

广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金
中基金（FOF）

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 8 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48

7.12	本报告期投资基金情况	48
7.13	投资组合报告附注	52
8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	54
9	开放式基金份额变动	54
10	重大事件揭示	54
10.1	基金份额持有人大会决议	54
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	55
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.7	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.8	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	55
10.9	其他重大事件	58
11	影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）	
基金主代码	026115	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 8 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,488,261,312.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C
下属分级基金的交易代码	026115	026116
报告期末下属分级基金的份额总额	1,351,531,122.69 份	1,136,730,190.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过定量与定性相结合的方法精选不同资产类别中的优质基金，结合基金的风险收益特征和市场环境合理配置权重，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券、基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。 具体包括：1、大类资产配置策略；2、基金投资策略；3、股票（含存托凭证）投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×83%+银行活期存款利率（税后）×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×2%+沪深 300 指数收益率×7%+恒生指数收益率（经估值汇率调整）×3%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，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。 本基金可以投资于港股通标的证券，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险、港股通 ETF 价格较大波动的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	张姗
	联系电话	020-83936666	400-61-95555
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105828	400-61-95555
传真		020-34281105	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510308	518040
法定代表人		葛长伟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日)	
	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式(FOF) A	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式(FOF) C
本期已实现收益	-9,123,202.41	-12,011,095.18
本期利润	-9,251,731.12	-11,878,840.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0059	-0.0079
本期加权平均净值利润率	-0.59%	-0.79%
本期基金份额净值增长率	-0.59%	-0.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式(FOF) A	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式(FOF) C
期末可供分配利润	-7,944,855.73	-8,827,082.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0059	-0.0078
期末基金资产净值	1,343,586,266.96	1,127,903,107.27
期末基金份额净值	0.9941	0.9922
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式(FOF) A	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式(FOF) C
基金份额累计净值增长率	-0.59%	-0.78%

注：（1）本基金合同生效日为 2026 年 1 月 8 日，至报告期末不满半年。

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

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

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

（5）本基金 T 日的基金份额净值在 T+3 日内公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.19%	0.25%	0.78%	0.14%	0.41%	0.11%
自基金合同生效起至今	-0.59%	0.23%	0.54%	0.15%	-1.13%	0.08%

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.08%	0.25%	0.78%	0.14%	0.30%	0.11%
自基金合同生效起至今	-0.78%	0.23%	0.54%	0.15%	-1.32%	0.08%

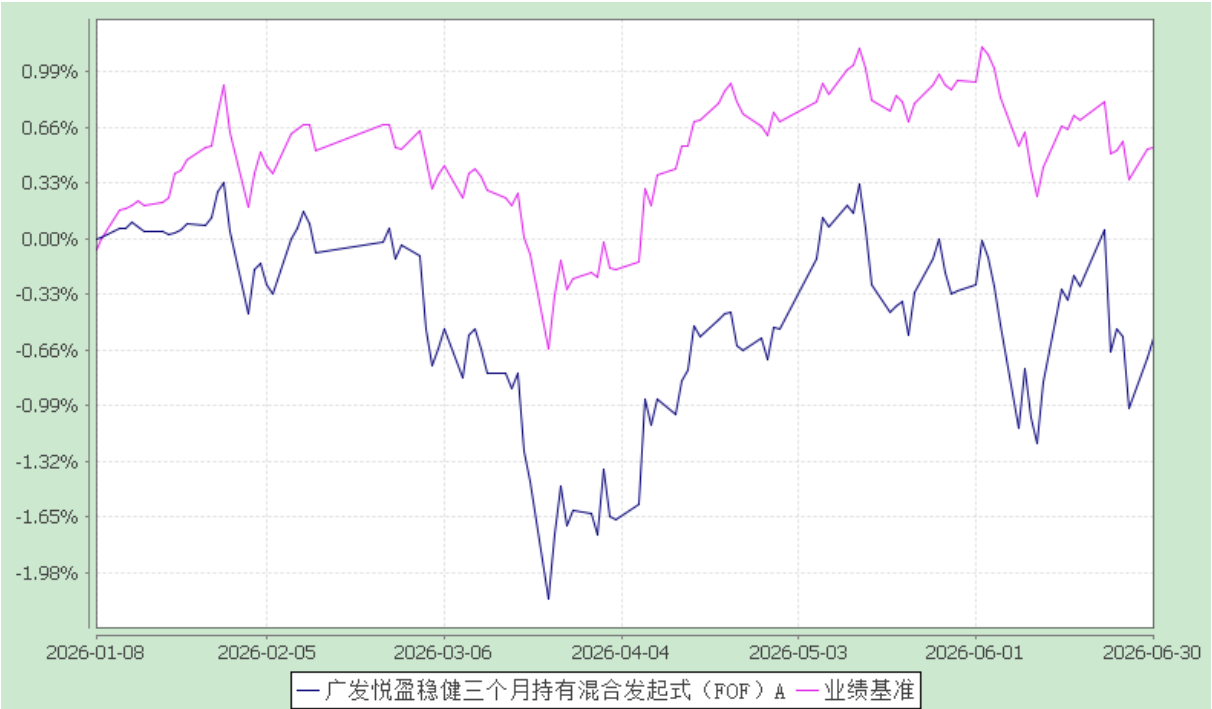
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

