,376,792.00	1.14
4	300223	北京君正	134,800	33,551,720.00	1.09
5	002008	大族激光	220,500	33,099,255.00	1.07
6	001309	德明利	29,400	27,721,260.00	0.90
7	688002	睿创微纳	174,600	27,008,874.00	0.87
8	688347	华虹宏力	77,816	26,169,520.80	0.85
9	002273	水晶光电	719,200	25,517,216.00	0.83
10	001389	广合科技	104,658	24,830,110.50	0.80
11	002738	中矿资源	402,800	23,761,172.00	0.77
12	002281	光迅科技	92,100	23,664,174.00	0.77
13	688220	翱捷科技-U	182,200	22,651,104.00	0.73
14	300548	长芯博创	77,000	21,406,000.00	0.69
15	688120	华海清科	63,400	20,426,212.00	0.66
16	688469	芯联集成-U	1,904,859	20,210,553.99	0.65
17	300136	信维通信	164,800	19,652,400.00	0.64
18	301536	星宸科技	149,600	19,255,016.00	0.62
19	300567	精测电子	59,800	18,992,480.00	0.61
20	002517	恺英网络	1,156,100	18,786,625.00	0.61
21	002271	东方雨虹	1,554,550	18,452,508.50	0.60
22	300073	当升科技	375,600	18,043,824.00	0.58
23	301358	湖南裕能	236,200	17,920,494.00	0.58
24	600601	方正科技	1,283,100	17,758,104.00	0.57
25	688387	信科移动-U	894,782	17,752,474.88	0.57

26	688385	复旦微电	248,200	17,694,178.00	0.57
27	002266	浙富控股	3,468,900	17,552,634.00	0.57
28	002414	高德红外	1,314,500	17,430,270.00	0.56
29	300432	富临精工	864,400	17,365,796.00	0.56
30	002436	兴森科技	339,999	17,322,949.05	0.56
31	300919	中伟新材	392,600	17,176,250.00	0.56
32	300458	全志科技	432,550	17,068,423.00	0.55
33	002402	和而泰	653,656	16,883,934.48	0.55
34	002064	华峰化学	1,772,600	16,821,974.00	0.54
35	002841	视源股份	486,902	16,812,726.06	0.54
36	603345	安井食品	206,800	16,583,292.00	0.54
37	600595	中孚实业	2,915,400	16,384,548.00	0.53
38	688099	晶晨股份	158,000	16,258,200.00	0.53
39	600166	福田汽车	5,506,400	16,023,624.00	0.52
40	000683	博源化工	2,748,700	15,832,512.00	0.51
41	002756	永兴材料	276,991	15,688,770.24	0.51
42	300475	香农芯创	51,600	15,480,000.00	0.50
43	601212	白银有色	3,012,000	15,300,960.00	0.49
44	600685	中船防务	598,342	15,221,820.48	0.49
45	600105	永鼎股份	223,400	15,075,032.00	0.49
46	300373	扬杰科技	95,567	15,025,999.41	0.49
47	688615	合合信息	132,125	14,943,337.50	0.48
48	301606	绿联科技	242,740	14,811,994.80	0.48
49	603077	和邦生物	6,342,800	14,715,296.00	0.48
50	688475	萤石网络	536,299	14,667,777.65	0.47
51	600316	洪都航空	524,600	14,657,324.00	0.47
52	600535	天士力	1,079,520	14,282,049.60	0.46
53	002299	圣农发展	939,101	14,236,771.16	0.46
54	002152	广电运通	1,517,083	14,230,238.54	0.46
55	601155	新城控股	1,385,400	14,214,204.00	0.46
56	688361	中科飞测	33,000	14,190,000.00	0.46
57	000415	渤海租赁	3,478,800	14,158,716.00	0.46
58	001286	陕西能源	1,388,400	14,078,376.00	0.46
59	688052	纳芯微	48,800	14,069,528.00	0.46
60	000883	湖北能源	3,242,900	14,009,328.00	0.45
61	300012	华测检测	1,008,000	13,970,880.00	0.45
62	600816	建元信托	5,695,300	13,896,532.00	0.45
63	002120	韵达股份	2,137,800	13,596,408.00	0.44
64	000703	恒逸石化	986,100	13,381,377.00	0.43
65	002683	广东宏大	439,382	12,869,498.78	0.42
66	601608	中信重工	2,691,300	12,837,501.00	0.42
67	688728	格科微	608,200	12,796,528.00	0.41
68	600298	安琪酵母	351,400	12,720,680.00	0.41
69	600704	物产中大	2,687,391	12,684,485.52	0.41

