

# 广发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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56

<b>8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	58
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	58
10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8	其他重大事件.....	62
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	63
11.1	备查文件目录.....	63
11.2	存放地点.....	63
11.3	查阅方式.....	63

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发多因子混合
基金主代码	002943
交易代码	002943
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 30 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,226,107,568.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以企业本身价值为基础，通过深入研究企业基本面，精选出具有清晰经营模式、优良管理架构、稳定财务状况、股价大幅低于内在价值的股票，优选个股力争获取超越市场表现的阿尔法收益。
投资策略	具体策略包括：（1）股票投资策略；（2）债券投资策略；（3）金融衍生品投资策略。 本基金通过以下三个因子精选企业个股：基本面因子、管理因子、价格因子。基本面因子包括公司财务状况、现金流稳定性、上下游产业链环节中所具备的议价能力、公司创新能力；管理因子包括股东价值导向、激励机制合理性、资产配置及经营能力；价格因子包括公司现有资产（包括隐形资产）和负债的净清算价值、在公司持续经营的假定基础上，对公司未来成长性和空间的合理估算运用现金流贴现模型进行测算的结果。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588

传真	020-34281105	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	葛长伟	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告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	1,034,870,374.89
本期利润	1,150,496,484.42
加权平均基金份额本期利润	0.3794
本期加权平均净值利润率	10.17%
本期基金份额净值增长率	11.03%
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	4,625,901,665.88

期末可供分配基金份额利润	1.4339
期末基金资产净值	12,690,061,760.44
期末基金份额净值	3.9336
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2025 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	345.83%

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	3.64%	0.77%	2.13%	0.40%	1.51%	0.37%
过去三个月	3.40%	1.45%	1.57%	0.74%	1.83%	0.71%
过去六个月	11.03%	1.32%	1.14%	0.69%	9.89%	0.63%
过去一年	42.59%	1.64%	12.40%	0.93%	30.19%	0.71%
过去三年	15.14%	1.33%	-1.02%	0.73%	16.16%	0.60%
自基金合同生效起至今	345.83%	1.33%	27.90%	0.77%	317.93%	0.56%

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

（2016 年 12 月 30 日至 2025 年 6 月 30 日）



#### 4 管理人报告

##### 4.1 基金管理人及基金经理情况

##### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

##### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨冬	本基金的基金经理；广发瑞誉一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发价	2021-07-02	-	19年	杨冬先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、权益投资二部副总经理、权益投资二部总经理、专户投资部副总经理。

	<p>值领航一年持有期混合型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；广发稳健策略混合型证券投资基金的基金经理；广发均衡成长混合型证券投资基金的基金经理；广发制造智选股票型发起式证券投资基金的基金经理；广发科技智选股票型发起式证券投资基金的基金经理；公司总经理助理</p>				
唐晓斌	<p>本基金的基金经理；广发多元新兴股票型证券投资基金的基金经理；广发瑞锦一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理；广发瑞誉一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发价值领航一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发远见智选混合型证券投资基</p>	<p>2018-06-25</p>	-	17 年	<p>唐晓斌先生，中国籍，工学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员，广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组组长、研究发展部总助、权益投资二部投资经理、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2014年12月24日至2018年1月9日)、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年11月27日至2019年1月10日)。</p>

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
杨冬	公募基金	8	16,473,475,864.16	2021-07-02
	私募资产管理计划	0	0.00	2013-03-11
	其他组合	1	9,303,908,679.21	2014-12-19
	合计	9	25,777,384,543.37	

注：本报告期内，唐晓斌已于 2025 年 4 月 30 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划；杨冬已于 2025 年 1 月 6 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划，已于 2025 年 1 月 10 日离任其管理的 1 个私募资产管理计划。

#### 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 年上半年资本市场虽然波动较大，但是整体向上趋势比较明显。年初，随着国家新一轮“以旧换新”补贴等财政刺激，以及降准降息的预期，市场表现较为活跃。AI、人形机器人、自动驾驶等科技板块迎来了强劲的上漲。4 月初，美国“关税战”来袭，宣布美国对所有贸易伙伴设立 10% 的“最低基准关税”，并对中国输美商品加征 34% 的“对等关税”。同时，我国宣布进行反制，关税战升级，资本市场也出现了较大的波动。随着中美开始第一轮贸易谈判出现缓和，市场逐渐恢复正常。二季度，科技行业出现明显回落，而“新消费”和创新药则明显上涨。总体看，2025 年上半年虽然宽基指数走势一般，但是板块轮动的特征非常明显。海外算力、新消费和创新药持续上涨，固态电池、可控核聚变、跨境支付、顺周期等低位板块也有着不错的表现。

本报告期内，本基金重点配置了高端制造、金融、创新药、公用事业等细分行业龙头。

#### 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 11.03%，同期业绩比较基准收益率为 1.14%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们更关注国内宏观经济的表现，以及海外关税政策的变化。关税风波告一段落，国内经济以及相关的政策更值得关注。同时，随着 9 月份美国可能进入降息周期，非美市场的流动性迎来利好。我们更看好港股的投资机会。

我们希望能够寻找 ROE 持续提升的公司。过去很长时间，企业间的竞争是非常激烈的，因为能见到成效。这是因为在增量市场环境下，激烈的价格竞争可以获得更多增量市场的份额。但是，从

当前市场看，激烈的价格竞争已经带来了一些不良的结果，越来越多的企业开始将重心从追求规模转变到提高企业盈利。能够在激烈的竞争环境下，通过自身的技术和成本优势持续提升盈利水平的公司，值得我们深入挖掘。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法

律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：广发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
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	869,742,539.98	626,136,555.31
结算备付金		27,697,593.00	9,675,151.60
存出保证金		2,967,510.11	3,073,706.79
交易性金融资产	6.4.7.2	11,902,670,101.24	9,627,981,646.55
其中：股票投资		11,872,015,614.26	9,484,710,389.17
基金投资		-	-
债券投资		30,654,486.98	143,271,257.38
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		49,643,556.21	12,932,133.96
应收股利		-	-
应收申购款		21,481,668.93	14,808,732.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,874,202,969.47	10,294,607,927.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		28,602,257.18	6,755,743.78
应付赎回款		133,688,981.44	35,541,294.13
应付管理人报酬		12,208,907.04	10,691,141.89
应付托管费		2,034,817.83	1,781,857.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.38	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	7,606,239.16	7,859,506.77
负债合计		184,141,209.03	62,629,543.92
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	3,226,107,568.15	2,888,212,333.27
未分配利润	6.4.7.9	9,463,954,192.29	7,343,766,049.83
净资产合计		12,690,061,760.44	10,231,978,383.10
负债和净资产总计		12,874,202,969.47	10,294,607,927.02