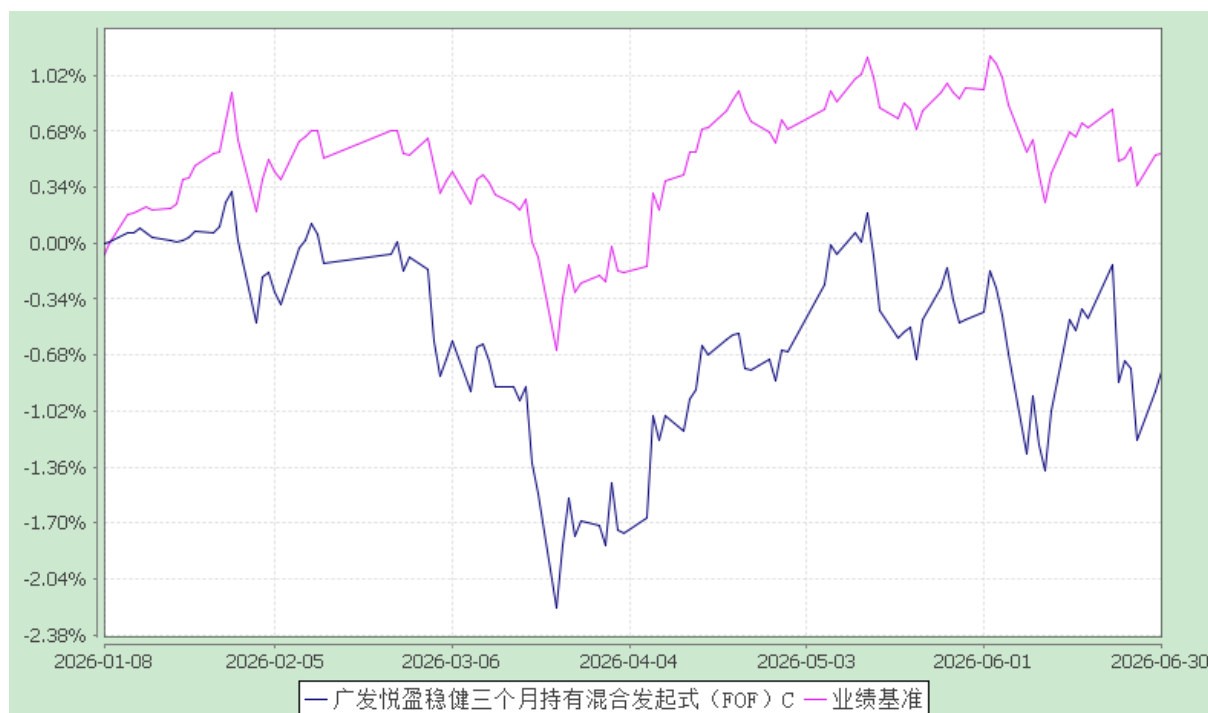
广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2026 年 1 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A



广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C



注：（1）本基金合同生效日期为 2026 年 1 月 8 日，至报告期末未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，至报告期末本基金仍处于建仓期。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资基金管理机构、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		
曹建文	本基金的基金经理；广发稳健养老	2026-01-08	-	13.3 年	曹建文先生，中国籍，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证

目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)的基金经理；广发锐意进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发安泰稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发养老目标日期2060五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发安诚养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发积极回报3个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；广发养老目标日期2055五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；资产配置部总经理助理					书。曾任浦银安盛基金管理有限公司金融分析师、投资经理，平安养老保险股份有限公司投资经理、广发养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理(自 2021 年 11 月 29 日至 2025 年 2 月 21 日)、广发均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理(自 2021 年 11 月 29 日至 2025 年 6 月 25 日)、广发积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理(自 2022 年 12 月 28 日至 2026 年 3 月 31 日)。
--	--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 77 次，其中 76 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济延续温和复苏态势，稳增长政策持续发力，“两新”政策接续推进，价格数据低位企稳——CPI 同比从年初 1 月的 0.2% 回升至 1.0%-1.3% 区间；制造业 PMI 在荣枯线附

