

广发中证 800 指数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：财通证券股份有限公司

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。

基金托管人财通证券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	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49

7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	50
8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
9 开放式基金份额变动	52
10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	54
11 影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	广发中证 800 指数增强	
基金主代码	023562	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 5 月 15 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	财通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	59,036,809.55 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 800 指数增强 A	广发中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023562	023563
报告期末下属分级基金的份额总额	6,292,405.55 份	52,744,404.00 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%。本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，再基于数量化投资分析及基本面研究等方法对投资组合进行优化，以争取实现指数增强型的目标。具体策略包括：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 800 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	财通证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	项军	马坚岗
	联系电话	020-83936666	0571-85080360
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	cttg@ctsec.com
客户服务电话		95105828	95336
传真		020-34281105	0571-87830199
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼
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	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼
邮政编码		510308	310007
法定代表人		葛长伟	章启诚

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	广发中证 800 指数增强 A	广发中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	247,705.56	221,521.33
本期利润	217,733.28	448,391.06
加权平均基金份额本期利润	0.0565	0.0869
本期加权平均净值利润率	4.55%	7.02%
本期基金份额净值增长率	4.29%	4.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发中证 800 指数增强 A	广发中证 800 指数增强 C
期末可供分配利润	1,627,899.33	13,348,044.55
期末可供分配基金份额利润	0.2587	0.2531
期末基金资产净值	7,920,304.88	66,092,448.55
期末基金份额净值	1.2587	1.2531
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发中证 800 指数增强 A	广发中证 800 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	25.87%	25.31%

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

广发中证 800 指数增强 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	5.92%	1.06%	13.02%	1.27%	-7.10%	-0.21%
过去六个月	4.29%	1.01%	10.59%	1.18%	-6.30%	-0.17%
过去一年	22.38%	0.91%	31.40%	1.04%	-9.02%	-0.13%
自基金合同生效起至今	25.87%	0.87%	31.88%	1.00%	-6.01%	-0.13%

广发中证 800 指数增强 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	5.81%	1.06%	13.02%	1.27%	-7.21%	-0.21%
过去六个月	4.10%	1.01%	10.59%	1.18%	-6.49%	-0.17%
过去一年	21.90%	0.91%	31.40%	1.04%	-9.50%	-0.13%
自基金合同生效起至今	25.31%	0.87%	31.88%	1.00%	-6.57%	-0.13%

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 800 指数增强型证券投资基金

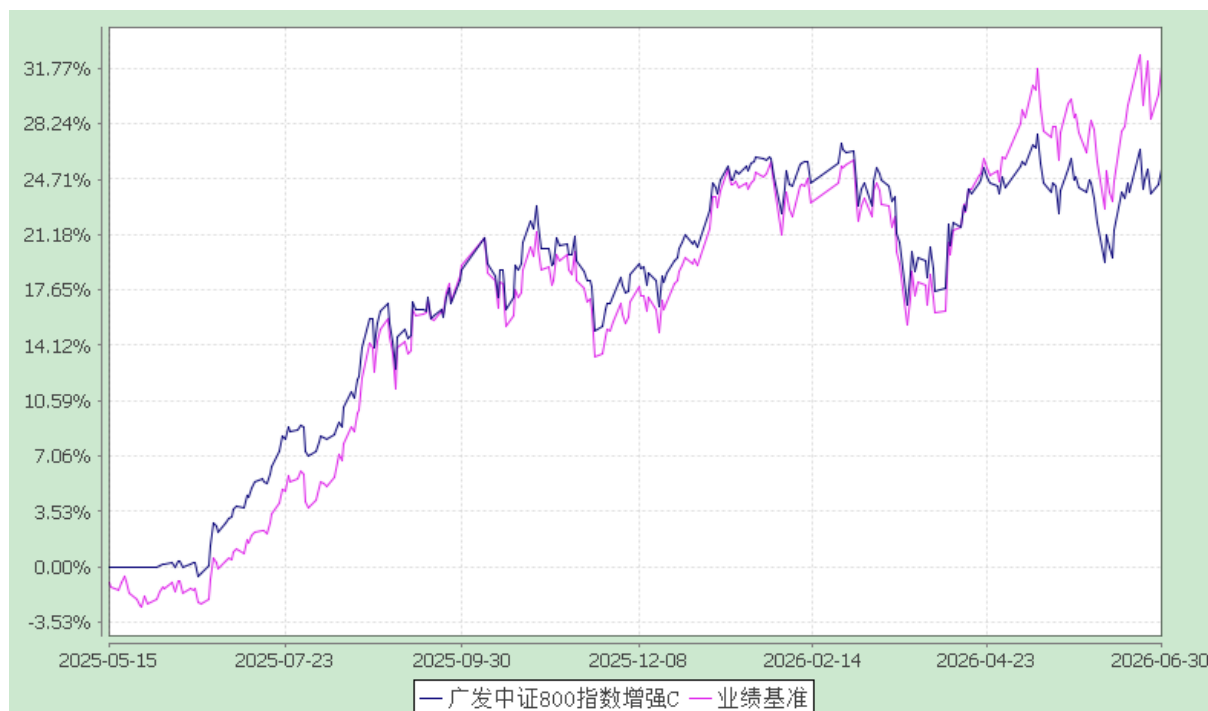
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2025 年 5 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发中证 800 指数增强 A



广发中证 800 指数增强 C



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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2025-05-15	-	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；广发智选启航混合型证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 500 指数量化增强型证券投资基金的基金经理；广发汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理				
--	--	--	--	--	--

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 年上半年市场整体上涨，沪深 300、中证 500、中证 1000、中证 2000、中证 800 指数分别上涨 7.55%、20.97%、15.99%、9.10%、11.12%。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 4.29%，C 类基金份额净值增长率为 4.10%，同期业绩比较基准收益率为 10.59%。

