广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工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 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 7
2.6 其他相关资料 7
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 8
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 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 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16
5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 17
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 17
6 半年度财务会计报告（未经审计） 17
6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 18
6.3 净资产变动表 19
6.4 报表附注 21
7 投资组合报告 47
7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 48
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 48
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 48
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 64
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 68
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 68
7.8 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 69
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 69
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 69

7.11 投资组合报告附注 69
8 基金份额持有人信息 70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 70
8.2 盈利投资者数量占比 70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 71
8.4 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 71
9 开放式基金份额变动 71
10 重大事件揭示 72
10.1 基金份额持有人大会决议 72
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 72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 72
10.4 基金投资策略的改变 72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 72
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 72
10.8 其他重大事件 85
11 影响投资者决策的其他重要信息 86
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 86
12 备查文件目录 86
12.1 备查文件目录 86
12.2 存放地点 87
12.3 查阅方式 87

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）	
基金简称	广发全球稳健配置混合（QDII）	
基金主代码	019230	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 4 月 24 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	1,966,290,331.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C
下属分级基金的交易代码	019230	019231
报告期末下属分级基金的份额总额	670,284,264.01 份	1,296,006,067.51 份

注：广发全球稳健配置混合（QDII）A 含 A 类人民币份额（份额代码：019230）及 A 类美元现汇份额（份额代码：019232），交易代码仅列示 A 类人民币份额代码；广发全球稳健配置混合（QDII）C 含 C 类人民币份额（份额代码：019231）及 C 类美元现汇份额（份额代码：019233），交易代码仅列示 C 类人民币份额代码。

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，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解全球各国的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。 本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，采用“自上而下”的分析视角，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时做出动态调整。 具体投资策略包括：1、国家地区配置策略；2、大类资产配置策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	彭博巴克莱全球综合债券指数收益率×55%+人民币计价的 MSCI 全球指数收益率×40%+人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型

	基金，低于股票型基金。 本基金为全球证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。 本基金投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国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168号星河湾中心28-38层；广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		葛长伟	廖林

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	1、The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited 2、Industrial and Commercial Bank of China (Asia) Limited
	中文	-	1、香港上海汇丰银行有限公司 2、中国工商银行(亚洲)有限公司
注册地址		-	1、香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦 2、33/F, ICBC Tower, 3 Garden Road,

		Central, Hong Kong
办公地址	-	1、香港九龙深旺道一号汇丰中心一座六楼 2、29/F, ICBC Tower, 3 Garden Road, Central, Hong Kong
邮政编码	-	-

2.5 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

2.6 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**	
	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C
本期已实现收益	12,896,592.89	14,365,025.26
本期利润	62,510,227.88	87,375,790.37
加权平均基金份额本期利润	0.2765	0.2671
本期加权平均净值利润率	24.34%	23.10%
本期基金份额净值增长率	22.13%	21.85%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C
期末可供分配利润	55,121,775.89	91,024,600.65
期末可供分配基金份额利润	0.0822	0.0702
期末基金资产净值	830,053,821.30	1,588,415,449.99

期末基金份额净值	1.2384	1.2256
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C
基金份额累计净值增长率	23.84%	22.56%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发全球稳健配置混合（QDII）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	25.24%	1.33%	5.26%	0.41%	19.98%	0.92%
过去六个月	22.13%	1.01%	2.91%	0.41%	19.22%	0.60%
过去一年	24.86%	0.74%	7.38%	0.34%	17.48%	0.40%
自基金合同生效起至今	23.84%	0.54%	21.10%	0.41%	2.74%	0.13%

广发全球稳健配置混合（QDII）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	25.11%	1.33%	5.26%	0.41%	19.85%	0.92%
过去六个月	21.85%	1.01%	2.91%	0.41%	18.94%	0.60%
过去一年	24.27%	0.74%	7.38%	0.34%	16.89%	0.40%
自基金合同生效起至今	22.56%	0.54%	21.10%	0.41%	1.46%	0.13%

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

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

较

广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）

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

(2024 年 4 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日)

广发全球稳健配置混合（QDII）A

广发全球稳健配置混合（QDII）C

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李耀柱	本基金的基金经理；广发全球精选股票型证券投资基金的基金经理；广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理；广发沪港深价值成长混合型证券投资基金的基金经理；广发沪港深新机遇股票型证券投资基金的基金经理；广发优势企业混合型证券投资基金（QDII）的基金经理；国	2026-04-10	-	15.9 年	李耀柱先生，中国籍，理学硕士，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中央交易部股票交易员、 国际业务部研究员、基金经理助理、国际业务部总经理助理、国际业务部副总经理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2016

	际业务部总经理				年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 9 月 21 日至 2018 年 10 月 16 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2019 年 4 月 12 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 10 日至 2019 年 4 月 12 日)、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 12 月 17 日至 2020 年 2 月 14 日)、广发消费升级股票型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 27 日至 2020 年 7 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 3 月 7 日至 2020 年 8 月 10 日)、广发港股通优质增长混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 6 日至 2020 年 8 月 10 日)、广发海外多元配置证券投资基金(QDII)基金经理(自 2018 年 2 月 8 日至 2020 年 11 月 27 日)、广发高股息优享混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 1 月 20 日至 2021 年 2 月 1 日)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 2 月 14 日至 2022 年 9 月 26 日)、广发瑞福精选混合型证券投资基金基金经

					理(自 2020 年 11 月 10 日至 2022 年 9 月 26 日)、广发科技动力股票型证券投资基金基金经理(自 2018 年 5 月 31 日至 2025 年 1 月 3 日)、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 24 日至 2025 年 1 月 3 日)、广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）基金经理(自 2021 年 3 月 3 日至 2025 年 9 月 26 日)、广发沪港深行业龙头混合型证券投资基金基金经理(自 2025 年 2 月 10 日至 2026 年 3 月 5 日)、广发沪港深价值精选混合型证券投资基金基金经理(自 2025 年 2 月 12 日至 2026 年 3 月 5 日)、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2025 年 3 月 6 日至 2026 年 3 月 19 日)、广发港股通成长精选股票型证券投资基金基金经理(自 2020 年 9 月 10 日至 2026 年 4 月 21 日)。
林逵	本基金的基金经理助理；广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理助理；广发港股通成长精选股票型证券投资基金的基金经理助理；广发沪港深价值成长混合型证券投资基金的基金经理助理；广发全球精选股票型证券投资基	2026-06-26	-	11 年	林逵先生，中国籍，理学博士，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量化研究员、基金经理助理，上海箐安投资管理有限公司投资经理，蚂蚁科技集团股份有限公司金融智能技术部算法专家，财付通支付科技有限公司自营量化投资经理。

	金的基金经理助理				
沈博文	本基金的基金经理；国际业务部副总经理	2024-04-24	2026-04-10	15.4 年	沈博文女士，中国籍，材料科学工程和金融工程双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国泰君安（香港）有限公司研究部研究员，中投国际（香港）有限责任公司债券投资部副经理，先后任富国基金管理有限公司固定收益投资经理、固定收益基金经理、跨境投资部总经理、广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理(自 2024 年 4 月 24 日至 2026 年 4 月 10 日)、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自 2023 年 4 月 10 日至 2026 年 6 月 16 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备

选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，美国就业市场和经济动能在退税、世界杯效应和股市财富效应等因素加持下，整体经历了“偏弱—企稳—小幅回升”的过程，同时通胀在关税、油价上升、AI 相关涨价等因素推动下，在上半年整体走高。就业韧性叠加通胀走高，市场对美联储加息预期逐渐升温，对资产价格有一定影响。持续的高油价带来的高通胀，使得全球其他央行加息预期也有所升温，其中欧央行和日本央行在二季度均加息 25BP。

国内方面，一季度，经济动能整体改善，内需有所改善。在国补和春节假期等因素影响下，商品消费和服务消费显示出较强韧性，同时外需持续超预期，全球制造业 PMI 改善叠加科技产品出口量价齐升，带动国内出口持续高增。但二季度，在美伊冲突下，结构性特征明显，外需受益于海外经济动能改善和科技产品出口，出口持续超预期，但内需潜力仍有待释放。上半年通胀持续改善，油价上行推动 PPI 同比大幅回升，CPI 中枢也较去年明显抬升。

大类资产方面，美债收益率在 2026 年上半年整体上行，主要受高油价和就业复苏推动，美联储加息预期升温，收益率曲线整体熊平。美股上半年先下后上，一季度受仓位拥挤和美伊冲突影响，市场整体回调，但二季度随着美伊冲突缓解和 AI 产业盈利预期上修，美股快速反弹，上半年标普 500 指数上涨约 9.55%，纳斯达克 100 指数上涨约 19.91%。美元指数上半年整体走强，主要是由于

美国基本面偏强和美联储加息预期升温，但人民币汇率则逆势走强，主要是由于出口持续超预期和国内资产回报率提升等,在岸人民币一度升至 6.75 附近,而黄金则在 1 月大幅上涨后出现持续回调，伦敦金在 6 月底回落至 4000 美元/盎司附近。中国国债收益率在上半年由于宽松的资金面等因素，整体下行。A 股上半年整体收涨，但结构分化明显，半导体等科技板块表现亮眼，其中上证综指上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 上涨 64.25%。港股上半年表现欠佳，恒生指数下跌 10.73%，恒生科技下跌 18.92%，主要受行业叙事走弱和海外流动性收紧预期的负面影响。