近波动修复；央行维持流动性合理充裕，资金面整体平稳偏松。海外方面，上半年演绎较为跌宕：一季度中东地缘局势与通胀预期升温令市场对美联储年内降息的预期明显降温，风险偏好一度回落；二季度美伊冲突、霍尔木兹海峡通航风险等地缘因素反复扰动，美联储货币政策路径摇摆，全球资产波动明显加大。

在此背景下，国内权益市场呈现“震荡上行、成长科技强势领跑”的格局。上半年整体来看，主要宽基指数分化显著：科创 50 大幅上涨 64.25%、创业板指上涨 35.58%，而以大盘蓝筹为主的上证指数仅上涨 3.16%、沪深 300 上涨 7.55%。从结构看，一季度市场板块轮动加快，受能源安全与油价上涨驱动煤炭、石油石化等一度领先；进入二季度后，以 AI 算力、半导体设备、光模块为代表的科技链条全面爆发。上半年，电子行业大涨 86.29%、通信上涨 73.59%，领跑全市场，建筑材料、机械设备等紧随其后；相较而言，商贸零售（-29.42%）、农林牧渔（-25.26%）、食品饮料（-19.52%）、钢铁（-19.01%）等消费与顺周期方向大幅回调，银行（-12.27%）、非银金融（-15.26%）等高股息与金融板块亦表现落后，市场呈现显著的科技成长与价值消费分化。

国内债券市场方面，上半年受权益市场风险偏好持续回暖、货币政策相对克制及通胀预期等因素影响，长端利率债整体缺乏趋势性机会，10 年期国债收益率在年中回落至 1.73% 附近。

全球资产方面，美股在 AI 产业趋势与科技龙头业绩支撑下震荡上行，但受美联储政策预期反复摆动及地缘扰动，波动率明显抬升，上半年标普 500 指数上涨 9.55%、纳斯达克指数上涨 12.79%。商品市场分化加剧、波动剧烈：黄金年初一度刷新历史高位（盘中最高接近 5600 美元/盎司），随后受美元阶段性走强、地缘与降息预期反复定价影响出现显著回撤，6 月末回落至 4022 美元/盎司；原油受中东冲突与供需变化影响呈“过山车”式波动。美债方面，伴随地缘风险与降息预期反复定价，十年美债收益率震荡上行。

本基金成立于报告期内，报告期内完成建仓，采用全球多元资产配置策略，注重收益来源的多样化，在传统的境内权益和债券之外，还配置了投资于美国、亚太等市场的权益基金和债券基金，并配置了部分商品基金。整体配置策略注重跨资产策略的比价和配置。境内债券部分，建仓初期底仓以优质中短久期债券型基金为主，二季度减持了部分中短债品种，增配了偏债混及灵活配置型等固收+品种。境内权益部分整体配置风格相对均衡，境外权益以亚太和美股的配置为主。商品基金部分以黄金为主，二季度适度增加了配置比例。本基金将继续坚持全球多元资产配置与稳健的目标风险策略，注重收益来源多样化与回撤控制，力争在回撤可控的基础上实现净值的长期平稳增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-0.59%，C 类基金份额净值增长率为-0.78%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%。

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 2026 年下半年，全球资本市场仍将围绕 AI 产业趋势、货币政策预期与地缘风险展开。AI 产业投资与算力需求仍可能是重要主线，但经过上半年科技成长板块的显著上涨，板块波动与分化风险或将上升。海外方面，市场仍在交易货币政策边际宽松预期，但美联储降息时点与幅度仍受通胀、就业和地缘局势制约。A 股方面，我们认为中期仍具结构性机会，指数层面或以震荡为主；结构上一方面继续关注 AI 与科技等主线方向，另一方面关注前期调整较充分、估值具备安全边际，并有业绩催化或政策改善预期的周期、资源、消费等方向。债券市场在货币政策相对克制、负债端稳定性仍待观察的背景下，趋势性机会或较有限，需等待更具赔率的位置。黄金在全球储备多元化、央行购金与地缘不确定性等中长期因素支撑下仍具配置价值，但短期高波动特征可能延续。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金且截至本报告期末，合同生效不满三年，不适用《公开募集证券投资基金

运作管理办法》第四十一条的披露规定。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	45,051,231.78
结算备付金		366,860.03

存出保证金		187,192.58
交易性金融资产	6.4.7.2	2,427,362,131.48
其中：股票投资		69,100,328.97
基金投资		2,237,192,841.52
债券投资		121,068,960.99
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		47,237,021.21
应收股利		5,871.20
应收申购款		15,603.91
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	11,444.80
资产总计		2,520,237,356.99
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		2,004,370.14
应付赎回款		45,632,855.64
应付管理人报酬		328,434.33
应付托管费		236,531.12
应付销售服务费		394,662.67
应付投资顾问费		-
应交税费		4,610.30
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	146,518.56
负债合计		48,747,982.76
净资产：		
实收基金	6.4.7.8	2,488,261,312.84
未分配利润	6.4.7.9	-16,771,938.61
净资产合计		2,471,489,374.23
负债和净资产总计		2,520,237,356.99