70	601665	齐鲁银行	2,193,700	12,657,649.00	0.41
71	000739	普洛药业	753,200	12,548,312.00	0.41
72	000155	川能动力	1,043,900	12,505,922.00	0.40
73	002078	太阳纸业	984,200	12,292,658.00	0.40
74	300054	鼎龙股份	115,900	12,281,923.00	0.40
75	000027	深圳能源	1,980,200	12,277,240.00	0.40
76	600801	华新建材	776,266	12,109,749.60	0.39
77	603939	益丰药房	669,578	12,039,012.44	0.39
78	002126	银轮股份	240,400	11,971,920.00	0.39
79	601399	国机重装	3,391,340	11,869,690.00	0.38
80	300677	英科医疗	300,700	11,778,419.00	0.38
81	002444	巨星科技	375,300	11,671,830.00	0.38
82	601139	深圳燃气	2,045,300	11,576,398.00	0.37
83	601106	中国一重	3,479,200	11,481,360.00	0.37
84	002153	石基信息	1,571,255	11,360,173.65	0.37
85	600808	马钢股份	4,522,000	11,305,000.00	0.37
86	300957	贝泰妮	355,600	11,204,956.00	0.36
87	688180	君实生物-U	329,200	11,133,544.00	0.36
88	688692	达梦数据	45,211	11,044,595.19	0.36
89	300285	国瓷材料	106,300	10,968,034.00	0.35
90	600390	五矿资本	2,347,700	10,705,512.00	0.35
91	603308	应流股份	176,600	10,666,640.00	0.34
92	000738	航发控制	583,000	10,663,070.00	0.34
93	601869	长飞光纤	19,500	10,645,050.00	0.34
94	688777	中控技术	90,400	10,622,000.00	0.34
95	600499	科达制造	750,700	10,359,660.00	0.34
96	600312	平高电气	572,100	10,103,286.00	0.33
97	002340	格林美	1,512,500	9,997,625.00	0.32
98	300666	江丰电子	27,000	9,952,200.00	0.32
99	688313	仕佳光子	53,800	9,934,170.00	0.32
100	688778	厦钨新能	181,914	9,896,121.60	0.32
101	300757	罗博特科	15,900	9,842,100.00	0.32
102	002025	航天电器	127,800	9,740,916.00	0.32
103	688037	芯源微	22,000	9,659,100.00	0.31
104	603233	大参林	638,013	9,589,335.39	0.31
105	300454	深信服	96,548	9,287,917.60	0.30
106	600988	赤峰黄金	347,100	9,135,672.00	0.30
107	002851	麦格米特	54,600	9,128,028.00	0.30
108	600352	浙江龙盛	743,300	9,001,363.00	0.29
109	002465	海格通信	697,600	8,908,352.00	0.29
110	600765	中航重机	686,564	8,870,406.88	0.29
111	603179	新泉股份	178,040	8,839,686.00	0.29
112	688266	泽璟制药-U	74,800	8,726,168.00	0.28
113	600109	国金证券	992,900	8,717,662.00	0.28