操作上，上半年组合持续优化大类资产类别与区域配置。一季度，调整了权益资产内部结构和债券久期。二季度，港股优质的新上市公司为我们组合配置提供机会，围绕着芯片、创新药等行业积极配置。同时，我们适度增配了 A 股、海外发达市场的 AI 和半导体产业链行业，以及港股通高分红板块，债券部分主要以境内利率债为主，以维持组合整体稳健性并保持一定的流动性。策略上，我们采取多资产、多市场、多策略的运作方式，主观和量化策略结合，并控制合适的风险资产比例，力求构建一个最优化的风险调整后收益组合。

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 22.13%，C 类基金份额净值增长率为 21.85%，同期业绩比较基准收益率为 2.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为当前市场对美联储年内加息预期定价过度，下半年有回落空间，带动美债收益率有所回落，曲线整体牛陡。同时，加息预期回落也将带动美元小幅走弱，但预计下行幅度可能相对有限。预计人民币在下半年仍将继续小幅升值，一方面是由于美联储加息预期回落，另一方面预计国内出口仍将维持较强韧性。黄金由于筹码结构恶化，预计短期维持震荡，关注四季度筹码出清后可能的再度上行机会。国内国债收益率在下半年预计仍将维持区间震荡，缺乏明显的下行或上行催化，择机做多赔率。我们对下半年美股仍然持乐观看法，尤其是半导体等硬科技板块，一方面是由于 AI 产业仍在快速演进、盈利预期仍在持续上修，另一方面下半年若美联储加息预期回落，也将边际利好估值。同样地，我们也继续看好 A 股、港股、日股和韩股的硬科技板块，将受益于盈利预期的持续上修和海外流动性的边际改善。

展望未来，资产价格的 K 型分化会得到阶段性缓解，积极进行组合平衡会是未来组合管理的重点。上半年，我们看到了市场价格的极端走势，科技板块一骑绝尘，传统板块表现相对疲弱。随着资产价格的极端走势演绎到一个阶段性极致的水平，资产价格的 K 型走势会得到缓解。我们会在风

险资产上重新调整组合的均衡性。下半年，我们将在策略上保持均衡，风险资产方面增加相对低波权益的关注，同时适当增加海外权益，特别是发达市场权益的比例，提升组合的抗风险能力。行业和地区上，我们看好中国、韩国、日本和美国的科技行业以及高分红行业的配置机会，未来将积极关注。固定收益方面，我们看好人民币债券的中长期配置价值，人民币债券仍然是我们重要的固定收益配置。

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遵规守信、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 2026 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：广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	335,065,262.15	40,016,160.32
结算备付金		135,143,139.31	7,607,779.55
存出保证金		13,089,281.36	1,310,371.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,978,095,472.26	249,199,929.05
其中：股票投资		682,871,991.66	50,916,528.45
基金投资		-	24,377,625.34
债券投资		1,295,223,480.60	173,905,775.26
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		62,932,964.00	688,001.49
应收股利		335,740.60	31,262.69
应收申购款		52,828,679.80	74,894.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,577,490,539.48	298,928,399.08
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	20,005,613.38
应付清算款		86,423,947.41	28,645,134.28
应付赎回款		69,325,437.46	2,708,749.38
应付管理人报酬		1,933,718.52	260,790.40
应付托管费		322,286.40	43,465.08
应付销售服务费		540,470.66	44,186.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,004.26	15,259.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	463,403.48	129,362.54
负债合计		159,021,268.19	51,852,560.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,966,290,331.52	244,492,389.78
未分配利润	6.4.7.9	452,178,939.77	2,583,448.61
净资产合计		2,418,469,271.29	247,075,838.39
负债和净资产总计		2,577,490,539.48	298,928,399.08

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发全球稳健配置混合（QDII）A 基金份额净值人民币 1.2384 元，基金份额总额 670,284,264.01 份；广发全球稳健配置混合（QDII）C 基金份额净值人民币 1.2256 元，基金份额总额 1,296,006,067.51 份；总份额总额 1,966,290,331.52 份。

6.2 利润表

会计主体：广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**附注号**	**本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日**	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**

一、营业总收入		155,290,046.45	1,327,165.26
1．利息收入		383,041.99	130,702.31
其中：存款利息收入	6.4.7.10	350,652.27	101,578.35
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		32,389.72	29,123.96
其他利息收入		-	-
2．投资收益（损失以“-”填列）		30,888,294.63	-2,316,044.21
其中：股票投资收益	6.4.7.11	26,394,953.35	-5,810,596.70
基金投资收益	6.4.7.12	-890,249.32	412,247.48
债券投资收益	6.4.7.13	1,164,114.05	5,573,178.49
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	3,491,089.72	-3,331,037.77
股利收益	6.4.7.17	728,386.83	840,164.29
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	122,624,400.10	2,819,962.25
4．汇兑收益（损失以“-”号填列）		211,358.58	668,648.77
5．其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,182,951.15	23,896.14
减：二、营业总支出		5,404,028.20	2,142,779.17
1．管理人报酬		3,698,650.25	1,640,826.77
2．托管费		616,441.70	273,471.15
3．销售服务费		913,848.93	26,500.24
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		62,704.63	88,264.41
其中：卖出回购金融资产支出		62,704.63	88,264.41
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		12,159.30	11,236.15
8．其他费用	6.4.7.21	100,223.39	102,480.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**149,886,018.25**	**-815,613.91**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**149,886,018.25**	**-815,613.91**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		149,886,018.25	-815,613.91

6.3 净资产变动表

会计主体：广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	244,492,389.78	2,583,448.61	247,075,838.39
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	244,492,389.78	2,583,448.61	247,075,838.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,721,797,941.74	449,595,491.16	2,171,393,432.90
（一）、综合收益总额	-	149,886,018.25	149,886,018.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,721,797,941.74	299,709,472.91	2,021,507,414.65
其中：1.基金申购款	2,187,969,715.39	365,539,034.81	2,553,508,750.20
2.基金赎回款	-466,171,773.65	-65,829,561.90	-532,001,335.55
（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	1,966,290,331.52	452,178,939.77	2,418,469,271.29
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	348,677,314.55	-2,233,637.29	346,443,677.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	348,677,314.55	-2,233,637.29	346,443,677.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-119,780,463.21	291,554.85	-119,488,908.36
（一）、综合收益总额	-	-815,613.91	-815,613.91

（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）	-119,780,463.21	1,107,168.76	-118,673,294.45
其中：1.基金申购款	19,064,415.37	-66,443.99	18,997,971.38
2.基金赎回款	-138,844,878.58	1,173,612.75	-137,671,265.83
（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	228,896,851.34	-1,942,082.44	226,954,768.90

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

广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2023]1769 号《关于准予广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）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《广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》公开募集。本基金于 2024 年 2 月 6 日至 2024 年 4 月 19 日止期间募集资金总额共计人民币 528,823,655.34 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 243,774.87 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证。经向中国证监会备案，《广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》于 2024 年 4 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 529,067,430.21 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司和中国工商银行（亚洲）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。

根据基金管理人于 2025 年 9 月 13 日发布的《广发基金管理有限公司关于旗下部分基金增加境

外托管人的公告》，本基金自 2025 年 9 月 15 日起增加中国工商银行（亚洲）有限公司为境外托管人。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

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

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

（2）企业所得税、个人所得税

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

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

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

（3）印花税

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

（4）其他税收

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金份额或基金境外交易或收益涉及的税收，按照投资所在地或相关国家（地区）的法律法规、税收协定等执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	335,065,262.15
等于：本金	335,035,121.76
加：应计利息	30,140.39
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	335,065,262.15

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		560,158,960.74	-	682,871,991.66	122,713,030.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	52,593,371.00	182,405.81	52,798,425.81	22,649.00
	银行间市场	1,227,753,550.00	13,386,054.79	1,242,425,054.79	1,285,450.00
	合计	1,280,346,921.00	13,568,460.60	1,295,223,480.60	1,308,099.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,840,505,881.74	13,568,460.60	1,978,095,472.26	124,021,129.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-121,813,883.13	-	-	-
其中：股指期货投资	-121,813,883.13	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-121,813,883.13	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
HIN6	HANG SENG IDX FUT Jul26	-74.00	-73,535,662.63	-38,389.91
NQU6	NASDAQ	-12.00	-49,911,253.24	-1,594,642.83

	100 E-MINI Sep26			
合计	-	-	-	-1,633,032.74
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-1,633,032.74
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为期货投资。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23,252.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	357,954.96
其中：交易所市场	351,879.96
银行间市场	6,075.00
应付利息	-
预提费用	82,195.94
合计	463,403.48

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发全球稳健配置混合（QDII）A		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,129,540.89	142,129,540.89
本期申购	672,522,513.69	672,522,513.69
本期赎回（以“-”号填列）	-144,367,790.57	-144,367,790.57
本期末	670,284,264.01	670,284,264.01

金额单位：人民币元

广发全球稳健配置混合（QDII）C		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,362,848.89	102,362,848.89
本期申购	1,515,447,201.70	1,515,447,201.70
本期赎回（以“-”号填列）	-321,803,983.08	-321,803,983.08
本期末	1,296,006,067.51	1,296,006,067.51