注：（1）报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A 基金份额净值人民币 0.9941 元，基金份额总额 1,351,531,122.69 份；广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C 基金份额净值人民币 0.9922 元，基金份额总额 1,136,730,190.15 份；总份额总额 2,488,261,312.84 份。

（2）本会计期间为 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-14,734,950.06
1. 利息收入		243,538.83
其中：存款利息收入	6.4.7.10	202,100.73
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		41,438.10
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,801,181.44
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-2,302,115.40
基金投资收益	6.4.7.12	-27,218,262.72
债券投资收益	6.4.7.13	833,999.98
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	12,885,196.70
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	3,725.85
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	818,966.70
减：二、营业总支出		6,395,621.68
1. 管理人报酬		1,834,296.37
2. 托管费		1,604,071.48
3. 销售服务费		2,850,099.94

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	6.4.7.21	-
7. 税金及附加		5,847.40
8. 其他费用	6.4.7.22	101,306.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,130,571.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,130,571.74
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-21,130,571.74

6.3 净资产变动表

会计主体：广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	3,287,754,745.13	-	3,287,754,745.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-799,493,432.29	-16,771,938.61	-816,265,370.90
（一）、综合收益总额	-	-21,130,571.74	-21,130,571.74
（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）	-799,493,432.29	4,358,633.13	-795,134,799.16
其中：1.基金申购款	1,499,379.57	-8,266.18	1,491,113.39
2.基金赎回款	-800,992,811.86	4,366,899.31	-796,625,912.55
（三）、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	2,488,261,312.84	-16,771,938.61	2,471,489,374.23

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

广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2025]2480 号《关于准予广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》公开募集。本基金于 2026 年 1 月 5 日至 2026 年 1 月 6 日止期间募集资金总额共计人民币 3,287,719,622.84 元（不含认购资金利息），认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 35,122.29 元，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证。经向中国证监会备案，《广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》于 2026 年 1 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,287,754,745.13 份。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要包含货币资金、买入返售金融资产和其他应收科目等。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

本基金持有的以摊余成本计量的金融负债主要包括卖出回购金融资产款和其他应付科目等。

（3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已经开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。对于存在分级份额调整的基金，上述申购和赎回包括因级别调整而引起的分级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入（若有）、转出（若有）及红利再投资（若有）等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

（5）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（6）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（7）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（8）黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

（9）黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

（10）其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，投资者持有的场外份额可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资。基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配并应满足基金合同对收益分配次数、比例等方面的要求。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》，财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

（2016）70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

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

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

（2）企业所得税、个人所得税

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

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

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有

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

（3）印花税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	45,051,231.78
等于：本金	45,043,908.04
加：应计利息	7,323.74
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	45,051,231.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		77,369,717.78	-	69,100,328.97	-8,269,388.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	119,957,036.49	1,173,120.99	121,068,960.99	-61,196.49
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	119,957,036.49	1,173,120.99	121,068,960.99	-61,196.49
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,228,858,530.37	-	2,237,192,841.52	8,334,311.15
其他		-	-	-	-

合计	2,426,185,284.64	1,173,120.99	2,427,362,131.48	3,725.85
----	------------------	--------------	------------------	----------

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	11,444.80
待摊费用	-
合计	11,444.80

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	41,450.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	20,012.11
其中：交易所市场	20,012.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,056.42
合计	146,518.56

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	
项目	本期

	2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,636,144,341.84	1,636,144,341.84
本期申购	575,838.18	575,838.18
本期赎回（以“-”号填列）	-285,189,057.33	-285,189,057.33
本期末	1,351,531,122.69	1,351,531,122.69

金额单位：人民币元

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C		
项目	本期	
	2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,651,610,403.29	1,651,610,403.29
本期申购	923,541.39	923,541.39
本期赎回（以“-”号填列）	-515,803,754.53	-515,803,754.53
本期末	1,136,730,190.15	1,136,730,190.15

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

6.4.1“基金基本情况”之说明。

2、申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-9,123,202.41	-128,528.71	-9,251,731.12
本期基金份额交易产生的变动数	1,516,118.05	-209,242.66	1,306,875.39
其中：基金申购款	-3,268.92	126.96	-3,141.96
基金赎回款	1,519,386.97	-209,369.62	1,310,017.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,607,084.36	-337,771.37	-7,944,855.73