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 3.9336 元，基金份额总额 3,226,107,568.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发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
<b>一、营业总收入</b>		<b>1,229,032,944.43</b>	<b>-902,346,116.67</b>
1.利息收入		1,834,589.93	1,106,741.48
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,834,589.93	1,106,741.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,099,909,773.18	-1,420,875,758.09
其中：股票投资收益	6.4.7.11	968,780,929.01	-1,516,697,708.86
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	136,815.45	1,699,123.64
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	130,992,028.72	94,122,827.13
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	115,626,109.53	510,871,912.73
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	11,662,471.79	6,550,987.21
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>78,536,460.01</b>	<b>75,366,772.77</b>
1. 管理人报酬		67,207,549.57	64,492,791.64
2. 托管费		11,201,258.30	10,748,798.57
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		2.36	32.36
8. 其他费用	6.4.7.21	127,649.78	125,150.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）</b>		<b>1,150,496,484.42</b>	<b>-977,712,889.44</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,150,496,484.42</b>	<b>-977,712,889.44</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>1,150,496,484.42</b>	<b>-977,712,889.44</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发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	2,888,212,333.27	7,343,766,049.83	10,231,978,383.10
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,888,212,333.27	7,343,766,049.83	10,231,978,383.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	337,895,234.88	2,120,188,142.46	2,458,083,377.34
（一）、综合收益总额	-	1,150,496,484.42	1,150,496,484.42
（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）	337,895,234.88	969,691,658.04	1,307,586,892.92
其中：1. 基金申购款	1,384,433,427.90	3,846,038,375.54	5,230,471,803.44
2. 基金赎回款	-1,046,538,193.02	-2,876,346,717.50	-3,922,884,910.52
（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	3,226,107,568.15	9,463,954,192.29	12,690,061,760.44
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	4,050,560,126.93	8,171,323,234.08	12,221,883,361.01
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	4,050,560,126.93	8,171,323,234.08	12,221,883,361.01

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-689,186,339.82	-2,259,655,223.43	-2,948,841,563.25
（一）、综合收益总额	-	-977,712,889.44	-977,712,889.44
（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）	-689,186,339.82	-1,281,942,333.99	-1,971,128,673.81
其中：1.基金申购款	288,946,614.22	541,968,667.43	830,915,281.65
2.基金赎回款	-978,132,954.04	-1,823,911,001.42	-2,802,043,955.46
（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	3,361,373,787.11	5,911,668,010.65	9,273,041,797.76

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[2016]1278 号《关于准予广发多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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 2016 年 11 月 30 日向社会公开发行募集并于 2016 年 12 月 30 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2016 年 11 月 30 日至 2016 年 12 月 27 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 200,788,412.15 元，有效认购户数为 421 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 23,359.93 元，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。上述资金业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	869,742,539.98
等于：本金	869,672,958.56
加：应计利息	69,581.42
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	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
合计	869,742,539.98

### 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	11,260,444,575.75	-	11,872,015,614.26	611,571,038.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	356,432.84	30,654,486.98	544,754.17
	银行间市场	-	-	-
	合计	356,432.84	30,654,486.98	544,754.17
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,290,197,875.72	356,432.84	11,902,670,101.24	612,115,792.68

### 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 2025 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	7,501,727.73
其中：交易所市场	7,501,727.73
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,511.43
合计	7,606,239.16

#### 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	2,888,212,333.27	2,888,212,333.27
本期申购	1,384,433,427.90	1,384,433,427.90
本期赎回（以“-”号填列）	-1,046,538,193.02	-1,046,538,193.02
本期末	3,226,107,568.15	3,226,107,568.15

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	3,150,974,181.73	4,192,791,868.10	7,343,766,049.83
本期期初	3,150,974,181.73	4,192,791,868.10	7,343,766,049.83
本期利润	1,034,870,374.89	115,626,109.53	1,150,496,484.42
本期基金份额交易产生的变动数	440,057,109.26	529,634,548.78	969,691,658.04
其中：基金申购款	1,742,067,166.27	2,103,971,209.27	3,846,038,375.54
基金赎回款	-1,302,010,057.01	-1,574,336,660.49	-2,876,346,717.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,625,901,665.88	4,838,052,526.41	9,463,954,192.29

#### 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
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	38,375.54
其他	87,723.84
合计	1,834,589.93

### 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	968,780,929.01
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	968,780,929.01

#### 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	16,653,764,804.03
减：卖出股票成本总额	15,659,364,112.45
减：交易费用	25,619,762.57
买卖股票差价收入	968,780,929.01

### 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	719,881.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-583,066.00
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	136,815.45

#### 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	115,225,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	113,883,066.00

减：应计利息总额	1,925,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-583,066.00

#### 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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	130,992,028.72
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	130,992,028.72

#### 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	115,626,109.53
——股票投资	114,842,511.93
——债券投资	783,597.60
——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	115,626,109.53

#### 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	10,380,944.71
基金转换费收入	1,281,527.08
合计	11,662,471.79

#### 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	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	9,249.21
账户维护费	18,000.00
其他	5,189.14
合计	127,649.78

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	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	555,847,242.11	1.61%	1,741,508,864.15	9.82%

#### 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 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	
	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	148,800.00	8.82%	95,396,090.11	46.82%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	242,349.42	1.61%	242,349.42	3.23%
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	1,647,286.51	10.61%	518,352.37	7.35%

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	67,207,549.57	64,492,791.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,069,898.85	17,463,881.25
应支付基金管理人的净管理费	48,137,650.72	47,028,910.39

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

约定年费率为 1.20%。

##### 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	11,201,258.30	10,748,798.57

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	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
报告期初持有的基金份额	8,756,893.74	8,756,893.74
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,756,893.74	8,756,893.74
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.27%	0.26%

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	869,742,539.98	1,708,490.55	297,751,231.02	1,016,682.46

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994.00	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701.00	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397.00	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	227.00	5,855.50	18,087.36	-
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	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	350.00	9,620.72	15,827.00	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	166.00	15,521.00	15,049.56	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182.00	5,447.00	14,172.34	-
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	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-
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	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
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	-
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	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-

				受限						
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	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
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
68831	仕佳光	2025-06	重大事	38.05	2025-0	39.98	99,319.00	2,944,929.11	3,779,087.95	-

3	子	-30	项停牌		7-11					
---	---	-----	-----	--	------	--	--	--	--	--

### 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	28,355,761.10	122,021,850.63
合计	28,355,761.10	122,021,850.63

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 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	2,298,725.88	88,381.43
未评级	-	21,161,025.32
合计	2,298,725.88	21,249,406.75

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
<b>资产</b>					
货币资金	869,742,539.98	-	-	-	869,742,539.98
结算备付金	27,697,593.00	-	-	-	27,697,593.00
存出保证金	2,967,510.11	-	-	-	2,967,510.11
交易性金融资产	30,654,486.98	-	-	11,872,015,614.26	11,902,670,101.24
应收清算款	-	-	-	49,643,556.21	49,643,556.21
应收申购款	-	-	-	21,481,668.93	21,481,668.93
资产总计	931,062,130.07	-	-	11,943,140,839.40	12,874,202,969.47
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	28,602,257.18	28,602,257.18
应付赎回款	-	-	-	133,688,981.44	133,688,981.44

应付管理人报酬	-	-	-	12,208,907.04	12,208,907.04
应付托管费	-	-	-	2,034,817.83	2,034,817.83
应交税费	-	-	-	6.38	6.38
其他负债	-	-	-	7,606,239.16	7,606,239.16
负债总计	-	-	-	184,141,209.03	184,141,209.03
利率敏感度缺口	931,062,130.07	-	-	11,758,999,630.37	12,690,061,760.44
<b>上年度末</b>					
<b>2024 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	626,136,555.31	-	-	-	626,136,555.31
结算备付金	9,675,151.60	-	-	-	9,675,151.60
存出保证金	3,073,706.79	-	-	-	3,073,706.79
交易性金融资产	143,271,257.38	-	-	9,484,710,389.17	9,627,981,646.55
应收清算款	-	-	-	12,932,133.96	12,932,133.96
应收申购款	-	-	-	14,808,732.81	14,808,732.81
资产总计	782,156,671.08	-	-	9,512,451,255.94	10,294,607,927.02
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	6,755,743.78	6,755,743.78
应付赎回款	-	-	-	35,541,294.13	35,541,294.13
应付管理人报酬	-	-	-	10,691,141.89	10,691,141.89
应付托管费	-	-	-	1,781,857.00	1,781,857.00
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	7,859,506.77	7,859,506.77
负债总计	-	-	-	62,629,543.92	62,629,543.92
利率敏感度缺口	782,156,671.08	-	-	9,449,821,712.02	10,231,978,383.10

