广发集汇债券型证券投资基金

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
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 15
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 15
5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 20
7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 58
7.12 投资组合报告附注 58

8 基金份额持有人信息 59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
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 60
9 开放式基金份额变动 60
10 重大事件揭示 61
10.1 基金份额持有人大会决议 61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 61
10.4 基金投资策略的改变 61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 62
10.8 其他重大事件 64
11 影响投资者决策的其他重要信息 65
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 65
12 备查文件目录 66
12.1 备查文件目录 66
12.2 存放地点 66
12.3 查阅方式 66

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发集汇债券型证券投资基金	
基金简称	广发集汇债券	
基金主代码	016424	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 8 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	454,155,175.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
下属分级基金的交易代码	016424	016425
报告期末下属分级基金的份额总额	158,954,563.23 份	295,200,612.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。 具体投资策略包括：1、大类资产配置；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票（存托凭证）投资策略；5、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债总全价(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+人民币计价的恒生指数收益率×5%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 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、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

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	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	项军	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-34281105	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510308	100818
法定代表人		葛长伟	葛海蛟

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）	
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
本期已实现收益	5,777,289.37	2,521,517.26
本期利润	12,719,421.94	8,648,706.22
加权平均基金份额本期利润	0.1191	0.1945
本期加权平均净值利润率	10.37%	16.86%
本期基金份额净值增长率	9.44%	9.28%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
期末可供分配利润	27,996,552.45	48,193,538.18
期末可供分配基金份额利润	0.1761	0.1633
期末基金资产净值	193,583,077.71	355,425,727.16
期末基金份额净值	1.2179	1.2040
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
基金份额累计净值增长率	21.79%	20.40%

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

广发集汇债券 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	9.41%	0.39%	0.56%	0.12%	8.85%	0.27%
过去六个月	9.44%	0.34%	0.24%	0.12%	9.20%	0.22%
过去一年	15.19%	0.27%	-0.16%	0.11%	15.35%	0.16%
过去三年	20.67%	0.25%	6.64%	0.12%	14.03%	0.13%
自基金合同生效起至今	21.79%	0.23%	7.69%	0.12%	14.10%	0.11%

广发集汇债券 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	9.32%	0.39%	0.56%	0.12%	8.76%	0.27%
过去六个月	9.28%	0.34%	0.24%	0.12%	9.04%	0.22%
过去一年	14.84%	0.27%	-0.16%	0.11%	15.00%	0.16%
过去三年	19.52%	0.25%	6.64%	0.12%	12.88%	0.13%
自基金合同生效起至今	20.40%	0.23%	7.69%	0.12%	12.71%	0.11%

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

广发集汇债券型证券投资基金

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

（2022 年 11 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发集汇债券 A



广发集汇债券 C



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		
姚秋	本基金的基金经理；广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发恒	2022-11-08	-	17 年	姚秋先生，中国籍，经济学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国建设银行北京分行投资银行部债券研究员；中国工商银行

	悦债券型证券投资基金的基金经理；广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发稳信六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；混合资产投资部联席总经理，兼任固定收益研究部总经理				资产管理部固定收益投资经理；新华基金管理股份有限公司总经理助理、基金经理；广发基金管理有限公司债券投资部总经理、广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金经理(自 2023 年 1 月 18 日至 2026 年 1 月 30 日)。
吴迪	本基金的基金经理；广发聚源债券型证券投资基金(LOF)的基金经理；广发景丰纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发景益债券型证券投资基金的基金经理；广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；广发恒祥债券型证券投资基金的基金经理；广发稳信六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发汇元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理；广发汇佳定期开放债券	2025-11-25	-	11.7 年	吴迪女士，中国籍，理学硕士，FRM，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金融工程与风险管理部研究员、固定收益管理总部研究员、固定收益管理总部总经理助理、固定收益管理总部副总经理、广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 6 月 12 日至 2024 年 12 月 20 日)、广发中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 19 日至 2025 年 3 月 11 日)、广发集丰债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 7 日)、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 4 月 8 日至 2025 年 5 月 7 日)、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理(自 2024 年 3 月 21 日至 2025 年 11 月 26 日)。

	型发起式证券投资基金的基金经理助理；特定策略投资部总经理				
郎振东	本基金的基金经理助理；广发聚安混合型证券投资基金的基金经理；广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发汇成一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇吉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；广发添盈 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；广发汇达纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发景宏债券型证券投资基金的基金经理；广发添福 60 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理；广发中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发汇阳三个月定期开放债券型发起式证券投资基金	2022-12-02	-	13.7 年	郎振东先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司基金会计部基金会计、固定收益管理总部债券交易员、广发安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2021 年 4 月 19 日至 2024 年 4 月 10 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2021 年 11 月 29 日至 2024 年 4 月 10 日)、广发集瑞债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 4 月 9 日至 2024 年 12 月 30 日)、广发睿享稳健增利混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 4 月 9 日至 2025 年 3 月 3 日)、广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理(自 2023 年 2 月 10 日至 2026 年 1 月 30 日)。

	的基金经理；广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发恒信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发恒悦债券型证券投资基金的基金经理助理				

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，权益市场震荡偏强，呈现出 AI 资本开支驱动的结构牛市，背后是产业趋势、盈利可见度与资金拥挤度共同作用下的“K”型扩张。一季度，在增量资金和宏观逻辑对冲下，市场先经历春季躁动下的主题行情，再经历顺周期、化工轮动的慢牛整固，最后地缘冲突导致过度交易“滞胀”，带来大幅回撤，转债估值冲高回落，转债结构性的赚钱效应初步体现；二季度，科技主升浪启动，AI 的快速发展带动全球半导体形成“需求扩张—供需错配—利润改善—估值上修”的链式传导，科技对周期、价值板块的流动性明显抽水，市场极致分化，最终市场进入高拥挤度阶段，转债内部结构也跟随权益行情走向极致，赚钱效应进一步缩圈。债券市场受益于资金面持续宽松，供需格局好于预期，债市收益率整体先上后下，信用利差先收窄后低位震荡。一季度，年初风险偏好抬升叠加供给压力担忧，10 年国债收益率上行至 1.9%水平，随后配置盘主导债市超跌反弹，曲线陡峭化，信用利差大幅收窄后被动走阔；二季度，资金面超预期宽松，资管机构配置资金充裕叠加政府债供给持续慢于预期，良好的供需格局驱动 10 年国债最低下行至 1.7%附近、信用利差进一步收窄，6 月以来资金面收敛、机构预防性赎回，债市小幅回调、信用利差明显走阔，而后在央行呵护跨季资金面下，债市情绪有所修复，收益率低位震荡、信用利差逐步收窄。

报告期内，组合秉承“固收+”多策略的投资理念，在权益资产中使用量化和主观双引擎驱动，通过低相关的策略叠加，降低“固收+”产品对单一策略的依赖度，凭借量化策略在全市场广泛捕获

收益，借助主观选股把握阶段性重点机会，并通过顶层的大类资产配置实现各类子策略的灵活调配以适应多变的市场风格。上半年组合较大力度地参与了科技板块的配置机会，重点参与了国产半导体设备板块的投资机会，在较好地控制住回撤的基础上，显著地提高了投资回报。债券方面，组合主要持仓信用债、利率债，通过灵活久期操作波段增厚组合收益。

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 9.44%，C 类基金份额净值增长率为 9.28%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，权益市场行情分化或更加极致，宽基指数大概率呈震荡格局，估值抬升至中高区间后，需重点关注业绩修复，预计交易主线将继续围绕强叙事与强业绩兑现展开，关注科技板块超跌反弹机会，逻辑或从估值驱动切换到盈利驱动，同时通胀与货币政策存在不确定性，美国中期选举再添不确定的变量。股票投资方面，未来组合将优化各类投资策略，主观与量化并行，使组合更加适应不同的市场环境，力争为投资人带来更好的回报体验。

债券市场或延续震荡格局，供需结构和资金面的边际变化对债市影响较大，外围扰动、政策博弈和风险偏好等因素或放大债市波动，信用债关注评级调整对个券估值和定价范式的影响。债券投资方面，组合将持续跟踪基本面修复、机构配置需求等信号以及微观经济数据表征以灵活应对，重视流动性和负债端稳定性，关注票息品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同

约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发集汇债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发集汇债券型证券投资基金