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发全球稳健配置混合（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,667,329.29	-679,145.12	1,988,184.17
本期期初	2,667,329.29	-679,145.12	1,988,184.17
本期利润	12,896,592.89	49,613,634.99	62,510,227.88
本期基金份额交易产生的变动数	39,557,853.71	55,713,291.53	95,271,145.24
其中：基金申购款	47,264,674.25	65,131,580.67	112,396,254.92
基金赎回款	-7,706,820.54	-9,418,289.14	-17,125,109.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,121,775.89	104,647,781.40	159,769,557.29

单位：人民币元

广发全球稳健配置混合（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,022,386.36	-427,121.92	595,264.44
本期期初	1,022,386.36	-427,121.92	595,264.44
本期利润	14,365,025.26	73,010,765.11	87,375,790.37
本期基金份额交易产生的变动数	75,637,189.03	128,801,138.64	204,438,327.67
其中：基金申购款	94,744,944.94	158,397,834.95	253,142,779.89
基金赎回款	-19,107,755.91	-29,596,696.31	-48,704,452.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	91,024,600.65	201,384,781.83	292,409,382.48

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	314,456.78
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	35,674.15
其他	521.34
合计	350,652.27

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,394,953.35
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	26,394,953.35

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	976,198,116.96
减：卖出股票成本总额	946,181,645.93
减：交易费用	3,621,517.68

买卖股票差价收入	26,394,953.35

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	62,803,787.90
减：卖出/赎回基金成本总额	63,693,635.11
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-25,917.87
减：交易费用	26,319.98
基金投资收益	-890,249.32

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,961,541.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,797,427.60
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	1,164,114.05

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	261,857,235.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	261,964,485.19
减：应计利息总额	2,683,998.46
减：交易费用	6,179.05
买卖债券差价收入	-2,797,427.60

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	3,118,876.64
汇率期货投资收益	470,442.97
国债期货投资收益	-98,229.89

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	633,413.87
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	94,972.96
合计	728,386.83

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	124,385,677.09
——股票投资	123,321,618.14
——债券投资	977,645.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	86,413.55
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,761,276.99
——权证投资	-
——汇率期货投资	-128,244.25
——股指期货投资	-1,633,032.74
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	122,624,400.10

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,170,600.95
基金转换费收入	6,080.83
其他	6,269.37
合计	1,182,951.15

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,824.00
账户维护费	18,000.00
其他	6,503.45
合计	100,223.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行（亚洲）有限公司	基金境外资产托管人
香港上海汇丰银行有限公司	基金境外资产托管人

广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
瑞晨股权投资基金管理（广东）有限公司	基金管理人子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期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	840,186.52	0.03%	44,363,230.53	5.10%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	3,499,185.54	1.01%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	419,873,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	315.43	0.01%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	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	19,342.32	4.34%	13,333.01	93.04%

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,698,650.25	1,640,826.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,029,237.45	735,519.80
应支付基金管理人的净管理费	2,669,412.80	905,306.97

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

约定年费率为 1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2026年1月1日至2026年6月30日	2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	616,441.70	273,471.15

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

约定年费率为 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C	合计
广发基金管理有限公司	-	113,678.76	113,678.76
广发证券股份有限公司	-	1,990.88	1,990.88
合计	-	115,669.64	115,669.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C	合计
广发基金管理有限公司	-	616.96	616.96
广发证券股份有限公司	-	12.67	12.67
合计	-	629.63	629.63

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 0.50%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	90,693,814.62	-	-	-
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	90,693,814.62	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.53%	-	-	-

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

广发全球稳健配置混合（QDII）A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年6月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
瑞晨股权投资基金管理(广东)有限公	9,046,783.90	1.35%	-	-

司				

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

广发全球稳健配置混合（QDII）C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	252,037,300.85	151,044.83	1,737,451.88	25,954.28
香港上海汇丰银行有限公司	83,027,961.30	163,411.95	16,557,946.86	73,799.34

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司、境外资产托管人香港上海汇丰银行有限公司保管，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

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
香港上海汇丰银行有限公司	USY000AKAK39	HKAA 4 ¾ 07/15/28 REGS	公开发行	6,000.00	599,196.00
香港上海汇丰银行有限公司	USY000AKAL12	HKAA 4 ⅞ 07/15/30 REGS	公开发行	6,000.00	597,288.00
香港上海汇丰银行有限公司	USY000AKAM94	HKAA 5 ⅛ 01/15/35 REGS	公开发行	3,000.00	297,135.00

香港上海汇丰银行有限公司	USY4841PAD43	KHFC 5 ⅛ 01/21/30 REGS	公开发行	3,000.00	298,578.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS2971656074	TATSON 5.389 07/21/28 EMTN	公开发行	2,000.00	200,000.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS2998746213	MAADEN 5 ¼ 02/13/30 REGS	公开发行	2,000.00	199,774.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS2998746486	MAADEN 5 ½ 02/13/35 REGS	公开发行	2,000.00	199,362.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS3010536145	SRCSUK 5 ⅜ 02/27/35	公开发行	3,000.00	297,621.00
香港上海汇丰银行有限公司	HK0001127510	MTRC 4 ⅞ 04/01/35 EMTN	公开发行	2,000.00	199,796.00
香港上海汇丰银行有限公司	HK0001127528	MTRC 5 ¼ 04/01/55 EMTN	公开发行	2,000.00	196,912.00
香港上海汇丰银行有限公司	USJ54675BE26	NIPLIF 6 ½ 04/30/55 REGS	公开发行	2,000.00	200,000.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS3037640037	KORWAT 4 ⅜ 05/21/27 EMTN	公开发行	2,000.00	199,092.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS3055657848	SRGIM 5 ¾ 05/28/35 REGS	公开发行	3,000.00	299,391.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS3055659620	SRGIM 6 ½ 05/28/55 REGS	公开发行	2,000.00	199,424.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS3094282269	MTRC 4 ⅞ PERP EMTN	公开发行	2,000.00	200,000.00
香港上海汇丰银行有限公司	XS3094282343	MTRC 5 ⅝ PERP EMTN	公开发行	2,000.00	200,000.00
香港上海汇丰银行有限公司	USY306AXAL42	HLINSU 6.3 06/24/55 REGS	公开发行	2,000.00	200,000.00
香港上海汇	US45604HAS	INDKOR 4 ⅜	公开发行	2,000.00	199,006.00

丰银行有限公司	67	06/24/30 REGS			
香港上海汇丰银行有限公司	XS3096112688	RESLIF 6 ¾ 07/02/35	公开发行	3,000.00	300,000.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
9630 HK	芯碁微装	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	219.81	397.95	94,550.00	20,783,216.80	37,626,285.65	-
3277 HK	长光辰芯	2026-04-15	6 个月	新股流通受限	34.91	89.71	245,500.00	8,570,638.72	22,023,210.59	-
9637 HK	礼邦医药-B	2026-06-25	6 个月	新股流通受限	19.66	35.63	502,700.00	9,885,450.72	17,912,906.59	-
7666 HK	剂泰科技-P	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	9.18	12.23	1,417,000.00	13,013,926.38	17,323,584.64	-
6228 HK	MERDEKAGOLD-DRS	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	23.14	19.61	589,400.00	13,635,975.29	11,556,618.89	-
6106 HK	仙工智能	2026-06-22	6 个月	新股流通受限	88.35	81.05	77,100.00	6,811,498.19	6,249,065.70	-
1021 HK	华沿机器人	2026-03-26	6 个月	新股流通受限	15.02	14.65	46,000.00	690,951.74	673,852.36	-

001248 CH	华润新能源	2026-06-25	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	1,000.00	10,110.00	10,110.00	-

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。

本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险小。在场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	50,782,416.49	48,888,667.62
合计	50,782,416.49	48,888,667.62

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、超短期融资券以及未有境内评级的境外债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	1,376,418.21
AAA 以下	-	312,025.18
未评级	1,244,441,064.11	123,328,664.25
合计	1,244,441,064.11	125,017,107.64

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以及未有境内评级的境外债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	335,065,262.15	-	-	-	335,065,262.15
结算备付金	125,512,962.10	-	-	9,630,177.21	135,143,139.31
存出保证金	459,938.41	-	-	12,629,342.95	13,089,281.36
交易性金融资产	153,130,014.85	661,702,876.71	480,390,589.04	682,871,991.66	1,978,095,472.26
应收清算款	-	-	-	62,932,964.00	62,932,964.00
应收股利	-	-	-	335,740.60	335,740.60
应收申购款	831,643.72	-	-	51,997,036.08	52,828,679.80
资产总计	614,999,821.23	661,702,876.71	480,390,589.04	820,397,252.50	2,577,490,539.48
负债					
应付清算款	-	-	-	86,423,947.41	86,423,947.41
应付赎回款	-	-	-	69,325,437.46	69,325,437.46
应付管理人报酬	-	-	-	1,933,718.52	1,933,718.52
应付托管费	-	-	-	322,286.40	322,286.40
应付销售服务费	-	-	-	540,470.66	540,470.66
应交税费	-	-	-	12,004.26	12,004.26
其他负债	-	-	-	463,403.48	463,403.48
负债总计	-	-	-	159,021,268.19	159,021,268.19
利率敏感度缺口	614,999,821.23	661,702,876.71	480,390,589.04	661,375,984.31	2,418,469,271.29
上年度末 2025 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**