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	-4,848.00	-120,806.19
市场利率下降 25 个基点	4,849.67	121,039.42

#### 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	11,872,015,614.26	93.55	9,484,710,389.17	92.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,298,725.88	0.02	88,381.43	0.00
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	11,874,314,340.14	93.57	9,484,798,770.60	92.70

##### 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）		
		<table border="1"> <thead> <tr> <th>本期末 2025 年 6 月 30 日</th> <th>上年度末 2024 年 12 月 31 日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日			

	上升 5%	695,425,473.25	471,275,248.07
	下降 5%	-695,425,473.25	-471,275,248.07

#### 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	11,870,136,097.23
第二层次	32,150,234.59
第三层次	383,769.42
合计	11,902,670,101.24

###### 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	11,872,015,614.26	92.22
	其中：股票	11,872,015,614.26	92.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,654,486.98	0.24
	其中：债券	30,654,486.98	0.24
	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	897,440,132.98	6.97
8	其他各项资产	74,092,735.25	0.58
9	合计	12,874,202,969.47	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	1,722,666.10	0.01
B	采矿业	93,195,476.46	0.73
C	制造业	6,852,757,164.05	54.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,977,053.38	0.47
E	建筑业	76,837,176.86	0.61
F	批发和零售业	147,394,009.80	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	745,708,539.20	5.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	181,417,861.25	1.43

J	金融业	3,335,104,345.93	26.28
K	房地产业	31,111,294.00	0.25
L	租赁和商务服务业	60,942,114.68	0.48
M	科学研究和技术服务业	134,475,672.90	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	97,109,800.45	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	54,262,439.20	0.43
S	综合	-	-
	合计	11,872,015,614.26	93.55

### 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	601688	华泰证券	53,568,071	954,047,344.51	7.52
2	002422	科伦药业	24,233,512	870,467,751.04	6.86
3	600016	民生银行	128,260,367	609,236,743.25	4.80
4	300750	宁德时代	2,396,098	604,343,837.56	4.76
5	002352	顺丰控股	11,561,654	563,746,249.04	4.44
6	601318	中国平安	9,762,800	541,640,144.00	4.27
7	601211	国泰海通	27,936,300	535,259,508.00	4.22
8	600388	龙净环保	40,222,850	482,674,200.00	3.80
9	688027	国盾量子	1,428,590	392,876,535.90	3.10
10	000960	锡业股份	24,377,800	372,980,340.00	2.94
11	601138	工业富联	15,364,900	328,501,562.00	2.59
12	300499	高澜股份	11,799,796	210,036,368.80	1.66
13	301031	中熔电气	2,501,510	199,245,271.50	1.57
14	600926	杭州银行	11,478,373	193,066,233.86	1.52
15	002920	德赛西威	1,794,900	183,313,137.00	1.44
16	688522	纳睿雷达	3,038,552	155,634,633.44	1.23
17	000893	亚钾国际	4,979,200	150,073,088.00	1.18

18	600958	东方证券	15,156,300	146,712,984.00	1.16
19	688548	广钢气体	14,035,271	140,633,415.42	1.11
20	600919	江苏银行	11,129,765	132,889,394.10	1.05
21	600309	万华化学	2,055,500	111,531,430.00	0.88
22	300432	富临精工	8,230,880	107,577,601.60	0.85
23	688169	石头科技	679,241	106,335,178.55	0.84
24	301508	中机认检	2,988,500	101,011,300.00	0.80
25	601126	四方股份	6,192,500	100,751,975.00	0.79
26	600595	中孚实业	20,604,900	90,249,462.00	0.71
27	300679	电连技术	1,716,800	77,908,384.00	0.61
28	600323	瀚蓝环境	2,898,000	70,566,300.00	0.56
29	603167	渤海轮渡	5,999,900	68,398,860.00	0.54
30	000997	新大陆	1,963,700	63,584,606.00	0.50
31	603312	西典新能	1,662,012	60,945,980.04	0.48
32	301511	德福科技	2,850,340	59,002,038.00	0.46
33	002335	科华数据	1,379,500	58,877,060.00	0.46
34	600096	云天化	2,574,601	56,563,983.97	0.45
35	600030	中信证券	2,009,275	55,496,175.50	0.44
36	603119	浙江荣泰	1,044,980	48,319,875.20	0.38
37	600480	凌云股份	3,778,546	45,984,904.82	0.36
38	301162	国能日新	875,820	45,262,377.60	0.36
39	601919	中远海控	2,925,349	43,997,248.96	0.35
40	689009	九号公司	643,172	38,056,487.24	0.30
41	300953	震裕科技	351,120	35,586,012.00	0.28
42	688336	三生国健	628,820	34,107,196.80	0.27
43	600660	福耀玻璃	590,010	33,636,470.10	0.27
44	002318	久立特材	1,418,600	33,181,054.00	0.26
45	002407	多氟多	2,715,640	33,103,651.60	0.26
46	600499	科达制造	3,371,500	33,040,700.00	0.26
47	002223	鱼跃医疗	924,273	32,904,118.80	0.26
48	600873	梅花生物	3,058,800	32,698,572.00	0.26
49	603596	伯特利	609,400	32,109,286.00	0.25
50	002926	华西证券	3,530,600	31,563,564.00	0.25
51	300537	广信材料	1,177,800	30,187,014.00	0.24
52	600335	国机汽车	4,558,800	29,404,260.00	0.23
53	300373	扬杰科技	555,900	28,851,210.00	0.23
54	002821	凯莱英	326,692	28,830,569.00	0.23
55	600268	国电南自	3,543,908	27,713,360.56	0.22
56	600295	鄂尔多斯	3,161,640	27,537,884.40	0.22
57	688188	柏楚电子	209,110	27,531,422.60	0.22
58	001914	招商积余	2,223,700	27,507,169.00	0.22
59	002001	新和成	1,290,100	27,440,427.00	0.22
60	600098	广州发展	4,385,956	27,412,225.00	0.22
61	601958	金铂股份	2,475,500	27,081,970.00	0.21

