

广发恒祥债券型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61

8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	63
9 开放式基金份额变动	63
10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	65
10.8 其他重大事件	66
11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	67

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发恒祥债券型证券投资基金	
基金简称	广发恒祥债券	
基金主代码	014738	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 月 6 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,022,356,537.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发恒祥债券 A	广发恒祥债券 C
下属分级基金的交易代码	014738	014739
报告期末下属分级基金的份额总额	4,105,812,177.54 份	2,916,544,359.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。具体投资策略包括：1、大类资产配置；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票投资策略；5、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债总全价(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×7%+人民币计价的恒生指数收益率×3%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金资产若投资于港股，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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

			司
信 息 披 露 负 责 人	姓 名	项 军	张立学
	联系电话	020-83936666	010-68858126
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		95105828	95580
传真		020-34281105	010-86353609
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		510308	100808
法定代表人		葛长伟	郑国雨

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	广发恒祥债券 A	广发恒祥债券 C
本期已实现收益	89,891,719.75	62,079,839.42
本期利润	268,500,747.18	179,180,400.17
加权平均基金份额本期利润	0.1105	0.0974
本期加权平均净值利润率	9.80%	8.76%
本期基金份额净值增长率	8.43%	8.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发恒祥债券 A	广发恒祥债券 C
期末可供分配利润	460,060,524.69	282,920,081.82
期末可供分配基金份额利润	0.1121	0.0970
期末基金资产净值	4,890,328,522.37	3,427,631,822.76
期末基金份额净值	1.1911	1.1752
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	广发恒祥债券 A	广发恒祥债券 C
基金份额累计净值增长率	19.11%	17.52%

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

广发恒祥债券 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	8.04%	0.39%	0.98%	0.13%	7.06%	0.26%
过去六个月	8.43%	0.33%	0.69%	0.12%	7.74%	0.21%

过去一年	12.50%	0.27%	0.51%	0.11%	11.99%	0.16%
过去三年	20.36%	0.21%	6.86%	0.12%	13.50%	0.09%
自基金合同生效起至今	19.11%	0.19%	8.00%	0.12%	11.11%	0.07%

广发恒祥债券 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	7.95%	0.39%	0.98%	0.13%	6.97%	0.26%
过去六个月	8.26%	0.33%	0.69%	0.12%	7.57%	0.21%
过去一年	12.16%	0.27%	0.51%	0.11%	11.65%	0.16%
过去三年	19.19%	0.21%	6.86%	0.12%	12.33%	0.09%
自基金合同生效起至今	17.52%	0.19%	8.00%	0.12%	9.52%	0.07%

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

广发恒祥债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022 年 5 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日)

广发恒祥债券 A



广发恒祥债券 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		
吴迪	本基金的基金经理；广发聚源债券型证券投资基金(LOF)的基金	2025-05-07	-	11.7 年	吴迪女士，中国籍，理学硕士，FRM，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金融工

	经理；广发景丰纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发景益债券型证券投资基金的基金经理；广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；广发集汇债券型证券投资基金的基金经理；广发稳信六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发汇元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理；广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理；特定策略投资部总经理			程与风险管理部研究员、固定收益管理总部研究员、固定收益管理总部总经理助理、固定收益管理总部副总经理、广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 6 月 12 日至 2024 年 12 月 20 日)、广发中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 19 日至 2025 年 3 月 11 日)、广发集丰债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 7 日)、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 4 月 8 日至 2025 年 5 月 7 日)、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理(自 2024 年 3 月 21 日至 2025 年 11 月 26 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，权益市场震荡偏强，呈现出 AI 资本开支驱动的结构牛市，背后是产业趋势、盈利可见度与资金拥挤度共同作用下的“K”型扩张。一季度，在增量资金和宏观逻辑对冲下，市场先经历春季躁动下的主题行情，再经历顺周期、化工轮动的慢牛整固，最后地缘冲突导致过度交易“滞胀”，带来大幅回撤，转债估值冲高回落，转债结构性的赚钱效应初步体现；二季度，科技主升浪启动，AI 的快速发展带动全球半导体形成“需求扩张—供需错配—利润改善—估值上修”的链

式传导，科技对周期、价值板块的流动性明显抽水，市场极致分化，最终进入高拥挤度阶段，转债内部结构也跟随权益行情走向极致，赚钱效应进一步缩圈。债券市场受益于资金面持续宽松，供需格局好于预期，债市收益率整体先上后下，信用利差先收窄后低位震荡。一季度，年初风险偏好抬升叠加供给压力担忧，10 年国债收益率上行至 1.9% 水平，随后配置盘主导债市超跌反弹，曲线陡峭化，信用利差大幅收窄后被动走阔；二季度，资金面超预期宽松，资管机构配置资金充裕叠加政府债供给持续慢于预期，良好的供需格局驱动 10 年国债最低下行至 1.7% 附近、信用利差进一步收窄，6 月以来资金面收敛、机构预防性赎回，债市小幅回调、信用利差明显走阔，而后在央行呵护跨季资金面下，债市情绪有所修复，收益率低位震荡、信用利差逐步收窄。

报告期内，组合秉承“固收+”多策略的投资理念，在权益资产中使用量化和主观双引擎驱动，通过低相关的策略叠加，降低“固收+”产品对单一策略的依赖度，凭借量化策略在全市场广泛捕获收益，借助主观选股把握阶段性重点机会，并通过顶层的大类资产配置实现各类子策略的灵活调配以适应多变的市场风格。上半年组合较大力度地参与了科技板块的配置机会，重点参与了国产半导体设备板块的投资机会，在较好地控制住回撤的基础上显著地提高了投资回报。债券方面，组合主要持仓信用债、利率债，通过灵活久期操作波段增厚组合收益。

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 8.43%，C 类基金份额净值增长率为 8.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，权益市场行情分化或更加极致，宽基指数大概率呈震荡格局，估值抬升至中高区间后，需重点关注业绩修复，预计交易主线将继续围绕强叙事与强业绩兑现展开，关注科技板块超跌反弹机会，逻辑或从估值驱动切换到盈利驱动，同时通胀与货币政策存在不确定性，美国中期选举再添不确定的变量。股票投资方面，未来将优化各类投资策略，主观与量化并行，使组合更加适应不同的市场环境，力争为投资人带来更好的回报体验。债券市场或延续震荡格局，供需结构和资金面的边际变化对债市影响较大，外围扰动、政策博弈和风险偏好等因素或放大债市波动，信用债关注评级调整对个券估值和定价范式的影响。债券投资方面，组合将持续跟踪基本面修复、机构配置需求等信号以及微观经济数据表征以灵活应对，重视流动性和负债端稳定性，关注票息品种。