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

本报告期内，本基金于 2026 年 1 月 5 日至 2026 年 6 月 26 日出现了基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

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，财通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）严格遵守法律法规、基金合同，认真履行了应尽的义务，不存在损害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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人严格遵守相关法律法规和基金合同的规定对基金管理人的投资运作进行监督。在基金资产净值的计算、利润分配等方面，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人对本期报告中的财务数据均核对无误。

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 800 指数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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	12,128,318.52	1,002,746.97
结算备付金		23,025.75	22,864.59
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	48,211,005.23	5,331,966.91
其中：股票投资		48,211,005.23	5,331,966.91
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		13,822,025.36	5,367.20
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		74,184,374.86	6,362,945.67
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		150,855.82	494,583.35
应付管理人报酬		12,036.72	5,763.90
应付托管费		3,439.06	1,646.84
应付销售服务费		5,207.63	1,882.09
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	82.20	100,000.00
负债合计		171,621.43	603,876.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	59,036,809.55	4,775,946.53
未分配利润	6.4.7.9	14,975,943.88	983,122.96
净资产合计		74,012,753.43	5,759,069.49
负债和净资产总计		74,184,374.86	6,362,945.67

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发中证 800 指数增强 A 基金份额净值人民币 1.2587 元，基金份额总额 6,292,405.55 份；广发中证 800 指数增强 C 基金份额净值人民币 1.2531 元，基金份额总额 52,744,404.00 份；总份额总额 59,036,809.55 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 800 指数增强型证券投资基金

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 5 月 15 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		730,094.71	4,064,559.23
1. 利息收入		3,512.84	132,168.45
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,512.84	45,912.06

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		-	86,256.39
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		527,034.07	1,226,352.26
其中：股票投资收益	6.4.7.11	413,958.51	568,918.30
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	57,667.57
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	-	34,314.12
股利收益	6.4.7.17	113,075.56	565,452.27
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	196,897.45	2,705,968.83
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	2,650.35	69.69
减：二、营业总支出		63,970.37	290,690.44
1. 管理人报酬		39,580.19	155,671.36
2. 托管费		11,308.60	44,477.52
3. 销售服务费		12,999.38	69,669.43
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		-	125.83
8. 其他费用	6.4.7.21	82.20	20,746.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		666,124.34	3,773,868.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		666,124.34	3,773,868.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		666,124.34	3,773,868.79

注：本基金合同生效日为 2025 年 5 月 15 日，上年度可比期间不完整。

6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 800 指数增强型证券投资基金

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	4,775,946.53	983,122.96	5,759,069.49
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	4,775,946.53	983,122.96	5,759,069.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	54,260,863.02	13,992,820.92	68,253,683.94
（一）、综合收益总额	-	666,124.34	666,124.34
（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）	54,260,863.02	13,326,696.58	67,587,559.60
其中：1.基金申购款	68,865,679.61	16,922,685.64	85,788,365.25
2.基金赎回款	-14,604,816.59	-3,595,989.06	-18,200,805.65
（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	59,036,809.55	14,975,943.88	74,012,753.43
项目	上年度可比期间 2025 年 5 月 15 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	226,181,429.92	-	226,181,429.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-97,965,093.02	3,595,941.62	-94,369,151.40
（一）、综合收益总额	-	3,773,868.79	3,773,868.79
（二）、本期基金份额交易产生的	-97,965,093.02	-177,927.17	-98,143,020.19

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	695,984.65	905.09	696,889.74
2.基金赎回款	-98,661,077.67	-178,832.26	-98,839,909.93
（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	128,216,336.90	3,595,941.62	131,812,278.52

注：本基金合同生效日为 2025 年 5 月 15 日，上年度可比期间不完整。

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 800 指数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]298 号《关于准予广发中证 800 指数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 800 指数增强型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金于 2025 年 4 月 7 日至 2025 年 5 月 12 日止期间募集资金总额共计人民币 226,138,851.49 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 42,578.43 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 800 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 5 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 226,181,429.92 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，基金托管人为财通证券股份有限公司。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编

制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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	691,224.06
等于：本金	691,052.64
加：应计利息	171.42
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	11,437,094.46
等于：本金	11,437,017.43
加：应计利息	77.03
合计	12,128,318.52

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		47,709,069.58	-	48,211,005.23	501,935.65
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		47,709,069.58	-	48,211,005.23	501,935.65

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	-
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	82.20
合计	82.20

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发中证 800 指数增强 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	3,119,881.56	3,119,881.56
本期申购	6,090,530.32	6,090,530.32
本期赎回（以“-”号填列）	-2,918,006.33	-2,918,006.33
本期末	6,292,405.55	6,292,405.55

金额单位：人民币元

广发中证 800 指数增强 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	1,656,064.97	1,656,064.97
本期申购	62,775,149.29	62,775,149.29
本期赎回（以“-”号填列）	-11,686,810.26	-11,686,810.26
本期末	52,744,404.00	52,744,404.00

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

广发中证 800 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,316,439.37	-670,876.88	645,562.49
本期期初	1,316,439.37	-670,876.88	645,562.49
本期利润	247,705.56	-29,972.28	217,733.28
本期基金份额交易产生的变动数	1,550,949.30	-786,345.74	764,603.56
其中：基金申购款	2,943,874.15	-1,428,139.28	1,515,734.87
基金赎回款	-1,392,924.85	641,793.54	-751,131.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,115,094.23	-1,487,194.90	1,627,899.33