62	688323	瑞华泰	1,840,659	26,707,962.09	0.21
63	001203	大中矿业	2,822,700	26,674,515.00	0.21
64	301160	翔楼新材	327,900	26,258,232.00	0.21
65	600352	浙江龙盛	2,579,900	26,211,784.00	0.21
66	600928	西安银行	6,364,600	24,949,232.00	0.20
67	002215	诺普信	2,378,700	24,571,971.00	0.19
68	688008	澜起科技	282,907	23,198,374.00	0.18
69	002328	新朋股份	3,935,320	22,903,562.40	0.18
70	000719	中原传媒	1,838,220	22,812,310.20	0.18
71	300982	苏文电能	1,235,200	22,221,248.00	0.18
72	600058	五矿发展	2,863,900	22,137,947.00	0.17
73	002443	金洲管道	3,446,600	21,920,376.00	0.17
74	000404	长虹华意	2,996,850	21,277,635.00	0.17
75	603508	思维列控	801,600	21,226,368.00	0.17
76	601886	江河集团	3,411,502	20,980,737.30	0.17
77	600704	物产中大	3,956,900	20,852,863.00	0.16
78	300005	探路者	2,434,600	20,767,138.00	0.16
79	000333	美的集团	286,200	20,663,640.00	0.16
80	688190	云路股份	220,822	20,439,284.32	0.16
81	002937	兴瑞科技	1,226,900	20,391,078.00	0.16
82	603885	吉祥航空	1,473,800	19,852,086.00	0.16
83	600887	伊利股份	706,500	19,697,220.00	0.16
84	002027	分众传媒	2,639,000	19,264,700.00	0.15
85	601311	骆驼股份	2,113,500	19,084,905.00	0.15
86	300059	东方财富	815,300	18,857,889.00	0.15
87	601799	星宇股份	149,200	18,650,000.00	0.15
88	600741	华域汽车	1,053,700	18,597,805.00	0.15
89	601083	锦江航运	1,667,100	18,521,481.00	0.15
90	002138	顺络电子	636,600	17,901,192.00	0.14
91	300088	长信科技	2,974,300	17,726,828.00	0.14
92	600998	九州通	3,446,270	17,713,827.80	0.14
93	600166	福田汽车	6,510,100	17,642,371.00	0.14
94	002081	金螳螂	5,094,600	17,474,478.00	0.14
95	600153	建发股份	1,683,800	17,461,006.00	0.14
96	600167	联美控股	3,100,003	17,422,016.86	0.14
97	002091	江苏国泰	2,391,300	17,384,751.00	0.14
98	300707	威唐工业	1,245,700	17,203,117.00	0.14
99	300482	万孚生物	795,400	16,981,790.00	0.13
100	600219	南山铝业	4,417,500	16,919,025.00	0.13
101	002182	宝武镁业	1,376,505	16,848,421.20	0.13
102	600757	长江传媒	1,754,900	16,285,472.00	0.13
103	603067	振华股份	974,540	14,851,989.60	0.12
104	001301	尚太科技	288,300	14,057,508.00	0.11
105	000729	燕京啤酒	1,066,864	13,794,551.52	0.11

106	600582	天地科技	2,249,500	13,474,505.00	0.11
107	600458	时代新材	941,200	12,913,264.00	0.10
108	688622	禾信仪器	161,371	12,695,056.57	0.10
109	688668	鼎通科技	202,793	12,666,450.78	0.10
110	000582	北部湾港	1,442,700	11,902,275.00	0.09
111	002142	宁波银行	430,200	11,770,272.00	0.09
112	002014	永新股份	969,984	11,756,206.08	0.09
113	002913	奥士康	395,000	11,616,950.00	0.09
114	002483	润邦股份	1,823,100	11,394,375.00	0.09
115	002597	金禾实业	481,700	11,344,035.00	0.09
116	603993	洛阳钼业	1,334,300	11,234,806.00	0.09
117	301102	兆讯传媒	1,027,645	11,221,883.40	0.09
118	601288	农业银行	1,901,600	11,181,408.00	0.09
119	600004	白云机场	1,222,000	11,120,200.00	0.09
120	002284	亚太股份	997,625	11,023,756.25	0.09
121	601600	中国铝业	1,564,700	11,015,488.00	0.09
122	002441	众业达	1,214,200	11,012,794.00	0.09
123	601717	中创智领	633,400	10,527,108.00	0.08
124	002545	东方铁塔	1,140,800	10,141,712.00	0.08
125	601555	东吴证券	1,118,200	9,784,250.00	0.08
126	002233	塔牌集团	1,321,700	9,780,580.00	0.08
127	600742	富维股份	1,017,520	9,676,615.20	0.08
128	688128	中国电研	394,950	9,676,275.00	0.08
129	300320	海达股份	971,100	9,652,734.00	0.08
130	301327	华宝新能	187,368	9,623,220.48	0.08
131	603444	吉比特	31,700	9,571,815.00	0.08
132	688093	世华科技	300,071	9,317,204.55	0.07
133	605080	浙江自然	331,500	9,215,700.00	0.07
134	301362	民爆光电	224,100	9,145,521.00	0.07
135	002461	珠江啤酒	802,800	9,063,612.00	0.07
136	603929	亚翔集成	257,500	9,038,250.00	0.07
137	301291	明阳电气	217,733	8,959,712.95	0.07
138	688596	正帆科技	260,974	8,852,238.08	0.07
139	002539	云图控股	943,100	8,846,278.00	0.07
140	600496	精工钢构	2,763,560	8,843,392.00	0.07
141	603170	宝立食品	706,300	8,807,561.00	0.07
142	601811	新华文轩	603,700	8,795,909.00	0.07
143	301109	军信股份	590,690	8,789,467.20	0.07
144	601226	华电科工	1,440,800	8,788,880.00	0.07
145	600713	南京医药	1,733,100	8,769,486.00	0.07
146	688403	汇成股份	836,818	8,694,539.02	0.07
147	603680	今创集团	756,400	8,645,652.00	0.07
148	600531	豫光金铅	1,116,600	8,642,484.00	0.07
149	600694	大商股份	464,900	8,623,895.00	0.07

150	600420	国药现代	775,552	8,259,628.80	0.07
151	300232	洲明科技	1,137,200	8,233,328.00	0.06
152	300973	立高食品	167,149	8,151,856.73	0.06
153	600578	京能电力	1,811,500	8,133,635.00	0.06
154	603328	依顿电子	820,931	8,053,333.11	0.06
155	000885	城发环境	599,000	7,978,680.00	0.06
156	002206	海利得	1,541,800	7,878,598.00	0.06
157	002487	大金重工	236,600	7,784,140.00	0.06
158	600237	铜峰电子	1,072,100	7,772,725.00	0.06
159	603173	福斯达	216,900	7,710,795.00	0.06
160	301061	匠心家居	99,140	7,687,315.60	0.06
161	301230	泓博医药	221,500	7,624,030.00	0.06
162	300476	胜宏科技	55,400	7,444,652.00	0.06
163	002155	湖南黄金	416,350	7,431,847.50	0.06
164	300990	同飞股份	148,500	7,410,150.00	0.06
165	002734	利民股份	398,600	7,294,380.00	0.06
166	600566	济川药业	275,800	7,261,814.00	0.06
167	601336	新华保险	119,758	7,005,843.00	0.06
168	688208	道通科技	228,158	6,981,634.80	0.06
169	601988	中国银行	1,202,600	6,758,612.00	0.05
170	603218	日月股份	522,700	6,633,063.00	0.05
171	000920	沃顿科技	611,300	6,602,040.00	0.05
172	600547	山东黄金	204,800	6,539,264.00	0.05
173	300115	长盈精密	304,000	6,505,600.00	0.05
174	301119	正强股份	180,900	6,396,624.00	0.05
175	002697	红旗连锁	1,154,000	6,173,900.00	0.05
176	300666	江丰电子	82,700	6,128,070.00	0.05
177	603612	索通发展	331,300	6,089,294.00	0.05
178	600036	招商银行	131,200	6,028,640.00	0.05
179	603259	药明康德	86,500	6,016,075.00	0.05
180	603373	安邦护卫	120,676	5,946,913.28	0.05
181	300012	华测检测	467,800	5,468,582.00	0.04
182	000975	山金国际	272,400	5,159,256.00	0.04
183	601939	建设银行	530,600	5,008,864.00	0.04
184	600351	亚宝药业	819,100	4,971,937.00	0.04
185	600519	贵州茅台	3,500	4,933,320.00	0.04
186	601900	南方传媒	309,500	4,840,580.00	0.04
187	000987	越秀资本	697,000	4,781,420.00	0.04
188	000415	渤海租赁	1,392,000	4,635,360.00	0.04
189	688372	伟测科技	76,556	4,623,982.40	0.04
190	002649	博彦科技	315,800	4,588,574.00	0.04
191	300685	艾德生物	208,300	4,484,699.00	0.04
192	688112	鼎阳科技	121,286	4,483,943.42	0.04
193	605555	德昌股份	268,790	4,453,850.30	0.04

