

广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

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，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
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	12
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	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	65

8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
9 开放式基金份额变动	66
10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	69
11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	71

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发量化多因子混合
基金主代码	005225
交易代码	005225
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 21 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	442,418,563.91 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过量化模型构建股票组合，力争实现超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观环境、政策因素、资金供求因素、证券市场基本面等角度进行综合分析，判断各类资产的市场趋势和预期风险收益，在严格控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	王小飞
	联系电话	020-83936666	021-60637103
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828	021-60637228
传真		020-34281105	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道	北京市西城区闹市口大街1号

	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	院1号楼
邮政编码	510308	100033
法定代表人	葛长伟	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	59,176,258.53
本期利润	85,815,814.88
加权平均基金份额本期利润	0.4047
本期加权平均净值利润率	23.59%
本期基金份额净值增长率	23.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	340,089,696.09
期末可供分配基金份额利润	0.7687
期末基金资产净值	836,528,707.76
期末基金份额净值	1.8908
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	89.08%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

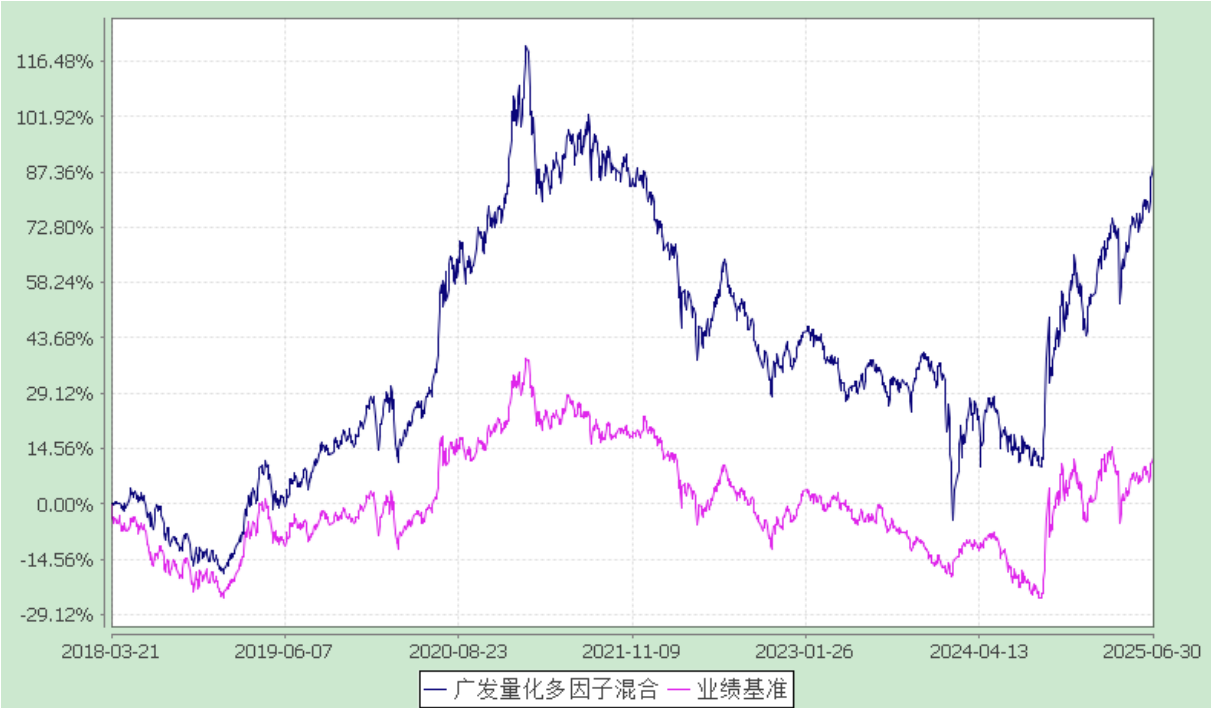
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	8.67%	0.92%	5.71%	1.00%	2.96%	-0.08%
过去三个月	11.38%	1.78%	4.25%	1.90%	7.13%	-0.12%
过去六个月	23.20%	1.52%	10.26%	1.71%	12.94%	-0.19%
过去一年	62.41%	1.83%	35.04%	1.98%	27.37%	-0.15%
过去三年	15.98%	1.57%	2.00%	1.35%	13.98%	0.22%
自基金合同生效起至今	89.08%	1.41%	12.23%	1.26%	76.85%	0.15%

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

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

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

广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018 年 3 月 21 日至 2025 年 6 月 30 日)



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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易威	本基金的基金经理；广发对冲套利定期开	2023-07-06	-	12 年	易威先生,中国籍,应用统计硕士,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中

	放混合型发起式证券投资基金的基金经理；广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理				央交易部股票交易员、量化投资部量化研究员、量化投资部投资经理。
李育鑫	本基金的基金经理；广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理；广发智选启航混合型证券投资基金的基金经理	2023-10-23	-	6 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。

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 28 次，均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，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

2025 年上半年，权益市场整体上涨，其中沪深 300、中证 500、中证 1000 与中证 2000 指数分别上涨 0.03%、3.31%、6.69% 与 15.24%，小市值风格表现优于大市值风格。按照申万一级行业分类，有色金属、银行、国防军工和传媒等行业涨幅较大，超过 10%，而煤炭、食品饮料和房地产等行业表现欠佳，跌幅超过 5%。

期间，本基金根据数据和模型进行决策，避免人为情绪、偏见和主观判断的干扰。本基金持股和行业配置的分散度均较高，风格上与比较基准保持接近，整体投资风格偏向小盘平衡型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 23.20%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%。

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，随着市场风险偏好回暖，权益资产的关注度将持续提升，而盈利质量的改善将会是市场的关注焦点。在未来的产品运作中，本基金将继续对多个量化模型进行均衡配置，争取获得长期稳定的超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	24,849,236.40	4,862,548.54
结算备付金		6,950,267.85	628,163.50
存出保证金		1,706,449.06	13,073.67
交易性金融资产	6.4.7.2	785,249,202.44	102,753,639.30
其中：股票投资		767,481,751.02	99,514,647.27

基金投资		-	-
债券投资		17,767,451.42	3,238,992.03
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		12,457,423.97	-
应收股利		-	-
应收申购款		34,127,545.11	421,771.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		865,340,124.83	108,679,196.35
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		19,664,136.64	1,821,053.01
应付赎回款		7,285,565.95	285,947.68
应付管理人报酬		559,425.77	77,862.06
应付托管费		111,885.17	15,572.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,638.27	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,184,765.27	261,324.96
负债合计		28,811,417.07	2,461,760.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	442,418,563.91	69,205,099.59
未分配利润	6.4.7.9	394,110,143.85	37,012,336.67
净资产合计		836,528,707.76	106,217,436.26
负债和净资产总计		865,340,124.83	108,679,196.35

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.8908 元，基金份额总额 442,418,563.91 份。

6.2 利润表

会计主体：广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		88,007,063.94	-12,571,458.60
1.利息收入		67,334.33	6,604.90
其中：存款利息收入	6.4.7.10	64,189.66	5,662.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,144.67	941.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		60,457,566.24	-7,599,717.42
其中：股票投资收益	6.4.7.11	56,345,615.19	-7,989,426.65
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	35,453.07	39,943.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	218,320.46	-126,794.71
股利收益	6.4.7.17	3,858,177.52	476,560.04
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	26,639,556.35	-5,144,725.60
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	842,607.02	166,379.52
减：二、营业总支出		2,191,249.06	468,685.84
1. 管理人报酬		1,762,029.15	330,277.79
2. 托管费		352,405.82	66,055.47
3. 销售服务费		-	-
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		797.17	-
8. 其他费用	6.4.7.21	76,016.92	72,352.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		85,815,814.88	-13,040,144.44

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,815,814.88	-13,040,144.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		85,815,814.88	-13,040,144.44

6.3 净资产变动表

会计主体：广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	69,205,099.59	37,012,336.67	106,217,436.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	69,205,099.59	37,012,336.67	106,217,436.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	373,213,464.32	357,097,807.18	730,311,271.50
（一）、综合收益总额	-	85,815,814.88	85,815,814.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	373,213,464.32	271,281,992.30	644,495,456.62
其中：1. 基金申购款	475,061,326.90	343,901,924.36	818,963,251.26
2. 基金赎回款	-101,847,862.58	-72,619,932.06	-174,467,794.64
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	442,418,563.91	394,110,143.85	836,528,707.76
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	59,440,895.38	21,468,102.56	80,908,997.94
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	59,440,895.38	21,468,102.56	80,908,997.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,677,429.65	-13,132,079.68	-21,809,509.33
（一）、综合收益总额	-	-13,040,144.44	-13,040,144.44
（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）	-8,677,429.65	-91,935.24	-8,769,364.89
其中：1.基金申购款	22,433,048.01	5,317,863.71	27,750,911.72
2.基金赎回款	-31,110,477.66	-5,409,798.95	-36,520,276.61
（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	50,763,465.73	8,336,022.88	59,099,488.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可（2017）1514 号《关于准予广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 2 月 12 日向社会公开发行募集并于 2018 年 3 月 21 日正式成立。

本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《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》、《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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 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

（1）印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税

实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据国税发明电[2002]47 号《黄金交易增值税征收管理办法》，基金买卖黄金现货实盘合约及黄金现货延期交收合约未发生实物交割的，免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、

非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

(3) 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	24,849,236.40
等于：本金	24,844,980.53
加：应计利息	4,255.87
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	24,849,236.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		744,811,850.95	-	767,481,751.02	22,669,900.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,696,915.00	65,351.42	17,767,451.42	5,185.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,696,915.00	65,351.42	17,767,451.42	5,185.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		762,508,765.95	65,351.42	785,249,202.44	22,675,085.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,962,880.00	-	-	-
其中：股指期货投资	11,962,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,962,880.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2509	IM2509	10.00	12,311,200.00	348,320.00
合计	-	-	-	348,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	348,320.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为国债/股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,414.72
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,096,974.91
其中：交易所市场	1,096,974.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,375.64
合计	1,184,765.27

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,205,099.59	69,205,099.59

本期申购	475,061,326.90	475,061,326.90
本期赎回（以“-”号填列）	-101,847,862.58	-101,847,862.58
本期末	442,418,563.91	442,418,563.91