114	600380	健康元	925,272	8,716,062.24	0.28
115	603225	新凤鸣	438,100	8,608,665.00	0.28
116	000951	中国重汽	437,400	8,533,674.00	0.28
117	600970	中材国际	1,191,800	8,497,534.00	0.27
118	600098	广州发展	1,425,600	8,425,296.00	0.27
119	688019	安集科技	24,600	8,350,716.00	0.27
120	300390	天华新能	88,700	8,294,337.00	0.27
121	601233	桐昆股份	377,800	8,179,370.00	0.26
122	000629	钒钛股份	2,369,250	7,913,295.00	0.26
123	300395	菲利华	59,000	7,890,070.00	0.26
124	688200	华峰测控	14,875	7,810,862.50	0.25
125	603737	三棵树	309,500	7,458,950.00	0.24
126	688599	天合光能	527,280	7,445,193.60	0.24
127	300487	蓝晓科技	126,100	7,420,985.00	0.24
128	600871	石化油服	3,501,000	7,107,030.00	0.23
129	688702	盛科通信-U	18,000	7,019,820.00	0.23
130	600348	华阳股份	896,100	6,855,165.00	0.22
131	002603	以岭药业	446,700	6,700,500.00	0.22
132	000893	亚钾国际	162,500	6,644,625.00	0.21
133	300115	长盈精密	233,400	6,521,196.00	0.21
134	603659	璞泰来	224,800	6,503,464.00	0.21
135	300620	光库科技	16,900	6,391,580.00	0.21
136	300699	光威复材	215,300	6,168,345.00	0.20
137	002138	顺络电子	80,900	5,913,790.00	0.19
138	603444	吉比特	16,123	5,778,805.66	0.19
139	002185	华天科技	258,300	5,762,673.00	0.19
140	600879	航天电子	266,600	5,675,914.00	0.18
141	000021	深科技	88,300	5,675,041.00	0.18
142	002487	大金重工	96,800	5,611,496.00	0.18
143	600927	永安期货	450,100	5,603,745.00	0.18
144	600339	中油工程	1,671,900	5,132,733.00	0.17
145	000783	长江证券	522,400	5,093,400.00	0.16
146	300346	南大光电	54,600	5,058,690.00	0.16
147	003031	中瓷电子	27,800	5,012,340.00	0.16
148	300058	蓝色光标	362,400	4,986,624.00	0.16
149	688017	绿的谐波	11,800	4,930,748.00	0.16
150	000987	越秀资本	586,400	4,585,648.00	0.15
151	600885	宏发股份	132,600	4,573,374.00	0.15
152	688301	奕瑞科技	36,800	4,563,200.00	0.15
153	300953	震裕科技	34,080	4,556,496.00	0.15
154	300146	汤臣倍健	492,700	4,454,008.00	0.14
155	000050	深天马 A	449,000	4,449,590.00	0.14
156	600688	上海石化	1,516,600	4,443,638.00	0.14
157	301526	国际复材	93,600	4,368,312.00	0.14

158	605358	立昂微	54,100	4,198,160.00	0.14
159	000039	中集集团	515,240	4,178,596.40	0.14
160	601108	财通证券	476,000	4,117,400.00	0.13
161	301377	鼎泰高科	7,400	4,076,660.00	0.13
162	002409	雅克科技	17,883	4,014,733.50	0.13
163	002407	多氟多	78,500	3,943,055.00	0.13
164	603256	宏和科技	14,400	3,820,752.00	0.12
165	600598	北大荒	346,300	3,753,892.00	0.12
166	600369	西南证券	929,300	3,735,786.00	0.12
167	601865	福莱特	355,400	3,735,254.00	0.12
168	002966	苏州银行	514,000	3,577,440.00	0.12
169	300759	康龙化成	120,900	3,497,637.00	0.11
170	688349	三一重能	229,880	3,489,578.40	0.11
171	603606	东方电缆	81,300	3,374,763.00	0.11
172	000519	中兵红箭	160,041	3,372,063.87	0.11
173	002812	恩捷股份	49,300	3,298,663.00	0.11
174	688172	燕东微	38,400	3,212,544.00	0.10
175	000034	神州数码	114,800	3,185,700.00	0.10
176	003022	联泓新科	121,006	3,134,055.40	0.10
177	600562	国睿科技	144,196	3,059,839.12	0.10
178	300037	新宙邦	32,200	2,989,770.00	0.10
179	002850	科达利	15,500	2,934,150.00	0.09
180	002500	山西证券	567,500	2,928,300.00	0.09
181	600060	海信视像	104,767	2,919,856.29	0.09
182	000831	中国稀土	52,500	2,913,225.00	0.09
183	002926	华西证券	352,700	2,881,559.00	0.09
184	600998	九州通	611,700	2,868,873.00	0.09
185	605589	圣泉集团	44,300	2,816,151.00	0.09
186	002065	东华软件	391,100	2,792,454.00	0.09
187	601699	潞安环能	182,300	2,603,244.00	0.08
188	000967	盈峰环境	246,800	2,598,804.00	0.08
189	600968	海油发展	758,600	2,526,138.00	0.08
190	603816	顾家家居	111,200	2,486,432.00	0.08
191	000528	柳工	314,200	2,372,210.00	0.08
192	300751	迈为股份	8,100	2,287,926.00	0.07
193	603806	福斯特	133,900	2,248,181.00	0.07
194	601577	长沙银行	256,800	2,236,728.00	0.07
195	601000	唐山港	533,500	2,214,025.00	0.07
196	600392	盛和资源	73,400	2,185,118.00	0.07
197	000709	河钢股份	1,108,400	2,150,296.00	0.07
198	002195	岩山科技	327,100	2,139,234.00	0.07
199	000960	锡业股份	48,186	2,057,060.34	0.07
200	000729	燕京啤酒	187,800	1,902,414.00	0.06
201	600546	山煤国际	170,100	1,859,193.00	0.06