单位：人民币元

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-

本期利润	-12,011,095.18	132,254.56	-11,878,840.62
本期基金份额交易产生的变动数	3,471,832.53	-420,074.79	3,051,757.74
其中：基金申购款	-6,573.89	1,449.67	-5,124.22
基金赎回款	3,478,406.42	-421,524.46	3,056,881.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,539,262.65	-287,820.23	-8,827,082.88

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	198,305.21
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	3,217.47
其他	578.05
合计	202,100.73

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,302,115.40
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	-2,302,115.40

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	50,749,796.21
减：卖出股票成本总额	52,916,261.27
减：交易费用	135,650.34
买卖股票差价收入	-2,302,115.40

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	2,065,584,779.62
减：卖出/赎回基金成本总额	2,092,678,756.00
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	23,349.11
减：交易费用	100,937.23
基金投资收益	-27,218,262.72

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	845,630.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,630.51
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	833,999.98

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,506,151.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,327,920.51
减：应计利息总额	189,861.53
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-11,630.51

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,138,257.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	10,746,938.77
合计	12,885,196.70

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	3,725.85
——股票投资	-8,269,388.81
——债券投资	-61,196.49
——资产支持证券投资	-
——基金投资	8,334,311.15
——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	3,725.85

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	709,699.92
其他	109,266.78
合计	818,966.70

6.4.7.20 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	213,076.50
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,192,645.44
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,060,020.15

注：当期持有基金产生的费用是根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、

管理费、托管费等进行的估算；上述费用已在本基金中基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金中基金的费用项目。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	26,731.62
信息披露费	58,324.80
证券出借违约金	-
银行汇划费	15,549.14
其他	700.93
合计	101,306.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金管理人
招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 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例

广发证券股份有限公司	180,466,601.11	99.69%
------------	----------------	--------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	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	163,283,091.68	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	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	519,548,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券股份有限公司	1,387,188,536.69	100.00%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	78,670.77	99.80%	19,925.58	99.57%

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,834,296.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	945,886.79
应支付基金管理人的净管理费	888,409.58

注：本基金投资于基金管理人自身管理的其他基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分后的余额的约定年费率计提，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扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分后的余额×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.50%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,604,071.48

注：本基金投资于基金托管人自身托管的其他基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额的约定年费率计提，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扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.13%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发悦盈稳健三个	广发悦盈稳健三个月持	合计

	月持有混合发起式 (FOF) A	有混合发起式 (FOF) C	
招商银行股份有限公司	-	2,850,069.96	2,850,069.96
合计	-	2,850,069.96	2,850,069.96

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 C 类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.40%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	广发悦盈稳健三个月持有混合 发起式 (FOF) A	广发悦盈稳健三个月持有混合 发起式 (FOF) C
基金合同生效日（2026 年 1 月 8 日）持有的基金份额	10,000,555.61	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	10,000,555.61	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.74%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式 (FOF) A

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年1月8日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	45,051,231.78	198,305.21

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有基金管理人广发基金管理有限公司所管理的基金合计 1,627,856,449.91 元，占本基金资产净值的比例为 65.87%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期
	2026 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	109,266.78
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,045,379.58
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	812,431.32
当期交易基金产生的交易费（元）	18,271.25

注：根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF

除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内(含)	新股流通受限	19.28	19.28	300.00	5,784.00	5,784.00	-
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月内(含)	新股流通受限	10.11	10.11	500.00	5,055.00	5,055.00	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内(含)	新股流通受限	8.52	8.52	300.00	2,556.00	2,556.00	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回

购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的合规及风险管理委员会负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险；在场外申赎基金份额均通过具有基金销售资格的金融机构进行，违约风险较小。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	121,068,960.99
合计	121,068,960.99

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

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	45,051,231.78	-	-	-	45,051,231.78
结算备付金	366,860.03	-	-	-	366,860.03
存出保证金	187,192.58	-	-	-	187,192.58
交易性金融资产	121,068,960.99	-	-	2,306,293,170.49	2,427,362,131.48
应收清算款	-	-	-	47,237,021.21	47,237,021.21
应收股利	-	-	-	5,871.20	5,871.20
应收申购款	-	-	-	15,603.91	15,603.91
其他资产	-	-	-	11,444.80	11,444.80
资产总计	166,674,245.38	-	-	2,353,563,111.61	2,520,237,356.99
负债					
应付清算款	-	-	-	2,004,370.14	2,004,370.14
应付赎回款	-	-	-	45,632,855.64	45,632,855.64
应付管理人报酬	-	-	-	328,434.33	328,434.33
应付托管费	-	-	-	236,531.12	236,531.12
应付销售服务费	-	-	-	394,662.67	394,662.67
应交税费	-	-	-	4,610.30	4,610.30
其他负债	-	-	-	146,518.56	146,518.56
负债总计	-	-	-	48,747,982.76	48,747,982.76
利率敏感度缺口	166,674,245.38	-	-	2,304,815,128.85	2,471,489,374.23