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,566,598.16	445,738.51	37,012,336.67
本期期初	36,566,598.16	445,738.51	37,012,336.67
本期利润	59,176,258.53	26,639,556.35	85,815,814.88
本期基金份额交易产生的变动数	244,346,839.40	26,935,152.90	271,281,992.30
其中：基金申购款	312,229,872.45	31,672,051.91	343,901,924.36
基金赎回款	-67,883,033.05	-4,736,899.01	-72,619,932.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	340,089,696.09	54,020,447.76	394,110,143.85

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,302.70
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	13,001.31
其他	12,885.65
合计	64,189.66

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	56,345,615.19
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	56,345,615.19

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	1,432,399,201.24
减：卖出股票成本总额	1,373,613,450.31
减：交易费用	2,440,135.74
买卖股票差价收入	56,345,615.19

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	39,873.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,420.19
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	35,453.07

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,182,532.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,108,317.80
减：应计利息总额	78,635.00
减：交易费用	0.10
买卖债券差价收入	-4,420.19

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	218,320.46

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,858,177.52
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	3,858,177.52

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	26,291,236.35
——股票投资	26,288,185.55
——债券投资	3,050.80
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	348,320.00
——权证投资	-
——股指期货投资	348,320.00
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	26,639,556.35

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	718,985.26
基金转换费收入	123,621.76
合计	842,607.02

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 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

审计费用	15,868.27
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	641.28
合计	76,016.92

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 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的子公司

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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	561,320,746.28	16.28%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024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	16,530,840.97	79.52%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	23,828,000.00	85.63%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	244,735.87	16.28%	244,735.87	22.31%
关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-

注：1、本基金对该类交易的佣金的计算方式是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、2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资

研究成果和市场信息服务；

4、自 2024 年 7 月 1 日起，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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,762,029.15	330,277.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	409,558.34	33,950.56
应支付基金管理人的净管理费	1,352,470.81	296,327.23

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

约定年费率为 1.00%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	352,405.82	66,055.47

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%。

6.4.10.3 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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
报告期初持有的基金份额	22,434,938.68	22,434,938.68
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	22,434,938.68	22,434,938.68
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.07%	44.20%

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

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	24,849,236.40	38,302.70	1,279,462.19	2,341.96

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536.00	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内(含)	新股流通受限	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205.00	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通	93.50	90.66	58.00	5,423.00	5,258.28	-

				受限						
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-

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 2025 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

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
600962	国投中鲁	2025-06-23	重大事项停牌	13.43	2025-07-07	14.77	19,600.00	282,070.00	263,228.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 2025 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 2025 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	17,767,451.42	2,729,464.93
合计	17,767,451.42	2,729,464.93

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	509,527.10
合计	-	509,527.10

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	24,849,236.40	-	-	-	24,849,236.40
结算备付金	6,950,267.85	-	-	-	6,950,267.85
存出保证金	1,706,449.06	-	-	-	1,706,449.06
交易性金融资产	17,767,451.42	-	-	767,481,751.02	785,249,202.44
应收清算款	-	-	-	12,457,423.97	12,457,423.97
应收申购款	-	-	-	34,127,545.11	34,127,545.11
资产总计	51,273,404.73	-	-	814,066,720.10	865,340,124.83
负债					
应付清算款	-	-	-	19,664,136.64	19,664,136.64
应付赎回款	-	-	-	7,285,565.95	7,285,565.95
应付管理人报酬	-	-	-	559,425.77	559,425.77
应付托管费	-	-	-	111,885.17	111,885.17
应交税费	-	-	-	5,638.27	5,638.27
其他负债	-	-	-	1,184,765.27	1,184,765.27
负债总计	-	-	-	28,811,417.07	28,811,417.07

利率敏感度缺口	51,273,404.73	-	-	785,255,303.03	836,528,707.76
上年度末 2024 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	4,862,548.54	-	-	-	4,862,548.54
结算备付金	628,163.50	-	-	-	628,163.50
存出保证金	13,073.67	-	-	-	13,073.67
交易性金融资产	3,238,992.03	-	-	99,514,647.27	102,753,639.30
应收申购款	-	-	-	421,771.34	421,771.34
资产总计	8,742,777.74	-	-	99,936,418.61	108,679,196.35
负债					
应付清算款	-	-	-	1,821,053.01	1,821,053.01
应付赎回款	-	-	-	285,947.68	285,947.68
应付管理人报酬	-	-	-	77,862.06	77,862.06
应付托管费	-	-	-	15,572.38	15,572.38
其他负债	-	-	-	261,324.96	261,324.96
负债总计	-	-	-	2,461,760.09	2,461,760.09
利率敏感度缺口	8,742,777.74	-	-	97,474,658.52	106,217,436.26

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-31,959.81	-3,199.85
	市场利率下降 25 个基点	32,082.85	3,206.88

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	767,481,751.02	91.75	99,514,647.27	93.69
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	767,481,751.02	91.75	99,514,647.27	93.69

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	上升 5%	38,866,980.11	4,476,152.34
	下降 5%	-38,866,980.11	-4,476,152.34

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	767,072,833.11
第二层次	18,046,064.96
第三层次	130,304.37
合计	785,249,202.44

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	767,481,751.02	88.69
	其中：股票	767,481,751.02	88.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,767,451.42	2.05
	其中：债券	17,767,451.42	2.05
	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	31,799,504.25	3.67
8	其他各项资产	48,291,418.14	5.58
9	合计	865,340,124.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,883,601.00	0.70
B	采矿业	8,817,241.00	1.05
C	制造业	501,899,534.82	60.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,007,922.00	3.23
E	建筑业	5,348,318.00	0.64
F	批发和零售业	37,538,807.30	4.49
G	交通运输、仓储和邮政业	12,784,825.00	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	98,222,427.60	11.74
J	金融业	9,031,954.00	1.08
K	房地产业	5,778,140.00	0.69
L	租赁和商务服务业	14,236,896.00	1.70
M	科学研究和技术服务业	5,184,118.50	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	7,372,963.00	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,870,140.00	0.22
Q	卫生和社会工作	6,112,000.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	20,392,862.80	2.44

S	综合	-	-
	合计	767,481,751.02	91.75

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002587	奥拓电子	1,186,500	7,652,925.00	0.91
2	300017	网宿科技	695,800	7,458,976.00	0.89
3	603267	鸿远电子	146,600	7,369,582.00	0.88
4	002655	共达电声	554,300	7,183,728.00	0.86
5	300369	绿盟科技	922,900	7,170,933.00	0.86
6	300081	恒信东方	954,500	6,757,860.00	0.81
7	002455	百川股份	903,300	6,756,684.00	0.81
8	002296	辉煌科技	601,600	6,707,840.00	0.80
9	002139	拓邦股份	465,700	6,431,317.00	0.77
10	603466	风语筑	632,700	6,383,943.00	0.76
11	601116	三江购物	586,100	6,382,629.00	0.76
12	603901	永创智能	601,900	6,344,026.00	0.76
13	002373	千方科技	679,500	6,319,350.00	0.76
14	301060	兰卫医学	650,300	6,275,395.00	0.75
15	002905	金逸影视	653,260	6,062,252.80	0.72
16	300317	珈伟新能	1,448,100	5,995,134.00	0.72
17	002454	松芝股份	762,500	5,886,500.00	0.70
18	000100	TCL 科技	1,348,000	5,836,840.00	0.70
19	000059	华锦股份	1,076,500	5,802,335.00	0.69
20	002695	煌上煌	616,300	5,793,220.00	0.69
21	002206	海利得	1,119,806	5,722,208.66	0.68
22	002284	亚太股份	515,400	5,695,170.00	0.68
23	688512	慧智微-U	492,600	5,374,266.00	0.64
24	300006	莱美药业	1,392,400	5,221,500.00	0.62
25	300358	楚天科技	642,900	5,014,620.00	0.60
26	300365	恒华科技	751,200	4,950,408.00	0.59
27	300994	久祺股份	315,300	4,931,292.00	0.59
28	600163	中闽能源	959,200	4,911,104.00	0.59
29	301069	凯盛新材	303,500	4,889,385.00	0.58
30	601233	桐昆股份	458,900	4,864,340.00	0.58
31	600704	物产中大	922,200	4,859,994.00	0.58

32	300615	欣天科技	363,100	4,854,647.00	0.58
33	600728	佳都科技	887,500	4,836,875.00	0.58
34	300232	洲明科技	664,300	4,809,532.00	0.57
35	300395	菲利华	94,000	4,803,400.00	0.57
36	002953	日丰股份	461,900	4,794,522.00	0.57
37	300401	花园生物	313,300	4,765,293.00	0.57
38	002414	高德红外	456,900	4,683,225.00	0.56
39	002434	万里扬	633,000	4,639,890.00	0.55
40	600176	中国巨石	402,500	4,588,500.00	0.55
41	002344	海宁皮城	1,053,100	4,570,454.00	0.55
42	688280	精进电动-UW	626,400	4,553,928.00	0.54
43	600429	三元股份	997,900	4,500,529.00	0.54
44	300539	横河精密	327,100	4,477,999.00	0.54
45	002782	可立克	335,200	4,350,896.00	0.52
46	300667	必创科技	274,600	4,335,934.00	0.52
47	300231	银信科技	346,600	4,266,646.00	0.51
48	301239	普瑞眼科	108,800	4,264,960.00	0.51
49	002795	永和智控	821,300	4,262,547.00	0.51
50	601117	中国化学	547,400	4,198,558.00	0.50
51	300168	万达信息	544,100	4,173,247.00	0.50
52	600682	南京新百	612,500	4,116,000.00	0.49
53	002446	盛路通信	557,400	4,113,612.00	0.49
54	600288	大恒科技	398,700	4,098,636.00	0.49
55	002121	科陆电子	812,000	4,060,000.00	0.49
56	601991	大唐发电	1,280,400	4,058,868.00	0.49
57	301419	阿莱德	147,000	4,057,200.00	0.49
58	300320	海达股份	406,100	4,036,634.00	0.48
59	603717	天域生物	555,800	4,029,550.00	0.48
60	600125	铁龙物流	707,800	4,006,148.00	0.48
61	000551	创元科技	303,700	3,902,545.00	0.47
62	002893	京能热力	359,600	3,844,124.00	0.46
63	000803	山高环能	620,300	3,821,048.00	0.46
64	603936	博敏电子	404,100	3,810,663.00	0.46
65	300634	彩讯股份	139,300	3,775,030.00	0.45
66	301232	飞沃科技	121,600	3,736,768.00	0.45
67	600483	福能股份	382,700	3,689,228.00	0.44
68	002419	天虹股份	672,700	3,605,672.00	0.43
69	301161	唯万密封	156,100	3,541,909.00	0.42
70	002380	科远智慧	143,500	3,508,575.00	0.42
71	300762	上海瀚讯	153,800	3,480,494.00	0.42
72	002215	诺普信	330,900	3,418,197.00	0.41
73	688173	希荻微	247,400	3,379,484.00	0.40
74	300571	平治信息	105,300	3,350,646.00	0.40
75	002706	良信股份	370,700	3,302,937.00	0.39