单位：人民币元

广发中证 800 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	692,906.97	-355,346.50	337,560.47
本期期初	692,906.97	-355,346.50	337,560.47
本期利润	221,521.33	226,869.73	448,391.06
本期基金份额交易产生的变动数	24,872,866.93	-12,310,773.91	12,562,093.02
其中：基金申购款	30,489,842.68	-15,082,891.91	15,406,950.77
基金赎回款	-5,616,975.75	2,772,118.00	-2,844,857.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,787,295.23	-12,439,250.68	13,348,044.55

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		2,842.43
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		492.77
结算备付金利息收入		161.16
其他		16.48

合计	3,512.84
----	----------

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	413,958.51
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	413,958.51

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	27,994,419.29
减：卖出股票成本总额	27,543,959.28
减：交易费用	36,501.50
买卖股票差价收入	413,958.51

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**

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1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	113,075.56
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	113,075.56

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	196,897.45
——股票投资	196,897.45
——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	196,897.45

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,170.98
基金转换费收入	1,479.37
合计	2,650.35

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	82.20
信息披露费	-
证券出借违约金	-

合计	82.20
----	-------

注：本基金本报告期内由基金管理人承担部分固定费用，具体情况详见 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明。

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
财通证券股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年5月15日（基金合同生效日） 至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券股份有限公司	98,220,519.44	100.00%	142,413,045.34	100.00%

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5月15日（基金合同生效日） 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
财通证券股份有限公司	-	-	82,293,169.12	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年5月15日（基金合同生效日） 至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例
财通证券股份有限公司	-	-	336,905,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	16,209.67	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年5月15日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	23,488.09	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1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年5月15日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	39,580.19	155,671.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,003.32	39,330.33
应支付基金管理人的净管理费	28,576.87	116,341.03

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5月15日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,308.60	44,477.52

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

约定年费率为 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 800 指数增 强 A	广发中证 800 指数增强 C	合计
广发基金管理有限公司	-	245.27	245.27
财通证券股份有限公司	-	2,312.66	2,312.66

司			
合计	-	2,557.93	2,557.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年5月15日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证800指数增强A	广发中证800指数增强C	合计
广发基金管理有限公司	-	13,741.96	13,741.96
财通证券股份有限公司	-	32.01	32.01
合计	-	13,773.97	13,773.97

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发中证 800 指数增强 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。

广发中证 800 指数增强 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5月15日（基金合同生效日）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
财通证券股份有限公司	11,437,094.46	492.77	5,294,607.34	6,379.00

注：本基金的上述银行存款由证券经纪商财通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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

自 2026 年 1 月 7 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金如涉及信息披露费、银行间账户维护费、审计费、持有人大会费等固定费用，均由管理人承担，不再从基金资产中列支。本基金本报告期内管理人承担的上述各类费用合计为人民币 40,754.00 元。

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
688759	必贝特-U	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	1,046.00	18,597.88	32,059.90	-

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。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、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	12,128,318.52	-	-	-	12,128,318.52
结算备付金	23,025.75	-	-	-	23,025.75
交易性金融资产	-	-	-	48,211,005.23	48,211,005.23
应收申购款	-	-	-	13,822,025.36	13,822,025.36
资产总计	12,151,344.27	-	-	62,033,030.59	74,184,374.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	150,855.82	150,855.82
应付管理人报酬	-	-	-	12,036.72	12,036.72
应付托管费	-	-	-	3,439.06	3,439.06
应付销售服务费	-	-	-	5,207.63	5,207.63
其他负债	-	-	-	82.20	82.20
负债总计	-	-	-	171,621.43	171,621.43
利率敏感度缺口	12,151,344.27	-	-	61,861,409.16	74,012,753.43
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	1,002,746.97	-	-	-	1,002,746.97
结算备付金	22,864.59	-	-	-	22,864.59
交易性金融资产	-	-	-	5,331,966.91	5,331,966.91
应收申购款	-	-	-	5,367.20	5,367.20
资产总计	1,025,611.56	-	-	5,337,334.11	6,362,945.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	494,583.35	494,583.35
应付管理人报酬	-	-	-	5,763.90	5,763.90
应付托管费	-	-	-	1,646.84	1,646.84
应付销售服务费	-	-	-	1,882.09	1,882.09
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	603,876.18	603,876.18
利率敏感度缺口	1,025,611.56	-	-	4,733,457.93	5,759,069.49

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	48,211,005.23	65.14	5,331,966.91	92.58
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	48,211,005.23	65.14	5,331,966.91	92.58

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%	2,755,632.73	287,648.15
	下降 5%	-2,755,632.73	-287,648.15

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	48,178,945.33
第二层次	-
第三层次	32,059.90
合计	48,211,005.23

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	48,211,005.23	64.99
	其中：股票	48,211,005.23	64.99

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	12,151,344.27	16.38
8	其他各项资产	13,822,025.36	18.63
9	合计	74,184,374.86	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	-	-
B	采矿业	1,892,082.16	2.56
C	制造业	27,547,023.62	37.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,759,816.00	2.38
E	建筑业	9,423.00	0.01
F	批发和零售业	50,344.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,141,591.00	1.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,811,054.11	2.45
J	金融业	5,853,928.00	7.91
K	房地产业	449,034.00	0.61
L	租赁和商务服务业	4,884.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	142,747.00	0.19

N	水利、环境和公共设施管理业	271,216.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	155,288.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,088,430.89	55.52

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	-	-
B	采矿业	244,260.00	0.33
C	制造业	4,670,915.90	6.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	265,662.00	0.36
E	建筑业	22,464.00	0.03
F	批发和零售业	240,171.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,176,007.44	1.59
J	金融业	228,092.00	0.31
K	房地产业	263,762.00	0.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,240.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,122,574.34	9.62