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发恒祥债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：广发恒祥债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,611,173.72	279,122,330.46
结算备付金		81,567,163.27	21,659,703.13
存出保证金		3,369,518.58	836,118.38
交易性金融资产	6.4.7.2	8,329,333,645.16	2,433,207,978.07
其中：股票投资		1,579,068,935.86	304,450,512.61
基金投资		-	-
债券投资		6,750,264,709.30	2,128,757,465.46
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		102,126,435.25	13,950,382.18
应收股利		317,845.23	23,200.00
应收申购款		69,209,613.67	42,169,267.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,596,535,394.88	2,790,968,979.35
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		215,914,386.08	110,017,772.72
应付清算款		42,941,034.57	5,241,454.97
应付赎回款		12,020,305.85	75,299,736.39
应付管理人报酬		3,798,499.32	1,568,167.33
应付托管费		1,085,285.56	448,047.84
应付销售服务费		668,318.75	249,294.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		194,075.41	49,668.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,953,144.21	993,381.83
负债合计		278,575,049.75	193,867,523.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	7,022,356,537.32	2,374,062,361.59
未分配利润	6.4.7.9	1,295,603,807.81	223,039,094.17
净资产合计		8,317,960,345.13	2,597,101,455.76
负债和净资产总计		8,596,535,394.88	2,790,968,979.35

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发恒祥债券 A 基金份额净值人民币 1.1911 元，基金份额总额 4,105,812,177.54 份；广发恒祥债券 C 基金份额净值人民币 1.1752 元，基金份额总额 2,916,544,359.78 份；总份额总额 7,022,356,537.32 份。

6.2 利润表

会计主体：广发恒祥债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	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
一、营业总收入		475,523,749.76	5,941,244.93
1. 利息收入		1,576,789.38	32,557.57
其中：存款利息收入	6.4.7.10	702,488.88	32,557.57
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		874,300.50	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		177,363,692.10	5,517,057.74
其中：股票投资收益	6.4.7.11	137,474,736.45	494,970.45
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	36,999,696.66	4,953,956.34
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	1,020,414.52	-
股利收益	6.4.7.17	1,868,844.47	68,130.95
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	295,709,588.18	390,217.02
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	873,680.10	1,412.60
减：二、营业总支出		27,842,602.41	516,171.56
1. 管理人报酬		16,485,899.91	268,098.85
2. 托管费		4,710,257.15	76,599.69
3. 销售服务费		3,012,596.05	7,937.34
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,441,712.17	93,036.00
其中：卖出回购金融资产支出		3,441,712.17	93,036.00
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		85,158.19	476.45
8. 其他费用	6.4.7.21	106,978.94	70,023.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		447,681,147.35	5,425,073.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		447,681,147.35	5,425,073.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		447,681,147.35	5,425,073.37

6.3 净资产变动表

会计主体：广发恒祥债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,374,062,361.59	223,039,094.17	2,597,101,455.76
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,374,062,361.59	223,039,094.17	2,597,101,455.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,648,294,175.73	1,072,564,713.64	5,720,858,889.37
（一）、综合收益总额	-	447,681,147.35	447,681,147.35
（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）	4,648,294,175.73	624,883,566.29	5,273,177,742.02
其中：1.基金申购款	6,922,106,399.12	886,267,144.27	7,808,373,543.39
2.基金赎回款	-2,273,812,223.39	-261,383,577.98	-2,535,195,801.37
（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	7,022,356,537.32	1,295,603,807.81	8,317,960,345.13
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	49,606,706.96	1,142,829.20	50,749,536.16
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	49,606,706.96	1,142,829.20	50,749,536.16

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	134,698,739.76	9,256,046.15	143,954,785.91
（一）、综合收益总额	-	5,425,073.37	5,425,073.37
（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）	134,698,739.76	3,830,972.78	138,529,712.54
其中：1.基金申购款	181,827,677.12	4,817,308.47	186,644,985.59
2.基金赎回款	-47,128,937.36	-986,335.69	-48,115,273.05
（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	184,305,446.72	10,398,875.35	194,704,322.07

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

广发恒祥债券型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]4005 号《关于准予广发恒祥债券型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发恒祥债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2022 年 4 月 18 日向社会公开发行募集并于 2022 年 5 月 6 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金募集期间为自 2022 年 4 月 18 日至 2022 年 4 月 29 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 224,576,601.11 元，有效认购户数为 4,800 户。其中广发恒祥债券 A（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 116,421,668.71 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 48,326.48 元；广发恒祥债券 C（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币

108,101,126.55 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 5,479.37 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》，财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕

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

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

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

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

（2）企业所得税、个人所得税

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

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

（3）印花税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	10,611,173.72
等于：本金	10,578,785.59
加：应计利息	32,388.13
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	10,611,173.72

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	1,308,003,221.11	-	1,579,068,935.86	271,065,714.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	1,823,222,215.32	9,094,851.73	1,835,257,186.93	2,940,119.88
交易所市场				

	银行间市场	4,851,246,744.44	42,260,022.37	4,915,007,522.37	21,500,755.56
	合计	6,674,468,959.76	51,354,874.10	6,750,264,709.30	24,440,875.44
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,982,472,180.87	51,354,874.10	8,329,333,645.16	295,506,590.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,196.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,854,370.91
其中：交易所市场	1,794,934.28
银行间市场	59,436.63
应付利息	-
预提费用	96,576.39
合计	1,953,144.21

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发恒祥债券 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	1,535,819,015.02	1,535,819,015.02
本期申购	3,262,993,780.99	3,262,993,780.99
本期赎回（以“-”号填列）	-693,000,618.47	-693,000,618.47
本期末	4,105,812,177.54	4,105,812,177.54

金额单位：人民币元

广发恒祥债券 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	838,243,346.57	838,243,346.57
本期申购	3,659,112,618.13	3,659,112,618.13
本期赎回（以“-”号填列）	-1,580,811,604.92	-1,580,811,604.92
本期末	2,916,544,359.78	2,916,544,359.78

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

广发恒祥债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,789,352.67	32,540,460.06	151,329,812.73
本期期初	118,789,352.67	32,540,460.06	151,329,812.73
本期利润	89,891,719.75	178,609,027.43	268,500,747.18
本期基金份额交易产生的变动数	251,379,452.27	113,306,332.65	364,685,784.92
其中：基金申购款	315,853,680.12	134,056,200.71	449,909,880.83
基金赎回款	-64,474,227.85	-20,749,868.06	-85,224,095.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	460,060,524.69	324,455,820.14	784,516,344.83