资产					
货币资金	40,016,160.32	-	-	-	40,016,160.32
结算备付金	1,980,751.53	-	-	5,627,028.02	7,607,779.55
存出保证金	1,310,371.00	-	-	-	1,310,371.00
交易性金融资产	79,325,723.76	43,608,738.59	50,971,312.91	75,294,153.79	249,199,929.05
应收清算款	-	-	-	688,001.49	688,001.49
应收股利	-	-	-	31,262.69	31,262.69
应收申购款	4,840.55	-	-	70,054.43	74,894.98
资产总计	122,637,847.16	43,608,738.59	50,971,312.91	81,710,500.42	298,928,399.08
负债					
卖出回购金融资产款	20,005,613.38	-	-	-	20,005,613.38
应付清算款	-	-	-	28,645,134.28	28,645,134.28
应付赎回款	-	-	-	2,708,749.38	2,708,749.38
应付管理人报酬	-	-	-	260,790.40	260,790.40
应付托管费	-	-	-	43,465.08	43,465.08
应付销售服务费	-	-	-	44,186.18	44,186.18
应交税费	-	-	-	15,259.45	15,259.45
其他负债	-	-	-	129,362.54	129,362.54
负债总计	20,005,613.38	-	-	31,846,947.31	51,852,560.69
利率敏感度缺口	102,632,233.78	43,608,738.59	50,971,312.91	49,863,553.11	247,075,838.39

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-12,780,789.91	-1,194,099.27
	市场利率下降 25 个基点	12,988,263.95	1,194,359.83

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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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				
货币资金	102,680,389.41	17.44	768.61	102,681,175.46
结算备付金	4,339,436.41	5,290,740.80	-	9,630,177.21
存出保证金	4,263,579.40	8,365,763.55	-	12,629,342.95
交易性金融资产	210,429,259.37	202,779,227.73	148,261,782.64	561,470,269.74
应收股利	34,619.26	85,521.34	-	120,140.60
应收清算款	-	38,960,665.52	-	38,960,665.52
应收申购款	3,608,247.88	-	-	3,608,247.88
资产合计	**325,355,531.73**	**255,481,936.38**	**148,262,551.25**	**729,100,019.36**
以外币计价的负债				
应付清算款	5,288,517.89	-	58,616,716.05	63,905,233.94
应付赎回款	1,451,190.29	-	-	1,451,190.29
其他负债	171.16	-	-	171.16
负债合计	**6,739,879.34**	**-**	**58,616,716.05**	**65,356,595.39**
资产负债表外汇风险敞口净额	**318,615,652.39**	**255,481,936.38**	**89,645,835.20**	**663,743,423.97**
项目	**上年度末 2025年12月31日**			
	美元 折合人民币	**港币 折合人民币**	**其他币种 折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产				
货币资金	31,825,096.09	1,302,479.64	450.15	33,128,025.88
结算备付金	4,853,578.43	773,449.59	-	5,627,028.02
交易性金融资产	184,751,985.45	2,135,683.20	1,064,154.99	187,951,823.64
应收股利	31,262.69	-	-	31,262.69
应收清算款	-	496,551.57	191,449.92	688,001.49
应收申购款	9,699.74	-	-	9,699.74
资产合计	**221,471,622.40**	**4,708,164.00**	**1,256,055.06**	**227,435,841.46**

以外币计价的负债				
应付清算款	25,525,680.78	-	-	25,525,680.78
应付赎回款	503.96	-	-	503.96
负债合计	**25,526,184.74**	**-**	**-**	**25,526,184.74**
资产负债表外汇风险敞口净额	**195,945,437.66**	**4,708,164.00**	**1,256,055.06**	**201,909,656.72**

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	33,187,171.20	10,095,482.84
	所有外币相对人民币贬值 5%	-33,187,171.20	-10,095,482.84

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	682,871,991.66	28.24	50,916,528.45	20.61
交易性金融资产－基金投资	-	-	24,377,625.34	9.87
交易性金融资产－债券投资	-	-	1,688,443.39	0.68
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	682,871,991.66	28.24	76,982,597.18	31.16

注：其他包含在期货交易所的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上升 5%	60,805,289.85	4,982,703.82
	下降 5%	-60,805,289.85	-4,982,703.82

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	569,496,357.24
第二层次	1,295,233,590.60
第三层次	113,365,524.42
合计	1,978,095,472.26

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	682,871,991.66	26.49
	其中：普通股	650,591,477.81	25.24
	存托凭证	32,280,513.85	1.25
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,295,223,480.60	50.25
	其中：债券	1,295,223,480.60	50.25
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	470,208,401.46	18.24
8	其他各项资产	129,186,665.76	5.01

9	合计	2,577,490,539.48	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 40,466,439.34 元，占基金资产净值比例 1.67%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
韩国	69,820,549.41	2.89
日本	78,441,233.23	3.24
中国	121,401,721.92	5.02
中国香港	202,779,227.73	8.38
美国	210,429,259.37	8.70
合计	682,871,991.66	28.24

注：（1）国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

（2）存托凭证按照本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	309,606.00	0.01
原材料	29,097,871.73	1.20
工业	4,468,178.82	0.18
非日常生活消费品	1,263,584.00	0.05
日常消费品	643,854.00	0.03
医疗保健	50,287,543.05	2.08
金融	40,386,571.02	1.67
信息技术	555,118,684.04	22.95
通讯业务	529,647.00	0.02
公用事业	675,704.00	0.03
房地产	90,748.00	0.00
合计	682,871,991.66	28.24

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比

								例（%）
1	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	潮州三环(集团)股份有限公司	300408 CH	深圳证券交易所	中国	337,500.00	56,328,750.00	2.33
2	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	11,972.00	47,367,456.47	1.96
3	Circuit Fabology Microelectronics Equipment Co Ltd	合肥芯碁微电子装备股份有限公司	9630 HK	香港交易所	中国香港	107,850.00	43,633,177.45	1.80
4	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	8,211.00	40,433,268.83	1.67
5	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	4,998.00	39,293,045.30	1.62
6	SK hynix Inc	SK 海力士株式会社	000660 KS	首尔证券交易所	韩国	3,240.00	37,769,904.28	1.56
7	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港交易所	中国香港	5,320,000.00	37,288,936.02	1.54
			601939 CH	上海证券交易所	中国	20,900.00	201,267.00	0.01
8	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	11,987.00	35,378,039.79	1.46
9	Taiyo Yuden Co Ltd	太阳诱电株式会社	6976 JP	东京证券交易所	日本	39,800.00	33,718,828.65	1.39
10	ARM Holdings PLC	ARM 控股公共有限公司	ARM US	纳斯达克证券交易所	美国	13,367.00	32,280,513.85	1.33
11	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	首尔证券交易所	韩国	21,814.00	32,050,645.13	1.33
12	Murata Manufacturing Co	村田制作所	6981 JP	东京证券交易所	日本	62,100.00	29,752,282.33	1.23

	Ltd							
13	Lingyi iTech Guangdong Co	广东领益智造股份有限公司	1688 HK	香港交易所	中国香港	3,158,460.00	29,270,802.22	1.21
14	Gpixel Changchun Microelectronics Inc	长春长光辰芯微电子股份有限公司	3277 HK	香港交易所	中国香港	245,500.00	22,023,210.59	0.91
15	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	兆易创新科技集团股份有限公司	603986 CH	上海证券交易所	中国	26,600.00	21,679,000.00	0.90
16	Maxone Semiconductor (Suzhou) Co., Ltd.	强一半导体(苏州)股份有限公司	688809 CH	上海证券交易所	中国	33,240.00	20,708,520.00	0.86
17	Alebund Pharmaceuticals Jiangsu Ltd	礼邦医药(江苏)股份有限公司	9637 HK	香港交易所	中国香港	502,700.00	17,912,906.59	0.74
18	Metis TechBio Co Ltd	剂泰科技(北京)股份有限公司	7666 HK	香港交易所	中国香港	1,417,000.00	17,323,584.64	0.72
19	Kulicke & Soffa Industries Inc	Kulicke & Soffa 实业股份有限公司	KLIC US	纳斯达克证券交易所	美国	17,208.00	15,676,935.13	0.65
20	IMPACT Therapeutics Inc	南京英派药业股份有限公司	7630 HK	香港交易所	中国香港	436,000.00	13,663,055.82	0.56
21	Merdeka Gold Resources Tbk PT	PT Merdeka Gold Resources Tbk	6228 HK	香港交易所	中国香港	589,700.00	11,563,133.02	0.48
22	Resonac Holdings Corp	昭和电工有限公司	4004 JP	东京证券交易所	日本	10,500.00	7,814,063.25	0.32