76	600643	爱建集团	443,300	3,289,286.00	0.39
77	300214	日科化学	479,900	3,258,521.00	0.39
78	002054	德美化工	472,800	3,252,864.00	0.39
79	600179	安通控股	1,176,800	3,247,968.00	0.39
80	002910	庄园牧场	342,100	3,222,582.00	0.39
81	300041	回天新材	338,500	3,188,670.00	0.38
82	601898	中煤能源	291,000	3,183,540.00	0.38
83	300420	五洋自控	919,000	3,161,360.00	0.38
84	300560	中富通	229,500	3,100,545.00	0.37
85	002036	联创电子	285,100	3,081,931.00	0.37
86	002030	达安基因	508,300	3,075,215.00	0.37
87	600664	哈药股份	835,100	3,073,168.00	0.37
88	000715	中兴商业	536,010	3,071,337.30	0.37
89	000906	浙商中拓	481,500	3,067,155.00	0.37
90	603225	新凤鸣	287,400	3,060,810.00	0.37
91	301298	东利机械	183,900	3,038,028.00	0.36
92	603313	梦百合	357,300	3,037,050.00	0.36
93	688365	光云科技	196,800	2,995,296.00	0.36
94	002283	天润工业	497,900	2,967,484.00	0.35
95	300155	安居宝	590,000	2,961,800.00	0.35
96	603085	天成自控	254,700	2,931,597.00	0.35
97	600662	外服控股	562,500	2,874,375.00	0.34
98	603113	金能科技	413,800	2,867,634.00	0.34
99	300593	新雷能	210,800	2,824,720.00	0.34
100	603968	醋化股份	248,000	2,819,760.00	0.34
101	600531	豫光金铅	362,300	2,804,202.00	0.34
102	300496	中科创达	49,000	2,803,780.00	0.34
103	002225	濮耐股份	554,600	2,745,270.00	0.33
104	600990	四创电子	97,300	2,728,292.00	0.33
105	002249	大洋电机	412,300	2,712,934.00	0.32
106	300776	帝尔激光	50,120	2,666,885.20	0.32
107	002350	北京科锐	385,000	2,641,100.00	0.32
108	002209	达意隆	207,200	2,600,360.00	0.31
109	002169	智光电气	398,300	2,577,001.00	0.31
110	600063	皖维高新	542,800	2,486,024.00	0.30
111	000975	山金国际	129,200	2,447,048.00	0.29
112	300873	海晨股份	120,900	2,440,971.00	0.29
113	301210	金杨股份	56,900	2,363,626.00	0.28
114	601311	骆驼股份	261,100	2,357,733.00	0.28
115	600778	友好集团	368,900	2,353,582.00	0.28
116	300098	高新兴	436,400	2,269,280.00	0.27
117	300160	秀强股份	403,500	2,267,670.00	0.27
118	300133	华策影视	296,600	2,227,466.00	0.27
119	000534	万泽股份	144,500	2,155,940.00	0.26

120	603618	杭电股份	351,400	2,143,540.00	0.26
121	301248	杰创智能	85,700	2,132,216.00	0.25
122	000156	华数传媒	267,700	2,125,538.00	0.25
123	300421	力星股份	139,600	2,091,208.00	0.25
124	002739	万达电影	182,700	2,088,261.00	0.25
125	002340	格林美	326,300	2,072,005.00	0.25
126	600104	上汽集团	127,700	2,049,585.00	0.25
127	300768	迪普科技	119,100	2,042,565.00	0.24
128	603636	南威软件	160,900	2,033,776.00	0.24
129	002020	京新药业	154,100	2,011,005.00	0.24
130	300556	丝路视觉	100,700	2,000,909.00	0.24
131	603660	苏州科达	275,960	1,995,190.80	0.24
132	600699	均胜电子	113,700	1,982,928.00	0.24
133	605166	聚合顺	175,800	1,967,202.00	0.24
134	603081	大丰实业	180,200	1,949,764.00	0.23
135	002885	京泉华	137,700	1,948,455.00	0.23
136	600661	昂立教育	175,600	1,870,140.00	0.22
137	301103	何氏眼科	83,200	1,847,040.00	0.22
138	300206	理邦仪器	152,500	1,833,050.00	0.22
139	603230	内蒙新华	141,500	1,826,765.00	0.22
140	300990	同飞股份	36,600	1,826,340.00	0.22
141	301199	迈赫股份	71,260	1,818,555.20	0.22
142	603816	顾家家居	70,800	1,806,816.00	0.22
143	300393	中来股份	312,600	1,800,576.00	0.22
144	600683	京投发展	463,700	1,785,245.00	0.21
145	300219	鸿利智汇	263,900	1,773,408.00	0.21
146	300086	康芝药业	322,700	1,752,261.00	0.21
147	603678	火炬电子	45,700	1,737,971.00	0.21
148	600780	通宝能源	289,500	1,716,735.00	0.21
149	603330	天洋新材	251,900	1,707,882.00	0.20
150	002527	新时达	115,800	1,689,522.00	0.20
151	000501	武商集团	192,000	1,662,720.00	0.20
152	600398	海澜之家	237,300	1,651,608.00	0.20
153	600674	川投能源	102,800	1,648,912.00	0.20
154	300888	稳健医疗	39,800	1,635,780.00	0.20
155	002649	博彦科技	111,100	1,614,283.00	0.19
156	002993	奥海科技	38,700	1,604,889.00	0.19
157	600354	敦煌种业	258,500	1,600,115.00	0.19
158	301395	仁信新材	118,560	1,599,374.40	0.19
159	603520	司太立	161,400	1,581,720.00	0.19
160	300509	新美星	184,200	1,576,752.00	0.19
161	300510	金冠股份	341,300	1,563,154.00	0.19
162	000750	国海证券	378,800	1,560,656.00	0.19
163	002056	横店东磁	110,200	1,559,330.00	0.19

164	001301	尚太科技	31,500	1,535,940.00	0.18
165	603278	大业股份	167,300	1,522,430.00	0.18
166	002645	华宏科技	162,800	1,478,224.00	0.18
167	002637	赞宇科技	146,000	1,457,080.00	0.17
168	000050	深天马 A	170,600	1,453,512.00	0.17
169	300101	振芯科技	64,100	1,450,583.00	0.17
170	601857	中国石油	169,300	1,447,515.00	0.17
171	301220	亚香股份	32,180	1,444,882.00	0.17
172	000962	东方钨业	87,200	1,430,952.00	0.17
173	600578	京能电力	316,900	1,422,881.00	0.17
174	601002	晋亿实业	287,500	1,417,375.00	0.17
175	000586	汇源通信	127,200	1,414,464.00	0.17
176	002010	传化智联	251,200	1,401,696.00	0.17
177	600050	中国联通	261,800	1,398,012.00	0.17
178	600180	瑞茂通	313,300	1,391,052.00	0.17
179	301305	朗坤科技	76,300	1,369,585.00	0.16
180	301510	固高科技	45,500	1,367,275.00	0.16
181	688685	迈信林	24,279	1,355,982.15	0.16
182	002849	威星智能	86,900	1,355,640.00	0.16
183	603566	普莱柯	99,000	1,347,390.00	0.16
184	603565	中谷物流	140,900	1,345,595.00	0.16
185	600019	宝钢股份	202,600	1,335,134.00	0.16
186	301018	申菱环境	34,400	1,305,136.00	0.16
187	600114	东睦股份	63,500	1,291,590.00	0.15
188	002009	天奇股份	83,500	1,285,065.00	0.15
189	300014	亿纬锂能	27,800	1,273,518.00	0.15
190	300295	三六五网	78,500	1,262,280.00	0.15
191	603966	法兰泰克	135,900	1,261,152.00	0.15
192	600785	新华百货	106,900	1,253,937.00	0.15
193	002011	盾安环境	108,000	1,252,800.00	0.15
194	000626	远大控股	183,500	1,244,130.00	0.15
195	603063	禾望电气	36,700	1,242,662.00	0.15
196	002935	天奥电子	76,000	1,216,000.00	0.15
197	301387	光大同创	30,900	1,202,010.00	0.14
198	002668	TCL 智家	119,200	1,164,584.00	0.14
199	603118	共进股份	102,184	1,151,613.68	0.14
200	603185	弘元绿能	77,200	1,146,420.00	0.14
201	605080	浙江自然	40,800	1,134,240.00	0.14
202	600973	宝胜股份	222,800	1,127,368.00	0.13
203	600262	北方股份	49,400	1,126,320.00	0.13
204	300830	金现代	122,000	1,113,860.00	0.13
205	300687	赛意信息	40,000	1,111,200.00	0.13
206	002815	崇达技术	97,500	1,104,675.00	0.13
207	002881	美格智能	23,300	1,081,120.00	0.13