单位：人民币元

广发恒祥债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,963,968.10	17,745,313.34	71,709,281.44
本期期初	53,963,968.10	17,745,313.34	71,709,281.44
本期利润	62,079,839.42	117,100,560.75	179,180,400.17
本期基金份额交易产生的变动数	166,876,274.30	93,321,507.07	260,197,781.37
其中：基金申购款	298,226,411.87	138,130,851.57	436,357,263.44
基金赎回款	-131,350,137.57	-44,809,344.50	-176,159,482.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,920,081.82	228,167,381.16	511,087,462.98

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	461,620.10
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	130,661.79
其他	110,206.99
合计	702,488.88

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	137,474,736.45
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	137,474,736.45

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	7,901,714,575.83
减：卖出股票成本总额	7,755,372,966.30
减：交易费用	8,866,873.08
买卖股票差价收入	137,474,736.45

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	41,773,781.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,774,084.41
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	36,999,696.66

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	5,286,941,722.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,234,823,551.13
减：应计利息总额	56,771,944.44
减：交易费用	120,311.19
买卖债券差价收入	-4,774,084.41

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
国债期货投资收益	1,020,414.52

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	1,868,844.47
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,868,844.47

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	295,709,588.18
——股票投资	268,791,278.49
——债券投资	26,918,309.69
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	295,709,588.18

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	741,034.65
基金转换费收入	132,645.45
合计	873,680.10

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	27,769.02
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	1,702.55
合计	106,978.94

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

中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	16,662,286,118.11	100.00%	158,685,492.55	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		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	
	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	3,246,992,700.26	100.00%	141,564,250.20	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		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	
	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	5,418,400,000.00	100.00%	266,082,000.00	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	3,082,561.10	100.00%	1,794,902.77	100.00%
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	69,187.31	100.00%	32,697.81	100.00%

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年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	16,485,899.91	268,098.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,717,167.39	29,582.63
应支付基金管理人的净管理费	14,768,732.52	238,516.22

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

约定年费率为 0.70%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年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	4,710,257.15	76,599.69

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		
	广发恒祥债券 A	广发恒祥债券 C	合计
广发基金管理有限公司	-	1,367,573.95	1,367,573.95
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	1,779.60	1,779.60
广发证券股份有限公司	-	465.46	465.46
合计	-	1,369,819.01	1,369,819.01
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		
	广发恒祥债券A	广发恒祥债券C	合计
广发基金管理有限公司	-	844.70	844.70
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	784.68	784.68
合计	-	1,629.38	1,629.38

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 0.30%。

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

单位：人民币元

本期 2026年1月1日至2026年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储 蓄银行股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储 蓄银行股份 有限公司	-	-	-	-	132,600,000.0 0	5,951.67

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	
	广发恒祥债券A	广发恒祥债券C	广发恒祥债券A	广发恒祥债券C
报告期初持有的基 金份额	107,853,711.15	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	107,853,711.15	-
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	107,853,711.15	-	107,853,711.15	-

金份额				
报告期末持有的基金 份额占基金总份 额比例	2.63%	-	74.45%	-

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

广发恒祥债券 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发恒祥债券 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
中国邮政储蓄银行股份有 限公司	10,611,173.72	461,620.10	50,049,656.58	18,231.58

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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
001248	华润新 能源	2026-06-25	1 个月 内 (含)	新股 流通 受限	10.11	10.11	1,000.00	10,110.00	10,110.00	-

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	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	121,987.00	77,519,560.96	107,291,226.11	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 92,913,544.99 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220208.IB	22 国开 08	2026-07-07	101.42	978,000.00	99,189,295.89
合计				978,000.00	99,189,295.89

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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 123,000,841.09 元，于 2026 年 7 月 6 日、2026 年 7 月 7 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。

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	20,133,545.21	-
A-1 以下	-	-
未评级	85,696,583.56	40,266,536.98
合计	105,830,128.77	40,266,536.98

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 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	19,980,985.71	-
A-1 以下	-	-

未评级	-	-
合计	19,980,985.71	-

注：1、短期同业存单评级取自第三方评级机构的发行主体信用评级。

2、短期同业存单 A-1 所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 的短期同业存单，短期同业存单 A-1 以下所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 以下的短期同业存单。

6.4.13.2.3 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	2,361,829,282.65	627,336,946.46
AAA 以下	78,457.91	57,864,469.43
未评级	4,262,545,854.26	1,403,289,512.59
合计	6,624,453,594.82	2,088,490,928.48

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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	10,611,173.72	-	-	-	10,611,173.72
结算备付金	81,567,163.27	-	-	-	81,567,163.27
存出保证金	3,369,518.58	-	-	-	3,369,518.58
交易性金融资产	748,839,021.12	4,947,553,646.05	1,053,872,042.13	1,579,068,935.86	8,329,333,645.16
应收清算款	-	-	-	102,126,435.25	102,126,435.25
应收股利	-	-	-	317,845.23	317,845.23
应收申购款	-	-	-	69,209,613.67	69,209,613.67
资产总计	844,386,876.69	4,947,553,646.05	1,053,872,042.13	1,750,722,830.01	8,596,535,394.88
负债					
卖出回购金融资产款	215,914,386.08	-	-	-	215,914,386.08
应付清算款	-	-	-	42,941,034.57	42,941,034.57
应付赎回款	-	-	-	12,020,305.85	12,020,305.85
应付管理人报酬	-	-	-	3,798,499.32	3,798,499.32
应付托管费	-	-	-	1,085,285.56	1,085,285.56
应付销售服务费	-	-	-	668,318.75	668,318.75

应交税费	-	-	-	194,075.41	194,075.41
其他负债	-	-	-	1,953,144.21	1,953,144.21
负债总计	215,914,386.08	-	-	62,660,663.67	278,575,049.75
利率敏感度缺口	628,472,490.61	4,947,553,646.05	1,053,872,042.13	1,688,062,166.34	8,317,960,345.13
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	279,122,330.46	-	-	-	279,122,330.46
结算备付金	21,659,703.13	-	-	-	21,659,703.13
存出保证金	836,118.38	-	-	-	836,118.38
交易性金融资产	443,677,863.06	1,327,520,938.63	357,558,663.77	304,450,512.61	2,433,207,978.07
应收清算款	-	-	-	13,950,382.18	13,950,382.18
应收股利	-	-	-	23,200.00	23,200.00
应收申购款	-	-	-	42,169,267.13	42,169,267.13
资产总计	745,296,015.03	1,327,520,938.63	357,558,663.77	360,593,361.92	2,790,968,979.35
负债					
卖出回购金融资产款	110,017,772.72	-	-	-	110,017,772.72
应付清算款	-	-	-	5,241,454.97	5,241,454.97
应付赎回款	-	-	-	75,299,736.39	75,299,736.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,568,167.33	1,568,167.33
应付托管费	-	-	-	448,047.84	448,047.84
应付销售服务费	-	-	-	249,294.24	249,294.24
应交税费	-	-	-	49,668.27	49,668.27
其他负债	-	-	-	993,381.83	993,381.83
负债总计	110,017,772.72	-	-	83,849,750.87	193,867,523.59
利率敏感度缺口	635,278,242.31	1,327,520,938.63	357,558,663.77	276,743,611.05	2,597,101,455.76