23	Mitsui Kinzoku Co Ltd	三井金属株式会社	5706 JP	东京证券交易所	日本	4,000.00	7,156,059.00	0.30
24	Shanghai Seer Intelligent Technology Co Ltd	上海仙工智能科技股份有限公司	6106 HK	香港交易所	中国香港	77,100.00	6,249,065.70	0.26
25	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	华虹宏力半导体有限公司	1347 HK	香港交易所	中国香港	17,000.00	3,177,503.32	0.13
26	Zhongji Innolight Co Ltd	中际旭创股份有限公司	300308 CH	深圳证券交易所	中国	900.00	1,143,000.00	0.05
27	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	宁德时代新能源科技股份有限公司	300750 CH	深圳证券交易所	中国	2,300.00	903,923.00	0.04
28	Eoptolink Technology Inc Ltd	成都新易盛通信技术股份有限公司	300502 CH	深圳证券交易所	中国	1,300.00	789,100.00	0.03
29	Guangdong Huayan Robotics Co Ltd	广东华沿机器人股份有限公司	1021 HK	香港交易所	中国香港	46,000.00	673,852.36	0.03
30	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业集团股份有限公司	601899 CH	上海证券交易所	中国	17,639.00	443,444.46	0.02
31	Luxshare Precision Industry Co Ltd	立讯精密工业股份有限公司	002475 CH	深圳证券交易所	中国	6,000.00	422,400.00	0.02
32	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd	苏州东山精密制造股份有限公司	002384 CH	深圳证券交易所	中国	1,500.00	393,525.00	0.02
33	Advanced Micro-Fa	中微半导体设备(上	688012 CH	上海证券交易	中国	800.00	374,800.00	0.02

	brication Equipment Inc China	海)股份有限公司		所				
34	WuXi AppTec Co Ltd	无锡药明康德新药开发股份有限公司	603259 CH	上海证券交易所	中国	3,000.00	373,530.00	0.02
35	Hygon Information Technology Co., Ltd.	海光信息技术股份有限公司	688041 CH	上海证券交易所	中国	1,000.00	370,300.00	0.02
36	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	江苏恒瑞医药股份有限公司	600276 CH	上海证券交易所	中国	6,000.00	312,240.00	0.01
37	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	沪士电子股份有限公司	002463 CH	深圳证券交易所	中国	2,000.00	305,600.00	0.01
38	Guotai Junan Securities Co Ltd	国泰海通证券股份有限公司	601211 CH	上海证券交易所	中国	16,300.00	296,660.00	0.01
39	Shenzhen Longsys Electronics Co., Ltd.	深圳市江波龙电子股份有限公司	301308 CH	深圳证券交易所	中国	400.00	281,520.00	0.01
40	Agricultural Bank of China Ltd	中国农业银行股份有限公司	601288 CH	上海证券交易所	中国	44,300.00	268,901.00	0.01
41	Bank of Communications Co Ltd	交通银行股份有限公司	601328 CH	上海证券交易所	中国	41,600.00	267,488.00	0.01
42	China CSSC Holdings Ltd	中国船舶工业股份有限公司	600150 CH	上海证券交易所	中国	7,600.00	256,804.00	0.01
43	Bank of Jiangsu	江苏银行股份有限	600919 CH	上海证券交易	中国	23,800.00	256,564.00	0.01

	Co Ltd	公司		所				
44	Han"s Laser Technology Industry Group Co Ltd	大族激光科技产业集团股份有限公司	002008 CH	深圳证券交易所	中国	1,600.00	240,176.00	0.01
45	Sharetronic Data Technology Co Ltd	协创数据技术股份有限公司	300857 CH	深圳证券交易所	中国	700.00	237,930.00	0.01
46	Shennan Circuits Co Ltd	深南电路股份有限公司	002916 CH	深圳证券交易所	中国	500.00	228,950.00	0.01
47	Eve Energy Co Ltd	惠州亿纬锂能股份有限公司	300014 CH	深圳证券交易所	中国	3,400.00	221,102.00	0.01
48	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co	长飞光纤光缆股份有限公司	601869 CH	上海证券交易所	中国	400.00	218,360.00	0.01
49	Ping An Bank Co Ltd	平安银行股份有限公司	000001 CH	深圳证券交易所	中国	21,200.00	213,060.00	0.01
50	Bank of Ningbo Co Ltd	宁波银行股份有限公司	002142 CH	深圳证券交易所	中国	7,100.00	210,799.00	0.01
51	Shannon Semiconductor Technology Co Ltd	香农芯创科技股份有限公司	300475 CH	深圳证券交易所	中国	700.00	210,000.00	0.01
52	Ganfeng Lithium Co Ltd	江西赣锋锂业集团股份有限公司	002460 CH	深圳证券交易所	中国	3,100.00	202,740.00	0.01
53	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	601988 CH	上海证券交易所	中国	35,400.00	202,488.00	0.01
54	China Merchants	招商证券股份有限	600999 CH	上海证券交易	中国	9,500.00	200,450.00	0.01

	Securities Co Ltd	公司		所				
55	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	600941 CH	上海证券交易所	中国	2,300.00	198,099.00	0.01
56	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	浙江华友钴业股份有限公司	603799 CH	上海证券交易所	中国	4,100.00	197,866.00	0.01
57	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	浙江核新同花顺网络信息股份有限公司	300033 CH	深圳证券交易所	中国	800.00	192,800.00	0.01
58	United Nova Technology Co.,Ltd.	芯联集成电路制造股份有限公司	688469 CH	上海证券交易所	中国	17,800.00	188,858.00	0.01
59	CRRC Corp Ltd	中国中车股份有限公司	601766 CH	上海证券交易所	中国	36,300.00	188,760.00	0.01
60	Rockchip Electronics Co Ltd	瑞芯微电子股份有限公司	603893 CH	上海证券交易所	中国	1,000.00	188,360.00	0.01
61	Grace Fabric Technology Co Ltd	宏和电子材料科技股份有限公司	603256 CH	上海证券交易所	中国	700.00	185,731.00	0.01
62	Raytron Technology Co Ltd	烟台睿创微纳技术股份有限公司	688002 CH	上海证券交易所	中国	1,200.00	185,628.00	0.01
63	Konfoong Materials International Co Ltd	宁波江丰电子材料股份有限公司	300666 CH	深圳证券交易所	中国	500.00	184,300.00	0.01
64	Bank of Nanjing Co Ltd	南京银行股份有限公司	601009 CH	上海证券交易所	中国	18,600.00	183,954.00	0.01
65	Foshan Haitian	佛山市海天调味食	603288 CH	上海证券交易	中国	5,500.00	182,380.00	0.01

	Flavouring & Food Co Ltd	品股份有限公司		所				
66	Zangge Mining Co Ltd	藏格矿业股份有限公司	000408 CH	深圳证券交易所	中国	2,600.00	180,232.00	0.01
67	China Resources Microelectronics Ltd	华润微电子有限公司	688396 CH	上海证券交易所	中国	1,800.00	175,590.00	0.01
68	Hunan Yuneng New Energy Battery Material Co.,Ltd.	湖南裕能新能源电池材料股份有限公司	301358 CH	深圳证券交易所	中国	2,300.00	174,501.00	0.01
69	Yunnan Energy New Material Co Ltd	云南恩捷新材料(集团)股份有限公司	002812 CH	深圳证券交易所	中国	2,600.00	173,966.00	0.01
70	Giant Network Group Co Ltd	巨人网络集团股份有限公司	002558 CH	深圳证券交易所	中国	6,300.00	173,628.00	0.01
71	All Winner Technology Co Ltd	珠海全志科技股份有限公司	300458 CH	深圳证券交易所	中国	4,400.00	173,624.00	0.01
72	China International Capital Corp Ltd	中国国际金融股份有限公司	601995 CH	上海证券交易所	中国	4,800.00	173,520.00	0.01
73	Suzhou Novosense Microelectronics Co Ltd	苏州纳芯微电子股份有限公司	688052 CH	上海证券交易所	中国	600.00	172,986.00	0.01
74	Zhejiang Dahua Technolog	浙江大华技术股份有限公司	002236 CH	深圳证券交易所	中国	10,400.00	171,496.00	0.01

	y Co Ltd							
75	Satellite Chemical Co Ltd	卫星化学股份有限公司	002648 CH	深圳证券交易所	中国	7,200.00	169,128.00	0.01
76	Beijing Easpring Material Technology Co Ltd	北京当升材料科技股份有限公司	300073 CH	深圳证券交易所	中国	3,500.00	168,140.00	0.01
77	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	广州视源电子科技股份有限公司	002841 CH	深圳证券交易所	中国	4,800.00	165,744.00	0.01
78	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	山东华鲁恒升化工股份有限公司	600426 CH	上海证券交易所	中国	6,900.00	165,048.00	0.01
79	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	中联重科股份有限公司	000157 CH	深圳证券交易所	中国	23,600.00	164,492.00	0.01
80	Wuhan Guide Infrared Co Ltd	武汉高德红外股份有限公司	002414 CH	深圳证券交易所	中国	12,400.00	164,424.00	0.01
81	Shenzhen MTC Co Ltd	深圳市兆驰股份有限公司	002429 CH	深圳证券交易所	中国	15,800.00	164,162.00	0.01
82	CGN Power Co Ltd	中国广核电力股份有限公司	003816 CH	深圳证券交易所	中国	41,900.00	163,829.00	0.01
83	Hengli Petrochemical Co Ltd	恒力石化股份有限公司	600346 CH	上海证券交易所	中国	9,200.00	162,932.00	0.01
84	Mianyang Fulin Precision	富临精工股份有限公司	300432 CH	深圳证券交易所	中国	8,100.00	162,729.00	0.01