208	688590	新致软件	52,400	1,076,296.00	0.13
209	601126	四方股份	65,900	1,072,193.00	0.13
210	688403	汇成股份	103,000	1,070,170.00	0.13
211	688334	西高院	61,200	1,051,416.00	0.13
212	300447	全信股份	65,800	1,031,086.00	0.12
213	603318	水发燃气	156,100	1,028,699.00	0.12
214	600482	中国动力	44,400	1,024,308.00	0.12
215	300739	明阳电路	68,900	1,022,476.00	0.12
216	300565	科信技术	80,600	1,022,008.00	0.12
217	002931	锋龙股份	64,000	1,020,800.00	0.12
218	603109	神驰机电	35,900	1,003,046.00	0.12
219	000936	华西股份	145,400	1,000,352.00	0.12
220	603040	新坐标	24,900	1,000,233.00	0.12
221	300022	吉峰科技	111,900	989,196.00	0.12
222	600866	星湖科技	141,500	977,765.00	0.12
223	300693	盛弘股份	32,600	976,696.00	0.12
224	600496	精工钢构	299,500	958,400.00	0.11
225	603633	徕木股份	108,900	946,341.00	0.11
226	600166	福田汽车	346,200	938,202.00	0.11
227	300737	科顺股份	192,200	926,404.00	0.11
228	300727	润禾材料	35,110	923,041.90	0.11
229	300685	艾德生物	42,600	917,178.00	0.11
230	002483	润邦股份	146,300	914,375.00	0.11
231	002453	华软科技	148,700	907,070.00	0.11
232	688315	诺禾致源	64,000	903,680.00	0.11
233	600410	华胜天成	93,400	895,706.00	0.11
234	601619	嘉泽新能	249,500	893,210.00	0.11
235	002244	滨江集团	91,100	888,225.00	0.11
236	002661	克明食品	88,300	883,883.00	0.11
237	300690	双一科技	36,400	881,244.00	0.11
238	301320	豪江智能	45,600	875,520.00	0.10
239	002585	双星新材	158,100	863,226.00	0.10
240	002048	宁波华翔	45,800	843,178.00	0.10
241	300662	科锐国际	28,000	831,880.00	0.10
242	603708	家家悦	79,400	809,880.00	0.10
243	603500	祥和实业	88,100	806,996.00	0.10
244	002486	嘉麟杰	307,100	804,602.00	0.10
245	300582	英飞特	62,700	803,814.00	0.10
246	002876	三利谱	31,900	803,561.00	0.10
247	002895	川恒股份	35,600	803,136.00	0.10
248	300713	英可瑞	43,500	797,790.00	0.10
249	688381	帝奥微	36,400	788,424.00	0.09
250	002728	特一药业	92,900	781,289.00	0.09
251	002698	博实股份	50,200	780,108.00	0.09

252	300416	苏试试验	54,000	773,820.00	0.09
253	603687	大胜达	103,700	770,491.00	0.09
254	601113	华鼎股份	195,000	770,250.00	0.09
255	688039	当虹科技	23,400	767,988.00	0.09
256	688722	同益中	35,800	761,466.00	0.09
257	605305	中际联合	27,300	758,394.00	0.09
258	603103	横店影视	46,900	752,745.00	0.09
259	003038	鑫铂股份	38,600	752,314.00	0.09
260	603588	高能环境	131,900	743,916.00	0.09
261	603987	康德莱	96,200	740,740.00	0.09
262	601339	百隆东方	155,700	734,904.00	0.09
263	300777	中简科技	20,100	728,625.00	0.09
264	300105	龙源技术	94,000	724,740.00	0.09
265	000823	超声电子	60,600	718,110.00	0.09
266	603583	捷昌驱动	19,600	715,792.00	0.09
267	688690	纳微科技	31,000	707,730.00	0.08
268	300543	朗科智能	65,800	707,350.00	0.08
269	300780	德恩精工	43,800	704,742.00	0.08
270	300126	锐奇股份	96,500	700,590.00	0.08
271	600640	国脉文化	57,400	695,688.00	0.08
272	002606	大连电瓷	77,500	691,300.00	0.08
273	688258	卓易信息	14,200	687,706.00	0.08
274	601218	吉鑫科技	166,300	683,493.00	0.08
275	688133	泰坦科技	29,400	676,788.00	0.08
276	002468	申通快递	63,300	676,677.00	0.08
277	603766	隆鑫通用	53,000	676,280.00	0.08
278	603938	三孚股份	46,800	672,984.00	0.08
279	300491	通合科技	35,200	672,320.00	0.08
280	000531	穗恒运 A	107,100	658,665.00	0.08
281	300435	中泰股份	43,100	654,258.00	0.08
282	002126	银轮股份	26,500	643,420.00	0.08
283	600348	华阳股份	96,000	639,360.00	0.08
284	600707	彩虹股份	98,000	633,080.00	0.08
285	000987	越秀资本	90,800	622,888.00	0.07
286	601801	皖新传媒	90,800	620,164.00	0.07
287	300825	阿尔特	56,900	615,089.00	0.07
288	002760	凤形股份	31,700	613,395.00	0.07
289	300648	星云股份	17,700	611,712.00	0.07
290	002405	四维图新	70,700	603,778.00	0.07
291	600143	金发科技	57,700	594,887.00	0.07
292	688508	芯朋微	10,600	591,692.00	0.07
293	603810	丰山集团	35,700	580,839.00	0.07
294	300112	万讯自控	64,100	580,105.00	0.07
295	603309	维力医疗	45,500	578,760.00	0.07

296	600057	厦门象屿	81,700	574,351.00	0.07
297	600237	铜峰电子	79,100	573,475.00	0.07
298	600380	健康元	51,800	571,354.00	0.07
299	300738	奥飞数据	26,800	560,924.00	0.07
300	301328	维峰电子	13,200	556,380.00	0.07
301	601061	中信金属	70,300	556,073.00	0.07
302	002299	圣农发展	38,700	553,023.00	0.07
303	688588	凌志软件	37,400	544,918.00	0.07
304	300497	富祥药业	60,400	542,996.00	0.06
305	000686	东北证券	70,900	540,967.00	0.06
306	002133	广宇集团	185,000	540,200.00	0.06
307	600369	西南证券	123,600	537,660.00	0.06
308	603612	索通发展	29,000	533,020.00	0.06
309	300659	中孚信息	36,400	529,256.00	0.06
310	600649	城投控股	123,200	528,528.00	0.06
311	601336	新华保险	9,000	526,500.00	0.06
312	605589	圣泉集团	18,200	505,050.00	0.06
313	000553	安道麦 A	69,400	501,068.00	0.06
314	000690	宝新能源	108,600	494,130.00	0.06
315	601515	东峰集团	129,000	492,780.00	0.06
316	600035	楚天高速	116,100	492,264.00	0.06
317	000682	东方电子	47,200	483,328.00	0.06
318	300885	海昌新材	34,400	481,944.00	0.06
319	002600	领益智造	56,100	481,899.00	0.06
320	003022	联泓新科	30,300	479,649.00	0.06
321	301282	金禄电子	19,300	478,447.00	0.06
322	600716	凤凰股份	129,000	477,300.00	0.06
323	300938	信测标准	22,500	472,725.00	0.06
324	002497	雅化集团	40,600	462,840.00	0.06
325	603206	嘉环科技	26,700	458,706.00	0.05
326	600155	华创云信	63,200	439,872.00	0.05
327	002063	远光软件	73,900	439,705.00	0.05
328	601918	新集能源	67,900	438,634.00	0.05
329	300980	祥源新材	18,700	437,954.00	0.05
330	300118	东方日升	45,400	434,932.00	0.05
331	600109	国金证券	49,400	433,238.00	0.05
332	300869	康泰医学	30,100	431,634.00	0.05
333	002075	沙钢股份	74,100	431,262.00	0.05
334	300616	尚品宅配	32,100	422,757.00	0.05
335	600480	凌云股份	34,610	421,203.70	0.05
336	600782	新钢股份	118,900	420,906.00	0.05
337	002842	翔鹭钨业	50,400	420,840.00	0.05
338	600105	永鼎股份	52,000	420,680.00	0.05
339	600351	亚宝药业	69,000	418,830.00	0.05

340	600526	菲达环保	85,700	411,360.00	0.05
341	300303	聚飞光电	64,400	408,296.00	0.05
342	000783	长江证券	57,800	400,554.00	0.05
343	300335	迪森股份	73,200	399,672.00	0.05
344	002202	金风科技	38,900	398,725.00	0.05
345	300854	中兰环保	23,300	396,799.00	0.05
346	600887	伊利股份	14,100	393,108.00	0.05
347	301135	瑞德智能	14,700	392,931.00	0.05
348	000068	华控赛格	114,700	392,274.00	0.05
349	603183	建研院	91,900	389,656.00	0.05
350	301008	宏昌科技	17,000	389,640.00	0.05
351	002212	天融信	50,600	389,620.00	0.05
352	301280	珠城科技	9,900	387,882.00	0.05
353	603316	诚邦股份	42,800	384,772.00	0.05
354	300956	英力股份	23,700	384,414.00	0.05
355	300378	鼎捷数智	10,400	380,640.00	0.05
356	300062	中能电气	70,200	377,676.00	0.05
357	001360	南矿集团	27,100	377,232.00	0.05
358	301558	三态股份	41,800	376,618.00	0.05
359	600718	东软集团	38,600	376,350.00	0.04
360	600337	美克家居	169,000	373,490.00	0.04
361	600576	祥源文旅	45,900	370,413.00	0.04
362	603199	九华旅游	10,200	369,648.00	0.04
363	000157	中联重科	50,900	368,007.00	0.04
364	688469	芯联集成-U	76,800	366,336.00	0.04
365	601375	中原证券	87,700	364,832.00	0.04
366	600169	太原重工	149,300	361,306.00	0.04
367	300626	华瑞股份	33,300	358,308.00	0.04
368	603236	移远通信	4,000	343,200.00	0.04
369	002801	微光股份	10,600	343,122.00	0.04
370	002285	世联行	146,900	334,932.00	0.04
371	300076	GQY 视讯	51,300	330,372.00	0.04
372	688772	珠海冠宇	23,068	329,641.72	0.04
373	300658	延江股份	50,900	329,323.00	0.04
374	603682	锦和商管	57,800	327,726.00	0.04
375	688235	百济神州-U	1,400	327,096.00	0.04
376	000657	中钨高新	27,300	323,778.00	0.04
377	600218	全柴动力	35,900	322,023.00	0.04
378	002912	中新赛克	13,400	319,590.00	0.04
379	600583	海油工程	57,700	315,042.00	0.04
380	300819	聚杰微纤	13,200	311,256.00	0.04
381	300009	安科生物	36,500	305,505.00	0.04
382	301102	兆讯传媒	27,700	302,484.00	0.04
383	002412	汉森制药	48,500	301,670.00	0.04