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	-57,480,248.88	-14,420,250.00
	市场利率下降 25 个基点	58,579,650.45	14,812,597.70

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	-	163,649,168.45	-	163,649,168.45
应收股利	-	317,845.23	-	317,845.23
资产合计	-	163,967,013.68	-	163,967,013.68
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	-	163,967,013.68	-	163,967,013.68
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				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

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%	8,198,350.68	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-8,198,350.68	-

注：本基金上年度末未持有外汇资产。

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	1,579,068,935.86	18.98	304,450,512.61	11.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	236,791.01	0.00	119,165,229.04	4.59
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	1,579,305,726.87	18.99	423,615,741.65	16.31

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%	115,799,533.01	16,169,778.31
	下降 5%	-115,799,533.01	-16,169,778.31

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	1,471,996,050.76

第二层次	6,857,337,594.40
第三层次	-
合计	8,329,333,645.16

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	1,579,068,935.86	18.37
	其中：股票	1,579,068,935.86	18.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,750,264,709.30	78.52
	其中：债券	6,750,264,709.30	78.52
	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	92,178,336.99	1.07
8	其他各项资产	175,023,412.73	2.04

9	合计	8,596,535,394.88	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 163,649,168.45 元，占基金资产净值比例 1.97%。

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	530,745.00	0.01
B	采矿业	3,018,901.00	0.04
C	制造业	1,391,390,593.87	16.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,152,043.00	0.01
E	建筑业	319,758.00	0.00
F	批发和零售业	2,110,353.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,144,506.00	0.03
H	住宿和餐饮业	32,382.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,222,081.54	0.05
J	金融业	7,590,415.00	0.09
K	房地产业	211,819.00	0.00
L	租赁和商务服务业	694,501.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	788,748.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	458,155.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,610.00	0.00
Q	卫生和社会工作	334,125.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	356,377.00	0.00
S	综合	43,654.00	0.00
	合计	1,415,419,767.41	17.02

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	58,979,513.11	0.71
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-

日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	104,669,655.34	1.26
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	163,649,168.45	1.97

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	002371	北方华创	296,710	262,457,797.60	3.16
2	688012	中微公司	525,116	246,016,846.00	2.96
3	688041	海光信息	307,619	113,911,315.70	1.37
4	688072	拓荆科技	121,987	107,291,226.11	1.29
5	300394	天孚通信	322,426	97,591,901.68	1.17
6	688233	神工股份	448,203	96,103,687.26	1.16
7	688545	兴福电子	640,809	85,266,045.54	1.03
8	300308	中际旭创	59,600	75,692,000.00	0.91
9	002428	云南锗业	537,800	64,632,804.00	0.78
10	01347	华虹宏力	332,000	62,054,770.72	0.75
10	688347	华虹宏力	297	99,881.10	0.00
11	00189	东岳集团	3,559,000	58,979,513.11	0.71
12	300236	上海新阳	379,700	49,930,550.00	0.60
13	03986	兆易创新	41,300	42,614,884.62	0.51
13	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	0.01
14	688313	仕佳光子	224,289	41,414,963.85	0.50
15	688766	普冉股份	53,058	40,674,262.80	0.49
16	002851	麦格米特	181,500	30,343,170.00	0.36
17	603061	金海通	45,600	22,901,232.00	0.28
18	002281	光迅科技	18,635	4,788,076.90	0.06
19	300750	宁德时代	3,700	1,454,137.00	0.02
20	300502	新易盛	2,000	1,214,000.00	0.01
21	600519	贵州茅台	800	948,392.00	0.01
22	688256	寒武纪	464	740,335.20	0.01
23	601899	紫金矿业	25,700	646,098.00	0.01
24	601318	中国平安	13,300	634,942.00	0.01
25	002384	东山精密	2,400	629,640.00	0.01

26	600036	招商银行	15,400	546,700.00	0.01
27	603259	药明康德	4,100	510,491.00	0.01
28	600030	中信证券	16,900	485,537.00	0.01
29	002475	立讯精密	6,700	471,680.00	0.01
30	000333	美的集团	6,100	460,733.00	0.01
31	600900	长江电力	17,400	460,578.00	0.01
32	301308	江波龙	600	422,280.00	0.01
33	300857	协创数据	1,200	407,880.00	0.00
34	300059	东方财富	20,000	407,600.00	0.00
35	601138	工业富联	5,600	404,040.00	0.00
36	300408	三环集团	2,400	400,560.00	0.00
37	601398	工商银行	56,500	399,455.00	0.00
38	300223	北京君正	1,600	398,240.00	0.00
39	688008	澜起科技	1,285	398,221.50	0.00
40	688110	东芯股份	1,924	391,918.80	0.00
41	688981	中芯国际	2,453	389,585.46	0.00
42	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.00
43	000725	京东方 A	43,000	373,240.00	0.00
44	002558	巨人网络	13,500	372,060.00	0.00
45	300475	香农芯创	1,200	360,000.00	0.00
46	688220	翱捷科技-U	2,861	355,679.52	0.00
47	601872	招商轮船	20,100	353,157.00	0.00
48	300323	华灿光电	16,700	340,680.00	0.00
49	300438	鹏辉能源	4,100	339,685.00	0.00
50	301536	星宸科技	2,600	334,646.00	0.00
51	301358	湖南裕能	4,400	333,828.00	0.00
52	601166	兴业银行	19,600	324,576.00	0.00
53	601288	农业银行	53,100	322,317.00	0.00
54	688266	泽璟制药-U	2,741	319,765.06	0.00
55	688388	嘉元科技	7,255	319,220.00	0.00
56	600276	恒瑞医药	6,000	312,240.00	0.00
57	600183	生益科技	1,800	312,120.00	0.00
58	600150	中国船舶	9,200	310,868.00	0.00
59	002079	苏州固锝	20,300	305,109.00	0.00
60	688503	聚和材料	2,277	302,157.90	0.00
61	601211	国泰海通	16,600	302,120.00	0.00
62	300184	力源信息	17,200	301,860.00	0.00
63	000858	五粮液	4,000	296,000.00	0.00
64	002064	华峰化学	30,900	293,241.00	0.00
65	000810	创维数字	22,100	292,825.00	0.00
66	600026	中远海能	16,300	292,422.00	0.00
67	688107	安路科技	6,386	291,201.60	0.00
68	000703	恒逸石化	21,100	286,327.00	0.00
69	301189	奥尼电子	4,800	282,864.00	0.00