	Co Ltd							
85	China Eastern Airlines Corp Ltd	中国东方航空股份有限公司	600115 CH	上海证券交易所	中国	42,700.00	162,687.00	0.01
86	Trina Solar Co Ltd	天合光能股份有限公司	688599 CH	上海证券交易所	中国	11,400.00	160,968.00	0.01
87	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	中远海运能源运输股份有限公司	600026 CH	上海证券交易所	中国	8,900.00	159,666.00	0.01
88	China National Chemical Engineering Co Ltd	中国化学工程股份有限公司	601117 CH	上海证券交易所	中国	21,600.00	158,760.00	0.01
89	YongXing Special Materials Technology Co Ltd	永兴特种材料科技股份有限公司	002756 CH	深圳证券交易所	中国	2,800.00	158,592.00	0.01
90	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	浙江世纪华通集团股份有限公司	002602 CH	深圳证券交易所	中国	11,200.00	157,920.00	0.01
91	Ecovacs Robotics Co Ltd	科沃斯机器人股份有限公司	603486 CH	上海证券交易所	中国	3,100.00	157,325.00	0.01
92	Sichuan New Energy Power Co Ltd	四川省新能源动力股份有限公司	000155 CH	深圳证券交易所	中国	13,100.00	156,938.00	0.01
93	SVG Optronics Co Ltd	苏州苏大维格科技集团股份有限公司	300331 CH	深圳证券交易所	中国	2,200.00	156,442.00	0.01
94	China Leadshine Technolog	深圳市雷赛智能控制股份有	002979 CH	深圳证券交易所	中国	2,800.00	156,184.00	0.01

	y Co Ltd	限公司						
95	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd	攀钢集团钒钛资源股份有限公司	000629 CH	深圳证券交易所	中国	46,700.00	155,978.00	0.01
96	Huadian Power International Corp Ltd	华电国际电力股份有限公司	600027 CH	上海证券交易所	中国	34,700.00	154,415.00	0.01
97	CNPC Capital Co Ltd	中国石油集团资本股份有限公司	000617 CH	深圳证券交易所	中国	23,400.00	154,206.00	0.01
98	Unionman Technology Co Ltd	广东九联科技股份有限公司	688609 CH	上海证券交易所	中国	14,000.00	154,140.00	0.01
99	Suzhou Recodeal Interconnect System Co Ltd	苏州瑞可达连接系统股份有限公司	688800 CH	上海证券交易所	中国	1,600.00	153,552.00	0.01
100	Queclink Wireless Solutions Co Ltd	上海移为通信技术股份有限公司	300590 CH	深圳证券交易所	中国	10,700.00	153,545.00	0.01
101	Beiqi Foton Motor Co Ltd	北汽福田汽车股份有限公司	600166 CH	上海证券交易所	中国	52,500.00	152,775.00	0.01
102	BeiGene Ltd	百济神州有限公司	688235 CH	上海证券交易所	中国	600.00	152,766.00	0.01
103	Anjoy Foods Group Co Ltd	安井食品集团股份有限公司	603345 CH	上海证券交易所	中国	1,900.00	152,361.00	0.01
104	Wuhan P&S Informati	武汉力源信息技术股份有限	300184 CH	深圳证券交易所	中国	8,600.00	150,930.00	0.01

	on Technology Co Ltd	公司						
105	Huafon Chemical Co Ltd	华峰化学股份有限公司	002064 CH	深圳证券交易所	中国	15,800.00	149,942.00	0.01
106	Shanxi Lu"an Environmental Energy Development Co Ltd	山西潞安环保能源开发股份有限公司	601699 CH	上海证券交易所	中国	10,500.00	149,940.00	0.01
107	Hainan Haide Capital Management Co Ltd	海南海德资本管理股份有限公司	000567 CH	深圳证券交易所	中国	25,100.00	149,847.00	0.01
108	Zhuhai Enpower Electric Co Ltd	珠海英搏尔电气股份有限公司	300681 CH	深圳证券交易所	中国	5,200.00	148,824.00	0.01
109	3peak Inc	思瑞浦微电子科技(苏州)股份有限公司	688536 CH	上海证券交易所	中国	400.00	145,636.00	0.01
110	Wuxi Paike New Materials Technology Co Ltd	无锡派克新材料科技股份有限公司	605123 CH	上海证券交易所	中国	1,500.00	145,515.00	0.01
111	Shaanxi Energy Investment Co., Ltd.	陕西能源投资股份有限公司	001286 CH	深圳证券交易所	中国	14,300.00	145,002.00	0.01
112	Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd	中炬高新技术实业(集团)股份有限公司	600872 CH	上海证券交易所	中国	8,300.00	144,088.00	0.01

113	Shandong Yisheng Livestock & Poultry Breeding Co Ltd	山东益生种畜禽股份有限公司	002458 CH	深圳证券交易所	中国	18,500.00	143,745.00	0.01
114	Winning Health Technology Group Co Ltd	卫宁健康科技集团股份有限公司	300253 CH	深圳证券交易所	中国	21,300.00	143,349.00	0.01
115	Guizhou Tyre Co Ltd	贵州轮胎股份有限公司	000589 CH	深圳证券交易所	中国	35,000.00	142,100.00	0.01
116	Guangzhou Great Power Energy & Technology Co Ltd	广州鹏辉能源科技股份有限公司	300438 CH	深圳证券交易所	中国	1,700.00	140,845.00	0.01
117	Shandong Jincheng Pharmaceutical Group Co Ltd	山东金城医药集团股份有限公司	300233 CH	深圳证券交易所	中国	11,200.00	138,880.00	0.01
118	Luoxin Pharmaceuticals Group Stock Co Ltd	罗欣药业集团股份有限公司	002793 CH	深圳证券交易所	中国	35,900.00	137,856.00	0.01
119	Shanghai Bright Power Semiconductor Co Ltd	上海晶丰明源半导体股份有限公司	688368 CH	上海证券交易所	中国	600.00	129,912.00	0.01
120	Yabao Pharmaceutical Group Co Ltd	亚宝药业集团股份有限公司	600351 CH	上海证券交易所	中国	22,500.00	129,375.00	0.01
121	Hubei Wanrun	湖北万润新能源科	688275 CH	上海证券交易	中国	1,000.00	127,550.00	0.01

	New Energy Technology Co.,Ltd.	技股份有限公司		所				
122	Dosilicon Co Ltd	东芯半导体股份有限公司	688110 CH	上海证券交易所	中国	600.00	122,220.00	0.01
123	Shenzhen Gongjin Electronics Co Ltd	深圳市共进电子股份有限公司	603118 CH	上海证券交易所	中国	9,500.00	115,045.00	0.00
124	Beijing Roborock Technology Co Ltd	北京石头世纪科技股份有限公司	688169 CH	上海证券交易所	中国	1,200.00	113,964.00	0.00
125	Kuangda Technology Group Co Ltd	旷达科技集团股份有限公司	002516 CH	深圳证券交易所	中国	19,900.00	111,042.00	0.00
126	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	北京东方雨虹防水技术股份有限公司	002271 CH	深圳证券交易所	中国	9,300.00	110,391.00	0.00
127	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	申万宏源集团股份有限公司	000166 CH	深圳证券交易所	中国	24,300.00	106,920.00	0.00
128	Sinosteel Engineering & Technology Co Ltd	中钢国际工程技术股份有限公司	000928 CH	深圳证券交易所	中国	21,200.00	105,576.00	0.00
129	ASR Microelectronics Co Ltd	翱捷科技股份有限公司	688220 CH	上海证券交易所	中国	800.00	99,456.00	0.00
130	Biwin Storage Technology Co., Ltd.	深圳佰维存储科技股份有限公司	688525 CH	上海证券交易所	中国	200.00	98,946.00	0.00

131	Shenzhen JPT Opto-Electronics Co Ltd	深圳市杰普特光电股份有限公司	688025 CH	上海证券交易所	中国	200.00	94,000.00	0.00
132	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	保利发展控股集团股份有限公司	600048 CH	上海证券交易所	中国	19,600.00	90,748.00	0.00
133	Jiangsu Guomao Reducer Co Ltd	江苏国茂减速机股份有限公司	603915 CH	上海证券交易所	中国	6,100.00	86,559.00	0.00
134	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	中国旅游集团中免股份有限公司	601888 CH	上海证券交易所	中国	1,600.00	85,936.00	0.00
135	Dongguan Dingtong Precision Metal Co Ltd	东莞市鼎通精密科技股份有限公司	688668 CH	上海证券交易所	中国	200.00	74,660.00	0.00
136	Zhefu Holding Group Co Ltd	浙富控股集团股份有限公司	002266 CH	深圳证券交易所	中国	14,000.00	70,840.00	0.00
137	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd	上海璞泰来新能源科技集团股份有限公司	603659 CH	上海证券交易所	中国	1,900.00	54,967.00	0.00
138	Anhui Huilong Agricultural Means of Production Co Ltd	安徽辉隆农资集团股份有限公司	002556 CH	深圳证券交易所	中国	10,500.00	47,040.00	0.00
139	Qinghai Salt Lake Industry	青海盐湖工业股份有限公司	000792 CH	深圳证券交易所	中国	1,400.00	42,266.00	0.00