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	300308	中际旭创	1,600	2,032,000.00	2.75
2	300750	宁德时代	3,300	1,296,933.00	1.75
3	300502	新易盛	1,760	1,068,320.00	1.44
4	600519	贵州茅台	700	829,843.00	1.12
5	688256	寒武纪	400	638,220.00	0.86
6	601318	中国平安	12,100	577,654.00	0.78
7	603986	兆易创新	700	570,500.00	0.77
8	300408	三环集团	3,100	517,390.00	0.70
9	600030	中信证券	18,000	517,140.00	0.70
10	002475	立讯精密	7,000	492,800.00	0.67
11	601899	紫金矿业	19,200	482,688.00	0.65
12	000333	美的集团	6,000	453,180.00	0.61
13	002371	北方华创	500	442,280.00	0.60
14	600036	招商银行	12,300	436,650.00	0.59
15	600150	中国船舶	12,911	436,262.69	0.59
16	000338	潍柴动力	15,500	422,375.00	0.57
17	688012	中微公司	898	420,713.00	0.57
18	601398	工商银行	59,500	420,665.00	0.57
19	002916	深南电路	900	412,110.00	0.56
20	601688	华泰证券	18,400	379,408.00	0.51
21	601138	工业富联	5,100	367,965.00	0.50
22	601601	中国太保	12,700	362,204.00	0.49
23	000100	TCL 科技	62,100	361,422.00	0.49
24	000938	紫光股份	12,300	354,978.00	0.48
25	300661	圣邦股份	2,400	344,352.00	0.47
26	603799	华友钴业	6,900	332,994.00	0.45
27	000425	徐工机械	40,000	323,600.00	0.44
28	601766	中国中车	62,000	322,400.00	0.44
29	688002	睿创微纳	2,064	319,280.16	0.43
30	002738	中矿资源	5,400	318,546.00	0.43
31	605117	德业股份	3,000	318,540.00	0.43
32	601600	中国铝业	38,300	314,826.00	0.43
33	002384	东山精密	1,200	314,820.00	0.43

34	600482	中国动力	9,400	308,320.00	0.42
35	600601	方正科技	22,100	305,864.00	0.41
36	600489	中金黄金	16,900	305,045.00	0.41
37	000408	藏格矿业	4,400	305,008.00	0.41
38	000166	申万宏源	66,900	294,360.00	0.40
39	600989	宝丰能源	14,200	288,686.00	0.39
40	600309	万华化学	4,200	287,322.00	0.39
41	000807	云铝股份	12,800	283,392.00	0.38
42	002001	新和成	9,900	281,358.00	0.38
43	600887	伊利股份	11,700	280,332.00	0.38
44	003816	中国广核	71,600	279,956.00	0.38
45	002532	天山铝业	25,900	277,907.00	0.38
46	600674	川投能源	19,600	277,732.00	0.38
47	601058	赛轮轮胎	24,000	276,720.00	0.37
48	300432	富临精工	13,700	275,233.00	0.37
49	600426	华鲁恒升	11,500	275,080.00	0.37
50	002463	沪电股份	1,800	275,040.00	0.37
51	002841	视源股份	7,900	272,787.00	0.37
52	300919	中伟新材	6,200	271,250.00	0.37
53	002266	浙富控股	53,600	271,216.00	0.37
54	601211	国泰海通	14,900	271,180.00	0.37
55	002493	荣盛石化	25,200	270,900.00	0.37
56	601728	中国电信	52,100	270,399.00	0.37
57	002271	东方雨虹	22,400	265,888.00	0.36
58	600595	中孚实业	47,200	265,264.00	0.36
59	002465	海格通信	20,700	264,339.00	0.36
60	301606	绿联科技	4,300	262,386.00	0.35
61	600115	中国东航	68,500	260,985.00	0.35
62	002152	广电运通	27,800	260,764.00	0.35
63	603308	应流股份	4,300	259,720.00	0.35
64	600685	中船防务	10,200	259,488.00	0.35
65	002273	水晶光电	7,300	259,004.00	0.35
66	600926	杭州银行	17,900	258,655.00	0.35
67	002120	韵达股份	40,200	255,672.00	0.35
68	601288	农业银行	41,700	253,119.00	0.34
69	601608	中信重工	52,900	252,333.00	0.34
70	600233	圆通速递	16,000	252,000.00	0.34
71	600019	宝钢股份	46,200	250,866.00	0.34
72	000683	博源化工	43,500	250,560.00	0.34
73	001286	陕西能源	24,700	250,458.00	0.34
74	300073	当升科技	5,200	249,808.00	0.34
75	000975	山金国际	14,600	248,200.00	0.34
76	600919	江苏银行	22,900	246,862.00	0.33
77	601155	新城控股	24,000	246,240.00	0.33