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	3,375,765.86	804,164.90
结算备付金		3,214,990.38	1,269,003.86
存出保证金		104,050.27	6,359.58
交易性金融资产	6.4.7.2	553,970,333.45	141,659,988.82
其中：股票投资		105,878,993.45	13,945,448.58
基金投资		-	-
债券投资		448,091,340.00	127,714,540.24
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		1,249,224.42	5,917,388.17
应收股利		-	-
应收申购款		42,430,503.69	1,411,829.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		604,344,868.07	151,068,734.73
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		50,621,124.95	30,701,824.27
应付清算款		2,802,455.09	17,516.35
应付赎回款		1,327,686.75	328,750.91
应付管理人报酬		200,537.58	55,641.55

应付托管费		42,972.35	11,923.20
应付销售服务费		40,451.94	2,766.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,868.44	911.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	292,966.10	137,616.56
负债合计		55,336,063.20	31,256,951.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	454,155,175.88	107,827,019.83
未分配利润	6.4.7.9	94,853,628.99	11,984,763.37
净资产合计		549,008,804.87	119,811,783.20
负债和净资产总计		604,344,868.07	151,068,734.73

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发集汇债券 A 基金份额净值人民币 1.2179 元，基金份额总额 158,954,563.23 份；广发集汇债券 C 基金份额净值人民币 1.2040 元，基金份额总额 295,200,612.65 份；总份额总额 454,155,175.88 份。

6.2 利润表

会计主体：广发集汇债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		22,548,989.28	502,317.64
1．利息收入		60,050.36	11,034.07
其中：存款利息收入	6.4.7.10	42,003.09	6,726.74
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		18,047.27	4,307.33
其他利息收入		-	-
2．投资收益（损失以“-”填列）		9,289,301.95	823,024.60
其中：股票投资收益	6.4.7.11	4,754,256.51	233,486.40
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,486,362.83	389,063.86
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	48,682.61	200,474.34
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	13,069,321.53	-332,284.99
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	130,315.44	543.96
减：二、营业总支出		1,180,861.12	376,712.39
1．管理人报酬		598,218.23	183,537.92
2．托管费		128,189.60	39,329.50
3．销售服务费		75,255.71	18,169.46
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		272,855.16	66,162.36
其中：卖出回购金融资产支出		272,855.16	66,162.36
6．信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		1,894.93	-
8．其他费用	6.4.7.21	104,447.49	69,513.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**21,368,128.16**	**125,605.25**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**21,368,128.16**	**125,605.25**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,368,128.16	125,605.25

6.3 净资产变动表

会计主体：广发集汇债券型证券投资基金

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	107,827,019.83	11,984,763.37	119,811,783.20
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	107,827,019.83	11,984,763.37	119,811,783.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	346,328,156.05	82,868,865.62	429,197,021.67
（一）、综合收益总额	-	21,368,128.16	21,368,128.16

（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）	346,328,156.05	61,500,737.46	407,828,893.51
其中：1.基金申购款	415,882,681.25	73,257,078.15	489,139,759.40
2.基金赎回款	-69,554,525.20	-11,756,340.69	-81,310,865.89
（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	454,155,175.88	94,853,628.99	549,008,804.87
项目	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	57,482,078.13	2,980,109.68	60,462,187.81
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	57,482,078.13	2,980,109.68	60,462,187.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,969,726.48	-318,923.65	-9,288,650.13
（一）、综合收益总额	-	125,605.25	125,605.25
（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）	-8,969,726.48	-444,528.90	-9,414,255.38
其中：1.基金申购款	9,718,358.05	532,334.46	10,250,692.51
2.基金赎回款	-18,688,084.53	-976,863.36	-19,664,947.89
（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	48,512,351.65	2,661,186.03	51,173,537.68

产			

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发集汇债券型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2022]1596 号《关于准予广发集汇债券型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发集汇债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2022 年 10 月 17 日向社会公开发行募集并于 2022 年 11 月 8 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为自 2022 年 10 月 17 日至 2022 年 11 月 4 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 1,301,553,117.13 元，有效认购户数为 6,702 户。其中广发集汇债券 A（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 845,583,690.14 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 363,868.05 元；广发集汇债券 C（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 455,467,513.68 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 138,045.26 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》，财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日

起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂（可选择）适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入及金融同业往来利息收入免征增值税，通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，未发生实物交割的，免征增值税。但自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税、个人所得税

对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提供的投资者名册，按照 20%的税率代扣个人所得税；通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

（3）印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳，自 2023 年 8 月 28 日起减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日

活期存款	3,375,765.86
等于：本金	3,373,931.09
加：应计利息	1,834.77
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	3,375,765.86

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		93,324,335.93	-	105,878,993.45	12,554,657.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	190,876,743.01	755,307.43	191,386,307.43	-245,743.01
	银行间市场	253,597,365.00	2,234,532.57	256,705,032.57	873,135.00
	合计	444,474,108.01	2,989,840.00	448,091,340.00	627,391.99
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		537,798,443.94	2,989,840.00	553,970,333.45	13,182,049.51

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	604.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	213,637.03
其中：交易所市场	198,557.87
银行间市场	15,079.16
应付利息	-
预提费用	78,724.36
合计	292,966.10

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发集汇债券 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	91,304,199.94	91,304,199.94
本期申购	107,472,899.85	107,472,899.85
本期赎回（以“-”号填列）	-39,822,536.56	-39,822,536.56
本期末	158,954,563.23	158,954,563.23

金额单位：人民币元

广发集汇债券 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	16,522,819.89	16,522,819.89
本期申购	308,409,781.40	308,409,781.40
本期赎回（以“-”号填列）	-29,731,988.64	-29,731,988.64
本期末	295,200,612.65	295,200,612.65

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

广发集汇债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,815,796.13	-513,531.70	10,302,264.43
本期期初	10,815,796.13	-513,531.70	10,302,264.43
本期利润	5,777,289.37	6,942,132.57	12,719,421.94
本期基金份额交易产生的变动数	11,403,466.95	203,361.16	11,606,828.11
其中：基金申购款	17,937,594.86	910,880.78	18,848,475.64
基金赎回款	-6,534,127.91	-707,519.62	-7,241,647.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,996,552.45	6,631,962.03	34,628,514.48

单位：人民币元

广发集汇债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,782,531.86	-100,032.92	1,682,498.94
本期期初	1,782,531.86	-100,032.92	1,682,498.94
本期利润	2,521,517.26	6,127,188.96	8,648,706.22
本期基金份额交易产生的变动数	43,889,489.06	6,004,420.29	49,893,909.35
其中：基金申购款	48,181,713.97	6,226,888.54	54,408,602.51
基金赎回款	-4,292,224.91	-222,468.25	-4,514,693.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,193,538.18	12,031,576.33	60,225,114.51

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	14,664.05
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	21,680.48
其他	5,658.56
合计	42,003.09

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	4,754,256.51
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	4,754,256.51

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	295,934,669.42
减：卖出股票成本总额	290,667,406.70
减：交易费用	513,006.21
买卖股票差价收入	4,754,256.51

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	1,788,219.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,698,143.02
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	4,486,362.83

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	748,107,470.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	738,456,907.72
减：应计利息总额	6,936,179.92
减：交易费用	16,240.00
买卖债券差价收入	2,698,143.02

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	48,682.61
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	48,682.61

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	13,069,321.53
——股票投资	12,382,825.04
——债券投资	686,496.49
——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	13,069,321.53

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	111,031.60
基金转换费收入	19,283.84
合计	130,315.44

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	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	16,386.60
账户维护费	18,000.00
其他	636.53
合计	104,447.49

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

广发证券股份有限公司	142,595,395.90	87.53%	4,051,670.68	37.25%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	598,218.23	183,537.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	157,691.21	77,868.70
应支付基金管理人的净管理费	440,527.02	105,669.22

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 0.70%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	128,189.60	39,329.50

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		
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C	合计
广发基金管理有限公司	-	7,688.15	7,688.15
中国银行股份有限公司	-	42,337.76	42,337.76

广发证券股份有限公司	-	0.17	0.17
合计	-	50,026.08	50,026.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发集汇债券A	广发集汇债券C	合计
广发基金管理有限公司	-	0.57	0.57
中国银行股份有限公司	-	10,783.94	10,783.94
广发证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	10,784.51	10,784.51