70	000973	佛塑科技	19,700	282,695.00	0.00
71	003022	联泓新科	10,900	282,310.00	0.00
72	300613	富瀚微	3,500	280,280.00	0.00
73	601699	潞安环能	19,600	279,888.00	0.00
74	000100	TCL 科技	47,800	278,196.00	0.00
75	300765	石药创新	10,200	277,746.00	0.00
76	601328	交通银行	42,700	274,561.00	0.00
77	688717	艾罗能源	3,279	270,747.03	0.00
78	002415	海康威视	7,900	270,180.00	0.00
79	300855	图南股份	8,600	268,836.00	0.00
80	601688	华泰证券	12,900	265,998.00	0.00
81	688678	福立旺	10,984	265,483.28	0.00
82	301210	金杨精密	8,800	264,000.00	0.00
83	688390	固德威	2,407	261,183.57	0.00
84	601882	海天精工	12,900	260,967.00	0.00
85	001313	粤海饲料	36,800	260,912.00	0.00
86	601975	招商南油	68,800	256,624.00	0.00
87	301122	采纳股份	8,700	255,867.00	0.00
88	001308	康冠科技	12,100	252,406.00	0.00
89	000026	飞亚达	11,700	252,018.00	0.00
90	300590	移为通信	17,500	251,125.00	0.00
91	001298	好上好	12,100	251,075.00	0.00
92	000567	海德股份	42,000	250,740.00	0.00
93	688221	前沿生物-U	11,088	248,371.20	0.00
94	688559	海目星	2,940	246,724.80	0.00
95	300504	天邑股份	15,200	245,176.00	0.00
96	603006	联明股份	17,200	245,100.00	0.00
97	300073	当升科技	5,100	245,004.00	0.00
98	301246	宏源药业	9,100	244,790.00	0.00
99	603162	海通发展	27,200	243,984.00	0.00
100	300488	恒锋工具	5,200	243,516.00	0.00
101	002266	浙富控股	48,000	242,880.00	0.00
102	688365	光云科技	15,392	242,731.84	0.00
103	300885	海昌新材	10,200	242,454.00	0.00
104	002843	泰嘉股份	11,200	240,464.00	0.00
105	688059	华锐精密	1,201	239,851.71	0.00
106	300274	阳光电源	1,500	238,530.00	0.00
107	300715	凯伦股份	14,400	237,024.00	0.00
108	301265	华新科技	8,600	236,930.00	0.00
109	002132	恒星科技	43,700	236,417.00	0.00
110	000651	格力电器	6,300	236,250.00	0.00
111	000792	盐湖股份	7,800	235,482.00	0.00
112	300067	安诺其	43,100	233,602.00	0.00
113	301266	宇邦新材	10,200	232,968.00	0.00

114	301295	美硕科技	5,500	231,990.00	0.00
115	300281	金明精机	38,200	230,346.00	0.00
116	002463	沪电股份	1,500	229,200.00	0.00
117	002388	新亚制程	43,700	228,988.00	0.00
118	600919	江苏银行	21,100	227,458.00	0.00
119	002810	山东赫达	9,200	227,240.00	0.00
120	000802	北京文化	65,100	226,548.00	0.00
121	301256	华融化学	17,400	225,504.00	0.00
122	601857	中国石油	25,900	224,812.00	0.00
123	600810	神马股份	36,400	224,588.00	0.00
124	002578	闽发铝业	71,100	223,965.00	0.00
125	002594	比亚迪	2,800	223,160.00	0.00
126	000001	平安银行	22,200	223,110.00	0.00
127	300014	亿纬锂能	3,400	221,102.00	0.00
128	301606	绿联科技	3,600	219,672.00	0.00
129	000809	和展能源	69,100	219,047.00	0.00
130	600984	建设机械	58,500	218,790.00	0.00
131	002678	珠江钢琴	51,600	218,268.00	0.00
132	600887	伊利股份	9,100	218,036.00	0.00
133	600792	云煤能源	67,700	214,609.00	0.00
134	603711	香飘飘	19,300	214,423.00	0.00
135	300277	汽轮科技	14,200	213,568.00	0.00
136	301002	崧盛股份	5,500	212,300.00	0.00
137	603719	良品铺子	24,300	210,195.00	0.00
138	688521	芯原股份	566	210,065.24	0.00
139	603915	国茂股份	14,800	210,012.00	0.00
140	300681	英搏尔	7,300	208,926.00	0.00
141	603390	通达电气	20,000	208,800.00	0.00
142	002752	昇兴股份	37,800	208,656.00	0.00
143	300476	胜宏科技	600	207,858.00	0.00
144	000983	山西焦煤	35,800	207,640.00	0.00
145	603178	圣龙股份	14,900	206,365.00	0.00
146	002041	登海种业	26,200	206,194.00	0.00
147	301261	恒工精密	2,600	203,060.00	0.00
148	002460	赣锋锂业	3,100	202,740.00	0.00
149	603799	华友钴业	4,200	202,692.00	0.00
150	600999	招商证券	9,600	202,560.00	0.00
151	301216	万凯新材	8,800	202,312.00	0.00
152	600601	方正科技	14,500	200,680.00	0.00
153	600522	中天科技	3,200	194,176.00	0.00
154	601988	中国银行	33,900	193,908.00	0.00
155	688275	万润新能	1,510	192,600.50	0.00
156	001314	亿道信息	3,100	191,580.00	0.00
157	002466	天齐锂业	3,100	190,092.00	0.00