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)
		本期末 2026 年 6 月 30 日
	市场利率上升 25 个基点	-88,376.26
	市场利率下降 25 个基点	88,505.50

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,364,913.34	-	11,364,913.34
资产合计	-	11,364,913.34	-	11,364,913.34
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,364,913.34	-	11,364,913.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026 年 6 月 30 日
	所有外币相对人民币升值 5%	568,245.67
	所有外币相对人民币贬值 5%	-568,245.67

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末
	2026 年 6 月 30 日

	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	69,100,328.97	2.80
交易性金融资产—基金投资	2,237,192,841.52	90.52
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,306,293,170.49	93.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026 年 6 月 30 日
	上升 5%	27,566,053.31
	下降 5%	-27,566,053.31

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	2,306,279,775.49
第二层次	121,082,355.99
第三层次	-
合计	2,427,362,131.48

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	69,100,328.97	2.74
	其中：股票	69,100,328.97	2.74
2	基金投资	2,237,192,841.52	88.77
3	固定收益投资	121,068,960.99	4.80
	其中：债券	121,068,960.99	4.80
	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	45,418,091.81	1.80
8	其他各项资产	47,457,133.70	1.88
9	合计	2,520,237,356.99	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 8,756,047.97 元，占基金资产净值比例 0.35%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,904,350.00	1.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,028,748.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	24,406,128.00	0.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,344,281.00	2.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	1,289,992.17	0.05
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-

通讯业务	7,466,055.80	0.30
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	8,756,047.97	0.35

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	1,473,800	24,406,128.00	0.99
2	300502	新易盛	15,060	9,141,420.00	0.37
3	00700	腾讯控股	20,000	7,466,055.80	0.30
4	601799	星宇股份	60,200	5,455,324.00	0.22
5	600519	贵州茅台	4,600	5,453,254.00	0.22
6	002283	天润工业	463,800	4,475,670.00	0.18
7	000425	徐工机械	470,900	3,809,581.00	0.15
8	600309	万华化学	36,900	2,524,329.00	0.10
9	002126	银轮股份	50,100	2,494,980.00	0.10
10	01211	比亚迪股份	20,500	1,289,992.17	0.05
11	600029	南方航空	198,600	1,028,748.00	0.04
12	600590	泰豪科技	93,500	944,350.00	0.04
13	002353	杰瑞股份	3,400	518,500.00	0.02
14	300750	宁德时代	200	78,602.00	0.00
15	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
16	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
17	920193	吉和昌	300	2,556.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	29,207,250.00	1.18
2	000425	徐工机械	10,995,574.00	0.44
3	601799	星宇股份	10,276,181.00	0.42
4	00700	腾讯控股	9,575,862.31	0.39
5	688256	寒武纪	8,231,075.26	0.33
6	002283	天润工业	6,828,643.00	0.28

7	300502	新易盛	6,785,629.00	0.27
8	603257	中国瑞林	6,574,605.00	0.27
9	600519	贵州茅台	6,459,550.00	0.26
10	01211	比亚迪股份	6,341,235.63	0.26
11	603979	金诚信	4,920,025.01	0.20
12	000893	亚钾国际	3,718,665.00	0.15
13	002532	天山铝业	3,281,971.00	0.13
14	600346	恒力石化	3,263,250.00	0.13
15	600309	万华化学	3,258,206.00	0.13
16	688521	芯原股份	3,073,611.84	0.12
17	002126	银轮股份	2,896,469.00	0.12
18	600841	动力新科	1,525,632.00	0.06
19	600029	南方航空	1,149,894.00	0.05
20	600590	泰豪科技	1,147,765.00	0.05

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 （%）
1	603257	中国瑞林	6,581,669.00	0.27
2	688256	寒武纪	6,181,536.96	0.25
3	000425	徐工机械	5,850,843.00	0.24
4	01211	比亚迪股份	5,049,633.93	0.20
5	300502	新易盛	3,764,813.00	0.15
6	002532	天山铝业	3,455,790.00	0.14
7	603979	金诚信	3,419,433.00	0.14
8	688521	芯原股份	3,376,763.17	0.14
9	000893	亚钾国际	3,141,988.00	0.13
10	601799	星宇股份	3,046,569.00	0.12
11	600346	恒力石化	2,590,650.00	0.10
12	002283	天润工业	1,578,973.00	0.06
13	600841	动力新科	1,230,927.00	0.05
14	002126	银轮股份	1,016,567.00	0.04
15	920119	美德乐	65,555.00	0.00
16	920220	朗信电气	33,600.00	0.00
17	603284	林平发展	30,803.00	0.00
18	920161	龙辰科技	28,020.00	0.00