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 0.30%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	广发集汇债券A	广发集汇债券C	广发集汇债券A	广发集汇债券C
报告期初持有的基金份额	55,212,110.06	-	-	-

报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	55,212,110.06	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.73%	-	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发集汇债券 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。

广发集汇债券 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,375,765.86	14,664.05	3,063,642.07	2,027.60

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	6,373.00	4,023,550.71	5,605,244.69	-

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 35,920,674.62 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220208.IB	22 国开 08	2026-07-01	101.42	178,000.00	18,052,857.54
250202.IB	25 国开 02	2026-07-01	100.33	50,000.00	5,016,579.45
260301.IB	26 进出 01	2026-07-01	100.53	100,000.00	10,052,663.01
260411.IB	26 农发 11	2026-07-01	100.49	50,000.00	5,024,287.67
合计				378,000.00	38,146,387.67

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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 14,700,450.33 元，于 2026 年 7 月 6 日、2026 年 7 月 7 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的合规及风险管理委员会负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常

经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,076,950.68	5,057,643.29
合计	15,076,950.68	5,057,643.29

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	211,177,465.79	32,534,232.12
AAA 以下	-	-
未评级	221,836,923.53	90,122,664.83
合计	433,014,389.32	122,656,896.95

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	3,375,765.86	-	-	-	3,375,765.86

结算备付金	3,214,990.38	-	-	-	3,214,990.38
存出保证金	104,050.27	-	-	-	104,050.27
交易性金融资产	76,130,686.31	186,346,915.64	185,613,738.05	105,878,993.45	553,970,333.45
应收清算款	-	-	-	1,249,224.42	1,249,224.42
应收申购款	-	-	-	42,430,503.69	42,430,503.69
资产总计	82,825,492.82	186,346,915.64	185,613,738.05	149,558,721.56	604,344,868.07
负债					
卖出回购金融资产款	50,621,124.95	-	-	-	50,621,124.95
应付清算款	-	-	-	2,802,455.09	2,802,455.09
应付赎回款	-	-	-	1,327,686.75	1,327,686.75
应付管理人报酬	-	-	-	200,537.58	200,537.58
应付托管费	-	-	-	42,972.35	42,972.35
应付销售服务费	-	-	-	40,451.94	40,451.94
应交税费	-	-	-	7,868.44	7,868.44
其他负债	-	-	-	292,966.10	292,966.10
负债总计	50,621,124.95	-	-	4,714,938.25	55,336,063.20
利率敏感度缺口	32,204,367.87	186,346,915.64	185,613,738.05	144,843,783.31	549,008,804.87
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	804,164.90	-	-	-	804,164.90
结算备付金	1,269,003.86	-	-	-	1,269,003.86
存出保证金	6,359.58	-	-	-	6,359.58
交易性金融资产	39,608,016.23	50,628,794.52	37,477,729.49	13,945,448.58	141,659,988.82
应收清算款	-	-	-	5,917,388.17	5,917,388.17
应收申购款	-	-	-	1,411,829.40	1,411,829.40
资产总计	41,687,544.57	50,628,794.52	37,477,729.49	21,274,666.15	151,068,734.73
负债					
卖出回购金融资产款	30,701,824.27	-	-	-	30,701,824.27
应付清算款	-	-	-	17,516.35	17,516.35
应付赎回款	-	-	-	328,750.91	328,750.91
应付管理人报酬	-	-	-	55,641.55	55,641.55
应付托管费	-	-	-	11,923.20	11,923.20
应付销售服务费	-	-	-	2,766.80	2,766.80
应交税费	-	-	-	911.89	911.89
其他负债	-	-	-	137,616.56	137,616.56

负债总计	30,701,824.27	-	-	555,127.26	31,256,951.53
利率敏感度缺口	10,985,720.30	50,628,794.52	37,477,729.49	20,719,538.89	119,811,783.20

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-5,482,573.07	-2,213,458.05
	市场利率下降 25 个基点	5,613,123.71	2,351,467.72

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	-	6,582,045.61	-	6,582,045.61
资产合计	-	**6,582,045.61**	-	**6,582,045.61**
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	-	**6,582,045.61**	-	**6,582,045.61**
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%	329,102.28	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-329,102.28	-

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	105,878,993.45	19.29	13,945,448.58	11.64
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	105,878,993.45	19.29	13,945,448.58	11.64

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%	6,417,539.33	779,305.68
	下降 5%	-6,417,539.33	-779,305.68

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	100,273,748.76
第二层次	453,696,584.69
第三层次	-
合计	553,970,333.45

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	105,878,993.45	17.52
	其中：股票	105,878,993.45	17.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	448,091,340.00	74.14

	其中：债券	448,091,340.00	74.14
	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	6,590,756.24	1.09
8	其他各项资产	43,783,778.38	7.24
9	合计	604,344,868.07	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 6,582,045.61 元，占基金资产净值比例 1.20%。

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	35,967.00	0.01
B	采矿业	200,662.00	0.04
C	制造业	97,499,024.66	17.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,567.00	0.01
E	建筑业	24,367.00	0.00
F	批发和零售业	142,030.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	146,692.00	0.03
H	住宿和餐饮业	1,799.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	482,462.18	0.09
J	金融业	493,321.00	0.09
K	房地产业	12,892.00	0.00
L	租赁和商务服务业	46,696.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	57,067.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	31,552.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,610.00	0.00

R	文化、体育和娱乐业	23,881.00	0.00
S	综合	3,358.00	0.00
	合计	99,296,947.84	18.09

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	1,740,053.07	0.32
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	4,841,992.54	0.88
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	6,582,045.61	1.20

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	002371	北方华创	29,700	26,271,432.00	4.79
2	688233	神工股份	31,259	6,702,554.78	1.22
3	688012	中微公司	14,142	6,625,527.00	1.21
4	688545	兴福电子	46,865	6,235,856.90	1.14
5	688072	拓荆科技	6,373	5,605,244.69	1.02
6	688808	联讯仪器	2,270	5,271,689.10	0.96
7	688041	海光信息	13,161	4,873,518.30	0.89
8	300394	天孚通信	16,100	4,873,148.00	0.89
9	300308	中际旭创	3,200	4,064,000.00	0.74
10	603061	金海通	7,800	3,917,316.00	0.71
11	688361	中科飞测	7,246	3,115,780.00	0.57
12	688037	芯源微	6,950	3,051,397.50	0.56
13	03986	兆易创新	2,700	2,785,960.98	0.51
13	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.01
14	688766	普冉股份	3,504	2,686,166.40	0.49
15	688082	盛美上海	6,061	2,618,352.00	0.48

16	688019	安集科技	6,554	2,224,820.84	0.41
17	002428	云南锗业	17,900	2,151,222.00	0.39
18	01347	华虹宏力	11,000	2,056,031.56	0.37
19	00189	东岳集团	105,000	1,740,053.07	0.32
20	002463	沪电股份	11,200	1,711,360.00	0.31
21	002851	麦格米特	9,000	1,504,620.00	0.27
22	002436	兴森科技	11,100	565,545.00	0.10
23	688521	芯原股份	826	306,561.64	0.06
24	002281	光迅科技	900	231,246.00	0.04
25	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.02
26	300750	宁德时代	200	78,602.00	0.01
27	300502	新易盛	100	60,700.00	0.01
28	002384	东山精密	200	52,470.00	0.01
29	601318	中国平安	900	42,966.00	0.01
30	601899	紫金矿业	1,700	42,738.00	0.01
31	688110	东芯股份	200	40,740.00	0.01
32	603259	药明康德	300	37,353.00	0.01
33	600036	招商银行	1,000	35,500.00	0.01
34	300857	协创数据	100	33,990.00	0.01
35	300408	三环集团	200	33,380.00	0.01
36	688981	中芯国际	200	31,764.00	0.01
37	600030	中信证券	1,100	31,603.00	0.01
38	000333	美的集团	400	30,212.00	0.01
39	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.01
40	600900	长江电力	1,100	29,117.00	0.01
41	601138	工业富联	400	28,860.00	0.01
42	002475	立讯精密	400	28,160.00	0.01
43	688503	聚和材料	200	26,540.00	0.00
44	300059	东方财富	1,300	26,494.00	0.00
45	601398	工商银行	3,700	26,159.00	0.00
46	301536	星宸科技	200	25,742.00	0.00
47	300223	北京君正	100	24,890.00	0.00
48	688220	翱捷科技-U	200	24,864.00	0.00
49	300438	鹏辉能源	300	24,855.00	0.00
50	002558	巨人网络	900	24,804.00	0.00
51	000725	京东方 A	2,800	24,304.00	0.00
52	688266	泽璟制药-U	200	23,332.00	0.00
53	601872	招商轮船	1,300	22,841.00	0.00
54	301358	湖南裕能	300	22,761.00	0.00
55	300323	华灿光电	1,100	22,440.00	0.00
56	000858	五粮液	300	22,200.00	0.00
57	688390	固德威	200	21,702.00	0.00
58	601166	兴业银行	1,300	21,528.00	0.00
59	601288	农业银行	3,500	21,245.00	0.00