78	002064	华峰化学	25,900	245,791.00	0.33
79	688692	达梦数据	1,000	244,290.00	0.33
80	300476	胜宏科技	700	242,501.00	0.33
81	000027	深圳能源	39,100	242,420.00	0.33
82	300059	东方财富	11,800	240,484.00	0.32
83	601328	交通银行	37,100	238,553.00	0.32
84	300857	协创数据	700	237,930.00	0.32
85	601939	建设银行	24,200	233,046.00	0.31
86	600801	华新建材	14,700	229,320.00	0.31
87	600028	中国石化	50,900	227,014.00	0.31
88	688472	阿特斯	20,489	221,690.98	0.30
89	002078	太阳纸业	17,700	221,073.00	0.30
90	002414	高德红外	16,500	218,790.00	0.30
91	603296	华勤技术	2,940	218,353.80	0.30
92	002594	比亚迪	2,700	215,190.00	0.29
93	601998	中信银行	30,900	214,137.00	0.29
94	002236	大华股份	12,900	212,721.00	0.29
95	301308	江波龙	300	211,140.00	0.29
96	601988	中国银行	36,800	210,496.00	0.28
97	600026	中远海能	11,700	209,898.00	0.28
98	600893	航发动力	5,400	207,036.00	0.28
99	600048	保利发展	43,800	202,794.00	0.27
100	000001	平安银行	19,900	199,995.00	0.27
101	600166	福田汽车	68,600	199,626.00	0.27
102	002402	和而泰	7,700	198,891.00	0.27
103	600999	招商证券	9,400	198,340.00	0.27
104	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.27
105	300115	长盈精密	6,900	192,786.00	0.26
106	002648	卫星化学	8,200	192,618.00	0.26
107	002008	大族激光	1,200	180,132.00	0.24
108	600183	生益科技	1,000	173,400.00	0.23
109	300628	亿联网络	5,100	172,482.00	0.23
110	601898	中煤能源	14,100	171,738.00	0.23
111	601857	中国石油	19,500	169,260.00	0.23
112	600900	长江电力	6,100	161,467.00	0.22
113	600875	东方电气	5,500	158,235.00	0.21
114	300015	爱尔眼科	18,800	155,288.00	0.21
115	002558	巨人网络	5,500	151,580.00	0.20
116	002415	海康威视	4,400	150,480.00	0.20
117	600886	国投电力	11,200	149,072.00	0.20
118	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.20
119	001389	广合科技	600	142,350.00	0.19
120	600025	华能水电	15,900	141,351.00	0.19
121	688041	海光信息	372	137,751.60	0.19

122	002025	航天电器	1,800	137,196.00	0.19
123	603259	药明康德	1,100	136,961.00	0.19
124	300604	长川科技	400	136,568.00	0.18
125	688347	华虹宏力	400	134,520.00	0.18
126	601088	中国神华	3,379	131,916.16	0.18
127	601985	中国核电	14,600	131,838.00	0.18
128	002517	恺英网络	8,100	131,625.00	0.18
129	688981	中芯国际	800	127,056.00	0.17
130	000725	京东方 A	14,400	124,992.00	0.17
131	688008	澜起科技	400	123,960.00	0.17
132	000301	东方盛虹	10,800	123,660.00	0.17
133	601872	招商轮船	6,800	119,476.00	0.16
134	300458	全志科技	2,900	114,434.00	0.15
135	688702	盛科通信-U	289	112,707.11	0.15
136	601166	兴业银行	6,700	110,952.00	0.15
137	688387	信科移动-U	5,276	104,675.84	0.14
138	300223	北京君正	400	99,560.00	0.13
139	600938	中国海油	3,500	95,025.00	0.13
140	600795	国电电力	19,700	91,999.00	0.12
141	002444	巨星科技	2,700	83,970.00	0.11
142	688469	芯联集成-U	6,875	72,943.75	0.10
143	601009	南京银行	6,300	62,307.00	0.08
144	000063	中兴通讯	1,600	57,904.00	0.08
145	600000	浦发银行	6,500	55,965.00	0.08
146	002683	广东宏大	1,900	55,651.00	0.08
147	002602	世纪华通	3,800	53,580.00	0.07
148	600346	恒力石化	3,000	53,130.00	0.07
149	603939	益丰药房	2,800	50,344.00	0.07
150	600050	中国联通	11,600	46,400.00	0.06
151	601111	中国国航	7,200	43,560.00	0.06
152	002600	领益智造	2,000	34,680.00	0.05
153	600809	山西汾酒	300	32,811.00	0.04
154	000708	中信特钢	2,200	27,764.00	0.04
155	600816	建元信托	10,700	26,108.00	0.04
156	601628	中国人寿	700	24,745.00	0.03
157	000883	湖北能源	5,500	23,760.00	0.03
158	601319	中国人保	3,000	20,280.00	0.03
159	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.02
160	600276	恒瑞医药	300	15,612.00	0.02
161	600176	中国巨石	200	14,576.00	0.02
162	301536	星辰科技	100	12,871.00	0.02
163	000703	恒逸石化	900	12,213.00	0.02
164	601360	三六零	1,100	9,559.00	0.01
165	603345	安井食品	100	8,019.00	0.01

166	601233	桐昆股份	300	6,495.00	0.01
167	000050	深天马 A	600	5,946.00	0.01
168	603225	新凤鸣	300	5,895.00	0.01
169	300759	康龙化成	200	5,786.00	0.01
170	600316	洪都航空	200	5,588.00	0.01
171	600372	中航机载	500	5,425.00	0.01
172	600011	华能国际	700	5,313.00	0.01
173	600535	天士力	400	5,292.00	0.01
174	000967	盈峰环境	500	5,265.00	0.01
175	601117	中国化学	700	5,145.00	0.01
176	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.01
177	000415	渤海租赁	1,200	4,884.00	0.01
178	600104	上汽集团	500	4,880.00	0.01
179	600741	华域汽车	300	4,656.00	0.01
180	600027	华电国际	1,000	4,450.00	0.01
181	600970	中材国际	600	4,278.00	0.01
182	600570	恒生电子	200	4,238.00	0.01
183	300450	先导智能	100	4,072.00	0.01
184	688349	三一重能	260	3,946.80	0.01
185	688223	晶科能源	800	3,800.00	0.01
186	000738	航发控制	200	3,658.00	0.00
187	600298	安琪酵母	100	3,620.00	0.00
188	603993	洛阳钼业	200	3,510.00	0.00
189	688599	天合光能	200	2,824.00	0.00
190	601225	陕西煤业	100	2,035.00	0.00
191	000009	中国宝安	100	623.00	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	601168	西部矿业	9,000	244,260.00	0.33
2	300098	高新兴	53,200	244,188.00	0.33
3	300006	莱美药业	47,300	242,649.00	0.33
4	300034	钢研高纳	14,100	241,674.00	0.33
5	601061	中信金属	22,300	240,171.00	0.32
6	300253	卫宁健康	35,500	238,915.00	0.32
7	000933	神火股份	11,100	235,320.00	0.32
8	600320	振华重工	56,900	234,997.00	0.32
9	000036	华联控股	53,400	233,358.00	0.32
10	601231	环旭电子	7,200	233,280.00	0.32
11	000553	安道麦 A	43,200	231,120.00	0.31
12	688173	希荻微	12,046	230,560.44	0.31