202	600711	盛屯矿业	168,000	1,842,960.00	0.06
203	002131	利欧股份	381,700	1,813,075.00	0.06
204	300570	太辰光	7,300	1,800,983.00	0.06
205	600486	扬农化工	35,500	1,799,850.00	0.06
206	000750	国海证券	478,600	1,761,248.00	0.06
207	603699	纽威股份	34,800	1,750,440.00	0.06
208	603920	世运电路	35,700	1,715,028.00	0.06
209	600517	国网英大	361,700	1,692,756.00	0.05
210	600038	中直股份	62,000	1,567,980.00	0.05
211	688213	思特威-W	14,287	1,529,709.09	0.05
212	601179	中国西电	100,200	1,494,984.00	0.05
213	601997	贵阳银行	290,700	1,491,291.00	0.05
214	600062	华润双鹤	90,600	1,453,224.00	0.05
215	601799	星宇股份	15,900	1,440,858.00	0.05
216	688281	华秦科技	28,200	1,416,486.00	0.05
217	603298	杭叉集团	58,900	1,405,354.00	0.05
218	603766	隆鑫通用	116,800	1,393,424.00	0.05
219	600208	衢州发展	484,200	1,370,286.00	0.04
220	000423	东阿阿胶	28,800	1,306,368.00	0.04
221	002265	建设工业	74,748	1,300,615.20	0.04
222	300140	节能环保	257,600	1,280,272.00	0.04
223	000825	太钢不锈	366,786	1,250,740.26	0.04
224	601555	东吴证券	155,800	1,233,936.00	0.04
225	002244	滨江集团	148,500	1,128,600.00	0.04
226	000786	北新建材	58,700	1,061,883.00	0.03
227	601696	中银证券	82,100	1,038,565.00	0.03
228	301611	珂玛科技	5,400	972,378.00	0.03
229	600157	永泰能源	576,300	927,843.00	0.03
230	688235	百济神州	3,572	909,466.92	0.03
231	603786	科博达	22,000	900,020.00	0.03
232	002821	凯莱英	5,400	874,800.00	0.03
233	688578	艾力斯	7,400	808,080.00	0.03
234	000878	云南铜业	47,047	747,106.36	0.02
235	600483	福能股份	72,400	737,756.00	0.02
236	688629	华丰科技	3,800	712,538.00	0.02
237	002429	兆驰股份	67,900	705,481.00	0.02
238	600884	杉杉股份	51,300	695,115.00	0.02
239	000983	山西焦煤	114,600	664,680.00	0.02
240	688375	国博电子	5,800	604,940.00	0.02
241	603379	三美股份	7,900	599,531.00	0.02
242	600848	上海临港	79,600	596,204.00	0.02
243	000997	新大陆	32,600	531,380.00	0.02
244	600637	东方明珠	61,300	509,403.00	0.02
245	601598	中国外运	98,800	490,048.00	0.02

246	600177	雅戈尔	62,100	467,613.00	0.02
247	600583	海油工程	90,300	454,209.00	0.01
248	600332	白云山	21,700	434,868.00	0.01
249	601567	三星电气	28,800	430,272.00	0.01
250	600985	淮北矿业	30,600	429,930.00	0.01
251	600153	建发股份	52,800	418,704.00	0.01
252	000830	鲁西化工	34,700	416,400.00	0.01
253	600901	江苏金租	70,600	405,950.00	0.01
254	600398	海澜之家	74,500	389,635.00	0.01
255	000959	首钢股份	106,200	372,762.00	0.01
256	688772	珠海冠宇	18,200	357,266.00	0.01
257	603338	浙江鼎力	8,300	352,750.00	0.01
258	601666	平煤股份	45,100	322,465.00	0.01
259	002261	拓维信息	11,100	310,911.00	0.01
260	600131	国网信通	20,500	299,300.00	0.01
261	600606	绿地控股	229,400	277,574.00	0.01
262	000009	中国宝安	44,100	274,743.00	0.01
263	600655	豫园股份	59,800	245,778.00	0.01
264	300017	网宿科技	17,800	231,578.00	0.01
265	600995	南网储能	17,500	215,250.00	0.01
266	601019	山东出版	30,600	195,840.00	0.01
267	000887	中鼎股份	10,000	178,900.00	0.01
268	300142	沃森生物	12,900	167,571.00	0.01
269	301301	川宁生物	20,500	162,770.00	0.01
270	600141	兴发集团	3,300	155,001.00	0.01
271	603000	人民网	9,100	134,589.00	0.00
272	600707	彩虹股份	6,600	111,474.00	0.00
273	601991	大唐发电	6,200	43,896.00	0.00
274	600378	昊华科技	400	30,152.00	0.00
275	601198	东兴证券	1,400	19,026.00	0.00
276	002831	裕同科技	400	14,224.00	0.00
277	002410	广联达	1,300	10,608.00	0.00
278	002773	康弘药业	300	6,135.00	0.00
279	002984	森麒麟	400	5,228.00	0.00
280	600497	驰宏锌锗	107	1,295.77	0.00