19	920200	振宏股份	24,500.00	0.00
20	001399	惠科股份	24,341.00	0.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	130,285,979.05
卖出股票收入（成交）总额	50,749,796.21

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	121,068,960.99	4.90
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	121,068,960.99	4.90

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	019792.SH	25 国债 19	1,198,000	121,068,960.99	4.90

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，通过定量与定性相结合的方法精选不同资产类别中的优质基金，结合基金的风险收益特征和市场环境合理配置权重，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金主要投资于开放式基金，总体风险较低，符合本基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资 产净值比 例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	000037	广发景宁 纯债 A	契约型开 放式	251,741,2 10.04	305,462,7 84.26	12.36	是
2	020089	广发纯债 债券 E	契约型开 放式	161,160,3 54.55	201,402,0 95.08	8.15	是
3	006869	广发政策 性金融债	契约型开 放式	119,024,4 82.83	125,642,2 44.08	5.08	是
4	019027	广发添福 30 天持有 债券 A	契约型开 放式	103,118,1 17.83	110,779,7 93.98	4.48	是
5	020580	广发景和 中短债 D	契约型开 放式	103,663,3 47.56	109,530,6 93.03	4.43	是
6	019487	广发添盈 债券 A	契约型开 放式	100,460,1 13.47	108,004,6 67.99	4.37	是
7	019929	广发中债	契约型开	102,484,2	107,096,0	4.33	是

		0-2 年政 金债指数 A	放式	58.45	50.08		
8	006998	广发景兴 中短债 A	契约型开 放式	105,333,7 27.11	106,987,4 66.63	4.33	是
9	010324	广发招财 短债 E	契约型开 放式	104,047,6 19.05	105,202,5 47.62	4.26	是
10	009532	广发景明 中短债 E	契约型开 放式	100,048,1 17.97	103,139,6 04.82	4.17	是
11	012591	广发添财 180 天滚 动持有债 券 A	契约型开 放式	87,466,10 6.88	100,997,1 13.61	4.09	是
12	004280	国寿安保 稳荣混合 C	契约型开 放式	46,385,77 5.03	61,855,43 1.00	2.50	否
13	518600	广发上海 金 ETF	交易型开 放式	6,510,700. 00	56,805,85 7.50	2.30	是
14	001807	易方达瑞 智混合 E	契约型开 放式	30,686,48 0.70	45,078,44 0.15	1.82	否
15	001343	易方达新 享混合 C	契约型开 放式	29,612,04 9.14	42,049,10 9.78	1.70	否
16	021662	国富亚洲 机会股票 (QDII)C	契约型开 放式	13,000,75 3.74	41,477,60 4.73	1.68	否
17	519761	交银多策 略回报灵 活配置混 合 C	契约型开 放式	22,716,94 6.84	40,256,70 1.50	1.63	否
18	001504	南方利淘 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	16,478,98 9.29	30,593,24 3.62	1.24	否
19	513180	华夏恒生 科技 ETF(QDII)	交易型开 放式	53,789,10 0.00	30,498,41 9.70	1.23	否
20	519759	交银周期 回报灵活 配置混合 C	契约型开 放式	23,542,80 8.02	30,389,05 6.59	1.23	否
21	001405	东方红策 略精选混 合 A	契约型开 放式	18,247,71 6.36	29,554,00 1.42	1.20	否
22	019480	博时亚洲	契约型开	19,647,65	28,876,15	1.17	否

		票息收益 债券 C 人 民币	放式	2.11	4.31		
23	518880	华安黄金 ETF	交易型开 放式	2,667,500. 00	22,348,31 5.00	0.90	否
24	513750	广发中证 港股通非 银 ETF	交易型开 放式	15,372,80 0.00	21,598,78 4.00	0.87	是
25	001423	景顺长城 安享回报 混合 C 类	契约型开 放式	12,606,51 7.73	20,271,28 0.51	0.82	否
26	007925	平安鑫享 混合 E	契约型开 放式	8,879,943. 17	15,658,89 1.79	0.63	否
27	512400	南方中证 申万有色 金属 ETF	交易型开 放式	8,040,600. 00	14,907,27 2.40	0.60	否
28	513120	广发中证 香港创新 药 (QDII-ET F)	交易型开 放式	14,005,10 0.00	14,817,39 5.80	0.60	是
29	560780	广发中证 半导体材 料设备 ETF	交易型开 放式	9,997,000. 00	14,625,61 1.00	0.59	是
30	513400	道琼斯 ETF	交易型开 放式	10,967,90 0.00	14,335,04 5.30	0.58	否
31	513130	华泰柏瑞 南方东英 恒生科技 指数 ETF(QDII)	交易型开 放式	24,832,60 0.00	13,856,59 0.80	0.56	否
32	011426	广发优势 成长股票 C	契约型开 放式	24,449,87 9.05	13,599,02 2.73	0.55	是
33	513090	易方达中 证香港证 券投资主 题(港股 通)ETF	交易型开 放式	7,023,000. 00	12,493,91 7.00	0.51	否
34	560280	广发中证 工程机械 ETF	交易型开 放式	8,224,300. 00	12,492,71 1.70	0.51	是
35	159980	大成有色	交易型开	5,527,900.	11,365,36	0.46	否