13	601700	风范股份	52,700	229,772.00	0.31
14	002396	星网锐捷	11,900	228,123.00	0.31
15	002948	青岛银行	44,900	228,092.00	0.31
16	601777	千里科技	27,900	227,664.00	0.31
17	300933	中辰股份	36,900	224,352.00	0.30
18	000949	新乡化纤	33,000	209,220.00	0.28
19	002284	亚太股份	22,000	208,780.00	0.28
20	300672	国科微	700	206,500.00	0.28
21	002752	昇兴股份	37,300	205,896.00	0.28
22	300168	万达信息	43,900	201,501.00	0.27
23	603228	景旺电子	2,500	181,025.00	0.24
24	301608	博实结	3,600	180,936.00	0.24
25	000680	山推股份	17,700	177,885.00	0.24
26	600418	江淮汽车	6,800	175,644.00	0.24
27	600167	联美控股	29,400	164,346.00	0.22
28	688536	思瑞浦	400	145,636.00	0.20
29	300206	理邦仪器	11,300	138,199.00	0.19
30	300323	华灿光电	6,100	124,440.00	0.17
31	001289	龙源电力	6,300	98,469.00	0.13
32	688025	杰普特	200	94,000.00	0.13
33	600271	航天信息	13,700	90,146.00	0.12
34	002643	万润股份	4,200	87,990.00	0.12
35	000045	深纺织 A	5,900	62,186.00	0.08
36	300213	佳讯飞鸿	8,400	50,904.00	0.07
37	301219	腾远钴业	900	49,320.00	0.07
38	002653	海思科	600	39,804.00	0.05
39	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.05
40	688759	必贝特-U	1,046	32,059.90	0.04
41	600266	城建发展	6,800	26,588.00	0.04
42	601068	中铝国际	5,200	22,464.00	0.03
43	600037	歌华有线	2,900	18,183.00	0.02
44	002379	宏桥控股	1,000	14,770.00	0.02
45	920101	志高机械	700	12,341.00	0.02
46	920018	宏远股份	780	11,388.00	0.02
47	603882	金域医学	500	11,240.00	0.02
48	002180	奔图科技	300	4,908.00	0.01
49	603901	永创智能	400	4,348.00	0.01
50	002204	大连重工	800	4,224.00	0.01
51	600523	贵航股份	400	4,220.00	0.01
52	601096	宏盛华源	900	3,906.00	0.01
53	600966	博汇纸业	800	3,824.00	0.01
54	000031	大悦城	1,800	3,816.00	0.01
55	300633	开立医疗	200	3,678.00	0.00
56	600718	东软集团	500	3,620.00	0.00

57	002953	日丰股份	400	3,488.00	0.00
58	301153	中科江南	200	3,258.00	0.00
59	002166	莱茵生物	500	3,140.00	0.00
60	002911	佛燃能源	300	2,847.00	0.00
61	600963	岳阳林纸	700	2,128.00	0.00
62	920056	能之光	100	1,773.00	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	300308	中际旭创	1,873,343.00	32.53
2	300750	宁德时代	1,413,983.00	24.55
3	300502	新易盛	878,213.00	15.25
4	601318	中国平安	778,304.00	13.51
5	600519	贵州茅台	749,881.00	13.02
6	601899	紫金矿业	653,572.00	11.35
7	600030	中信证券	633,066.30	10.99
8	000333	美的集团	595,971.00	10.35
9	002475	立讯精密	595,674.00	10.34
10	688256	寒武纪	591,208.00	10.27
11	601398	工商银行	584,055.00	10.14
12	600036	招商银行	555,721.00	9.65
13	600150	中国船舶	551,681.00	9.58
14	300408	三环集团	536,602.00	9.32
15	000338	潍柴动力	508,527.00	8.83
16	601688	华泰证券	493,912.00	8.58
17	603986	兆易创新	481,408.00	8.36
18	601600	中国铝业	466,663.00	8.10
19	603799	华友钴业	435,660.00	7.56
20	601766	中国中车	430,887.00	7.48
21	601728	中国电信	425,435.00	7.39
22	600601	方正科技	412,100.00	7.16
23	601058	赛轮轮胎	400,812.00	6.96
24	601601	中国太保	399,412.00	6.94
25	000408	藏格矿业	391,672.00	6.80
26	600887	伊利股份	388,738.00	6.75
27	601138	工业富联	388,000.00	6.74
28	002916	深南电路	387,363.00	6.73