194	600409	三友化工	915,700	4,450,302.00	0.04
195	002056	横店东磁	314,200	4,445,930.00	0.04
196	603699	纽威股份	142,100	4,429,257.00	0.03
197	605305	中际联合	158,704	4,408,797.12	0.03
198	601107	四川成渝	731,900	4,406,038.00	0.03
199	603816	顾家家居	172,400	4,399,648.00	0.03
200	300054	鼎龙股份	153,400	4,399,512.00	0.03
201	002293	罗莱生活	502,800	4,394,472.00	0.03
202	601330	绿色动力	574,400	4,388,416.00	0.03
203	300048	合康新能	744,400	4,369,628.00	0.03
204	603355	莱克电气	194,600	4,362,932.00	0.03
205	002947	恒铭达	129,900	4,311,381.00	0.03
206	600750	江中药业	197,000	4,300,510.00	0.03
207	688213	思特威-W	38,584	3,944,056.48	0.03
208	002345	潮宏基	265,300	3,881,339.00	0.03
209	603239	浙江仙通	255,100	3,854,561.00	0.03
210	603808	歌力思	458,500	3,805,550.00	0.03
211	605088	冠盛股份	100,100	3,795,792.00	0.03
212	603236	移远通信	44,200	3,792,360.00	0.03
213	688313	仕佳光子	99,319	3,779,087.95	0.03
214	688256	寒武纪-U	6,251	3,759,976.50	0.03
215	300502	新易盛	29,517	3,749,249.34	0.03
216	600771	广誉远	185,199	3,733,611.84	0.03
217	300824	北鼎股份	311,800	3,719,774.00	0.03
218	600685	中船防务	136,800	3,719,592.00	0.03
219	002543	万和电气	334,000	3,710,740.00	0.03
220	001389	广合科技	63,000	3,702,510.00	0.03
221	002444	巨星科技	144,300	3,681,093.00	0.03
222	002668	TCL 智家	375,385	3,667,511.45	0.03
223	002283	天润工业	614,600	3,663,016.00	0.03
224	688568	中科星图	101,573	3,657,643.73	0.03
225	002011	盾安环境	313,300	3,634,280.00	0.03
226	601339	百隆东方	769,400	3,631,568.00	0.03
227	603337	杰克股份	101,200	3,631,056.00	0.03
228	002250	联化科技	328,800	3,616,800.00	0.03
229	002705	新宝股份	244,700	3,597,090.00	0.03
230	688099	晶晨股份	49,570	3,519,965.70	0.03
231	605007	五洲特纸	295,000	3,395,450.00	0.03
232	600186	莲花控股	551,800	3,310,800.00	0.03
233	601319	中国人保	377,339	3,286,622.69	0.03
234	002380	科远智慧	134,200	3,281,190.00	0.03
235	601665	齐鲁银行	509,800	3,221,936.00	0.03
236	600900	长江电力	104,100	3,137,574.00	0.02
237	600507	方大特钢	712,361	3,091,646.74	0.02

238	300019	硅宝科技	151,900	2,998,506.00	0.02
239	300207	欣旺达	145,700	2,922,742.00	0.02
240	601166	兴业银行	123,500	2,882,490.00	0.02
241	003006	百亚股份	105,100	2,877,638.00	0.02
242	300976	达瑞电子	57,240	2,849,979.60	0.02
243	300770	新媒股份	70,299	2,811,257.01	0.02
244	002588	史丹利	313,300	2,760,173.00	0.02
245	600064	南京高科	349,900	2,697,729.00	0.02
246	603345	安井食品	31,400	2,525,188.00	0.02
247	002835	同为股份	134,300	2,520,811.00	0.02
248	002533	金杯电工	255,700	2,490,518.00	0.02
249	601009	南京银行	213,500	2,480,870.00	0.02
250	603367	辰欣药业	173,400	2,431,068.00	0.02
251	600276	恒瑞医药	46,700	2,423,730.00	0.02
252	002906	华阳集团	74,497	2,421,897.47	0.02
253	000650	仁和药业	440,750	2,388,865.00	0.02
254	000728	国元证券	293,230	2,313,584.70	0.02
255	603855	华荣股份	103,900	2,299,307.00	0.02
256	603809	豪能股份	147,321	2,254,011.30	0.02
257	002837	英维克	75,660	2,247,858.60	0.02
258	000651	格力电器	49,700	2,232,524.00	0.02
259	000690	宝新能源	486,900	2,215,395.00	0.02
260	301330	熵基科技	81,600	2,205,648.00	0.02
261	002296	辉煌科技	197,400	2,201,010.00	0.02
262	600479	千金药业	208,800	2,171,520.00	0.02
263	601899	紫金矿业	109,300	2,131,350.00	0.02
264	002999	天禾股份	293,000	2,045,140.00	0.02
265	688004	博汇科技	102,629	2,042,317.10	0.02
266	002454	松芝股份	264,400	2,041,168.00	0.02
267	002777	久远银海	111,700	2,039,642.00	0.02
268	603229	奥翔药业	233,600	2,036,992.00	0.02
269	002993	奥海科技	49,100	2,036,177.00	0.02
270	605259	绿田机械	103,500	2,029,635.00	0.02
271	300929	华骐环保	192,200	2,029,632.00	0.02
272	688501	青达环保	72,711	2,025,001.35	0.02
273	003011	海象新材	108,500	1,993,145.00	0.02
274	301037	保立佳	151,900	1,954,953.00	0.02
275	600211	西藏药业	52,900	1,947,778.00	0.02
276	002061	浙江交科	490,236	1,941,334.56	0.02
277	002939	长城证券	231,200	1,937,456.00	0.02
278	002209	达意隆	150,800	1,892,540.00	0.01
279	000725	京东方 A	466,600	1,861,734.00	0.01
280	600901	江苏金租	301,100	1,824,666.00	0.01
281	000783	长江证券	263,200	1,823,976.00	0.01

282	002073	软控股份	204,408	1,817,187.12	0.01
283	002371	北方华创	4,100	1,813,061.00	0.01
284	601728	中国电信	228,800	1,773,200.00	0.01
285	301321	翰博高新	114,900	1,756,821.00	0.01
286	601668	中国建筑	304,000	1,754,080.00	0.01
287	300570	太辰光	18,089	1,743,417.82	0.01
288	000026	飞亚达	110,200	1,743,364.00	0.01
289	603786	科博达	31,100	1,723,251.00	0.01
290	002714	牧原股份	41,000	1,722,410.00	0.01
291	001267	汇绿生态	183,100	1,717,478.00	0.01
292	300758	七彩化学	114,000	1,703,160.00	0.01
293	000937	冀中能源	295,400	1,698,550.00	0.01
294	600941	中国移动	14,900	1,676,995.00	0.01
295	002020	京新药业	128,000	1,670,400.00	0.01
296	603317	天味食品	149,497	1,662,406.64	0.01
297	603579	荣泰健康	60,360	1,645,413.60	0.01
298	002546	新联电子	298,600	1,639,314.00	0.01
299	300777	中简科技	44,700	1,620,375.00	0.01
300	603678	火炬电子	42,500	1,616,275.00	0.01
301	300708	聚灿光电	134,300	1,611,600.00	0.01
302	002979	雷赛智能	36,274	1,606,212.72	0.01
303	000988	华工科技	34,100	1,603,041.00	0.01
304	601857	中国石油	186,600	1,595,430.00	0.01
305	002895	川恒股份	70,200	1,583,712.00	0.01
306	300788	中信出版	47,400	1,520,592.00	0.01
307	605168	三人行	51,600	1,518,588.00	0.01
308	601818	光大银行	363,300	1,507,695.00	0.01
309	003000	劲仔食品	113,100	1,496,313.00	0.01
310	603519	立霸股份	121,800	1,481,088.00	0.01
311	601006	大秦铁路	221,700	1,463,220.00	0.01
312	300658	延江股份	221,000	1,429,870.00	0.01
313	603871	嘉友国际	132,440	1,423,730.00	0.01
314	601328	交通银行	177,600	1,420,800.00	0.01
315	603983	丸美生物	33,700	1,419,781.00	0.01
316	603992	松霖科技	64,700	1,414,342.00	0.01
317	600938	中国海油	53,400	1,394,274.00	0.01
318	601658	邮储银行	247,700	1,354,919.00	0.01
319	603799	华友钴业	36,200	1,340,124.00	0.01
320	601179	中国西电	218,200	1,339,748.00	0.01
321	603766	隆鑫通用	104,700	1,335,972.00	0.01
322	603368	柳药集团	78,300	1,324,053.00	0.01
323	301507	民生健康	90,500	1,313,155.00	0.01
324	600535	天士力	82,200	1,286,430.00	0.01
325	600989	宝丰能源	79,600	1,284,744.00	0.01