		金属期货 ETF	放式	00	2.40		
36	560860	万家中证 工业有色 金属主题 ETF	交易型开 放式	6,688,600. 00	10,835,53 2.00	0.44	否
37	159562	华夏中证 沪深港黄 金产业股 票 ETF	交易型开 放式	6,166,100. 00	10,611,85 8.10	0.43	否
38	159870	化工 ETF	交易型开 放式	12,042,70 0.00	10,380,80 7.40	0.42	否
39	588200	嘉实上证 科创板芯 片 ETF	交易型开 放式	1,981,200. 00	9,779,203. 20	0.40	否
40	512680	广发中证 军工 ETF	交易型开 放式	7,394,500. 00	9,672,006. 00	0.39	是
41	011123	汇添富 ESG 可持 续成长股 票 C	契约型开 放式	6,778,897. 94	8,811,211. 54	0.36	否
42	513850	易方达 MSCI 美 国 50ETF(Q DII)	交易型开 放式	4,462,700. 00	7,751,709. 90	0.31	否
43	159687	南方基金 南方东英 富时亚太 精选 ETF(QDII)	交易型开 放式	3,478,200. 00	6,879,879. 60	0.28	否
44	159566	易方达国 证新能源 电池 ETF	交易型开 放式	3,002,000. 00	6,811,538. 00	0.28	否
45	512070	易方达沪 深 300 非 银 ETF	交易型开 放式	7,883,400. 00	6,180,585. 60	0.25	否
46	515880	国泰中证 全指通信 设备 ETF	交易型开 放式	3,130,500. 00	5,622,378. 00	0.23	否
47	159655	华夏标普 500ETF(Q DII)	交易型开 放式	2,805,400. 00	5,288,179. 00	0.21	否
48	159513	大成纳斯	交易型开	2,635,800.	4,778,705.	0.19	否

		达克100ETF(QDII)	放式	00	40		
49	517900	招商中证银行 AH 价格优选 ETF	交易型开放式	2,836,600.00	3,852,102.80	0.16	否
50	515220	国泰中证煤炭 ETF	交易型开放式	3,073,100.00	3,278,997.70	0.13	否
51	03441	南方东西精选	交易型开放式	252,200.00	2,608,865.37	0.11	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

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

7.13.3 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	187,192.58
2	应收清算款	47,237,021.21
3	应收股利	5,871.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,603.91
6	其他应收款	11,444.80
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,457,133.70

7.13.4 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。

7.13.5 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	4,269	316,591.97	31,482,231.99	2.33%	1,320,048,890.70	97.67%
广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C	4,168	272,727.97	7,200,000.00	0.63%	1,129,530,190.15	99.37%
合计	8,437	294,922.52	38,682,231.99	1.55%	2,449,579,080.85	98.45%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	0.00	0.0000%
	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	0
	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	0
	广发悦盈稳健三个月持	0

	有混合发起式（FOF）C	
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,555.61	0.40%	10,000,555.61	0.40%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,555.61	0.40%	10,000,555.61	0.40%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）A	广发悦盈稳健三个月持有混合发起式（FOF）C
基金合同生效日（2026 年 1 月 8 日）基金份额总额	1,636,144,341.84	1,651,610,403.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	575,838.18	923,541.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	285,189,057.33	515,803,754.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,351,531,122.69	1,136,730,190.15

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2026 年 1 月 8 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 2 月 14 日发布公告，自 2026 年 2 月 13 日起，傅友兴先生离任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	

广发证券	4	180,466,601.11	99.69%	78,670.77	99.80%	-
中国银河	1	569,174.15	0.31%	154.51	0.20%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择标准

- （1）财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；
- （2）内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；
- （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；
- （4）具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；
- （5）具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；
- （6）中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

- （1）对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

（2）协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议并通知基金托管人。

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	163,283,091.68	100.00 %	519,548,000.00	100.00 %	-	-	1,387,188,536.69	100.00 %
中国银河	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-06
2	广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-09
3	关于广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-03
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册募集的文件

（二）《广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发悦盈稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

（五）法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日