384	603191	望变电气	23,400	295,308.00	0.04
385	600510	黑牡丹	57,900	294,711.00	0.04
386	300978	东箭科技	26,400	294,624.00	0.04
387	301090	华润材料	39,100	294,423.00	0.04
388	600537	亿晶光电	99,200	291,648.00	0.03
389	688048	长光华芯	5,000	288,700.00	0.03
390	600663	陆家嘴	32,300	286,178.00	0.03
391	002016	世荣兆业	52,000	284,960.00	0.03
392	603817	海峡环保	48,900	284,598.00	0.03
393	000729	燕京啤酒	21,500	277,995.00	0.03
394	601600	中国铝业	39,400	277,376.00	0.03
395	600011	华能国际	38,700	276,318.00	0.03
396	301057	汇隆新材	16,800	276,192.00	0.03
397	600336	澳柯玛	40,000	272,800.00	0.03
398	301388	欣灵电气	10,900	268,249.00	0.03
399	301313	凡拓数创	10,900	264,870.00	0.03
400	600962	国投中鲁	19,600	263,228.00	0.03
401	002127	南极电商	64,700	256,859.00	0.03
402	300176	鸿特科技	36,800	256,128.00	0.03
403	600981	汇鸿集团	89,900	255,316.00	0.03
404	300170	汉得信息	14,800	254,708.00	0.03
405	601118	海南橡胶	53,800	253,936.00	0.03
406	000498	山东路桥	43,000	252,840.00	0.03
407	603270	金帝股份	9,800	251,762.00	0.03
408	600060	海信视像	10,900	250,918.00	0.03
409	688288	鸿泉物联	8,600	249,486.00	0.03
410	000593	德龙汇能	41,400	249,228.00	0.03
411	600386	北巴传媒	53,200	243,124.00	0.03
412	601326	秦港股份	75,100	242,573.00	0.03
413	601901	方正证券	30,300	239,673.00	0.03
414	300322	硕贝德	15,700	234,715.00	0.03
415	300048	合康新能	39,800	233,626.00	0.03
416	600489	中金黄金	15,800	231,154.00	0.03
417	301226	祥明智能	8,400	229,992.00	0.03
418	000680	山推股份	25,500	228,735.00	0.03
419	300222	科大智能	22,400	228,256.00	0.03
420	600064	南京高科	29,600	228,216.00	0.03
421	300288	朗玛信息	14,800	223,628.00	0.03
422	300182	捷成股份	40,500	223,155.00	0.03
423	600713	南京医药	43,900	222,134.00	0.03
424	002293	罗莱生活	25,400	221,996.00	0.03
425	600724	宁波富达	48,500	220,675.00	0.03
426	600609	金杯汽车	41,200	217,948.00	0.03
427	002979	雷赛智能	4,900	216,972.00	0.03

428	002171	楚江新材	21,700	211,141.00	0.03
429	002081	金螳螂	60,900	208,887.00	0.02
430	603171	税友股份	4,800	205,968.00	0.02
431	600986	浙文互联	25,200	205,884.00	0.02
432	600067	冠城新材	69,000	205,620.00	0.02
433	600784	鲁银投资	31,900	204,160.00	0.02
434	002723	小崧股份	27,300	203,931.00	0.02
435	000404	长虹华意	28,500	202,350.00	0.02
436	002328	新朋股份	33,800	196,716.00	0.02
437	600027	华电国际	35,000	191,450.00	0.02
438	601616	广电电气	49,000	189,630.00	0.02
439	601369	陕鼓动力	21,500	188,555.00	0.02
440	300119	瑞普生物	9,700	188,374.00	0.02
441	688518	联赢激光	9,000	183,510.00	0.02
442	300525	博思软件	12,600	183,456.00	0.02
443	601615	明阳智能	15,700	180,393.00	0.02
444	300548	长芯博创	2,700	180,279.00	0.02
445	600582	天地科技	29,100	174,309.00	0.02
446	688401	路维光电	5,000	173,500.00	0.02
447	603855	华荣股份	7,800	172,614.00	0.02
448	002777	久远银海	9,400	171,644.00	0.02
449	000425	徐工机械	21,600	167,832.00	0.02
450	300111	向日葵	50,900	166,952.00	0.02
451	000601	韶能股份	34,300	166,698.00	0.02
452	002949	华阳国际	12,300	165,804.00	0.02
453	300573	兴齐眼药	3,200	165,728.00	0.02
454	600459	贵研铂业	10,500	162,855.00	0.02
455	002174	游族网络	13,400	162,542.00	0.02
456	600018	上港集团	28,400	162,164.00	0.02
457	300627	华测导航	4,620	161,700.00	0.02
458	300158	振东制药	36,200	159,280.00	0.02
459	000597	东北制药	30,300	156,348.00	0.02
460	600873	梅花生物	14,200	151,798.00	0.02
461	300570	太辰光	1,500	144,570.00	0.02
462	600298	安琪酵母	4,100	144,197.00	0.02
463	300683	海特生物	5,600	143,920.00	0.02
464	300902	国安达	7,400	139,268.00	0.02
465	002334	英威腾	17,200	136,396.00	0.02
466	300456	赛微电子	7,800	134,082.00	0.02
467	605507	国邦医药	6,700	132,459.00	0.02
468	600037	歌华有线	17,100	130,644.00	0.02
469	601677	明泰铝业	10,300	127,926.00	0.02
470	301332	德尔玛	12,400	126,976.00	0.02
471	002090	金智科技	13,100	125,498.00	0.02

472	000739	普洛药业	8,800	123,200.00	0.01
473	300602	飞荣达	5,600	118,776.00	0.01
474	603328	依顿电子	12,100	118,701.00	0.01
475	301228	实朴检测	4,200	118,314.00	0.01
476	688246	嘉和美康	4,000	117,560.00	0.01
477	600547	山东黄金	3,600	114,948.00	0.01
478	301353	普莱得	4,500	113,940.00	0.01
479	301266	宇邦新材	3,400	113,662.00	0.01
480	603083	剑桥科技	2,400	113,520.00	0.01
481	002709	天赐材料	6,200	112,344.00	0.01
482	001339	智微智能	2,300	111,159.00	0.01
483	600491	龙元建设	30,100	110,768.00	0.01
484	603596	伯特利	2,100	110,649.00	0.01
485	603116	红蜻蜓	18,800	110,544.00	0.01
486	003033	征和工业	2,600	110,214.00	0.01
487	300196	长海股份	9,000	109,800.00	0.01
488	601999	出版传媒	15,700	109,743.00	0.01
489	603090	宏盛股份	4,500	109,665.00	0.01
490	600335	国机汽车	17,000	109,650.00	0.01
491	601609	金田股份	15,600	109,356.00	0.01
492	000027	深圳能源	17,100	109,098.00	0.01
493	300154	瑞凌股份	12,100	108,900.00	0.01
494	300448	浩云科技	16,000	108,480.00	0.01
495	300151	昌红科技	8,800	108,328.00	0.01
496	003025	思进智能	8,000	108,320.00	0.01
497	000988	华工科技	2,300	108,123.00	0.01
498	603811	诚意药业	11,700	107,991.00	0.01
499	301381	赛维时代	5,400	107,730.00	0.01
500	002264	新华都	16,900	107,315.00	0.01
501	600507	方大特钢	24,700	107,198.00	0.01
502	600488	津药药业	25,600	106,752.00	0.01
503	603067	振华股份	7,000	106,680.00	0.01
504	603408	建霖家居	9,700	106,409.00	0.01
505	600062	华润双鹤	5,700	106,362.00	0.01
506	600299	安迪苏	11,000	106,150.00	0.01
507	301603	乔锋智能	2,100	106,071.00	0.01
508	301376	致欧科技	5,800	105,850.00	0.01
509	000959	首钢股份	31,100	105,740.00	0.01
510	600597	光明乳业	12,500	105,125.00	0.01
511	002375	亚厦股份	27,300	105,105.00	0.01
512	300871	回盛生物	5,000	104,500.00	0.01
513	603393	新天然气	3,600	104,220.00	0.01
514	300608	思特奇	8,800	102,432.00	0.01
515	002034	旺能环境	6,100	102,419.00	0.01

516	301076	新瀚新材	2,900	100,862.00	0.01
517	300580	贝斯特	4,100	100,737.00	0.01
518	300408	三环集团	3,000	100,200.00	0.01
519	601096	宏盛华源	24,000	99,360.00	0.01
520	600757	长江传媒	10,600	98,368.00	0.01
521	002266	浙富控股	31,900	98,252.00	0.01
522	001914	招商积余	7,900	97,723.00	0.01
523	300926	博俊科技	3,600	95,292.00	0.01
524	300187	永清环保	18,600	94,860.00	0.01
525	603111	康尼机电	14,400	94,752.00	0.01
526	688488	艾迪药业	6,800	94,180.00	0.01
527	300305	裕兴股份	14,600	93,148.00	0.01
528	600420	国药现代	8,600	91,590.00	0.01
529	600029	南方航空	14,900	87,910.00	0.01
530	601678	滨化股份	20,800	86,112.00	0.01
531	301300	远翔新材	2,400	85,728.00	0.01
532	601298	青岛港	9,500	82,555.00	0.01
533	300598	诚迈科技	1,900	80,845.00	0.01
534	301175	中科环保	15,600	80,652.00	0.01
535	300909	汇创达	3,000	79,230.00	0.01
536	002838	道恩股份	4,400	78,804.00	0.01
537	300161	华中数控	2,900	76,821.00	0.01
538	000419	通程控股	13,400	76,246.00	0.01
539	002245	蔚蓝锂芯	5,900	75,697.00	0.01
540	000922	佳电股份	6,600	75,108.00	0.01
541	600201	生物股份	9,100	72,982.00	0.01
542	300850	新强联	2,000	71,640.00	0.01
543	300345	华民股份	8,400	71,232.00	0.01
544	300011	鼎汉技术	9,500	70,965.00	0.01
545	603889	新澳股份	12,100	70,180.00	0.01
546	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.01
547	603386	骏亚科技	5,300	67,045.00	0.01
548	600203	福日电子	7,100	66,456.00	0.01
549	301456	盘古智能	2,700	66,042.00	0.01
550	300194	福安药业	15,600	65,988.00	0.01
551	603110	东方材料	4,000	65,120.00	0.01
552	605566	福莱蒾特	3,100	64,635.00	0.01
553	002746	仙坛股份	10,900	63,438.00	0.01
554	002545	东方铁塔	7,000	62,230.00	0.01
555	000868	安凯客车	10,500	61,950.00	0.01
556	600808	马钢股份	17,700	61,065.00	0.01
557	603809	豪能股份	3,900	59,670.00	0.01
558	001267	汇绿生态	6,200	58,156.00	0.01
559	300218	安利股份	3,700	55,426.00	0.01