60	600276	恒瑞医药	400	20,816.00	0.00
61	688388	嘉元科技	470	20,680.00	0.00
62	600150	中国船舶	600	20,274.00	0.00
63	601211	国泰海通	1,100	20,020.00	0.00
64	600026	中远海能	1,100	19,734.00	0.00
65	002079	苏州固锝	1,300	19,539.00	0.00
66	688396	华润微	200	19,510.00	0.00
67	300184	力源信息	1,100	19,305.00	0.00
68	300765	石药创新	700	19,061.00	0.00
69	000703	恒逸石化	1,400	18,998.00	0.00
70	002064	华峰化学	2,000	18,980.00	0.00
71	688107	安路科技	414	18,878.40	0.00
72	300855	图南股份	600	18,756.00	0.00
73	000973	佛塑科技	1,300	18,655.00	0.00
74	601699	潞安环能	1,300	18,564.00	0.00
75	000810	创维数字	1,400	18,550.00	0.00
76	000988	华工科技	100	18,461.00	0.00
77	003022	联泓新科	700	18,130.00	0.00
78	000100	TCL 科技	3,100	18,042.00	0.00
79	601328	交通银行	2,800	18,004.00	0.00
80	301210	金杨精密	600	18,000.00	0.00
81	301189	奥尼电子	300	17,679.00	0.00
82	301122	采纳股份	600	17,646.00	0.00
83	688717	艾罗能源	212	17,504.84	0.00
84	600183	生益科技	100	17,340.00	0.00
85	688678	福立旺	716	17,305.72	0.00
86	000026	飞亚达	800	17,232.00	0.00
87	002415	海康威视	500	17,100.00	0.00
88	001313	粤海饲料	2,400	17,016.00	0.00
89	301295	美硕科技	400	16,872.00	0.00
90	601975	招商南油	4,500	16,785.00	0.00
91	688559	海目星	200	16,784.00	0.00
92	001308	康冠科技	800	16,688.00	0.00
93	300885	海昌新材	700	16,639.00	0.00
94	001298	好上好	800	16,600.00	0.00
95	301265	华新科技	600	16,530.00	0.00
96	601688	华泰证券	800	16,496.00	0.00
97	601882	海天精工	800	16,184.00	0.00
98	688221	前沿生物-U	722	16,172.80	0.00
99	603162	海通发展	1,800	16,146.00	0.00
100	301246	宏源药业	600	16,140.00	0.00
101	300504	天邑股份	1,000	16,130.00	0.00
102	000567	海德股份	2,700	16,119.00	0.00
103	300613	富瀚微	200	16,016.00	0.00

104	301266	宇邦新材	700	15,988.00	0.00
105	002594	比亚迪	200	15,940.00	0.00
106	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.00
107	688365	光云科技	1,002	15,801.54	0.00
108	300590	移为通信	1,100	15,785.00	0.00
109	002266	浙富控股	3,100	15,686.00	0.00
110	603006	联明股份	1,100	15,675.00	0.00
111	301261	恒工精密	200	15,620.00	0.00
112	301002	崧盛股份	400	15,440.00	0.00
113	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.00
114	002388	新亚制程	2,900	15,196.00	0.00
115	300067	安诺其	2,800	15,176.00	0.00
116	002132	恒星科技	2,800	15,148.00	0.00
117	000792	盐湖股份	500	15,095.00	0.00
118	600919	江苏银行	1,400	15,092.00	0.00
119	300281	金明精机	2,500	15,075.00	0.00
119	000001	平安银行	1,500	15,075.00	0.00
120	002843	泰嘉股份	700	15,029.00	0.00
121	002008	大族激光	100	15,011.00	0.00
122	000651	格力电器	400	15,000.00	0.00
123	000802	北京文化	4,300	14,964.00	0.00
124	002810	山东赫达	600	14,820.00	0.00
125	300715	凯伦股份	900	14,814.00	0.00
126	600810	神马股份	2,400	14,808.00	0.00
127	601857	中国石油	1,700	14,756.00	0.00
128	600176	中国巨石	200	14,576.00	0.00
129	002578	闽发铝业	4,600	14,490.00	0.00
130	603799	华友钴业	300	14,478.00	0.00
131	603711	香飘飘	1,300	14,443.00	0.00
132	300073	当升科技	300	14,412.00	0.00
133	002678	珠江钢琴	3,400	14,382.00	0.00
134	600887	伊利股份	600	14,376.00	0.00
135	300681	英搏尔	500	14,310.00	0.00
136	000809	和展能源	4,500	14,265.00	0.00
137	301256	华融化学	1,100	14,256.00	0.00
138	600984	建设机械	3,800	14,212.00	0.00
139	603915	国茂股份	1,000	14,190.00	0.00
140	300488	恒锋工具	300	14,049.00	0.00
141	600792	云煤能源	4,400	13,948.00	0.00
142	603178	圣龙股份	1,000	13,850.00	0.00
143	603719	良品铺子	1,600	13,840.00	0.00
144	002752	昇兴股份	2,500	13,800.00	0.00
145	301216	万凯新材	600	13,794.00	0.00
146	600309	万华化学	200	13,682.00	0.00

147	300760	迈瑞医疗	100	13,583.00	0.00
148	603390	通达电气	1,300	13,572.00	0.00
149	300277	汽轮科技	900	13,536.00	0.00
150	002041	登海种业	1,700	13,379.00	0.00
151	000983	山西焦煤	2,300	13,340.00	0.00
152	002460	赣锋锂业	200	13,080.00	0.00
153	300014	亿纬锂能	200	13,006.00	0.00
154	600999	招商证券	600	12,660.00	0.00
155	600601	方正科技	900	12,456.00	0.00
156	001314	亿道信息	200	12,360.00	0.00
157	002466	天齐锂业	200	12,264.00	0.00
158	601127	赛力斯	200	12,250.00	0.00
159	601816	京沪高铁	2,700	12,231.00	0.00
160	601225	陕西煤业	600	12,210.00	0.00
161	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.00
162	600522	中天科技	200	12,136.00	0.00
163	600028	中国石化	2,700	12,042.00	0.00
164	300136	信维通信	100	11,925.00	0.00
165	002142	宁波银行	400	11,876.00	0.00
166	300106	西部牧业	1,200	11,808.00	0.00
167	688036	传音控股	200	11,790.00	0.00
168	300823	建科智能	800	11,664.00	0.00
169	300511	雪榕生物	2,300	11,569.00	0.00
170	000938	紫光股份	400	11,544.00	0.00
171	600893	航发动力	300	11,502.00	0.00
172	600089	特变电工	500	11,250.00	0.00
173	603937	丽岛新材	800	11,216.00	0.00
174	603217	元利科技	500	11,215.00	0.00
175	600135	乐凯胶片	1,400	11,186.00	0.00
176	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.00
177	600844	金煤科技	4,500	10,890.00	0.00
178	601995	中金公司	300	10,845.00	0.00
179	300955	嘉亨家化	300	10,827.00	0.00
180	601888	中国中免	200	10,742.00	0.00
181	600104	上汽集团	1,100	10,736.00	0.00
182	603019	中科曙光	100	10,723.00	0.00
183	605117	德业股份	100	10,618.00	0.00
184	601939	建设银行	1,100	10,593.00	0.00
185	300154	瑞凌股份	1,400	10,528.00	0.00
186	600584	长电科技	100	10,355.00	0.00
187	601658	邮储银行	2,100	10,353.00	0.00
188	601009	南京银行	1,000	9,890.00	0.00
189	605123	派克新材	100	9,701.00	0.00
190	300454	深信服	100	9,620.00	0.00