7.3.2 期末积极投资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	300098	高新兴	2,748,500	12,615,615.00	0.41
2	300933	中辰股份	1,893,400	11,511,872.00	0.37
3	000933	神火股份	529,700	11,229,640.00	0.36

4	000949	新乡化纤	1,731,600	10,978,344.00	0.36
5	300358	楚天科技	1,266,500	10,132,000.00	0.33
6	300022	吉峰科技	1,293,200	10,048,164.00	0.32
7	300842	帝科股份	111,316	9,926,047.72	0.32
8	601168	西部矿业	322,000	8,739,080.00	0.28
9	000100	TCL 科技	1,494,800	8,699,736.00	0.28
10	600320	振华重工	2,066,856	8,536,115.28	0.28
11	603901	永创智能	739,471	8,038,049.77	0.26
12	000036	华联控股	1,818,800	7,948,156.00	0.26
13	000567	海德股份	1,264,500	7,549,065.00	0.24
14	688275	万润新能	59,000	7,525,450.00	0.24
15	601061	中信金属	664,200	7,153,434.00	0.23
16	002558	巨人网络	246,800	6,801,808.00	0.22
17	300271	华宇软件	1,376,800	6,636,176.00	0.21
18	300213	佳讯飞鸿	1,058,600	6,415,116.00	0.21
19	002948	青岛银行	1,203,500	6,113,780.00	0.20
20	002284	亚太股份	640,400	6,077,396.00	0.20
21	688173	希荻微	312,000	5,971,680.00	0.19
22	688653	康希通信	343,017	5,961,635.46	0.19
23	600955	维远股份	390,700	5,751,104.00	0.19
24	601068	中铝国际	1,316,200	5,685,984.00	0.18
25	688148	芳源股份	660,233	5,664,799.14	0.18
26	600115	中国东航	1,463,200	5,574,792.00	0.18
27	600482	中国动力	168,500	5,526,800.00	0.18
28	301608	博实结	109,600	5,508,496.00	0.18
29	601231	环旭电子	167,900	5,439,960.00	0.18
30	688689	银河微电	84,000	5,436,480.00	0.18
31	600966	博汇纸业	1,117,100	5,339,738.00	0.17
32	301082	久盛电气	575,638	5,157,716.48	0.17
33	002488	金固股份	559,900	4,988,709.00	0.16
34	002458	益生股份	641,200	4,982,124.00	0.16
35	000059	华锦股份	1,308,200	4,905,750.00	0.16
36	002532	天山铝业	452,600	4,856,398.00	0.16
37	000166	申万宏源	1,073,900	4,725,160.00	0.15
38	688110	东芯股份	22,800	4,644,360.00	0.15
39	002054	德美化工	683,500	4,545,275.00	0.15
40	600288	大恒科技	329,700	4,385,010.00	0.14
41	601700	风范股份	989,100	4,312,476.00	0.14
42	600886	国投电力	321,600	4,280,496.00	0.14
43	301189	奥尼电子	72,140	4,251,210.20	0.14
44	603228	景旺电子	58,300	4,221,503.00	0.14
45	002653	海思科	62,799	4,166,085.66	0.13
46	300408	三环集团	24,800	4,139,120.00	0.13
47	002382	蓝帆医疗	795,400	4,040,632.00	0.13