	Co Ltd							
140	AECC Aviation Power Co Ltd	中国航发动力股份有限公司	600893 CH	上海证券交易所	中国	800.00	30,672.00	0.00
141	GD Power Development Co Ltd	国电电力发展股份有限公司	600795 CH	上海证券交易所	中国	6,000.00	28,020.00	0.00
142	C&S Paper Co Ltd	中顺洁柔纸业股份有限公司	002511 CH	深圳证券交易所	中国	3,200.00	21,280.00	0.00
143	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行股份有限公司	601998 CH	上海证券交易所	中国	2,700.00	18,711.00	0.00
144	Guangdong Baolihua New Energy Stock Co Ltd	广东宝丽华新能源股份有限公司	000690 CH	深圳证券交易所	中国	3,700.00	17,390.00	0.00
145	Songcheng Performance Development Co Ltd	宋城演艺发展股份有限公司	300144 CH	深圳证券交易所	中国	2,700.00	15,687.00	0.00
146	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd	山西太钢不锈钢股份有限公司	000825 CH	深圳证券交易所	中国	3,600.00	12,276.00	0.00
147	Sbt Ultrasonic Technology Co.,Ltd.	上海骄成超声波技术股份有限公司	688392 CH	上海证券交易所	中国	47.00	10,677.46	0.00
148	China Resources New Energy Holdings Company	华润新能源控股有限公司	001248 CH	深圳证券交易所	中国	1,000.00	10,110.00	0.00

	Limited							
149	Toread Holdings Group Co Ltd	探路者控股集团股份有限公司	300005 CH	深圳证券交易所	中国	400.00	9,040.00	0.00
150	Yunnan Aluminium Co Ltd	云南铝业股份有限公司	000807 CH	深圳证券交易所	中国	200.00	4,428.00	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Lingyi iTech Guangdong Co	1688 HK	68,160,640.36	27.59
2	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	300408 CH	50,033,691.00	20.25
3	Applied Materials Inc	AMAT US	44,481,867.67	18.00
4	Broadcom Inc	AVGO US	42,957,493.00	17.39
5	Lam Research Corp	LRCX US	42,222,621.91	17.09
6	China Construction Bank Corp	939 HK	40,344,164.75	16.33
		601939 CH	879,422.00	0.36
7	Merdeka Gold Resources Tbk PT	6228 HK	37,749,950.60	15.28
8	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	36,997,432.04	14.97
9	SK hynix Inc	000660 KS	36,025,073.46	14.58
10	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	33,493,423.77	13.56
		601088 CH	368,799.00	0.15
11	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	33,194,089.27	13.43
12	ARM Holdings PLC	ARM US	33,027,427.08	13.37
13	Semight Instruments Co., Ltd.	688808 CH	32,905,802.12	13.32
14	NAURA Technology Group Co Ltd	002371 CH	31,314,343.11	12.67
15	Micron Technology Inc	MU US	30,376,329.96	12.29
16	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	29,275,276.81	11.85
		601288 CH	836,414.00	0.34

17	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	688012 CH	29,975,196.53	12.13
18	Murata Manufacturing Co Ltd	6981 JP	28,527,819.46	11.55
19	Taiyo Yuden Co Ltd	6976 JP	28,296,143.56	11.45
20	Mitsui Kinzoku Co Ltd	5706 JP	24,664,474.18	9.98
21	Circuit Fabology Microelectronics Equipment Co Ltd	9630 HK	23,706,715.30	9.59
22	Yankuang Energy Group Co Ltd	1171 HK	23,316,789.69	9.44
		600188 CH	337,923.00	0.14
23	BOC Hong Kong Holdings Ltd	2388 HK	21,198,690.98	8.58
24	Maxone Semiconductor (Suzhou) Co., Ltd.	688809 CH	20,621,664.23	8.35
25	Semtech Corp	SMTC US	20,390,703.67	8.25
26	Gpixel Changchun Microelectronics Inc	3277 HK	15,765,785.93	6.38
27	GigaDevice Semiconductor Inc	3986 HK	15,710,294.61	6.36
28	Hangzhou Chang Chuan Technology Co Ltd	300604 CH	15,102,527.00	6.11
29	Bank of China Ltd	3988 HK	13,474,992.75	5.45
		601988 CH	199,021.00	0.08
30	Nihon Dempa Kogyo Co Ltd	6779 JP	13,316,827.99	5.39
31	Sbt Ultrasonic Technology Co.,Ltd.	688392 CH	13,100,021.71	5.30
32	Metis TechBio Co Ltd	7666 HK	13,013,926.38	5.27
33	Kulicke & Soffa Industries Inc	KLIC US	12,551,009.33	5.08
34	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	7220 JP	12,240,146.15	4.95
35	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	603986 CH	11,644,614.00	4.71
36	Corning Inc	GLW US	10,793,747.13	4.37
37	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MTSI US	10,474,251.46	4.24
38	PetroChina Co Ltd	857 HK	10,430,411.52	4.22
39	Alebund Pharmaceuticals Jiangsu Ltd	9637 HK	9,885,450.72	4.00
40	CKD Corp	6407 JP	9,795,850.84	3.96
41	Suzhou Kematek, Inc.	301611 CH	9,784,917.80	3.96

42	Resonac Holdings Corp	4004 JP	9,724,818.23	3.94
43	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	1347 HK	9,455,632.80	3.83
44	CoreWeave Inc	CRWV US	8,770,703.93	3.55
45	ASML Holding NV	ASML US	8,490,680.64	3.44
46	Nexchip Semiconductor Corporation	688249 CH	7,949,330.71	3.22
47	Raytron Technology Co Ltd	688002 CH	7,719,485.24	3.12
48	IMPACT Therapeutics Inc	7630 HK	7,665,345.65	3.10
49	Advanced Energy Industries Inc	AEIS US	7,498,450.45	3.03
50	Shanghai Iluvatar CoreX Semiconductor Co Ltd	9903 HK	7,461,165.38	3.02
51	Shanghai Seer Intelligent Technology Co Ltd	6106 HK	6,811,498.19	2.76
52	Yancoal Australia Ltd	3668 HK	6,635,703.00	2.69
53	Alphabet Inc	GOOGL US	6,606,999.12	2.67
54	CF Industries Holdings Inc	CF US	6,580,291.66	2.66
55	Jiangsu ToLand Alloy Co Ltd	300855 CH	6,298,687.00	2.55
56	Amazon.com Inc	AMZN US	6,079,294.48	2.46
57	Rio Tinto PLC	RIO US	5,700,652.12	2.31
58	Zhuhai Bojay Electronics Co Ltd	002975 CH	5,585,883.00	2.26
59	Delton Technology Guangzhou Inc	1989 HK	5,470,611.18	2.21
60	Marvell Technology Inc	MRVL US	5,350,026.75	2.17
61	Cerebras Systems Inc	CBRS US	5,338,698.05	2.16

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Semight Instruments Co., Ltd.	688808 CH	42,988,799.51	17.40
2	Lingyi iTech Guangdong Co	1688 HK	39,716,334.75	16.07
3	NAURA Technology Group Co Ltd	002371 CH	36,706,903.42	14.86
4	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	688012 CH	35,522,555.17	14.38

5	Broadcom Inc	AVGO US	34,218,355.61	13.85
6	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	29,088,748.96	11.77
		601088 CH	350,816.00	0.14
7	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	26,673,288.98	10.80
		601288 CH	547,938.00	0.22
8	GigaDevice Semiconductor Inc	3986 HK	23,618,602.37	9.56
9	Merdeka Gold Resources Tbk PT	6228 HK	23,353,098.98	9.45
10	Semtech Corp	SMTC US	23,030,797.83	9.32
11	BOC Hong Kong Holdings Ltd	2388 HK	20,374,154.55	8.25
12	Yankuang Energy Group Co Ltd	1171 HK	17,949,097.89	7.26
		600188 CH	329,730.00	0.13
13	Hangzhou Chang Chuan Technology Co Ltd	300604 CH	18,198,624.60	7.37
14	Mitsui Kinzoku Co Ltd	5706 JP	18,041,699.99	7.30
15	Lam Research Corp	LRCX US	16,313,019.17	6.60
16	Micron Technology Inc	MU US	15,242,509.57	6.17
17	Gpixel Changchun Microelectronics Inc	3277 HK	14,261,868.58	5.77
18	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	7220 JP	14,073,670.76	5.70
19	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MTSI US	13,503,303.90	5.47
20	Sbt Ultrasonic Technology Co.,Ltd.	688392 CH	13,484,600.58	5.46
21	Bank of China Ltd	3988 HK	12,494,773.42	5.06
22	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	1347 HK	11,223,005.34	4.54
23	Nihon Dempa Kogyo Co Ltd	6779 JP	11,210,923.69	4.54
24	Applied Materials Inc	AMAT US	10,525,483.80	4.26
25	Corning Inc	GLW US	10,046,323.70	4.07
26	Suzhou Kematek, Inc.	301611 CH	9,218,004.10	3.73
27	Raytron Technology Co Ltd	688002 CH	8,897,000.59	3.60
28	CKD Corp	6407 JP	8,861,684.01	3.59
29	Manycore Tech Inc	68 HK	8,629,372.17	3.49
30	PetroChina Co Ltd	857 HK	8,125,504.89	3.29
		601857 CH	480,071.00	0.19
31	ASML Holding NV	ASML US	8,351,323.47	3.38
32	Nexchip Semiconductor Corporation	688249 CH	8,309,156.77	3.36
33	CoreWeave Inc	CRWV US	8,004,833.84	3.24
34	Mueller Industries Inc	MLI US	7,819,982.84	3.17
35	Shanghai Iluvatar CoreX Semiconductor Co Ltd	9903 HK	7,485,999.17	3.03
36	Alphabet Inc	GOOGL US	7,028,355.97	2.84
37	Amazon.com Inc	AMZN US	6,882,294.56	2.79
38	Advanced Energy Industries Inc	AEIS US	6,869,655.00	2.78
39	CF Industries Holdings Inc	CF US	6,089,589.57	2.46
40	Jiangsu ToLand Alloy Co Ltd	300855 CH	5,975,301.00	2.42
41	NVIDIA Corp	NVDA US	5,924,235.75	2.40
42	Rio Tinto PLC	RIO US	5,826,936.85	2.36