191	000657	中钨高新	100	9,572.00	0.00
192	300390	天华新能	100	9,351.00	0.00
193	601006	大秦铁路	2,000	9,220.00	0.00
194	301239	普瑞眼科	300	9,135.00	0.00
195	600489	中金黄金	500	9,025.00	0.00
196	002049	紫光国微	100	8,875.00	0.00
197	603993	洛阳钼业	500	8,775.00	0.00
198	601066	中信建投	300	8,721.00	0.00
199	002027	分众传媒	1,800	8,712.00	0.00
200	601668	中国建筑	2,000	8,680.00	0.00
201	600031	三一重工	500	8,640.00	0.00
202	300671	富满微	100	8,616.00	0.00
203	600000	浦发银行	1,000	8,610.00	0.00
204	600549	厦门钨业	100	8,520.00	0.00
205	002236	大华股份	500	8,245.00	0.00
206	000338	潍柴动力	300	8,175.00	0.00
207	600019	宝钢股份	1,500	8,145.00	0.00
208	603345	安井食品	100	8,019.00	0.00
209	300458	全志科技	200	7,892.00	0.00
210	601012	隆基绿能	600	7,872.00	0.00
211	601111	中国国航	1,300	7,865.00	0.00
212	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.00
213	002156	通富微电	100	7,587.00	0.00
214	002532	天山铝业	700	7,511.00	0.00
215	600016	民生银行	2,300	7,406.00	0.00
216	600115	中国东航	1,900	7,239.00	0.00
217	000063	中兴通讯	200	7,238.00	0.00
218	002273	水晶光电	200	7,096.00	0.00
219	002648	卫星化学	300	7,047.00	0.00
220	688166	博瑞医药	200	7,002.00	0.00
221	601766	中国中车	1,300	6,760.00	0.00
222	600105	永鼎股份	100	6,748.00	0.00
223	000807	云铝股份	300	6,642.00	0.00
224	300124	汇川技术	100	6,633.00	0.00
225	000425	徐工机械	800	6,472.00	0.00
226	002493	荣盛石化	600	6,450.00	0.00
227	601126	四方股份	100	6,320.00	0.00
228	601998	中信银行	900	6,237.00	0.00
229	301297	富乐德	100	6,124.00	0.00
230	688005	容百科技	200	6,120.00	0.00
231	603728	鸣志电器	100	6,092.00	0.00
232	300432	富临精工	300	6,027.00	0.00
233	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.00
234	600688	上海石化	2,000	5,860.00	0.00

235	302132	中航成飞	100	5,832.00	0.00
236	002487	大金重工	100	5,797.00	0.00
237	600875	东方电气	200	5,754.00	0.00
238	601601	中国太保	200	5,704.00	0.00
239	000733	振华科技	100	5,664.00	0.00
239	002756	永兴材料	100	5,664.00	0.00
240	300568	星源材质	300	5,616.00	0.00
241	002979	雷赛智能	100	5,578.00	0.00
242	000034	神州数码	200	5,550.00	0.00
243	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.00
244	000966	长源电力	1,400	5,488.00	0.00
245	301219	腾远钴业	100	5,480.00	0.00
246	601169	北京银行	1,100	5,390.00	0.00
247	603032	德新科技	200	5,380.00	0.00
248	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.00
249	002518	科士达	100	5,359.00	0.00
250	000629	钒钛股份	1,600	5,344.00	0.00
251	600188	兖矿能源	300	5,331.00	0.00
252	600346	恒力石化	300	5,313.00	0.00
253	300747	锐科激光	100	5,309.00	0.00
254	002414	高德红外	400	5,304.00	0.00
255	300617	安靠智电	100	5,299.00	0.00
256	000617	中油资本	800	5,272.00	0.00
257	600988	赤峰黄金	200	5,264.00	0.00
258	300602	飞荣达	100	5,120.00	0.00
259	002465	海格通信	400	5,108.00	0.00
260	000975	山金国际	300	5,100.00	0.00
261	300779	惠城环保	100	5,020.00	0.00
262	600726	华电能源	700	4,984.00	0.00
263	601677	明泰铝业	300	4,980.00	0.00
264	603179	新泉股份	100	4,965.00	0.00
265	000969	安泰科技	200	4,908.00	0.00
266	300693	盛弘股份	100	4,875.00	0.00
266	002517	恺英网络	300	4,875.00	0.00
267	002966	苏州银行	700	4,872.00	0.00
268	301329	信音电子	200	4,858.00	0.00
269	600352	浙江龙盛	400	4,844.00	0.00
270	600157	永泰能源	3,000	4,830.00	0.00
271	600111	北方稀土	100	4,805.00	0.00
272	600426	华鲁恒升	200	4,784.00	0.00
273	002202	金风科技	200	4,780.00	0.00
274	002155	湖南黄金	200	4,774.00	0.00
275	000878	云南铜业	300	4,764.00	0.00
276	002271	东方雨虹	400	4,748.00	0.00

277	000628	高新发展	100	4,740.00	0.00
278	603638	艾迪精密	200	4,690.00	0.00
279	002179	中航光电	100	4,620.00	0.00
279	601607	上海医药	300	4,620.00	0.00
280	601238	广汽集团	900	4,572.00	0.00
281	601021	春秋航空	100	4,558.00	0.00
282	688472	阿特斯	418	4,522.76	0.00
283	002185	华天科技	200	4,462.00	0.00
284	002050	三花智控	100	4,383.00	0.00
285	300919	中伟新材	100	4,375.00	0.00
286	688609	九联科技	392	4,315.92	0.00
287	601061	中信金属	400	4,308.00	0.00
288	000625	长安汽车	600	4,302.00	0.00
289	601077	渝农商行	700	4,277.00	0.00
290	000933	神火股份	200	4,240.00	0.00
291	000519	中兵红箭	200	4,214.00	0.00
292	000967	盈峰环境	400	4,212.00	0.00
293	688728	格科微	200	4,208.00	0.00
294	300832	新产业	100	4,200.00	0.00
295	300015	爱尔眼科	500	4,130.00	0.00
296	300607	拓斯达	100	4,123.00	0.00
297	601600	中国铝业	500	4,110.00	0.00
298	000893	亚钾国际	100	4,089.00	0.00
299	601777	千里科技	500	4,080.00	0.00
299	688165	埃夫特-U	200	4,080.00	0.00
300	002497	雅化集团	200	4,074.00	0.00
301	300450	先导智能	100	4,072.00	0.00
302	600989	宝丰能源	200	4,066.00	0.00
303	600884	杉杉股份	300	4,065.00	0.00
304	300738	奥飞数据	200	4,044.00	0.00
305	601665	齐鲁银行	700	4,039.00	0.00
306	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
307	603333	福华尚纬	500	4,030.00	0.00
308	688387	信科移动-U	200	3,968.00	0.00
309	603225	新凤鸣	200	3,930.00	0.00
310	688772	珠海冠宇	200	3,926.00	0.00
311	603195	公牛集团	100	3,915.00	0.00
312	601088	中国神华	100	3,904.00	0.00
313	000951	中国重汽	200	3,902.00	0.00
314	300339	润和软件	100	3,851.00	0.00
315	603588	高能环境	200	3,840.00	0.00
316	002396	星网锐捷	200	3,834.00	0.00
317	603127	昭衍新药	100	3,822.00	0.00
318	300007	汉威科技	100	3,820.00	0.00