48	000810	创维数字	304,300	4,031,975.00	0.13
49	600026	中远海能	218,700	3,923,478.00	0.13
50	603882	金域医学	169,000	3,799,120.00	0.12
51	600037	歌华有线	600,000	3,762,000.00	0.12
52	600271	航天信息	570,900	3,756,522.00	0.12
53	600738	丽尚国潮	1,042,200	3,751,920.00	0.12
54	002545	东方铁塔	225,400	3,655,988.00	0.12
55	000338	潍柴动力	129,000	3,515,250.00	0.11
56	002752	昇兴股份	633,990	3,499,624.80	0.11
57	300672	国科微	11,800	3,481,000.00	0.11
58	300490	华自科技	257,800	3,410,694.00	0.11
59	002398	垒知集团	875,800	3,284,250.00	0.11
60	300206	理邦仪器	262,800	3,214,044.00	0.10
61	601872	招商轮船	180,700	3,174,899.00	0.10
62	603638	艾迪精密	133,445	3,129,285.25	0.10
63	000657	中钨高新	32,400	3,101,328.00	0.10
64	000553	安道麦 A	556,300	2,976,205.00	0.10
65	301086	鸿富瀚	13,580	2,842,022.40	0.09
66	601688	华泰证券	136,037	2,805,082.94	0.09
67	601096	宏盛华源	629,900	2,733,766.00	0.09
68	300034	钢研高纳	152,400	2,612,136.00	0.08
69	300016	北陆药业	340,000	2,607,800.00	0.08
70	300590	移为通信	177,300	2,544,255.00	0.08
71	601117	中国化学	344,800	2,534,280.00	0.08
72	600893	航发动力	65,300	2,503,602.00	0.08
73	000676	智度股份	468,000	2,391,480.00	0.08
74	002648	卫星化学	101,500	2,384,235.00	0.08
75	300363	博腾股份	146,600	2,380,784.00	0.08
76	300700	岱勒新材	110,400	2,349,312.00	0.08
77	300597	吉大通信	329,400	2,332,152.00	0.08
78	000425	徐工机械	284,800	2,304,032.00	0.07
79	300006	莱美药业	447,800	2,297,214.00	0.07
80	603615	茶花股份	141,300	2,281,995.00	0.07
81	000990	诚志股份	275,600	2,254,408.00	0.07
82	601038	一拖股份	204,600	2,166,714.00	0.07
83	300168	万达信息	458,500	2,104,515.00	0.07
84	002204	大连重工	392,600	2,072,928.00	0.07
85	002587	奥拓电子	253,300	1,978,273.00	0.06
86	603719	良品铺子	222,500	1,924,625.00	0.06
87	300579	数字认证	92,700	1,918,890.00	0.06
88	601058	赛轮轮胎	164,100	1,892,073.00	0.06
89	300233	金城医药	149,600	1,855,040.00	0.06
90	002772	众兴菌业	158,300	1,798,288.00	0.06
91	301096	百诚医药	29,700	1,698,543.00	0.05

92	605117	德业股份	15,100	1,603,318.00	0.05
93	002921	联诚精密	58,100	1,588,454.00	0.05
94	688183	生益电子	11,879	1,572,779.60	0.05
95	600989	宝丰能源	75,700	1,538,981.00	0.05
96	688167	炬光科技	4,330	1,533,729.30	0.05
97	603799	华友钴业	31,000	1,496,060.00	0.05
98	002080	中材科技	16,400	1,476,000.00	0.05
99	688536	思瑞浦	4,000	1,456,360.00	0.05
100	300661	圣邦股份	10,115	1,451,300.20	0.05
101	001314	亿道信息	22,900	1,415,220.00	0.05
102	002833	弘亚数控	73,356	1,415,037.24	0.05
103	600963	岳阳林纸	455,000	1,383,200.00	0.04
104	000938	紫光股份	47,400	1,367,964.00	0.04
105	688378	奥来德	21,400	1,326,800.00	0.04
106	601766	中国中车	251,200	1,306,240.00	0.04
107	301321	翰博高新	29,400	1,298,010.00	0.04
108	300253	卫宁健康	191,200	1,286,776.00	0.04
109	002392	北京利尔	156,900	1,266,183.00	0.04
110	002810	山东赫达	51,000	1,259,700.00	0.04
111	600748	上实发展	335,900	1,249,548.00	0.04
112	000031	大悦城	587,600	1,245,712.00	0.04
113	300128	锦富技术	208,800	1,236,096.00	0.04
114	301103	何氏眼科	81,300	1,217,874.00	0.04
115	688678	福立旺	50,000	1,208,500.00	0.04
116	002497	雅化集团	59,100	1,203,867.00	0.04
117	002246	北化股份	61,700	1,159,960.00	0.04
118	688627	精智达	1,600	1,144,000.00	0.04
119	300308	中际旭创	900	1,143,000.00	0.04
120	300232	洲明科技	197,800	1,133,394.00	0.04
121	002206	海利得	214,700	1,109,999.00	0.04
122	300434	金石亚药	98,500	1,106,155.00	0.04
123	301507	民生健康	90,300	1,086,309.00	0.04
124	301268	铭利达	76,100	1,063,878.00	0.03
125	300817	双飞集团	67,400	1,051,440.00	0.03
126	688025	杰普特	2,200	1,034,000.00	0.03
127	301326	捷邦科技	7,200	1,003,464.00	0.03
128	300738	奥飞数据	48,700	984,714.00	0.03
129	600266	城建发展	250,500	979,455.00	0.03
130	002166	莱茵生物	154,200	968,376.00	0.03
131	601968	宝钢包装	245,700	963,144.00	0.03
132	688560	明冠新材	81,000	959,850.00	0.03
133	300583	赛托生物	84,200	945,566.00	0.03
134	002969	嘉美包装	62,200	875,776.00	0.03
135	000426	兴业银锡	26,500	873,440.00	0.03