29	605117	德业股份	384,322.00	6.67
30	688012	中微公司	379,974.00	6.60
31	000425	徐工机械	379,663.00	6.59
32	601328	交通银行	379,642.00	6.59
33	001286	陕西能源	379,083.00	6.58
34	000100	TCL 科技	375,568.00	6.52
35	600489	中金黄金	365,746.00	6.35
36	601155	新城控股	362,733.00	6.30
37	601211	国泰海通	361,019.00	6.27
38	600309	万华化学	360,506.00	6.26
39	600115	中国东航	353,073.00	6.13
40	000933	神火股份	347,950.00	6.04
41	600426	华鲁恒升	347,047.00	6.03
42	600919	江苏银行	346,600.00	6.02
43	601288	农业银行	346,057.00	6.01
44	301606	绿联科技	341,636.00	5.93
45	000938	紫光股份	341,585.00	5.93
46	000725	京东方 A	335,970.00	5.83
47	600048	保利发展	335,493.00	5.83
48	002532	天山铝业	334,332.00	5.81
49	002738	中矿资源	333,272.00	5.79
50	002465	海格通信	331,606.00	5.76
51	002493	荣盛石化	330,771.00	5.74
52	000807	云铝股份	329,725.00	5.73
53	601231	环旭电子	327,248.00	5.68
54	003816	中国广核	325,666.00	5.65
55	600801	华新建材	324,766.00	5.64
56	601939	建设银行	321,270.00	5.58
57	002371	北方华创	319,181.00	5.54
58	600418	江淮汽车	318,571.00	5.53
59	601857	中国石油	318,470.00	5.53
60	002841	视源股份	317,333.00	5.51
61	002064	华峰化学	316,354.00	5.49
62	600019	宝钢股份	316,190.00	5.49
63	000166	申万宏源	313,638.00	5.45
64	300661	圣邦股份	312,728.00	5.43
65	600595	中孚实业	310,461.00	5.39
66	600989	宝丰能源	310,272.00	5.39
67	600926	杭州银行	308,317.00	5.35
68	603296	华勤技术	307,990.00	5.35
69	002152	广电运通	307,674.00	5.34
70	000036	华联控股	304,994.00	5.30
71	601988	中国银行	303,715.00	5.27
72	601998	中信银行	303,002.00	5.26

73	601168	西部矿业	301,922.00	5.24
74	600685	中船防务	301,751.00	5.24
75	300098	高新兴	300,080.00	5.21
76	002078	太阳纸业	299,918.00	5.21
77	600028	中国石化	296,065.00	5.14
78	600674	川投能源	294,783.00	5.12
79	002415	海康威视	294,526.00	5.11
80	300919	中伟新材	293,284.00	5.09
81	601061	中信金属	293,002.00	5.09
82	002414	高德红外	292,493.00	5.08
83	688002	睿创微纳	292,471.36	5.08
84	300432	富临精工	290,596.00	5.05
85	600482	中国动力	290,469.00	5.04
86	002001	新和成	289,585.00	5.03
87	000683	博源化工	288,772.00	5.01
88	002271	东方雨虹	287,909.00	5.00
89	002384	东山精密	284,260.00	4.94
90	300253	卫宁健康	279,717.00	4.86
91	002463	沪电股份	279,121.00	4.85
92	000975	山金国际	273,908.00	4.76
93	601608	中信重工	273,206.00	4.74
94	600233	圆通速递	270,397.00	4.70
95	002266	浙富控股	270,007.00	4.69
96	002273	水晶光电	263,476.00	4.57
97	002594	比亚迪	259,194.00	4.50
98	601088	中国神华	257,125.00	4.46
99	002120	韵达股份	256,897.00	4.46
100	600320	振华重工	255,940.00	4.44
101	300073	当升科技	255,186.00	4.43
102	300034	钢研高纳	253,484.00	4.40
103	603308	应流股份	253,462.00	4.40
104	000027	深圳能源	252,049.00	4.38
105	000001	平安银行	251,404.00	4.37
106	300933	中辰股份	250,409.00	4.35
107	300059	东方财富	247,187.00	4.29
108	301358	湖南裕能	247,087.00	4.29
109	002948	青岛银行	246,916.00	4.29
110	688472	阿特斯	244,901.16	4.25
111	300168	万达信息	241,798.00	4.20
112	601777	千里科技	240,961.00	4.18
113	000553	安道麦 A	239,257.00	4.15
114	600183	生益科技	238,742.00	4.15
115	600893	航发动力	237,876.00	4.13
116	002008	大族激光	236,124.00	4.10

117	688692	达梦数据	234,576.00	4.07
118	600026	中远海能	234,573.00	4.07
119	601700	风范股份	233,859.00	4.06
120	601898	中煤能源	232,592.00	4.04
121	002284	亚太股份	231,978.00	4.03
122	600900	长江电力	226,328.00	3.93
123	300857	协创数据	225,944.00	3.92
124	002558	巨人网络	224,736.00	3.90
125	300006	莱美药业	221,588.00	3.85
126	300476	胜宏科技	220,956.00	3.84
127	002752	昇兴股份	220,294.00	3.83
128	002236	大华股份	218,095.00	3.79
129	002396	星网锐捷	217,242.00	3.77
130	000949	新乡化纤	217,223.00	3.77
131	600166	福田汽车	212,118.00	3.68
132	300672	国科微	205,715.00	3.57
133	002648	卫星化学	203,590.00	3.54
134	600886	国投电力	203,265.00	3.53
135	600999	招商证券	202,537.00	3.52
136	688173	希荻微	201,113.37	3.49
137	002517	恺英网络	198,969.00	3.45
138	600875	东方电气	195,484.00	3.39
139	603228	景旺电子	190,874.00	3.31
140	600346	恒力石化	187,145.00	3.25
141	601985	中国核电	187,025.00	3.25
142	301608	博实结	182,342.00	3.17
143	002402	和而泰	182,132.00	3.16
144	002027	分众传媒	179,797.00	3.12
145	000301	东方盛虹	178,822.00	3.11
146	300115	长盈精密	178,525.00	3.10
147	000680	山推股份	175,466.00	3.05
148	601117	中国化学	174,959.00	3.04
149	301308	江波龙	173,595.00	3.01
150	600000	浦发银行	171,959.00	2.99
151	300015	爱尔眼科	171,348.00	2.98
152	600795	国电电力	170,390.00	2.96
153	300628	亿联网络	168,693.00	2.93
154	300206	理邦仪器	167,518.00	2.91
155	601166	兴业银行	167,252.00	2.90
156	603259	药明康德	166,192.00	2.89
157	600809	山西汾酒	164,496.00	2.86
158	600025	华能水电	164,142.00	2.85
159	600167	联美控股	163,913.00	2.85
160	601009	南京银行	147,216.00	2.56