560	000925	众合科技	7,000	53,760.00	0.01
561	605376	博迁新材	1,400	53,662.00	0.01
562	603379	三美股份	1,100	52,932.00	0.01
563	300984	金沃股份	920	52,670.00	0.01
564	300257	开山股份	5,100	51,357.00	0.01
565	300138	晨光生物	4,000	48,480.00	0.01
566	688207	格灵深瞳	3,200	48,320.00	0.01
567	600458	时代新材	3,500	48,020.00	0.01
568	301029	怡合达	2,100	48,006.00	0.01
569	603380	易德龙	1,800	47,880.00	0.01
570	002613	北玻股份	12,500	46,125.00	0.01
571	002516	旷达科技	8,800	45,320.00	0.01
572	002852	道道全	4,700	44,932.00	0.01
573	603158	腾龙股份	5,500	43,780.00	0.01
574	600628	新世界	5,800	42,456.00	0.01
575	000921	海信家电	1,600	41,120.00	0.00
576	300145	南方泵业	11,600	40,600.00	0.00
577	002479	富春环保	8,000	40,080.00	0.00
578	300285	国瓷材料	2,300	39,905.00	0.00
579	300128	锦富技术	7,100	39,618.00	0.00
580	002701	奥瑞金	6,600	39,270.00	0.00
581	000567	海德股份	6,500	38,480.00	0.00
582	300482	万孚生物	1,800	38,430.00	0.00
583	600835	上海机电	1,800	38,250.00	0.00
584	600535	天士力	2,400	37,560.00	0.00
585	002358	森源电气	7,300	37,157.00	0.00
586	600273	嘉化能源	4,300	36,378.00	0.00
587	600098	广州发展	5,700	35,625.00	0.00
588	600195	中牧股份	4,700	34,451.00	0.00
589	000001	平安银行	2,800	33,796.00	0.00
590	300319	麦捷科技	3,100	33,294.00	0.00
591	600528	中铁工业	4,300	31,734.00	0.00
592	600675	中华企业	10,900	31,392.00	0.00
593	301039	中集车辆	3,800	30,894.00	0.00
594	000058	深赛格	3,600	29,916.00	0.00
595	002060	广东建工	8,400	29,232.00	0.00
596	920037	广信科技	400	29,140.00	0.00
597	002563	森马服饰	5,300	27,878.00	0.00
598	002871	伟隆股份	2,500	27,825.00	0.00
599	601200	上海环境	3,500	27,790.00	0.00
600	002370	亚太药业	7,300	27,740.00	0.00
601	002911	佛燃能源	2,700	27,702.00	0.00
602	300681	英搏尔	1,000	27,660.00	0.00
603	002472	双环传动	800	26,792.00	0.00

604	300479	神思电子	1,200	26,484.00	0.00
605	002662	峰璟股份	6,700	22,914.00	0.00
606	002035	华帝股份	3,600	22,644.00	0.00
607	300599	雄塑科技	2,400	20,640.00	0.00
608	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
609	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
610	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
611	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
612	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
613	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
614	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
615	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
616	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
617	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
618	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
619	603202	天有为	58	5,258.28	0.00
620	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
621	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
622	000009	中国宝安	400	3,552.00	0.00
623	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
624	000026	飞亚达	200	3,164.00	0.00
625	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
626	000019	深粮控股	400	2,664.00	0.00
627	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
628	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
629	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
630	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
631	000008	神州高铁	600	1,674.00	0.00
632	300259	新天科技	400	1,420.00	0.00
633	000030	富奥股份	200	1,178.00	0.00
634	301380	挖金客	20	733.60	0.00
635	000031	大悦城	200	530.00	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	300017	网宿科技	13,740,417.00	12.94
2	002655	共达电声	10,110,449.00	9.52
3	002587	奥拓电子	8,899,318.00	8.38

4	000100	TCL 科技	8,853,083.00	8.33
5	002206	海利得	8,753,647.42	8.24
6	300369	绿盟科技	8,677,232.00	8.17
7	300363	博腾股份	8,622,184.00	8.12
8	300081	恒信东方	8,596,926.00	8.09
9	603466	风语筑	8,460,327.70	7.97
10	601116	三江购物	8,274,215.00	7.79
11	300232	洲明科技	7,874,422.00	7.41
12	603901	永创智能	7,608,952.00	7.16
13	603267	鸿远电子	7,409,700.00	6.98
14	300772	运达股份	7,332,912.70	6.90
15	002455	百川股份	7,094,211.00	6.68
16	002344	海宁皮城	6,972,004.00	6.56
17	601117	中国化学	6,847,911.00	6.45
18	002296	辉煌科技	6,812,771.00	6.41
19	600662	外服控股	6,730,482.60	6.34
20	301060	兰卫医学	6,726,370.00	6.33
21	002414	高德红外	6,710,975.00	6.32
22	002057	中钢天源	6,696,883.00	6.30
23	002284	亚太股份	6,616,205.00	6.23
24	002419	天虹股份	6,613,985.00	6.23
25	002373	千方科技	6,596,674.00	6.21
26	002139	拓邦股份	6,594,627.00	6.21
27	603063	禾望电气	6,511,445.00	6.13
28	600704	物产中大	6,467,762.00	6.09
29	601991	大唐发电	6,425,234.00	6.05
30	002649	博彦科技	6,339,448.00	5.97
31	300317	珈伟新能	6,263,266.00	5.90
32	688512	慧智微-U	6,224,984.97	5.86
33	300395	菲利华	6,224,844.00	5.86
34	600728	佳都科技	6,210,601.00	5.85
35	300168	万达信息	6,204,193.00	5.84
36	002695	煌上煌	6,203,633.00	5.84
37	002056	横店东磁	6,173,761.00	5.81
38	300410	正业科技	6,086,753.19	5.73
39	300006	莱美药业	5,998,792.00	5.65
40	002905	金逸影视	5,991,138.40	5.64
41	000059	华锦股份	5,932,698.00	5.59
42	600176	中国巨石	5,925,819.00	5.58
43	000750	国海证券	5,911,204.00	5.57
44	300565	科信技术	5,910,443.00	5.56
45	600643	爱建集团	5,884,886.00	5.54
46	300401	花园生物	5,754,506.00	5.42
47	300509	新美星	5,750,219.00	5.41

48	603118	共进股份	5,737,444.76	5.40
49	002454	松芝股份	5,689,472.00	5.36
50	300057	万顺新材	5,682,963.00	5.35
51	300903	科翔股份	5,677,727.00	5.35
52	601898	中煤能源	5,647,286.00	5.32
53	600429	三元股份	5,625,021.00	5.30
54	600288	大恒科技	5,540,261.00	5.22
55	300320	海达股份	5,503,980.00	5.18
56	002782	可立克	5,472,709.00	5.15
57	300365	恒华科技	5,456,609.00	5.14
58	300358	楚天科技	5,378,648.00	5.06
59	600163	中闽能源	5,205,846.00	4.90
60	688280	精进电动-UW	5,188,507.68	4.88
61	688173	希荻微	5,143,508.13	4.84
62	688235	百济神州-U	5,096,494.19	4.80
63	002676	顺威股份	5,088,752.00	4.79
64	300291	百纳千成	5,027,419.00	4.73
65	600682	南京新百	5,013,531.00	4.72
66	300231	银信科技	5,000,146.00	4.71
67	002953	日丰股份	4,924,571.00	4.64
68	601233	桐昆股份	4,857,755.00	4.57
69	002036	联创电子	4,850,480.00	4.57
70	300994	久祺股份	4,837,565.00	4.55
71	301161	唯万密封	4,832,752.00	4.55
72	301069	凯盛新材	4,820,055.00	4.54
73	300768	迪普科技	4,791,179.00	4.51
74	300435	中泰股份	4,772,775.00	4.49
75	300662	科锐国际	4,755,358.00	4.48
76	002434	万里扬	4,737,021.00	4.46
77	002225	濮耐股份	4,725,674.00	4.45
78	300615	欣天科技	4,671,195.00	4.40
79	600063	皖维高新	4,653,492.00	4.38
80	002380	科远智慧	4,641,566.00	4.37
81	603386	骏亚科技	4,628,220.00	4.36
82	301239	普瑞眼科	4,585,368.00	4.32
83	600483	福能股份	4,541,239.00	4.28
84	300454	深信服	4,534,219.00	4.27
85	000803	山高环能	4,534,063.00	4.27
86	002121	科陆电子	4,529,152.00	4.26
87	300539	横河精密	4,478,674.00	4.22
88	301018	申菱环境	4,449,035.00	4.19
89	600435	北方导航	4,430,140.00	4.17
90	603085	天成自控	4,411,870.00	4.15
91	601311	骆驼股份	4,403,647.00	4.15

92	600710	苏美达	4,390,079.00	4.13
93	002795	永和智控	4,359,556.00	4.10
94	301220	亚香股份	4,357,364.00	4.10
95	300533	冰川网络	4,348,324.00	4.09
96	002446	盛路通信	4,339,487.00	4.09
97	600125	铁龙物流	4,338,788.00	4.08
98	300667	必创科技	4,329,762.00	4.08
99	600531	豫光金铅	4,306,736.00	4.05
100	600114	东睦股份	4,277,586.04	4.03
101	300634	彩讯股份	4,277,191.00	4.03
102	300578	会畅通讯	4,265,912.00	4.02
103	002483	润邦股份	4,258,112.00	4.01
104	002893	京能热力	4,252,257.00	4.00
105	601857	中国石油	4,225,675.00	3.98
106	000551	创元科技	4,217,791.00	3.97
107	300830	金现代	4,214,859.00	3.97
108	300496	中科创达	4,120,250.00	3.88
109	002283	天润工业	4,106,934.00	3.87
110	603236	移远通信	4,098,379.00	3.86
111	688018	乐鑫科技	4,077,955.05	3.84
112	600664	哈药股份	4,074,641.00	3.84
113	002706	良信股份	4,039,891.00	3.80
114	603936	博敏电子	4,023,287.00	3.79
115	002546	新联电子	3,999,589.00	3.77
116	603717	天域生物	3,999,072.00	3.76
117	301380	挖金客	3,995,625.00	3.76
118	002527	新时达	3,991,787.00	3.76
119	002020	京新药业	3,910,570.00	3.68
120	688685	迈信林	3,902,468.28	3.67
121	301232	飞沃科技	3,898,928.80	3.67
122	301349	信德新材	3,893,577.00	3.67
123	688365	光云科技	3,891,010.11	3.66
124	300762	上海瀚讯	3,880,199.00	3.65
125	301419	阿莱德	3,865,108.40	3.64
126	300022	吉峰科技	3,844,775.00	3.62
127	603678	火炬电子	3,838,683.00	3.61
128	300101	振芯科技	3,820,561.00	3.60
129	301118	恒光股份	3,803,619.00	3.58
130	002063	远光软件	3,759,401.20	3.54
131	603296	华勤技术	3,681,973.00	3.47
132	002350	北京科锐	3,670,894.90	3.46
133	301282	金禄电子	3,644,091.00	3.43
134	002448	中原内配	3,636,743.00	3.42
135	002010	传化智联	3,607,280.00	3.40