136	301025	读客文化	110,600	858,256.00	0.03
137	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
138	600426	华鲁恒升	35,400	846,768.00	0.03
139	300587	天铁科技	218,700	841,995.00	0.03
140	000430	张家界	114,600	836,580.00	0.03
141	000852	石化机械	152,900	758,384.00	0.02
142	600230	沧州大化	57,200	744,744.00	0.02
143	301487	盟固利	38,700	741,105.00	0.02
144	002593	日上集团	185,500	740,145.00	0.02
145	003010	若羽臣	27,800	675,540.00	0.02
146	002090	金智科技	74,800	661,232.00	0.02
147	603826	坤彩科技	24,800	633,888.00	0.02
148	600725	云维股份	193,400	597,606.00	0.02
149	600971	恒源煤电	86,100	594,090.00	0.02
150	000680	山推股份	59,100	593,955.00	0.02
151	601901	方正证券	82,400	593,280.00	0.02
152	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.02
153	002468	申通快递	37,700	548,912.00	0.02
154	600673	东阳光	16,200	543,996.00	0.02
155	301060	兰卫医学	64,800	529,416.00	0.02
156	300633	开立医疗	28,100	516,759.00	0.02
157	600395	盘江股份	112,500	513,000.00	0.02
158	002338	奥普光电	8,700	497,640.00	0.02
159	603768	常青股份	48,600	443,718.00	0.01
160	600118	中国卫星	5,400	443,070.00	0.01
161	002419	天虹股份	100,600	425,538.00	0.01
162	300903	科翔股份	4,000	405,240.00	0.01
163	300970	华绿生物	21,460	392,288.80	0.01
164	920072	科莱瑞迪	10,144	383,950.40	0.01
165	300323	华灿光电	16,800	342,720.00	0.01
166	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
167	688345	博力威	5,200	302,016.00	0.01
168	600489	中金黄金	16,500	297,825.00	0.01
169	600372	中航机载	27,200	295,120.00	0.01
170	300450	先导智能	7,100	289,112.00	0.01
171	001311	多利科技	17,560	283,242.80	0.01
172	301136	招标股份	25,300	277,794.00	0.01
173	603381	永臻股份	17,424	268,503.84	0.01
174	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
175	600487	亨通光电	2,060	225,240.40	0.01
176	688683	莱尔科技	5,800	219,936.00	0.01
177	600096	云天化	6,500	197,600.00	0.01
178	002441	众业达	22,500	175,500.00	0.01
179	603071	物产环能	14,700	162,582.00	0.01