161	600970	中材国际	145,525.00	2.53
162	002392	北京利尔	142,133.00	2.47
163	000063	中兴通讯	141,571.00	2.46
164	688469	芯联集成-U	138,421.48	2.40
165	301536	星宸科技	137,673.00	2.39
166	601872	招商轮船	136,322.00	2.37
167	600372	中航机载	135,497.00	2.35
168	002497	雅化集团	134,671.00	2.34
169	688536	思瑞浦	133,760.00	2.32
170	688981	中芯国际	132,420.00	2.30
171	300450	先导智能	130,147.00	2.26
172	300759	康龙化成	128,844.00	2.24
173	600011	华能国际	128,548.00	2.23
174	002436	兴森科技	127,371.00	2.21
175	688521	芯原股份	125,092.00	2.17
176	300369	绿盟科技	121,647.00	2.11
177	001389	广合科技	121,132.00	2.10
178	300999	金龙鱼	119,998.00	2.08
179	000792	盐湖股份	118,373.00	2.06
180	300271	华宇软件	118,134.00	2.05
181	002025	航天电器	117,544.00	2.04
182	000519	中兵红箭	116,683.00	2.03
183	601336	新华保险	116,662.00	2.03

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	300750	宁德时代	269,893.00	4.69
2	300308	中际旭创	268,607.00	4.66
3	000725	京东方 A	252,481.00	4.38
4	601318	中国平安	240,712.00	4.18
5	601899	紫金矿业	207,185.00	3.60
6	601117	中国化学	204,503.00	3.55
7	000333	美的集团	196,430.00	3.41
8	601398	工商银行	189,640.00	3.29
9	002415	海康威视	182,535.00	3.17
10	601857	中国石油	181,125.00	3.15
11	002027	分众传媒	179,226.00	3.11

12	002436	兴森科技	177,483.00	3.08
13	002475	立讯精密	171,475.00	2.98
14	600011	华能国际	171,284.00	2.97
15	601728	中国电信	171,140.00	2.97
16	600036	招商银行	167,988.00	2.92
17	601328	交通银行	163,702.00	2.84
18	301536	星宸科技	154,950.00	2.69
19	603296	华勤技术	154,321.00	2.68
20	600030	中信证券	153,069.00	2.66
21	601600	中国铝业	150,394.00	2.61
22	600346	恒力石化	149,043.00	2.59
23	002392	北京利尔	148,606.00	2.58
24	300999	金龙鱼	145,909.00	2.53
25	601336	新华保险	145,245.00	2.52
26	000792	盐湖股份	144,716.00	2.51
27	600601	方正科技	139,963.00	2.43
28	002008	大族激光	139,649.00	2.42
29	002497	雅化集团	138,379.00	2.40
30	601088	中国神华	137,478.00	2.39
31	300759	康龙化成	137,289.00	2.38
32	600970	中材国际	136,499.00	2.37
33	600150	中国船舶	134,532.00	2.34
34	601688	华泰证券	134,417.00	2.33
35	600887	伊利股份	134,044.00	2.33
36	001286	陕西能源	133,230.00	2.31
37	600900	长江电力	131,597.00	2.29
38	601211	国泰海通	130,330.00	2.26
39	600372	中航机载	129,550.00	2.25
40	300450	先导智能	127,524.00	2.21
41	600690	海尔智家	127,338.00	2.21
42	301606	绿联科技	125,435.00	2.18
43	600104	上汽集团	124,914.00	2.17
44	600000	浦发银行	124,769.00	2.17
45	000519	中兵红箭	122,179.00	2.12
46	601939	建设银行	121,906.00	2.12
47	300219	鸿利智汇	120,902.00	2.10
48	600919	江苏银行	119,397.00	2.07
49	600418	江淮汽车	118,714.00	2.06
50	300274	阳光电源	117,287.00	2.04
51	300373	扬杰科技	116,618.00	2.02
52	600361	创新新材	116,491.00	2.02
53	300408	三环集团	115,813.00	2.01
54	600809	山西汾酒	115,679.00	2.01
55	000338	潍柴动力	115,357.00	2.00

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	70,226,100.15
卖出股票收入（成交）总额	27,994,419.29

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,822,025.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,822,025.36

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 800 指数增强 A	186	33,830.14	0.00	0.00%	6,292,405.55	100.00%
广发中证 800 指数增强 C	727	72,550.76	34,058,844.15	64.57%	18,685,559.85	35.43%
合计	913	64,662.44	34,058,844.15	57.69%	24,977,965.40	42.31%

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 800 指数增强 A	0.00	0.0000%
	广发中证 800 指数增强 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	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 800 指数增强 A	0
	广发中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 800 指数增强 A	0
	广发中证 800 指数增强 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 800 指数增强 A	广发中证 800 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 5 月 15 日）基金份额总额	60,078,580.48	166,102,849.44
本报告期期初基金份额总额	3,119,881.56	1,656,064.97
本报告期基金总申购份额	6,090,530.32	62,775,149.29
减：本报告期基金总赎回份额	2,918,006.33	11,686,810.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,292,405.55	52,744,404.00

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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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	
财通证券	3	98,220,519.44	100.00%	16,209.67	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财通证券作为证券经纪商，证券经纪商财通证券与基金管理人不存在关联方关系。

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
财通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20260513-20260526,20260601-20260608	-	2,367,984.84	-	2,367,984.84	4.01%
	2	20260626-20260628	-	7,978,299.03	-	7,978,299.03	13.51%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自 2026 年 1 月 7 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金如涉及信息披露费、银行间账户维护费、审计费、持有人大会费等固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

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 800 指数增强型证券投资基金注册募集的文件
- （二）《广发中证 800 指数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 800 指数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