158	600176	中国巨石	2,600	189,488.00	0.00
159	001309	德明利	200	188,580.00	0.00
160	601816	京沪高铁	41,600	188,448.00	0.00
161	600309	万华化学	2,700	184,707.00	0.00
162	600028	中国石化	41,300	184,198.00	0.00
163	002916	深南电路	400	183,160.00	0.00
164	300106	西部牧业	18,500	182,040.00	0.00
165	000938	紫光股份	6,300	181,818.00	0.00
166	688396	华润微	1,861	181,540.55	0.00
167	603937	丽岛新材	12,800	179,456.00	0.00
168	601225	陕西煤业	8,700	177,045.00	0.00
169	300823	建科智能	12,100	176,418.00	0.00
170	300511	雪榕生物	35,000	176,050.00	0.00
171	600135	乐凯胶片	21,900	174,981.00	0.00
172	600487	亨通光电	1,600	174,944.00	0.00
173	300955	嘉亨家化	4,800	173,232.00	0.00
174	300604	长川科技	500	170,710.00	0.00
175	605117	德业股份	1,600	169,888.00	0.00
176	002142	宁波银行	5,700	169,233.00	0.00
177	600893	航发动力	4,400	168,696.00	0.00
178	300154	瑞凌股份	22,200	166,944.00	0.00
179	601939	建设银行	17,300	166,599.00	0.00
180	600844	金煤科技	68,800	166,496.00	0.00
181	000988	华工科技	900	166,149.00	0.00
182	603217	元利科技	7,400	165,982.00	0.00
183	301239	普瑞眼科	5,400	164,430.00	0.00
184	688111	金山办公	763	162,557.15	0.00
185	600089	特变电工	7,000	157,500.00	0.00
186	600104	上汽集团	16,100	157,136.00	0.00
187	688525	佰维存储	313	154,850.49	0.00
188	688036	传音控股	2,617	154,272.15	0.00
189	002353	杰瑞股份	1,000	152,500.00	0.00
190	601009	南京银行	15,400	152,306.00	0.00
191	002049	紫光国微	1,700	150,875.00	0.00
192	002008	大族激光	1,000	150,110.00	0.00
193	601995	中金公司	4,100	148,215.00	0.00
194	600489	中金黄金	8,200	148,010.00	0.00
195	601127	赛力斯	2,400	147,000.00	0.00
196	600584	长电科技	1,400	144,970.00	0.00
197	600031	三一重工	8,300	143,424.00	0.00
198	000338	潍柴动力	5,200	141,700.00	0.00
199	688002	睿创微纳	906	140,149.14	0.00
200	601006	大秦铁路	30,400	140,144.00	0.00
201	601066	中信建投	4,800	139,536.00	0.00

202	603019	中科曙光	1,300	139,399.00	0.00
203	603993	洛阳钼业	7,700	135,135.00	0.00
204	002027	分众传媒	27,800	134,552.00	0.00
205	601668	中国建筑	30,200	131,068.00	0.00
206	300390	天华新能	1,400	130,914.00	0.00
207	601888	中国中免	2,400	128,904.00	0.00
208	603083	剑桥科技	500	127,435.00	0.00
209	600000	浦发银行	14,700	126,567.00	0.00
210	300124	汇川技术	1,900	126,027.00	0.00
211	002236	大华股份	7,600	125,324.00	0.00
212	002648	卫星化学	5,300	124,497.00	0.00
213	600019	宝钢股份	22,500	122,175.00	0.00
214	600549	厦门钨业	1,400	119,280.00	0.00
215	001389	广合科技	500	118,625.00	0.00
216	601111	中国国航	19,600	118,580.00	0.00
217	000807	云铝股份	5,300	117,342.00	0.00
218	601012	隆基绿能	8,900	116,768.00	0.00
219	600105	永鼎股份	1,700	114,716.00	0.00
220	600016	民生银行	35,600	114,632.00	0.00
221	300458	全志科技	2,900	114,434.00	0.00
222	600115	中国东航	29,200	111,252.00	0.00
223	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.00
224	300760	迈瑞医疗	800	108,664.00	0.00
225	002532	天山铝业	10,100	108,373.00	0.00
226	002756	永兴材料	1,900	107,616.00	0.00
227	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.00
228	000425	徐工机械	13,000	105,170.00	0.00
229	300432	富临精工	5,200	104,468.00	0.00
230	601601	中国太保	3,600	102,672.00	0.00
231	601766	中国中车	19,600	101,920.00	0.00
232	002493	荣盛石化	9,450	101,587.50	0.00
233	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.00
234	002738	中矿资源	1,700	100,283.00	0.00
235	603032	德新科技	3,600	96,840.00	0.00
236	300033	同花顺	400	96,400.00	0.00
237	300919	中伟新材	2,200	96,250.00	0.00
238	600111	北方稀土	2,000	96,100.00	0.00
239	300136	信维通信	800	95,400.00	0.00
240	300395	菲利华	700	93,611.00	0.00
241	601998	中信银行	13,200	91,476.00	0.00
242	600688	上海石化	30,900	90,537.00	0.00
243	000063	中兴通讯	2,500	90,475.00	0.00
244	300672	国科微	300	88,500.00	0.00
245	002179	中航光电	1,900	87,780.00	0.00

246	002028	思源电气	500	86,500.00	0.00
247	300671	富满微	1,000	86,160.00	0.00
248	688536	思瑞浦	236	85,925.24	0.00
249	300433	蓝思科技	1,600	85,856.00	0.00
250	002273	水晶光电	2,400	85,152.00	0.00
251	000966	长源电力	21,600	84,672.00	0.00
252	002156	通富微电	1,100	83,457.00	0.00
253	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.00
254	600346	恒力石化	4,700	83,237.00	0.00
255	002414	高德红外	6,200	82,212.00	0.00
256	600426	华鲁恒升	3,400	81,328.00	0.00
257	002271	东方雨虹	6,800	80,716.00	0.00
258	002465	海格通信	6,300	80,451.00	0.00
259	000629	钒钛股份	23,900	79,826.00	0.00
260	600726	华电能源	11,200	79,744.00	0.00
261	301297	富乐德	1,300	79,612.00	0.00
262	688301	奕瑞科技	637	78,988.00	0.00
263	600988	赤峰黄金	3,000	78,960.00	0.00
264	601169	北京银行	16,100	78,890.00	0.00
265	002185	华天科技	3,500	78,085.00	0.00
266	605123	派克新材	800	77,608.00	0.00
267	300454	深信服	800	76,960.00	0.00
268	000975	山金国际	4,500	76,500.00	0.00
269	000617	中油资本	11,500	75,785.00	0.00
270	601607	上海医药	4,900	75,460.00	0.00
271	300568	星源材质	4,000	74,880.00	0.00
272	002050	三花智控	1,700	74,511.00	0.00
273	601088	中国神华	1,900	74,176.00	0.00
274	002966	苏州银行	10,600	73,776.00	0.00
275	600157	永泰能源	45,600	73,416.00	0.00
276	600989	宝丰能源	3,600	73,188.00	0.00
277	002517	恺英网络	4,500	73,125.00	0.00
278	600188	兖矿能源	4,100	72,857.00	0.00
279	600875	东方电气	2,500	71,925.00	0.00
280	600884	杉杉股份	5,200	70,460.00	0.00
281	600352	浙江龙盛	5,800	70,238.00	0.00
282	601677	明泰铝业	4,200	69,720.00	0.00
283	688472	阿特斯	6,434	69,615.88	0.00
284	603179	新泉股份	1,400	69,510.00	0.00
285	300015	爱尔眼科	8,400	69,384.00	0.00
286	601238	广汽集团	13,400	68,072.00	0.00
287	688166	博瑞医药	1,924	67,359.24	0.00
288	300953	震裕科技	500	66,850.00	0.00
289	002155	湖南黄金	2,800	66,836.00	0.00