180	300636	同和药业	24,000	152,880.00	0.00
181	688525	佰维存储	282	139,513.86	0.00
182	002953	日丰股份	15,100	131,672.00	0.00
183	301308	江波龙	99	69,676.20	0.00
184	920178	锐翔智能	300	39,900.00	0.00
185	002837	英维克	500	39,780.00	0.00
186	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
187	603890	春秋电子	1,100	30,382.00	0.00
188	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
189	920156	海昌智能	500	24,390.00	0.00
190	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
191	920125	鸿仕达	100	20,300.00	0.00
192	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
193	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
194	920161	龙辰科技	500	17,225.00	0.00
195	920200	振宏股份	500	16,075.00	0.00
196	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
197	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
198	920083	金戈新材	200	10,120.00	0.00
199	920096	嘉晨智能	200	9,316.00	0.00
200	603185	弘元绿能	550	9,179.50	0.00
201	300497	富祥股份	400	8,864.00	0.00
202	920126	永大股份	600	7,284.00	0.00
203	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
204	920012	创达新材	100	6,885.00	0.00
205	920191	瑞尔竞达	700	6,461.00	0.00
206	300082	奥克股份	696	6,006.48	0.00
207	920206	彩客科技	100	4,996.00	0.00
208	920183	海菲曼	100	2,901.00	0.00
209	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
210	688439	振华风光	55	2,541.00	0.00
211	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
212	688131	皓元医药	25	2,365.00	0.00
213	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
214	300889	爱克股份	88	1,965.04	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	002738	中矿资源	74,755,708.00	2.42
2	002558	巨人网络	73,392,660.00	2.37
3	301358	湖南裕能	66,609,569.10	2.15
4	600487	亨通光电	65,378,743.80	2.11
5	000933	神火股份	64,157,561.00	2.07
6	002517	恺英网络	63,459,065.00	2.05
7	688498	源杰科技	62,307,438.07	2.02
8	688469	芯联集成-U	57,407,785.88	1.86
9	002414	高德红外	56,542,908.68	1.83
10	002841	视源股份	55,812,328.60	1.81
11	002008	大族激光	54,370,739.00	1.76
12	300450	先导智能	54,248,785.99	1.75
13	601608	中信重工	52,242,765.00	1.69
14	600970	中材国际	51,862,000.70	1.68
15	600885	宏发股份	51,719,647.50	1.67
16	600801	华新建材	51,480,127.56	1.66
17	300604	长川科技	51,419,318.00	1.66
18	600704	物产中大	50,951,827.00	1.65
19	002410	广联达	49,972,867.00	1.62
20	002025	航天电器	49,579,860.00	1.60

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600487	亨通光电	120,885,937.58	3.91
2	002281	光迅科技	69,265,332.42	2.24
3	301358	湖南裕能	63,419,969.00	2.05
4	002008	大族激光	62,053,129.54	2.01
5	002025	航天电器	55,148,033.05	1.78
6	688525	佰维存储	52,844,229.02	1.71
7	002436	兴森科技	52,387,846.00	1.69
8	002558	巨人网络	51,761,538.20	1.67
9	300037	新宙邦	50,275,080.25	1.63
10	300604	长川科技	49,080,269.00	1.59
11	300450	先导智能	48,996,904.00	1.58
12	688498	源杰科技	48,968,663.62	1.58
13	688469	芯联集成-U	46,954,131.48	1.52

14	603890	春秋电子	46,094,632.00	1.49
15	600578	京能电力	45,761,365.80	1.48
16	600885	宏发股份	45,602,653.18	1.47
17	000960	锡业股份	44,773,450.82	1.45
18	002353	杰瑞股份	44,620,543.00	1.44
19	601991	大唐发电	44,475,348.48	1.44
20	000519	中兵红箭	43,953,957.97	1.42

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	9,316,823,981.38
卖出股票收入（成交）总额	6,782,757,809.93

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,744,972.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,744,972.14

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
广发中证 500 指数量化增强 A	5,312	104,975.15	4,873,501.69	0.87%	552,754,505.98	99.13%
广发中证 500 指数量化增强 C	40,147	60,450.16	1,300,835.97	0.05%	2,425,591,671.44	99.95%
合计	45,459	65,653.02	6,174,337.66	0.21%	2,978,346,177.42	99.79%

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	广发中证 500 指数量化增强 A	4.95	0.0000%
	广发中证 500 指数量化增强 C	0.00	0.0000%
	合计	4.95	0.0000%

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	广发中证 500 指数量化增强 A	0
	广发中证 500 指数量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 500 指数量化增强 A	0
	广发中证 500 指数量化增强 C	0

	合计	0
--	----	---

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 500 指数量化增强 A	广发中证 500 指数量化增强 C
基金合同生效日（2026 年 2 月 10 日）基金份额总额	912,736,987.24	4,692,298,871.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,501,462.80	167,172,608.45
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	371,610,442.37	2,432,578,972.41
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	557,628,007.67	2,426,892,507.41

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2026 年 2 月 10 日。

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。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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	
广发证券	3	16,097,521,394.51	100.00%	2,655,878.88	100.00%	-

注：1、选择标准

- (1) 属于公司基金合作券商名单；
- (2) 具备一定的券商交易模式基金合作经验；
- (3) 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；
- (4) 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。本基金管理人对符合上述标准、且有合作意愿的券商进行评估并确定合作券商。

(2) 协议签署。本基金管理人与选定的合作券商、托管人签订经纪服务协议。

3、本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择广发证券作为证券经纪商，证券经纪商广发证券是基金管理人的控股股东。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	关于广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-04
2	广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-11
3	关于广发中证 500 指数量化增强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	2026-04-08

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) 中国证监会准予广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册募集的文件
- (二) 《广发中证 500 指数量化增强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) 《广发中证 500 指数量化增强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