326	000869	张裕 A	57,500	1,220,725.00	0.01
327	688082	盛美上海	10,035	1,143,387.90	0.01
328	301295	美硕科技	47,700	1,138,122.00	0.01
329	300304	云意电气	153,700	1,118,936.00	0.01
330	002448	中原内配	132,700	1,110,699.00	0.01
331	688388	嘉元科技	54,821	1,100,805.68	0.01
332	002958	青农商行	298,800	1,078,668.00	0.01
333	300039	上海凯宝	177,700	1,076,862.00	0.01
334	688329	艾隆科技	55,477	1,067,377.48	0.01
335	688698	伟创电气	22,227	1,049,114.40	0.01
336	601218	吉鑫科技	253,300	1,041,063.00	0.01
337	601088	中国神华	24,900	1,009,446.00	0.01
338	600319	亚星化学	152,400	995,172.00	0.01
339	600602	云赛智联	47,200	952,024.00	0.01
340	688026	洁特生物	57,804	947,985.60	0.01
341	688021	奥福科技	61,723	943,744.67	0.01
342	688565	力源科技	101,884	942,427.00	0.01
343	688335	复洁环保	77,210	941,962.00	0.01
344	688485	九州一轨	86,425	941,168.25	0.01
345	603311	金海高科	84,800	937,888.00	0.01
346	603177	德创环保	102,900	936,390.00	0.01
347	688193	仁度生物	22,248	935,083.44	0.01
348	301010	晶雪节能	54,400	931,328.00	0.01
349	301072	中捷精工	43,300	929,651.00	0.01
350	300931	通用电梯	121,800	929,334.00	0.01
351	688671	碧兴物联	43,517	929,087.95	0.01
352	300420	五洋自控	269,800	928,112.00	0.01
353	301448	开创电气	36,100	925,243.00	0.01
354	600298	安琪酵母	26,300	924,971.00	0.01
355	688450	光格科技	34,986	924,330.12	0.01
356	301359	东南电子	44,840	923,255.60	0.01
357	603380	易德龙	34,700	923,020.00	0.01
358	688558	国盛智科	36,551	922,547.24	0.01
359	301395	仁信新材	68,200	920,018.00	0.01
360	002394	联发股份	111,700	919,291.00	0.01
361	688670	金迪克	65,845	918,537.75	0.01
362	300948	冠中生态	84,300	918,027.00	0.01
363	301529	福赛科技	29,300	917,969.00	0.01
364	300405	科隆股份	162,400	917,560.00	0.01
365	603309	维力医疗	72,100	917,112.00	0.01
366	001210	金房能源	66,980	916,956.20	0.01
367	301043	绿岛风	29,800	916,648.00	0.01
368	688038	中科通达	57,759	916,635.33	0.01
369	603515	欧普照明	50,900	915,691.00	0.01

370	300371	汇中股份	78,900	915,240.00	0.01
371	300305	裕兴股份	143,400	914,892.00	0.01
372	603172	万丰股份	57,400	914,382.00	0.01
373	301446	福事特	38,800	913,352.00	0.01
374	300616	尚品宅配	69,300	912,681.00	0.01
375	301006	迈拓股份	58,700	912,198.00	0.01
376	300668	杰恩设计	52,500	911,925.00	0.01
377	000586	汇源通信	82,000	911,840.00	0.01
378	688350	富淼科技	57,184	911,512.96	0.01
379	300417	南华仪器	72,800	910,728.00	0.01
380	688355	明志科技	51,800	910,126.00	0.01
381	688328	深科达	40,162	909,669.30	0.01
382	600099	林海股份	83,900	909,476.00	0.01
383	301503	智迪科技	23,900	909,395.00	0.01
384	688162	巨一科技	33,363	908,808.12	0.01
385	688367	工大高科	51,461	908,286.65	0.01
386	002382	蓝帆医疗	162,100	907,760.00	0.01
387	300923	研奥股份	36,400	906,360.00	0.01
388	300717	华信新材	49,900	904,687.00	0.01
389	688677	海泰新光	23,185	904,446.85	0.01
390	300621	维业股份	101,700	904,113.00	0.01
391	600067	冠城新材	303,300	903,834.00	0.01
392	000550	江铃汽车	44,400	902,652.00	0.01
393	001358	兴欣新材	37,700	902,161.00	0.01
394	002871	伟隆股份	80,900	900,417.00	0.01
395	301081	严牌股份	93,300	900,345.00	0.01
396	002669	康达新材	77,600	900,160.00	0.01
397	300535	达威股份	54,200	899,178.00	0.01
398	300610	晨化股份	78,800	898,320.00	0.01
399	001366	播恩集团	73,500	897,435.00	0.01
400	001336	楚环科技	42,100	895,467.00	0.01
401	002188	中天服务	160,800	894,048.00	0.01
402	603729	龙韵股份	52,200	893,664.00	0.01
403	601686	友发集团	157,100	892,328.00	0.01
404	603272	联翔股份	51,800	882,672.00	0.01
405	603269	海鸥股份	94,360	879,435.20	0.01
406	688409	富创精密	15,944	877,079.44	0.01
407	301071	力量钻石	29,400	876,414.00	0.01
408	601601	中国太保	20,800	780,208.00	0.01
409	603565	中谷物流	80,824	771,869.20	0.01
410	000860	顺鑫农业	48,600	755,730.00	0.01
411	600664	哈药股份	202,100	743,728.00	0.01
412	600988	赤峰黄金	29,300	728,984.00	0.01
413	603558	健盛集团	79,500	724,245.00	0.01