290	000878	云南铜业	4,200	66,696.00	0.00
291	000034	神州数码	2,400	66,600.00	0.00
292	603659	璞泰来	2,300	66,539.00	0.00
293	688609	九联科技	6,023	66,313.23	0.00
294	000933	神火股份	3,100	65,720.00	0.00
295	001287	中电港	2,100	65,415.00	0.00
296	688120	华海清科	203	65,402.54	0.00
297	300037	新宙邦	700	64,995.00	0.00
298	601061	中信金属	6,000	64,620.00	0.00
299	300418	昆仑万维	1,600	64,576.00	0.00
300	002202	金风科技	2,700	64,530.00	0.00
301	603333	福华尚纬	8,000	64,480.00	0.00
302	603345	安井食品	800	64,152.00	0.00
303	601126	四方股份	1,000	63,200.00	0.00
304	000625	长安汽车	8,800	63,096.00	0.00
305	002484	江海股份	600	63,000.00	0.00
306	688378	奥来德	1,011	62,682.00	0.00
307	000733	振华科技	1,100	62,304.00	0.00
308	600885	宏发股份	1,800	62,082.00	0.00
309	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.00
310	601665	齐鲁银行	10,600	61,162.00	0.00
311	002436	兴森科技	1,200	61,140.00	0.00
312	002497	雅化集团	3,000	61,110.00	0.00
313	601077	渝农商行	10,000	61,100.00	0.00
314	603638	艾迪精密	2,600	60,970.00	0.00
315	603728	鸣志电器	1,000	60,920.00	0.00
316	002947	恒铭达	800	60,840.00	0.00
317	688005	容百科技	1,971	60,312.60	0.00
318	000519	中兵红箭	2,800	58,996.00	0.00
319	000969	安泰科技	2,400	58,896.00	0.00
320	002506	协鑫集成	18,500	58,830.00	0.00
321	601108	财通证券	6,800	58,820.00	0.00
322	300832	新产业	1,400	58,800.00	0.00
323	000155	川能动力	4,900	58,702.00	0.00
324	601600	中国铝业	7,100	58,362.00	0.00
325	603992	松霖科技	1,800	58,320.00	0.00
326	301329	信音电子	2,400	58,296.00	0.00
327	300617	安靠智电	1,100	58,289.00	0.00
328	601777	千里科技	7,100	57,936.00	0.00
329	000967	盈峰环境	5,500	57,915.00	0.00
330	301392	汇成真空	200	57,728.00	0.00
331	688279	峰昭科技	257	57,681.08	0.00
332	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.00
333	603588	高能环境	3,000	57,600.00	0.00

334	688387	信科移动-U	2,894	57,416.96	0.00
335	300661	圣邦股份	400	57,392.00	0.00
336	603127	昭衍新药	1,500	57,330.00	0.00
337	301500	飞南资源	2,200	57,310.00	0.00
338	600418	江淮汽车	2,200	56,826.00	0.00
339	002850	科达利	300	56,790.00	0.00
340	300187	永清环保	11,200	56,560.00	0.00
341	300602	飞荣达	1,100	56,320.00	0.00
342	002714	牧原股份	1,600	55,984.00	0.00
343	688516	奥特维	974	55,897.86	0.00
344	002979	雷赛智能	1,000	55,780.00	0.00
345	002837	英维克	700	55,692.00	0.00
346	688599	天合光能	3,944	55,689.28	0.00
347	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.00
348	688372	伟测科技	296	55,056.00	0.00
349	600801	华新建材	3,500	54,600.00	0.00
350	300738	奥飞数据	2,700	54,594.00	0.00
351	601696	中银证券	4,300	54,395.00	0.00
352	688235	百济神州	213	54,231.93	0.00
353	002745	木林森	4,300	53,965.00	0.00
354	688615	合合信息	476	53,835.60	0.00
355	600208	衢州发展	19,000	53,770.00	0.00
356	603806	福斯特	3,200	53,728.00	0.00
357	600233	圆通速递	3,400	53,550.00	0.00
358	300077	国民技术	1,700	53,295.00	0.00
359	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.00
360	600166	福田汽车	18,100	52,671.00	0.00
361	302132	中航成飞	900	52,488.00	0.00
362	002487	大金重工	900	52,173.00	0.00
363	002600	领益智造	3,000	52,020.00	0.00
364	002545	东方铁塔	3,200	51,904.00	0.00
365	600961	株冶集团	1,600	51,824.00	0.00
366	688006	杭可科技	1,417	51,791.35	0.00
367	002396	星网锐捷	2,700	51,759.00	0.00
368	688213	思特威-W	483	51,714.81	0.00
369	600941	中国移动	600	51,678.00	0.00
370	300166	东方国信	2,900	51,359.00	0.00
371	300999	金龙鱼	2,200	51,172.00	0.00
372	603129	春风动力	200	51,160.00	0.00
373	002498	汉缆股份	7,500	51,150.00	0.00
374	600595	中孚实业	9,100	51,142.00	0.00
375	001339	智微智能	500	51,140.00	0.00
376	002468	申通快递	3,500	50,960.00	0.00
377	300058	蓝色光标	3,700	50,912.00	0.00

378	603195	公牛集团	1,300	50,895.00	0.00
379	000951	中国重汽	2,600	50,726.00	0.00
380	688692	达梦数据	207	50,568.03	0.00
381	600406	国电南瑞	2,200	50,270.00	0.00
382	000831	中国稀土	900	49,941.00	0.00
383	603288	海天味业	1,500	49,740.00	0.00
384	600998	九州通	10,600	49,714.00	0.00
385	300607	拓斯达	1,200	49,476.00	0.00
386	301219	腾远钴业	900	49,320.00	0.00
387	002969	嘉美包装	3,500	49,280.00	0.00
388	000883	湖北能源	11,400	49,248.00	0.00
389	000301	东方盛虹	4,300	49,235.00	0.00
390	000027	深圳能源	7,900	48,980.00	0.00
391	300693	盛弘股份	1,000	48,750.00	0.00
392	601615	明阳智能	4,200	48,594.00	0.00
393	688772	珠海冠宇	2,475	48,584.25	0.00
394	600109	国金证券	5,500	48,290.00	0.00
395	688690	纳微科技	1,092	48,157.20	0.00
396	300679	电连技术	800	47,992.00	0.00
397	300747	锐科激光	900	47,781.00	0.00
398	688127	蓝特光学	488	47,628.80	0.00
399	600535	天士力	3,600	47,628.00	0.00
400	300115	长盈精密	1,700	47,498.00	0.00
401	603305	旭升集团	3,900	47,268.00	0.00
402	688629	华丰科技	252	47,252.52	0.00
403	300373	扬杰科技	300	47,169.00	0.00
404	601229	上海银行	5,400	46,872.00	0.00
405	300253	卫宁健康	6,900	46,437.00	0.00
406	600906	财达证券	6,200	46,252.00	0.00
407	301345	涛涛车业	200	46,200.00	0.00
408	300134	大富科技	5,400	46,170.00	0.00
409	601628	中国人寿	1,300	45,955.00	0.00
410	000762	西藏矿业	1,700	45,390.00	0.00
411	002265	建设工业	2,600	45,240.00	0.00
412	603225	新凤鸣	2,300	45,195.00	0.00
413	300779	惠城环保	900	45,180.00	0.00
414	000690	宝新能源	9,600	45,120.00	0.00
415	688400	凌云光	678	44,883.60	0.00
416	000166	申万宏源	10,200	44,880.00	0.00
417	000783	长江证券	4,600	44,850.00	0.00
418	002153	石基信息	6,200	44,826.00	0.00
419	600546	山煤国际	4,100	44,813.00	0.00
420	688584	上海合晶	1,246	44,793.70	0.00
421	300450	先导智能	1,100	44,792.00	0.00