319	002506	协鑫集成	1,200	3,816.00	0.00
320	300001	特锐德	100	3,783.00	0.00
321	002745	木林森	300	3,765.00	0.00
322	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.00
323	603305	旭升集团	300	3,636.00	0.00
324	688599	天合光能	257	3,628.84	0.00
325	688382	益方生物-U	200	3,600.00	0.00
326	000155	川能动力	300	3,594.00	0.00
327	300166	东方国信	200	3,542.00	0.00
328	300187	永清环保	700	3,535.00	0.00
328	601628	中国人寿	100	3,535.00	0.00
329	600109	国金证券	400	3,512.00	0.00
330	002714	牧原股份	100	3,499.00	0.00
331	600166	福田汽车	1,200	3,492.00	0.00
332	002265	建设工业	200	3,480.00	0.00
333	601229	上海银行	400	3,472.00	0.00
334	601615	明阳智能	300	3,471.00	0.00
335	002600	领益智造	200	3,468.00	0.00
336	601108	财通证券	400	3,460.00	0.00
337	002841	视源股份	100	3,453.00	0.00
338	600885	宏发股份	100	3,449.00	0.00
339	000301	东方盛虹	300	3,435.00	0.00
340	300034	钢研高纳	200	3,428.00	0.00
341	300134	大富科技	400	3,420.00	0.00
342	002498	汉缆股份	500	3,410.00	0.00
343	600208	衢州发展	1,200	3,396.00	0.00
344	600595	中孚实业	600	3,372.00	0.00
345	600673	东阳光	100	3,358.00	0.00
345	603806	福斯特	200	3,358.00	0.00
346	603288	海天味业	100	3,316.00	0.00
347	600580	卧龙电驱	100	3,310.00	0.00
348	600018	上港集团	700	3,304.00	0.00
349	000426	兴业银锡	100	3,296.00	0.00
350	600998	九州通	700	3,283.00	0.00
351	002922	伊戈尔	100	3,280.00	0.00
352	600546	山煤国际	300	3,279.00	0.00
353	002545	东方铁塔	200	3,244.00	0.00
354	603992	松霖科技	100	3,240.00	0.00
355	600961	株冶集团	100	3,239.00	0.00
356	301510	固高科技	100	3,193.00	0.00
357	000062	深圳华强	100	3,182.00	0.00
358	600619	海立股份	200	3,170.00	0.00
359	300872	天阳科技	200	3,160.00	0.00
360	600233	圆通速递	200	3,150.00	0.00

361	300077	国民技术	100	3,135.00	0.00
362	001289	龙源电力	200	3,126.00	0.00
362	002352	顺丰控股	100	3,126.00	0.00
363	600801	华新建材	200	3,120.00	0.00
364	001287	中电港	100	3,115.00	0.00
365	000027	深圳能源	500	3,100.00	0.00
365	300687	赛意信息	100	3,100.00	0.00
366	600330	天通股份	100	3,084.00	0.00
367	000166	申万宏源	700	3,080.00	0.00
368	603276	恒兴新材	200	3,062.00	0.00
368	002838	道恩股份	100	3,062.00	0.00
369	300773	拉卡拉	200	3,060.00	0.00
370	600475	华光环能	200	3,050.00	0.00
371	000883	湖北能源	700	3,024.00	0.00
372	600906	财达证券	400	2,984.00	0.00
373	000783	长江证券	300	2,925.00	0.00
374	002468	申通快递	200	2,912.00	0.00
375	601000	唐山港	700	2,905.00	0.00
376	300759	康龙化成	100	2,893.00	0.00
376	603659	璞泰来	100	2,893.00	0.00
377	002153	石基信息	400	2,892.00	0.00
378	601666	平煤股份	400	2,860.00	0.00
379	300031	宝通科技	100	2,857.00	0.00
380	000415	渤海租赁	700	2,849.00	0.00
381	300133	华策影视	400	2,832.00	0.00
382	000690	宝新能源	600	2,820.00	0.00
382	002602	世纪华通	200	2,820.00	0.00
383	002969	嘉美包装	200	2,816.00	0.00
384	600369	西南证券	700	2,814.00	0.00
385	002261	拓维信息	100	2,801.00	0.00
386	601399	国机重装	800	2,800.00	0.00
387	300127	银河磁体	100	2,795.00	0.00
388	300115	长盈精密	100	2,794.00	0.00
388	600316	洪都航空	100	2,794.00	0.00
389	600060	海信视像	100	2,787.00	0.00
390	603030	全筑股份	1,400	2,786.00	0.00
391	603077	和邦生物	1,200	2,784.00	0.00
392	000932	华菱钢铁	800	2,776.00	0.00
393	300058	蓝色光标	200	2,752.00	0.00
394	600808	马钢股份	1,100	2,750.00	0.00
395	600323	瀚蓝环境	100	2,746.00	0.00
396	000727	冠捷科技	1,000	2,730.00	0.00
397	603025	大豪科技	200	2,728.00	0.00
398	601168	西部矿业	100	2,714.00	0.00

399	300997	欢乐家	200	2,710.00	0.00
400	300253	卫宁健康	400	2,692.00	0.00
401	002416	爱施德	300	2,688.00	0.00
402	002488	金固股份	300	2,673.00	0.00
403	000762	西藏矿业	100	2,670.00	0.00
404	601919	中远海控	200	2,652.00	0.00
405	600535	天士力	200	2,646.00	0.00
406	000036	华联控股	600	2,622.00	0.00
407	601360	三六零	300	2,607.00	0.00
408	301500	飞南资源	100	2,605.00	0.00
409	300057	万顺新材	300	2,604.00	0.00
410	603317	天味食品	200	2,602.00	0.00
410	300017	网宿科技	200	2,602.00	0.00
411	603876	鼎胜新材	100	2,601.00	0.00
412	300142	沃森生物	200	2,598.00	0.00
413	601728	中国电信	500	2,595.00	0.00
414	600029	南方航空	500	2,590.00	0.00
415	000801	四川九洲	200	2,588.00	0.00
416	600977	中国电影	200	2,584.00	0.00
417	600418	江淮汽车	100	2,583.00	0.00
418	688658	悦康药业	200	2,572.00	0.00
419	002948	青岛银行	500	2,540.00	0.00
420	002531	天顺风能	300	2,529.00	0.00
421	603439	三力制药	200	2,522.00	0.00
422	300322	硕贝德	100	2,520.00	0.00
422	600361	创新新材	700	2,520.00	0.00
423	300861	美畅股份	100	2,519.00	0.00
424	601881	中国银河	200	2,514.00	0.00
425	600037	歌华有线	400	2,508.00	0.00
426	600927	永安期货	200	2,490.00	0.00
427	603596	伯特利	100	2,484.00	0.00
428	600737	中粮糖业	200	2,466.00	0.00
429	300498	温氏股份	200	2,464.00	0.00
430	300772	运达股份	200	2,460.00	0.00
431	600339	中油工程	800	2,456.00	0.00
432	600623	华谊集团	300	2,421.00	0.00
433	603135	中重科技	200	2,420.00	0.00
434	603737	三棵树	100	2,410.00	0.00
435	600050	中国联通	600	2,400.00	0.00
435	000830	鲁西化工	200	2,400.00	0.00
436	603766	隆鑫通用	200	2,386.00	0.00
437	300459	汤姆猫	700	2,373.00	0.00
438	002251	步步高	700	2,366.00	0.00
439	688586	江航装备	200	2,338.00	0.00

440	300337	银邦股份	200	2,332.00	0.00
441	002458	益生股份	300	2,331.00	0.00
442	300999	金龙鱼	100	2,326.00	0.00
443	601106	中国一重	700	2,310.00	0.00
444	002216	三全食品	200	2,306.00	0.00
445	600406	国电南瑞	100	2,285.00	0.00
446	000060	中金岭南	300	2,271.00	0.00
447	300153	科泰电源	100	2,262.00	0.00
448	000061	农产品	400	2,240.00	0.00
449	603816	顾家家居	100	2,236.00	0.00
450	002516	旷达科技	400	2,232.00	0.00
451	603057	紫燕食品	100	2,230.00	0.00
452	000837	秦川机床	200	2,222.00	0.00
453	300497	富祥股份	100	2,216.00	0.00
454	601069	西部黄金	100	2,200.00	0.00
455	600008	首创环保	800	2,176.00	0.00
456	600057	厦门象屿	400	2,168.00	0.00
457	601233	桐昆股份	100	2,165.00	0.00
458	600295	鄂尔多斯	200	2,144.00	0.00
459	600879	航天电子	100	2,129.00	0.00
460	600562	国睿科技	100	2,122.00	0.00
460	688469	芯联集成-U	200	2,122.00	0.00
461	000612	焦作万方	200	2,118.00	0.00
462	301039	中集车辆	300	2,115.00	0.00
463	601101	昊华能源	200	2,112.00	0.00
464	300201	海伦哲	100	2,107.00	0.00
465	300130	新国都	100	2,104.00	0.00
466	601865	福莱特	200	2,102.00	0.00
467	002643	万润股份	100	2,095.00	0.00
468	001236	弘业期货	300	2,085.00	0.00
469	002429	兆驰股份	200	2,078.00	0.00
470	300579	数字认证	100	2,070.00	0.00
470	600971	恒源煤电	300	2,070.00	0.00
471	002832	比音勒芬	100	2,064.00	0.00
472	600655	豫园股份	500	2,055.00	0.00
473	601155	新城控股	200	2,052.00	0.00
474	301263	泰恩康	100	2,049.00	0.00
475	002635	安洁科技	100	2,045.00	0.00
476	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.00
477	300416	苏试试验	100	2,038.00	0.00
478	300921	南凌科技	100	2,031.00	0.00
479	001286	陕西能源	200	2,028.00	0.00
480	000729	燕京啤酒	200	2,026.00	0.00
481	600158	中体产业	300	2,022.00	0.00