414	600933	爱柯迪	45,075	721,650.75	0.01
415	688278	特宝生物	9,821	708,192.31	0.01
416	000680	山推股份	77,100	691,587.00	0.01
417	001207	联科科技	27,800	682,212.00	0.01
418	000528	柳工	70,650	678,946.50	0.01
419	002396	星网锐捷	30,000	673,500.00	0.01
420	000848	承德露露	72,400	661,012.00	0.01
421	601628	中国人寿	15,900	654,921.00	0.01
422	002594	比亚迪	1,900	630,629.00	0.00
423	600993	马应龙	22,100	624,988.00	0.00
424	600502	安徽建工	132,800	624,160.00	0.00
425	000786	北新建材	22,920	606,921.60	0.00
426	601236	红塔证券	70,700	598,829.00	0.00
427	688578	艾力斯	6,377	593,316.08	0.00
428	300196	长海股份	46,800	570,960.00	0.00
429	301318	维海德	16,800	568,512.00	0.00
430	600380	健康元	51,300	565,839.00	0.00
431	603199	九华旅游	15,500	561,720.00	0.00
432	301317	鑫磊股份	18,200	561,288.00	0.00
433	600396	华电辽能	190,200	561,090.00	0.00
434	600621	华鑫股份	36,500	558,815.00	0.00
435	601916	浙商银行	164,800	558,672.00	0.00
436	601128	常熟银行	75,500	556,435.00	0.00
437	600223	福瑞达	65,800	540,876.00	0.00
438	600273	嘉化能源	63,100	533,826.00	0.00
439	601225	陕西煤业	25,700	494,468.00	0.00
440	688253	英诺特	14,543	448,796.98	0.00
441	605499	东鹏饮料	1,300	408,265.00	0.00
442	002035	华帝股份	60,000	377,400.00	0.00
443	603348	文灿股份	15,600	325,728.00	0.00
444	688150	莱特光电	12,879	318,368.88	0.00
445	601766	中国中车	44,500	313,280.00	0.00
446	002463	沪电股份	6,900	293,802.00	0.00
447	603728	鸣志电器	4,700	270,109.00	0.00
448	688506	百利天恒	853	252,590.36	0.00
449	000858	五粮液	1,800	214,020.00	0.00
450	000403	派林生物	11,700	212,121.00	0.00
451	000157	中联重科	29,200	211,116.00	0.00
452	603833	欧派家居	3,300	186,285.00	0.00
453	002429	兆驰股份	41,189	180,407.82	0.00
454	600438	通威股份	9,700	162,475.00	0.00
455	603516	淳中科技	4,500	161,550.00	0.00
456	002230	科大讯飞	3,300	158,004.00	0.00
457	301202	朗威股份	3,700	152,070.00	0.00

458	002469	三维化学	17,500	145,425.00	0.00
459	601611	中国核建	15,700	144,283.00	0.00
460	001308	康冠科技	6,215	140,583.30	0.00
461	688089	嘉必优	5,216	131,182.40	0.00
462	600015	华夏银行	15,200	120,232.00	0.00
463	301028	东亚机械	9,101	111,851.29	0.00
464	300442	润泽科技	2,100	104,013.00	0.00
465	300475	香农芯创	2,800	99,764.00	0.00
466	301125	腾亚精工	5,600	98,728.00	0.00
467	002153	石基信息	10,700	92,662.00	0.00
468	300181	佐力药业	5,200	90,116.00	0.00
469	000581	威孚高科	4,500	85,230.00	0.00
470	600886	国投电力	5,100	75,174.00	0.00
471	688348	昱能科技	1,567	67,333.99	0.00
472	688111	金山办公	226	63,291.30	0.00
473	600710	苏美达	6,200	59,582.00	0.00
474	600177	雅戈尔	8,000	58,400.00	0.00
475	002925	盈趣科技	3,100	55,738.00	0.00
476	300033	同花顺	200	54,602.00	0.00
477	300014	亿纬锂能	1,100	50,391.00	0.00
478	603187	海容冷链	4,200	49,392.00	0.00
479	600018	上港集团	8,500	48,535.00	0.00
480	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
481	300765	新诺威	900	46,521.00	0.00
482	600025	华能水电	4,700	44,885.00	0.00
483	603158	腾龙股份	5,600	44,576.00	0.00
484	002327	富安娜	5,900	43,778.00	0.00
485	603848	好太太	2,800	43,120.00	0.00
486	601989	中国重工	9,100	42,224.00	0.00
487	600674	川投能源	2,500	40,100.00	0.00
488	601868	中国能建	16,200	36,126.00	0.00
489	300783	三只松鼠	1,300	35,243.00	0.00
490	603590	康辰药业	1,100	34,584.00	0.00
491	000039	中集集团	4,300	33,798.00	0.00
492	600623	华谊集团	4,304	32,581.28	0.00
493	601298	青岛港	3,600	31,284.00	0.00
494	000166	申万宏源	5,800	29,116.00	0.00
495	002558	巨人网络	1,200	28,260.00	0.00
496	603115	海星股份	1,900	27,417.00	0.00
497	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
498	688018	乐鑫科技	169	24,690.90	0.00
499	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
500	002106	莱宝高科	2,300	23,805.00	0.00
501	300597	吉大通信	2,300	22,402.00	0.00

502	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
503	603979	金诚信	459	21,315.96	0.00
504	601000	唐山港	5,100	20,706.00	0.00
505	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
506	002791	坚朗五金	800	17,120.00	0.00
507	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
508	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
509	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
510	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
511	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
512	300861	美畅股份	700	14,231.00	0.00
513	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
514	002967	广电计量	800	14,072.00	0.00
515	002479	富春环保	2,800	14,028.00	0.00
516	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
517	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
518	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
519	601633	长城汽车	600	12,888.00	0.00
520	600007	中国国贸	600	12,348.00	0.00
521	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
522	300857	协创数据	140	12,048.40	0.00
523	300122	智飞生物	600	11,754.00	0.00
524	601169	北京银行	1,704	11,638.32	0.00
525	600893	航发动力	300	11,562.00	0.00
526	002847	盐津铺子	140	11,256.00	0.00
527	600201	生物股份	1,300	10,426.00	0.00
528	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
529	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
530	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
531	002064	华峰化学	1,400	9,254.00	0.00
532	002268	电科网安	500	9,145.00	0.00
533	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
534	603296	华勤技术	100	8,068.00	0.00
535	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
536	301381	赛维时代	400	7,980.00	0.00
537	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
538	002245	蔚蓝锂芯	600	7,698.00	0.00
539	601019	山东出版	800	7,576.00	0.00
540	688020	方邦股份	193	7,308.91	0.00
541	603160	汇顶科技	100	7,103.00	0.00
542	000887	中鼎股份	400	7,036.00	0.00
543	688123	聚辰股份	85	6,884.15	0.00
544	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
545	601878	浙商证券	600	6,546.00	0.00

546	301220	亚香股份	140	6,286.00	0.00
547	002991	甘源食品	100	6,247.00	0.00
548	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
549	688516	奥特维	182	6,049.68	0.00
550	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
551	002984	森麒麟	300	5,625.00	0.00
552	600332	白云山	200	5,272.00	0.00
553	002032	苏泊尔	100	5,239.00	0.00
554	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
555	002240	盛新锂能	400	5,152.00	0.00
556	603283	赛腾股份	140	4,751.60	0.00
557	603338	浙江鼎力	100	4,740.00	0.00
558	300263	隆华科技	600	4,650.00	0.00
559	601012	隆基绿能	300	4,506.00	0.00
560	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
561	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
562	600350	山东高速	400	4,264.00	0.00
562	600779	水井坊	100	4,264.00	0.00
563	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
564	002897	意华股份	100	3,879.00	0.00
565	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
566	000513	丽珠集团	100	3,604.00	0.00
567	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
568	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
569	603517	绝味食品	200	3,050.00	0.00
570	300628	亿联网络	87	3,024.12	0.00
571	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
572	600511	国药股份	100	2,916.00	0.00
573	300573	兴齐眼药	56	2,900.24	0.00
574	300926	博俊科技	96	2,541.12	0.00
575	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
576	600066	宇通客车	100	2,486.00	0.00
577	301301	川宁生物	200	2,408.00	0.00
578	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
579	301133	金钟股份	100	2,268.00	0.00
580	000883	湖北能源	500	2,255.00	0.00
581	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
582	601567	三星医疗	100	2,242.00	0.00
583	000400	许继电气	100	2,177.00	0.00
584	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
585	002414	高德红外	200	2,050.00	0.00
586	300119	瑞普生物	100	1,942.00	0.00
587	688303	大全能源	85	1,812.20	0.00
588	688408	中信博	38	1,773.84	0.00