43	Delton Technology Guangzhou Inc	1989 HK	5,786,320.52	2.34
44	Apple Inc	AAPL US	5,766,219.12	2.33
45	Intel Corp	INTC US	5,684,752.42	2.30
46	Marvell Technology Inc	MRVL US	5,546,126.18	2.24
47	Zhuhai Bojay Electronics Co Ltd	002975 CH	5,121,141.00	2.07
48	Yancoal Australia Ltd	3668 HK	4,991,563.36	2.02
49	Jiaxin International Resources Investment Ltd	3858 HK	4,947,792.27	2.00

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,454,815,491.00
卖出收入（成交）总额	976,198,116.96

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	-	-
AA+至 AA-	-	-
A+至 A-	-	-
BBB+至 BBB-	-	-
BB+至 BB-	-	-
B+至 B-	-	-
CCC+至 CCC-	-	-
未评级	1,295,223,480.60	53.56
合计	1,295,223,480.60	53.56

注：本基金债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，其中境内债券取自境内第三方评级机构的债项评级。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	240210.IB	24 国开 10	200,000,000	210,041,095.89	8.68
2	09230407.IB	23 农发清发 07	150,000,000	160,134,698.63	6.62
3	250203.IB	25 国开 03	130,000,000	129,886,098.63	5.37
4	220205.IB	22 国开 05	100,000,000	108,786,164.38	4.50
5	240413.IB	24 农发 13	100,000,000	102,171,506.85	4.22

注：（1）债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

（2）数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep26	0.00	0.00
2	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jul26	0.00	0.00

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep26 卖出持仓量 12 手，合约市值人民币-49,911,253.24 元，公允价值变动人民币-1,594,642.83 元；HANG SENG IDX FUT Jul26 卖出持仓量 74 手，合约市值人民币-73,535,662.63 元，公允价值变动人民币-38,389.91 元。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	13,089,281.36
2	应收清算款	62,932,964.00
3	应收股利	335,740.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,828,679.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,186,665.76

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	9630 HK	芯碁微装	37,626,285.65	1.56	非公开发行流通受限

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
广发全球稳健配置混合（QDII）A	24,418	27,450.42	355,227,384.32	53.00%	315,056,879.69	47.00%
广发全球稳健配置混合（QDII）C	53,755	24,109.50	933,818,491.09	72.05%	362,187,576.42	27.95%
合计	78,173	25,153.06	1,289,045,875.41	65.56%	677,244,456.11	34.44%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	92.87%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，

区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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	广发全球稳健配置混合（QDII）A	9,894,423.26	1.4762%
	广发全球稳健配置混合（QDII）C	336,541.43	0.0260%
	合计	10,230,964.69	0.5203%

8.4 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	广发全球稳健配置混合（QDII）A	>100
	广发全球稳健配置混合（QDII）C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发全球稳健配置混合（QDII）A	0
	广发全球稳健配置混合（QDII）C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发全球稳健配置混合（QDII）A	广发全球稳健配置混合（QDII）C
基金合同生效日（2024 年 4 月 24 日）基金份额总额	507,328,079.72	21,739,350.49
本报告期期初基金份额总额	142,129,540.89	102,362,848.89
本报告期基金总申购份额	672,522,513.69	1,515,447,201.70
减：本报告期基金总赎回份额	144,367,790.57	321,803,983.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	670,284,264.01	1,296,006,067.51

注：本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

ANZ Banking Group Limited	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas SA	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Bank of China (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Bank of Montreal	-	-	-	-	-	-
Barclays Bank	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-
CEB International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	376,021,436.11	15.47%	1,527,865.92	53.46%	-
CMB International Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-
China CITIC Bank International	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Limited	-	52,260,108.17	2.15%	439,400.03	15.37%	-
China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	-	-	-	-	-	-
DBS Vickers	-	-	-	-	-	-

Securities Ltd.						
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-
Essence International Financial Holdings Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-
HSBC Broking Services (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Ltd.	-	3,660,028.76	0.15%	1,375.78	0.05%	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase & Co.	-	3,428,661.67	0.14%	34,286.62	1.20%	-
Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities Co.,Ltd.	-	-	-	-	-	-
SDIC Securities	-	748,981,915.12	30.81%	205,812.79	7.20%	-

(Hong Kong) Limited						
Shenwan Hongyuan Securities(H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (China) Limited	-	-	-	-	-	-
United Bank of Switzerland	-	189,892,906.64	7.81%	151,913.86	5.31%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	374,513,594.61	15.41%	163,287.79	5.71%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	267,269,539.25	10.99%	116,529.54	4.08%	-
东吴证券国际	-	65,391,013.18	2.69%	65,391.01	2.29%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	减少 2 个
方正证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	8	840,186.52	0.03%	315.43	0.01%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	减少 3 个
瑞银证券	1	9,977,706.52	0.41%	4,350.30	0.15%	-

申万宏源证券	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	3	338,753,594.75	13.93%	147,697.32	5.17%	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：一、境内合作券商的选择标准和程序

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。

二、境外合作券商的选择标准和程序

1、选择标准

（1）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据境外投资组合投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（2）具备投资运作所需的高效、安全、合规的交易执行能力，满足投资组合进行证券交易执行的需要；

（3）券商中后台系统能提供良好的交收结算服务。开展股票交易的境外券商，原则上需要支持 DTCC 系统进行交易匹配与交收；

（4）需要配合完成境外券商尽职调查问卷；

（5）最近3年未因反洗钱、交易业务内控问题受到经营地监管机构的处罚。

2、选择流程

对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述准入标准，对拟合作券商是否符合准入条件进行评估，确定选用符合条件的合作券商，并办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
ANZ Banking Group Limited	2,092,185.20	0.64%	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas SA	1,359,952.32	0.42%	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of Chin	-	-	-	-	-	-	-	-

a (Hong Kong) Limited								
Bank of Montreal	20,725,293.65	6.35%	-	-	-	-	-	-
Barclays Bank	8,679,175.32	2.66%	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd.	10,065,162.95	3.09%	-	-	-	-	-	-
CEB International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	37,720,197.05	36.97%
CMB International Securities Ltd.	6,551,599.83	2.01%	-	-	-	-	-	-
China	-	-	-	-	-	-	-	-

CITIC Bank International								
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	3,389,125.09	1.04%	-	-	-	-	-	-
DBS Vickers Secur	-	-	-	-	-	-	-	-

ities Ltd.								
Deutsche Bank AG	32,044,013.24	9.82%	-	-	-	-	-	-
Essence International Financial Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	9,865,663.51	3.02%	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC Broking Services (Asia) Limited	10,038,694.40	3.08%	-	-	-	-	-	-
Haitong Inter	-	-	-	-	-	-	1,187,400.01	1.16%

national Securities Company Ltd.								
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	5,023,837.92	1.54%	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase & Co.	8,490,091.50	2.60%	-	-	-	-	-	-
Jefferies Hong Kong Limited	7,309,590.19	2.24%	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	7,631,804.51	2.34%	-	-	-	-	-	-
Mizuho	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities Asia Limited								
Morgan Stanley	22,391,826.49	6.86%	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities Co.,Ltd.	1,367,532.99	0.42%	-	-	-	-	-	-
SDIC Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	63,125,787.06	61.87%
Shenwan Hongyuan Securities(H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (China) Limited	6,923,289.62	2.12%	-	-	-	-	-	-
United Bank	13,254,179.50	4.06%	-	-	-	-	-	-

of Switzerland								
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	10,699,605.72	3.28%	300,000,000.00	58.90%	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	128,910,667.65	39.52%	171,768,000.00	33.72%	-	-	-	-
东吴证券国际	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	9,091,804.66	2.79%	34,300,000.00	6.73%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	291,770.25	0.09%	3,300,000.00	0.65%	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-10
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22
5	关于广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）暂停大额申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-29

6	关于广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）调整大额申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务限额的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-15
7	关于广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）调整大额申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务限额的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-29
8	广发基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260429-20260429	-	90,693,814.62	-	90,693,814.62	4.61%
	2	20260311-20260416	39,471,087.43	27,385,142.89	60,191,108.15	6,665,122.17	0.34%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）募集的文件

（二）《广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）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）《广发全球稳健配置混合型证券投资基金（QDII）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