482	603505	金石资源	100	2,015.00	0.00
483	002044	美年健康	400	2,012.00	0.00
483	600446	金证股份	200	2,012.00	0.00
484	300580	贝斯特	100	2,011.00	0.00
485	000680	山推股份	200	2,010.00	0.00
486	600332	白云山	100	2,004.00	0.00
486	000950	重药控股	400	2,004.00	0.00
487	000681	视觉中国	100	1,994.00	0.00
488	600783	鲁信创投	100	1,992.00	0.00
489	300682	朗新科技	200	1,980.00	0.00
490	601678	滨化股份	300	1,977.00	0.00
491	301551	无线传媒	100	1,973.00	0.00
492	002292	奥飞娱乐	300	1,968.00	0.00
493	600928	西安银行	600	1,962.00	0.00
493	002195	岩山科技	300	1,962.00	0.00
494	002961	瑞达期货	100	1,958.00	0.00
495	600717	天津港	500	1,945.00	0.00
496	002077	大港股份	100	1,929.00	0.00
497	603599	广信股份	200	1,916.00	0.00
498	301487	盟固利	100	1,915.00	0.00
499	601608	中信重工	400	1,908.00	0.00
499	002120	韵达股份	300	1,908.00	0.00
499	300399	天利科技	100	1,908.00	0.00
500	000949	新乡化纤	300	1,902.00	0.00
501	002320	海峡股份	300	1,881.00	0.00
502	002246	北化股份	100	1,880.00	0.00
503	300244	迪安诊断	100	1,874.00	0.00
504	002245	蔚蓝锂芯	100	1,871.00	0.00
505	002534	西子洁能	100	1,855.00	0.00
506	600657	信达地产	800	1,848.00	0.00
507	000750	国海证券	500	1,840.00	0.00
508	002345	潮宏基	200	1,834.00	0.00
509	301363	美好医疗	100	1,833.00	0.00
509	600409	三友化工	300	1,833.00	0.00
510	603093	南华期货	100	1,815.00	0.00
511	601985	中国核电	200	1,806.00	0.00
512	600754	锦江酒店	100	1,799.00	0.00
513	603939	益丰药房	100	1,798.00	0.00
514	002557	洽洽食品	100	1,796.00	0.00
515	603108	润达医疗	200	1,780.00	0.00
516	600025	华能水电	200	1,778.00	0.00
517	000712	锦龙股份	200	1,772.00	0.00
518	300592	华凯易佰	100	1,770.00	0.00
519	688779	五矿新能	217	1,759.87	0.00

520	601001	晋控煤业	100	1,739.00	0.00
521	002081	金螳螂	400	1,732.00	0.00
521	002541	鸿路钢构	100	1,732.00	0.00
522	601068	中铝国际	400	1,728.00	0.00
523	601139	深圳燃气	300	1,698.00	0.00
523	600072	中船科技	200	1,698.00	0.00
524	000402	金融街	700	1,687.00	0.00
525	000686	东北证券	200	1,680.00	0.00
526	002163	海南发展	200	1,668.00	0.00
527	000739	普洛药业	100	1,666.00	0.00
528	601333	广深铁路	600	1,650.00	0.00
529	300761	立华股份	100	1,641.00	0.00
530	300185	通裕重工	600	1,638.00	0.00
531	000990	诚志股份	200	1,636.00	0.00
532	301153	中科江南	100	1,629.00	0.00
533	300363	博腾股份	100	1,624.00	0.00
534	000550	江铃汽车	100	1,622.00	0.00
535	600507	方大特钢	400	1,620.00	0.00
536	600123	兰花科创	300	1,602.00	0.00
537	600882	妙可蓝多	100	1,599.00	0.00
538	600654	中安科	600	1,596.00	0.00
538	600596	新安股份	100	1,596.00	0.00
539	002099	海翔药业	300	1,584.00	0.00
540	601969	海南矿业	200	1,582.00	0.00
541	603013	亚普股份	100	1,579.00	0.00
542	002221	东华能源	300	1,578.00	0.00
543	300424	航新科技	100	1,574.00	0.00
544	002045	国光电器	200	1,570.00	0.00
545	000552	甘肃能化	700	1,568.00	0.00
546	603132	金徽股份	100	1,558.00	0.00
547	605011	杭州热电	100	1,546.00	0.00
548	600143	金发科技	100	1,545.00	0.00
549	601997	贵阳银行	300	1,539.00	0.00
550	600338	西藏珠峰	100	1,524.00	0.00
550	601212	白银有色	300	1,524.00	0.00
551	002299	圣农发展	100	1,516.00	0.00
552	600021	上海电力	100	1,507.00	0.00
553	603233	大参林	100	1,503.00	0.00
554	300284	苏交科	300	1,500.00	0.00
554	000059	华锦股份	400	1,500.00	0.00
555	601179	中国西电	100	1,492.00	0.00
556	300140	节能环境	300	1,491.00	0.00
557	300925	法本信息	100	1,479.00	0.00
557	601801	皖新传媒	300	1,479.00	0.00

558	002017	东信和平	100	1,463.00	0.00
559	301267	华厦眼科	100	1,459.00	0.00
560	600926	杭州银行	100	1,445.00	0.00
561	601788	光大证券	100	1,443.00	0.00
562	300276	三丰智能	200	1,434.00	0.00
563	002131	利欧股份	300	1,425.00	0.00
564	600871	石化油服	700	1,421.00	0.00
565	600863	华能蒙电	300	1,410.00	0.00
566	600985	淮北矿业	100	1,405.00	0.00
567	600335	国机汽车	300	1,404.00	0.00
568	601727	上海电气	200	1,400.00	0.00
569	301268	铭利达	100	1,398.00	0.00
570	300298	三诺生物	100	1,395.00	0.00
571	601187	厦门银行	200	1,366.00	0.00
572	000539	粤电力 A	200	1,362.00	0.00
572	002755	奥赛康	100	1,362.00	0.00
572	600929	雪天盐业	300	1,362.00	0.00
573	000709	河钢股份	700	1,358.00	0.00
574	601319	中国人保	200	1,352.00	0.00
575	002795	永和智控	200	1,338.00	0.00
576	601868	中国能建	500	1,335.00	0.00
577	300341	麦克奥迪	100	1,325.00	0.00
578	002340	格林美	200	1,322.00	0.00
579	002797	第一创业	200	1,314.00	0.00
580	000559	万向钱潮	100	1,293.00	0.00
581	600773	西藏城投	100	1,287.00	0.00
582	002701	奥瑞金	300	1,278.00	0.00
582	600015	华夏银行	200	1,278.00	0.00
583	002439	启明星辰	100	1,265.00	0.00
584	002174	游族网络	100	1,261.00	0.00
585	600320	振华重工	300	1,239.00	0.00
586	600126	杭钢股份	200	1,226.00	0.00
587	600841	动力新科	200	1,220.00	0.00
588	300582	英飞特	100	1,218.00	0.00
589	600497	驰宏锌锗	100	1,211.00	0.00
590	600292	电投水电	100	1,204.00	0.00
591	300564	筑博设计	100	1,201.00	0.00
592	000800	一汽解放	200	1,190.00	0.00
593	603997	继峰股份	100	1,183.00	0.00
594	003816	中国广核	300	1,173.00	0.00
595	600201	生物股份	100	1,165.00	0.00
596	600686	金龙汽车	100	1,129.00	0.00
597	300437	清水源	100	1,126.00	0.00
598	600151	航天机电	100	1,122.00	0.00