589	000951	中国重汽	100	1,758.00	0.00
590	601881	中国银河	100	1,715.00	0.00
591	603319	美湖股份	48	1,700.16	0.00
592	603232	格尔软件	100	1,695.00	0.00
593	600875	东方电气	100	1,674.00	0.00
594	301608	博实结	18	1,603.44	0.00
595	600312	平高电气	100	1,539.00	0.00
596	600161	天坛生物	80	1,535.20	0.00
597	600557	康缘药业	100	1,478.00	0.00
598	300406	九强生物	100	1,415.00	0.00
599	002572	索菲亚	100	1,401.00	0.00
600	002290	禾盛新材	43	1,343.75	0.00
601	002611	东方精工	100	1,206.00	0.00
602	688630	芯碁微装	15	1,190.55	0.00
603	688533	上声电子	40	1,077.20	0.00
604	603351	威尔药业	40	1,059.20	0.00
605	603518	锦泓集团	100	988.00	0.00
606	603801	志邦家居	100	969.00	0.00
607	601800	中国交建	100	889.00	0.00
608	601369	陕鼓动力	100	877.00	0.00
609	603298	杭叉集团	40	838.00	0.00
610	000544	中原环保	100	813.00	0.00
611	002658	雪迪龙	100	783.00	0.00
612	688567	孚能科技	50	725.00	0.00
613	000521	长虹美菱	100	694.00	0.00
614	000530	冰山冷热	100	591.00	0.00
615	600027	华电国际	100	547.00	0.00
616	300217	东方电热	100	527.00	0.00
617	603950	长源东谷	20	500.60	0.00
618	601598	中国外运	100	493.00	0.00
619	000750	国海证券	100	412.00	0.00
620	000600	建投能源	52	359.32	0.00
621	600808	马钢股份	100	345.00	0.00
622	000998	隆平高科	26	256.10	0.00
623	002367	康力电梯	27	189.81	0.00
624	688538	和辉光电-U	78	182.52	0.00
625	688616	西力科技	3	38.16	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	002422	科伦药业	750,801,957.88	7.34
2	600016	民生银行	560,064,134.52	5.47
3	002352	顺丰控股	392,265,717.65	3.83
4	688027	国盾量子	391,258,588.16	3.82
5	601318	中国平安	385,658,659.50	3.77
6	000960	锡业股份	364,277,140.30	3.56
7	688676	金盘科技	345,561,631.80	3.38
8	601138	工业富联	276,697,193.40	2.70
9	300499	高澜股份	268,190,211.01	2.62
10	301358	湖南裕能	250,167,746.46	2.44
11	688275	万润新能	242,252,993.07	2.37
12	600919	江苏银行	229,307,681.71	2.24
13	300693	盛弘股份	222,606,128.49	2.18
14	300433	蓝思科技	205,604,118.67	2.01
15	002920	德赛西威	182,825,045.67	1.79
16	300017	网宿科技	169,331,875.00	1.65
17	689009	九号公司	169,005,557.92	1.65
18	600926	杭州银行	165,440,015.40	1.62
19	002001	新和成	153,372,987.81	1.50
20	603986	兆易创新	152,016,165.11	1.49

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	688266	泽璟制药-U	895,087,108.19	8.75
2	600919	江苏银行	630,521,916.94	6.16
3	601689	拓普集团	336,338,251.23	3.29
4	600926	杭州银行	309,356,144.52	3.02
5	603920	世运电路	296,195,482.68	2.89
6	300693	盛弘股份	292,758,266.10	2.86
7	301382	蜂助手	257,648,417.20	2.52
8	688676	金盘科技	249,915,529.60	2.44
9	301358	湖南裕能	230,066,773.88	2.25
10	002966	苏州银行	222,889,506.61	2.18

11	002241	歌尔股份	222,034,445.30	2.17
12	600487	亨通光电	209,327,960.99	2.05
13	300017	网宿科技	192,878,279.50	1.89
14	300433	蓝思科技	191,668,014.66	1.87
15	002126	银轮股份	181,797,380.47	1.78
16	300723	一品红	178,151,345.41	1.74
17	688275	万润新能	175,717,578.46	1.72
18	688220	翱捷科技-U	175,180,048.08	1.71
19	605589	圣泉集团	167,455,379.28	1.64
20	603986	兆易创新	151,392,956.38	1.48

### 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	17,931,826,825.61
卖出股票收入（成交）总额	16,653,764,804.03

### 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	28,355,761.10	0.22
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）	2,298,725.88	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,654,486.98	0.24

### 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	019749.SH	24 国债 15	280,000	28,355,761.10	0.22
2	118053.SH	正帆转债	9,300	1,199,663.05	0.01
3	118055.SH	伟测转债	6,080	806,622.61	0.01
4	123255.SZ	鼎龙转债	1,488	204,822.38	0.00
5	123250.SZ	嘉益转债	701	85,005.68	0.00

### 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，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**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	2,967,510.11

2	应收清算款	49,643,556.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,481,668.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,092,735.25

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123250.SZ	嘉益转债	85,005.68	0.00
2	113682.SH	益丰转债	1,189.40	0.00

#### 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
552,367	5,840.51	899,790,855 .52	27.89%	2,326,316,7 12.63	72.11%

## 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	3,168,090.81	0.0982%

## 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（2016年12月30日）基金份额总额	200,788,412.15
本报告期期初基金份额总额	2,888,212,333.27
本报告期基金总申购份额	1,384,433,427.90
减：本报告期基金总赎回份额	1,046,538,193.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,226,107,568.15

## 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、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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，本基金托管人及其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	
华创证券	2	4,354,659,651.73	12.59%	1,898,631.56	12.59%	-
华泰证券	5	4,207,264,834.12	12.17%	1,834,368.31	12.17%	-
天风证券	3	3,789,228,243.97	10.96%	1,652,102.74	10.96%	-
东吴证券	3	3,349,575,730.07	9.69%	1,460,422.80	9.69%	-
兴业证券	3	2,843,037,421.61	8.22%	1,239,563.01	8.22%	减少 1 个
浙商证券	1	2,781,044,349.46	8.04%	1,212,545.53	8.04%	-
中金公司	4	1,666,881,588.42	4.82%	726,763.36	4.82%	-
德邦证券	2	1,589,393,731.65	4.60%	692,979.11	4.60%	减少 1 个
中泰证券	3	1,377,783,588.49	3.98%	600,713.65	3.98%	减少 1 个
东北证券	2	1,347,541,634.04	3.90%	587,528.13	3.90%	减少 2 个
申万宏源证券	3	1,196,199,515.13	3.46%	521,545.46	3.46%	-
中信证券	2	1,108,643,812.30	3.21%	483,372.50	3.21%	-
民生证券	1	1,091,583,400.74	3.16%	475,932.16	3.16%	-
国泰海通	4	1,066,905,220.87	3.08%	465,170.70	3.08%	-
国信证券	2	1,054,072,328.14	3.05%	459,580.69	3.05%	-
国盛证券	2	588,642,555.51	1.70%	256,649.41	1.70%	-
广发证券	8	555,847,242.11	1.61%	242,349.42	1.61%	-
长江证券	3	403,014,082.15	1.17%	175,714.13	1.17%	-
东方证券	2	107,754,042.32	0.31%	46,980.75	0.31%	-
国联民生	1	104,891,869.64	0.30%	45,733.09	0.30%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-

太平洋	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
西南证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
平安证券	4	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
南京证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-

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
华创证券	931,000.00	55.16%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券	608,000.00	36.02%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	148,800.00	8.82%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

国都证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

### 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 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发多因子灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发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

### 11.2 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

### 11.3 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日