136	603259	药明康德	3,589,333.00	3.38
137	603660	苏州科达	3,564,647.60	3.36
138	688590	新致软件	3,564,117.18	3.36
139	000715	中兴商业	3,525,075.40	3.32
140	300659	中孚信息	3,524,677.44	3.32
141	603968	醋化股份	3,517,241.00	3.31
142	002017	东信和平	3,509,640.50	3.30
143	300214	日科化学	3,503,485.00	3.30
144	300041	回天新材	3,485,056.00	3.28
145	603588	高能环境	3,471,996.00	3.27
146	300206	理邦仪器	3,432,215.00	3.23
147	002215	诺普信	3,417,348.00	3.22
148	300203	聚光科技	3,411,842.00	3.21
149	600556	天下秀	3,392,464.00	3.19
150	300043	星辉娱乐	3,387,037.00	3.19
151	000534	万泽股份	3,378,227.00	3.18
152	300271	华宇软件	3,354,345.00	3.16
153	600179	安通控股	3,348,749.00	3.15
154	300693	盛弘股份	3,347,989.00	3.15
155	300560	中富通	3,336,877.00	3.14
156	300767	震安科技	3,327,361.00	3.13
157	601118	海南橡胶	3,324,789.00	3.13
158	600050	中国联通	3,318,522.00	3.12
159	603318	水发燃气	3,296,574.00	3.10
160	600482	中国动力	3,294,783.00	3.10
161	300571	平治信息	3,290,918.00	3.10
162	603855	华荣股份	3,280,563.00	3.09
163	600380	健康元	3,244,703.00	3.05
164	600973	宝胜股份	3,242,944.00	3.05
165	600237	铜峰电子	3,237,977.00	3.05
166	002339	积成电子	3,217,782.00	3.03
167	002938	鹏鼎控股	3,217,100.00	3.03
168	002249	大洋电机	3,208,517.00	3.02
169	600354	敦煌种业	3,191,480.00	3.00
170	600990	四创电子	3,168,537.00	2.98
171	002803	吉宏股份	3,147,072.00	2.96
172	002910	庄园牧场	3,141,243.00	2.96
173	002054	德美化工	3,133,688.00	2.95
174	300420	五洋自控	3,132,996.00	2.95
175	300155	安居宝	3,100,464.00	2.92
176	000823	超声电子	3,088,952.00	2.91
177	301379	天山电子	3,078,808.00	2.90
178	603225	新凤鸣	3,060,712.00	2.88
179	002030	达安基因	3,059,191.00	2.88

180	000906	浙商中拓	3,040,370.00	2.86
181	300098	高新兴	3,029,164.00	2.85
182	301199	迈赫股份	3,022,690.80	2.85
183	603313	梦百合	3,014,761.00	2.84
184	300303	聚飞光电	3,003,816.00	2.83
185	002645	华宏科技	3,003,619.00	2.83
186	002209	达意隆	2,996,405.00	2.82
187	603230	内蒙新华	2,992,097.00	2.82
188	600601	方正科技	2,984,327.00	2.81
189	300984	金沃股份	2,956,984.60	2.78
190	603618	杭电股份	2,951,926.00	2.78
191	300133	华策影视	2,930,845.00	2.76
192	002550	千红制药	2,908,515.00	2.74
193	605166	聚合顺	2,900,695.00	2.73
194	601113	华鼎股份	2,898,057.00	2.73
195	000415	渤海租赁	2,896,495.00	2.73
196	301298	东利机械	2,894,480.00	2.73
197	605277	新亚电子	2,876,673.00	2.71
198	002212	天融信	2,850,184.00	2.68
199	601600	中国铝业	2,848,068.00	2.68
200	603816	顾家家居	2,832,302.00	2.67
201	600758	辽宁能源	2,831,266.00	2.67
202	600019	宝钢股份	2,826,242.00	2.66
203	002522	浙江众成	2,823,859.00	2.66
204	301248	杰创智能	2,810,797.00	2.65
205	601179	中国西电	2,809,897.00	2.65
206	603113	金能科技	2,808,209.00	2.64
207	600640	国脉文化	2,782,072.00	2.62
208	600060	海信视像	2,775,033.00	2.61
209	300086	康芝药业	2,771,296.00	2.61
210	300593	新雷能	2,760,070.00	2.60
211	002328	新朋股份	2,754,656.00	2.59
212	300259	新天科技	2,743,813.00	2.58
213	002090	金智科技	2,720,319.00	2.56
214	000050	深天马 A	2,720,307.00	2.56
215	600778	友好集团	2,719,626.00	2.56
216	000975	山金国际	2,717,335.00	2.56
217	000811	冰轮环境	2,713,661.00	2.55
218	300521	爱司凯	2,686,895.00	2.53
219	601616	广电电气	2,681,506.00	2.52
220	300160	秀强股份	2,677,062.00	2.52
221	688201	信安世纪	2,668,313.07	2.51
222	300987	川网传媒	2,659,013.00	2.50
223	002169	智光电气	2,656,672.00	2.50

224	002340	格林美	2,654,255.00	2.50
225	300988	津荣天宇	2,644,789.00	2.49
226	300972	万辰集团	2,640,598.00	2.49
227	002468	申通快递	2,639,230.00	2.48
228	300476	胜宏科技	2,637,700.00	2.48
229	603636	南威软件	2,600,026.00	2.45
230	300776	帝尔激光	2,597,393.60	2.45
231	600248	陕建股份	2,596,849.00	2.44
232	300149	睿智医药	2,595,340.00	2.44
233	601369	陕鼓动力	2,586,757.00	2.44
234	603308	应流股份	2,586,210.00	2.43
235	300219	鸿利智汇	2,577,254.00	2.43
236	300207	欣旺达	2,572,899.00	2.42
237	300909	汇创达	2,569,029.00	2.42
238	600480	凌云股份	2,553,415.00	2.40
239	300570	太辰光	2,552,431.00	2.40
240	603081	大丰实业	2,548,855.00	2.40
241	300447	全信股份	2,545,959.00	2.40
242	002935	天奥电子	2,543,345.00	2.39
243	002376	新北洋	2,507,233.00	2.36
244	000563	陕国投 A	2,503,597.00	2.36
245	300940	南极光	2,482,840.40	2.34
246	002759	天际股份	2,471,253.00	2.33
247	300873	海晨股份	2,470,877.00	2.33
248	300835	龙磁科技	2,465,466.00	2.32
249	002413	雷科防务	2,452,082.00	2.31
250	300637	扬帆新材	2,448,848.00	2.31
251	002606	大连电瓷	2,447,667.00	2.30
252	002532	天山铝业	2,424,515.00	2.28
253	600120	浙江东方	2,422,888.00	2.28
254	600496	精工钢构	2,417,543.00	2.28
255	688588	凌志软件	2,415,646.78	2.27
256	000090	天健集团	2,377,780.00	2.24
257	600210	紫江企业	2,377,078.00	2.24
258	600218	全柴动力	2,363,179.00	2.22
259	300608	思特奇	2,353,236.00	2.22
260	300990	同飞股份	2,346,901.00	2.21
261	002668	TCL 智家	2,337,055.00	2.20
262	688579	山大地纬	2,332,742.17	2.20
263	000156	华数传媒	2,313,179.00	2.18
264	300138	晨光生物	2,311,394.00	2.18
265	002486	嘉麟杰	2,289,191.00	2.16
266	002561	徐家汇	2,286,841.00	2.15
267	301210	金杨股份	2,281,940.00	2.15

268	300679	电连技术	2,260,077.00	2.13
269	600661	昂立教育	2,253,433.00	2.12
270	002073	软控股份	2,253,379.00	2.12
271	600674	川投能源	2,251,772.00	2.12
272	300423	昇辉科技	2,249,828.00	2.12
273	300105	龙源技术	2,247,176.00	2.12
274	000498	山东路桥	2,243,544.00	2.11
275	002993	奥海科技	2,240,553.00	2.11
276	002263	大东南	2,233,575.00	2.10
277	600699	均胜电子	2,231,213.00	2.10
278	300787	海能实业	2,229,112.80	2.10
279	002556	辉隆股份	2,228,135.00	2.10
280	300872	天阳科技	2,214,693.00	2.09
281	300548	长芯博创	2,214,515.00	2.08
282	603708	家家悦	2,208,780.00	2.08
283	301305	朗坤科技	2,191,819.00	2.06
284	001301	尚太科技	2,191,032.00	2.06
285	000936	华西股份	2,189,311.00	2.06
286	300079	数码视讯	2,164,175.00	2.04
287	002849	威星智能	2,151,481.00	2.03
288	605589	圣泉集团	2,149,005.00	2.02
289	600780	通宝能源	2,146,882.00	2.02
290	002171	楚江新材	2,134,727.00	2.01
291	300727	润禾材料	2,132,789.00	2.01
292	002126	银轮股份	2,130,802.00	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	300363	博腾股份	9,241,619.00	8.70
2	300772	运达股份	8,423,134.10	7.93
3	300410	正业科技	7,862,802.31	7.40
4	002057	中钢天源	7,465,112.00	7.03
5	300903	科翔股份	7,124,481.80	6.71
6	300057	万顺新材	6,580,411.00	6.20
7	300017	网宿科技	6,053,658.00	5.70