599	002737	葵花药业	100	1,121.00	0.00
600	002668	TCL 智家	100	1,108.00	0.00
601	002670	国盛证券	100	1,100.00	0.00
602	301136	招标股份	100	1,098.00	0.00
603	600711	盛屯矿业	100	1,097.00	0.00
604	600372	中航机载	100	1,085.00	0.00
605	600598	北大荒	100	1,084.00	0.00
606	601038	一拖股份	100	1,059.00	0.00
607	600746	江苏索普	200	1,046.00	0.00
608	301215	中汽股份	200	1,038.00	0.00
609	603885	吉祥航空	100	1,029.00	0.00
610	301339	通行宝	100	1,023.00	0.00
611	603871	嘉友国际	100	1,021.00	0.00
612	605055	迎丰股份	100	1,020.00	0.00
613	601963	重庆银行	100	1,008.00	0.00
613	002563	森马服饰	200	1,008.00	0.00
614	600583	海油工程	200	1,006.00	0.00
615	600618	氯碱化工	100	1,005.00	0.00
616	600968	海油发展	300	999.00	0.00
617	603697	有友食品	100	959.00	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	002371	北方华创	31,342,428.45	26.16
2	688012	中微公司	12,842,327.87	10.72
3	688072	拓荆科技	12,013,121.06	10.03
4	300308	中际旭创	11,152,479.64	9.31
5	688041	海光信息	9,663,442.85	8.07
6	301511	德福科技	9,395,849.00	7.84
7	603061	金海通	9,248,541.00	7.72
8	01347	华虹宏力	7,740,672.11	6.46
8	688347	华虹宏力	1,495,759.75	1.25
9	688545	兴福电子	8,688,153.06	7.25
10	300394	天孚通信	7,435,078.00	6.21
11	688082	盛美上海	7,040,116.40	5.88
12	300236	上海新阳	6,866,992.00	5.73
13	688361	中科飞测	6,758,793.64	5.64
14	688766	普冉股份	6,521,714.76	5.44

15	300757	罗博特科	6,491,785.00	5.42
16	00189	东岳集团	6,342,801.48	5.29
17	688502	茂莱光学	6,172,886.16	5.15
18	688233	神工股份	5,920,023.00	4.94
19	688019	安集科技	5,626,273.13	4.70
20	03986	兆易创新	4,694,429.77	3.92
20	603986	兆易创新	842,904.00	0.70
21	688808	联讯仪器	5,358,229.30	4.47
22	688008	澜起科技	5,342,154.99	4.46
23	002281	光迅科技	5,238,106.00	4.37
24	301421	波长光电	5,012,486.00	4.18
25	688313	仕佳光子	4,498,812.26	3.75
26	002428	云南锗业	4,280,513.00	3.57
27	301338	凯格精机	4,197,843.00	3.50
28	300502	新易盛	3,695,995.00	3.08
29	002837	英维克	2,768,315.10	2.31
30	688037	芯源微	2,683,293.36	2.24
31	688521	芯原股份	2,653,940.15	2.22
32	002436	兴森科技	2,528,134.00	2.11
33	688027	国盾量子	2,410,474.11	2.01

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	002371	北方华创	10,065,106.00	8.40
2	301511	德福科技	9,960,573.00	8.31
3	300308	中际旭创	8,435,150.00	7.04
4	688012	中微公司	8,366,955.33	6.98
5	688072	拓荆科技	7,975,742.59	6.66
6	01347	华虹宏力	6,365,766.06	5.31
6	688347	华虹宏力	1,544,092.57	1.29
7	688502	茂莱光学	6,984,560.92	5.83
8	300236	上海新阳	6,694,098.00	5.59
9	300757	罗博特科	6,505,871.00	5.43
10	603061	金海通	6,449,318.50	5.38
11	688041	海光信息	5,377,516.23	4.49

12	688361	中科飞测	5,290,050.04	4.42
13	688008	澜起科技	5,149,409.86	4.30
14	688082	盛美上海	5,112,368.32	4.27
15	002281	光迅科技	4,862,392.00	4.06
16	301421	波长光电	4,790,682.00	4.00
17	688313	仕佳光子	4,418,391.16	3.69
18	301338	凯格精机	4,386,372.20	3.66
19	00189	东岳集团	4,257,568.66	3.55
20	300502	新易盛	4,200,122.80	3.51
21	688019	安集科技	3,827,933.44	3.19
22	688766	普冉股份	3,623,554.39	3.02
23	300394	天孚通信	2,908,204.00	2.43
24	300750	宁德时代	2,849,808.00	2.38
25	688545	兴福电子	2,807,441.19	2.34
26	03986	兆易创新	1,939,393.61	1.62
26	603986	兆易创新	853,043.00	0.71
27	002837	英维克	2,682,688.00	2.24
28	002428	云南锗业	2,462,433.00	2.06

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	370,218,126.53
卖出股票收入（成交）总额	295,934,669.42

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	60,101,804.35	10.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	156,467,565.75	28.50
	其中：政策性金融债	156,467,565.75	28.50
4	企业债券	191,386,307.43	34.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,024,465.75	1.83
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	30,111,196.72	5.48
10	合计	448,091,340.00	81.62

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	260010.IB	26 附息国债 10	600,000	60,101,804.35	10.95
2	210410.IB	21 农发 10	400,000	44,384,712.33	8.08
3	245402.SH	26 兴业 06	400,000	40,034,310.14	7.29
3	244729.SH	26 华泰 G4	400,000	40,034,310.14	7.29
4	250430.IB	25 农发 30	300,000	30,571,652.05	5.57
5	2605644.IB	26 安徽债 50	300,000	30,111,196.72	5.48

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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行或其分支行的处罚。国家开发银行、中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	104,050.27
2	应收清算款	1,249,224.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,430,503.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,783,778.38

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	5,605,244.69	1.02	重大事项停牌

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
广发集汇债券 A	1,105	143,850.28	56,738,749.35	35.69%	102,215,813.88	64.31%
广发集汇债券 C	1,305	226,207.37	86,240,845.78	29.21%	208,959,766.87	70.79%
合计	2,410	188,446.13	142,979,595.13	31.48%	311,175,580.75	68.52%

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	广发集汇债券 A	1,922,905.01	1.2097%
	广发集汇债券 C	50,129.34	0.0170%
	合计	1,973,034.35	0.4344%

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	广发集汇债券 A	>100
	广发集汇债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发集汇债券 A	50~100
	广发集汇债券 C	0
	合计	50~100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C

基金合同生效日（2022 年 11 月 8 日）基金份额总额	845,947,558.19	455,605,558.94
本报告期期初基金份额总额	91,304,199.94	16,522,819.89
本报告期基金总申购份额	107,472,899.85	308,409,781.40
减：本报告期基金总赎回份额	39,822,536.56	29,731,988.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	158,954,563.23	295,200,612.65

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，无涉及本基金托管业务的诉讼。

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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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的基金托管业务履职不涉及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	
招商证券	2	374,900,934.98	56.28%	163,460.36	56.28%	减少 1 个
国泰海通	4	170,881,174.86	25.65%	74,504.19	25.65%	-
摩根大通证券(中国)	2	100,386,277.11	15.07%	43,768.76	15.07%	-
华福证券	2	8,876,036.40	1.33%	3,869.99	1.33%	-
中信证券	3	6,920,708.62	1.04%	3,017.48	1.04%	-
粤开证券	3	4,187,663.98	0.63%	1,825.80	0.63%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	3	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

中国银河	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
华源证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
国投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-

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
招商证券	20,305,933.97	12.47%	64,060,000.00	18.63%	-	-
国泰海通	-	-	170,300,000.00	49.52%	-	-
摩根大通证券(中国)	-	-	88,850,000.00	25.84%	-	-
华福证券	-	-	12,000,00	3.49%	-	-

			0.00			
中信证券	-	-	3,700,000.00	1.08%	-	-
粤开证券	-	-	5,000,000.00	1.45%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	142,595,395.90	87.53%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日

			期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 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
4	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
5	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
6	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260610	55,212,110.06	-	-	55,212,110.06	12.16%
	2	20260626-20260628	-	83,766,124.98	-	83,766,124.98	18.44%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护							

持有人利益。

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集汇债券型证券投资基金募集的文件
（二）《广发集汇债券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）《广发集汇债券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