8	300291	百纳千成	6,027,687.00	5.67
9	002676	顺威股份	5,810,165.80	5.47
10	603118	共进股份	5,707,842.00	5.37
11	300565	科信技术	5,698,512.50	5.36
12	603063	禾望电气	5,691,795.48	5.36
13	688235	百济神州-U	5,395,040.62	5.08
14	600435	北方导航	5,347,173.00	5.03
15	300533	冰川网络	5,126,079.00	4.83
16	603386	骏亚科技	5,048,470.00	4.75
17	301118	恒光股份	4,954,820.00	4.66
18	002056	横店东磁	4,823,189.00	4.54
19	300435	中泰股份	4,815,116.00	4.53
20	002649	博彦科技	4,792,919.00	4.51
21	002546	新联电子	4,781,346.00	4.50
22	600643	爱建集团	4,698,325.00	4.42
23	300454	深信服	4,663,358.00	4.39
24	301349	信德新材	4,612,976.00	4.34
25	300509	新美星	4,561,685.00	4.29
26	600710	苏美达	4,511,464.00	4.25
27	300203	聚光科技	4,440,568.00	4.18
28	000750	国海证券	4,375,782.00	4.12
29	300578	会畅通讯	4,330,549.00	4.08
30	301380	挖金客	4,244,671.05	4.00
31	688018	乐鑫科技	4,091,364.81	3.85
32	300043	星辉娱乐	4,056,900.00	3.82
33	603236	移远通信	4,049,572.00	3.81
34	300767	震安科技	4,038,748.00	3.80
35	301379	天山电子	4,015,913.10	3.78
36	002655	共达电声	3,963,477.00	3.73
37	300662	科锐国际	3,926,572.00	3.70
38	600662	外服控股	3,908,072.00	3.68
39	002448	中原内配	3,883,267.00	3.66
40	301282	金禄电子	3,867,120.00	3.64
41	603296	华勤技术	3,860,727.00	3.63
42	002483	润邦股份	3,835,700.00	3.61
43	300987	川网传媒	3,817,634.00	3.59
44	002017	东信和平	3,798,657.10	3.58
45	603259	药明康德	3,750,381.00	3.53
46	600758	辽宁能源	3,737,995.00	3.52
47	002250	联化科技	3,586,012.00	3.38
48	300271	华宇软件	3,584,784.00	3.37
49	002206	海利得	3,548,844.00	3.34
50	002339	积成电子	3,508,709.00	3.30
51	603855	华荣股份	3,446,593.00	3.24

52	301018	申菱环境	3,445,681.00	3.24
53	300972	万辰集团	3,434,941.00	3.23
54	600556	天下秀	3,319,223.00	3.12
55	002803	吉宏股份	3,310,883.91	3.12
56	600114	东睦股份	3,309,031.00	3.12
57	002550	千红制药	3,304,326.00	3.11
58	300984	金沃股份	3,299,334.60	3.11
59	300940	南极光	3,270,108.00	3.08
60	600601	方正科技	3,246,697.00	3.06
61	300909	汇创达	3,223,015.50	3.03
62	605277	新亚电子	3,216,780.00	3.03
63	002419	天虹股份	3,210,839.00	3.02
64	300988	津荣天宇	3,192,568.00	3.01
65	002063	远光软件	3,146,005.00	2.96
66	300830	金现代	3,138,556.00	2.95
67	000100	TCL 科技	3,087,697.00	2.91
68	002522	浙江众成	3,086,686.00	2.91
69	603588	高能环境	3,083,584.00	2.90
70	688201	信安世纪	3,072,416.32	2.89
71	300232	洲明科技	3,056,594.00	2.88
72	601118	海南橡胶	3,040,431.00	2.86
73	300022	吉峰科技	3,009,478.70	2.83
74	600248	陕建股份	2,954,243.00	2.78
75	603308	应流股份	2,890,637.00	2.72
76	300521	爱司凯	2,886,460.00	2.72
77	000811	冰轮环境	2,885,638.00	2.72
78	002938	鹏鼎控股	2,862,094.00	2.69
79	601857	中国石油	2,860,143.00	2.69
80	002414	高德红外	2,846,831.10	2.68
81	002255	海陆重工	2,835,184.00	2.67
82	300637	扬帆新材	2,815,596.00	2.65
83	300476	胜宏科技	2,786,520.00	2.62
84	300149	睿智医药	2,785,947.00	2.62
85	002212	天融信	2,780,131.00	2.62
86	002532	天山铝业	2,778,884.00	2.62
87	002413	雷科防务	2,774,231.00	2.61
88	600380	健康元	2,763,839.00	2.60
89	601311	骆驼股份	2,760,088.00	2.60
90	601898	中煤能源	2,752,745.00	2.59
91	600237	铜峰电子	2,750,417.00	2.59
92	000090	天健集团	2,746,417.00	2.59
93	000415	渤海租赁	2,739,964.00	2.58
94	300768	迪普科技	2,739,642.00	2.58
95	601117	中国化学	2,730,100.21	2.57

96	002073	软控股份	2,722,662.00	2.56
97	002759	天际股份	2,722,070.00	2.56
98	002263	大东南	2,698,059.00	2.54
99	300570	太辰光	2,685,653.00	2.53
100	600120	浙江东方	2,683,295.00	2.53
101	601369	陕鼓动力	2,670,439.00	2.51
102	601179	中国西电	2,664,296.00	2.51
103	300207	欣旺达	2,662,967.00	2.51
104	300259	新天科技	2,635,549.00	2.48
105	300515	三德科技	2,621,652.00	2.47
106	300423	昇辉科技	2,604,341.00	2.45
107	300659	中孚信息	2,601,248.00	2.45
108	600210	紫江企业	2,600,854.00	2.45
109	300101	振芯科技	2,594,805.00	2.44
110	002090	金智科技	2,588,556.00	2.44
111	600216	浙江医药	2,582,772.00	2.43
112	600060	海信视像	2,564,330.08	2.41
113	688590	新致软件	2,547,911.69	2.40
114	002328	新朋股份	2,546,676.00	2.40
115	000563	陕国投 A	2,542,717.00	2.39
116	301220	亚香股份	2,535,281.40	2.39
117	002376	新北洋	2,525,022.00	2.38
118	600063	皖维高新	2,517,031.00	2.37
119	002344	海宁皮城	2,498,289.00	2.35
120	300548	长芯博创	2,495,916.00	2.35
121	688579	山大地纬	2,490,195.66	2.34
122	300787	海能实业	2,475,791.96	2.33
123	002479	富春环保	2,463,696.00	2.32
124	300693	盛弘股份	2,446,515.00	2.30
125	600640	国脉文化	2,443,111.00	2.30
126	300835	龙磁科技	2,441,073.40	2.30
127	300081	恒信东方	2,440,286.00	2.30
128	601616	广电电气	2,402,995.00	2.26
129	002036	联创电子	2,397,694.00	2.26
130	300138	晨光生物	2,396,573.00	2.26
131	603466	风语筑	2,373,796.00	2.23
132	000498	山东路桥	2,372,335.00	2.23
133	601991	大唐发电	2,363,197.00	2.22
134	002606	大连电瓷	2,360,178.00	2.22
135	600482	中国动力	2,360,093.00	2.22
136	300369	绿盟科技	2,357,582.00	2.22
137	301226	祥明智能	2,355,440.00	2.22
138	002010	传化智联	2,338,296.00	2.20
139	688685	迈信林	2,336,386.13	2.20

140	002527	新时达	2,334,124.00	2.20
141	601600	中国铝业	2,330,140.00	2.19
142	601116	三江购物	2,320,409.00	2.18
143	002561	徐家汇	2,308,289.00	2.17
144	603186	华正新材	2,305,476.00	2.17
145	603318	水发燃气	2,301,108.00	2.17
146	600218	全柴动力	2,295,001.00	2.16
147	688233	神工股份	2,281,787.17	2.15
148	002556	辉隆股份	2,272,787.00	2.14
149	000823	超声电子	2,264,511.00	2.13
150	300525	博思软件	2,256,706.00	2.12
151	300168	万达信息	2,255,719.00	2.12
152	600973	宝胜股份	2,251,638.00	2.12
153	601226	华电科工	2,246,423.00	2.11
154	300016	北陆药业	2,246,163.00	2.11
155	002627	三峡旅游	2,242,609.00	2.11
156	300485	赛升药业	2,223,633.00	2.09
157	600828	茂业商业	2,223,609.00	2.09
158	300303	聚飞光电	2,218,868.00	2.09
159	601113	华鼎股份	2,182,780.00	2.06
160	600826	兰生股份	2,151,116.00	2.03
161	300395	菲利华	2,141,490.00	2.02
162	300414	中光防雷	2,139,031.00	2.01

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	2,015,292,368.51
卖出股票收入（成交）总额	1,432,399,201.24

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	17,767,451.42	2.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,767,451.42	2.12

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	019773.SH	25 国债 08	155,000	15,547,897.12	1.86
2	019749.SH	24 国债 15	12,000	1,215,246.90	0.15
3	019766.SH	25 国债 01	10,000	1,004,307.40	0.12

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,706,449.06
2	应收清算款	12,457,423.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,127,545.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,291,418.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

13,239	33,417.82	205,540,201 .68	46.46%	236,878,362 .23	53.54%
--------	-----------	--------------------	--------	--------------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	6,853,153.76	1.5490%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 3 月 21 日）基金份额总额	237,368,420.96
本报告期期初基金份额总额	69,205,099.59
本报告期基金总申购份额	475,061,326.90
减：本报告期基金总赎回份额	101,847,862.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	442,418,563.91

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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领

域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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、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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
国投证券	4	2,151,130,876.59	62.41%	937,912.90	62.41%	-
中信建投证券	2	734,527,052.43	21.31%	320,253.86	21.31%	-
广发证券	6	561,320,746.28	16.28%	244,735.87	16.28%	-
国泰海通	3	56,177.00	0.00%	15.77	0.00%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
天风证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

国海证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
光大证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	减少 2 个

注：1、选择标准

- （1）经营行为稳健规范，合规内控制度健全，财务状况良好，在业内具有良好声誉；
- （2）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；
- （3）具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

（4）具有较强的综合研究能力，拥有独立的研究部门及相当规模的研究团队，有完善的研究报告质量和合规保障机制，能及时向公司提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告，可以根据公司管理基金的特定要求，提供专门研究报告；

（5）公司证券研究报告业务、内控管理、合规风控等方面未受到重大行政处罚或重大行政监管措施；

- （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。

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。

10.7.2 基金租用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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
国投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	4,257,859.87	20.48%	4,000,000.00	14.37%	-	-
广发证券	16,530,840.97	79.52%	23,828,000.00	85.63%	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

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 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-29
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21
4	广发基金管理有限公司关于调整直销柜台转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-14

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	20250101-20250218	22,434,938.68	-	-	22,434,938.68	5.07%
	2	20250205-20250211	-	38,809,325.53	94,212.00	38,715,113.53	8.75%
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

- 1.中国证监会注册广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 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

二〇二五年八月三十日