422	000932	华菱钢铁	12,900	44,763.00	0.00
423	000062	深圳华强	1,400	44,548.00	0.00
424	600619	海立股份	2,800	44,380.00	0.00
425	300773	拉卡拉	2,900	44,370.00	0.00
426	601666	平煤股份	6,200	44,330.00	0.00
427	688063	派能科技	832	44,320.64	0.00
428	603439	三力制药	3,500	44,135.00	0.00
429	600808	马钢股份	17,600	44,000.00	0.00
430	300133	华策影视	6,200	43,896.00	0.00
431	688778	厦钨新能	805	43,792.00	0.00
432	600673	东阳光	1,300	43,654.00	0.00
433	300997	欢乐家	3,200	43,360.00	0.00
434	688368	晶丰明源	200	43,304.00	0.00
435	603030	全筑股份	21,700	43,183.00	0.00
436	688385	复旦微电	605	43,130.45	0.00
437	603077	和邦生物	18,500	42,920.00	0.00
438	002518	科士达	800	42,872.00	0.00
439	000426	兴业银锡	1,300	42,848.00	0.00
440	000628	高新发展	900	42,660.00	0.00
441	600879	航天电子	2,000	42,580.00	0.00
442	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.00
443	600369	西南证券	10,500	42,210.00	0.00
444	688099	晶晨股份	409	42,086.10	0.00
445	300130	新国都	2,000	42,080.00	0.00
446	688777	中控技术	358	42,065.00	0.00
447	000681	视觉中国	2,100	41,874.00	0.00
448	601069	西部黄金	1,900	41,800.00	0.00
449	300001	特锐德	1,100	41,613.00	0.00
450	601000	唐山港	10,000	41,500.00	0.00
451	002841	视源股份	1,200	41,436.00	0.00
452	002531	天顺风能	4,900	41,307.00	0.00
453	601399	国机重装	11,800	41,300.00	0.00
454	600323	瀚蓝环境	1,500	41,190.00	0.00
455	300034	钢研高纳	2,400	41,136.00	0.00
456	601919	中远海控	3,100	41,106.00	0.00
457	600361	创新新材	11,400	41,040.00	0.00
458	601021	春秋航空	900	41,022.00	0.00
459	603025	大豪科技	3,000	40,920.00	0.00
460	000415	渤海租赁	10,000	40,700.00	0.00
461	603505	金石资源	2,000	40,300.00	0.00
462	000036	华联控股	9,200	40,204.00	0.00
463	002338	奥普光电	700	40,040.00	0.00
464	000837	秦川机床	3,600	39,996.00	0.00
465	601865	福莱特	3,800	39,938.00	0.00

466	603135	中重科技	3,300	39,930.00	0.00
467	300057	万顺新材	4,600	39,928.00	0.00
468	000727	冠捷科技	14,500	39,585.00	0.00
469	600029	南方航空	7,600	39,368.00	0.00
470	688382	益方生物-U	2,179	39,222.00	0.00
471	688165	埃夫特-U	1,917	39,106.80	0.00
472	601155	新城控股	3,800	38,988.00	0.00
473	601881	中国银河	3,100	38,967.00	0.00
474	600977	中国电影	3,000	38,760.00	0.00
475	300416	苏试试验	1,900	38,722.00	0.00
476	002251	步步高	11,400	38,532.00	0.00
477	301363	美好医疗	2,100	38,493.00	0.00
478	002429	兆驰股份	3,700	38,443.00	0.00
479	601728	中国电信	7,400	38,406.00	0.00
480	301487	盟固利	2,000	38,300.00	0.00
481	603276	恒兴新材	2,500	38,275.00	0.00
482	600737	中粮糖业	3,100	38,223.00	0.00
483	300580	贝斯特	1,900	38,209.00	0.00
484	002025	航天电器	500	38,110.00	0.00
485	600050	中国联通	9,500	38,000.00	0.00
486	601168	西部矿业	1,400	37,996.00	0.00
487	000060	中金岭南	5,000	37,850.00	0.00
488	300620	光库科技	100	37,820.00	0.00
489	002416	爱施德	4,200	37,632.00	0.00
490	001289	龙源电力	2,400	37,512.00	0.00
491	300244	迪安诊断	2,000	37,480.00	0.00
492	002488	金固股份	4,200	37,422.00	0.00
493	603124	江南新材	200	37,396.00	0.00
494	601106	中国一重	11,300	37,290.00	0.00
495	300687	赛意信息	1,200	37,200.00	0.00
496	300031	宝通科技	1,300	37,141.00	0.00
497	300459	汤姆猫	10,900	36,951.00	0.00
498	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.00
499	601233	桐昆股份	1,700	36,805.00	0.00
500	000893	亚钾国际	900	36,801.00	0.00
501	300803	指南针	400	36,668.00	0.00
502	002602	世纪华通	2,600	36,660.00	0.00
502	001337	四川黄金	1,000	36,660.00	0.00
503	002077	大港股份	1,900	36,651.00	0.00
504	301550	斯菱智驱	400	36,572.00	0.00
505	601360	三六零	4,200	36,498.00	0.00
506	300017	网宿科技	2,800	36,428.00	0.00
507	600037	歌华有线	5,800	36,366.00	0.00
508	300872	天阳科技	2,300	36,340.00	0.00

509	603308	应流股份	600	36,240.00	0.00
510	600060	海信视像	1,300	36,231.00	0.00
511	688728	格科微	1,721	36,209.84	0.00
512	300763	锦浪科技	400	36,140.00	0.00
513	002948	青岛银行	7,100	36,068.00	0.00
514	000612	焦作万方	3,400	36,006.00	0.00
515	002080	中材科技	400	36,000.00	0.00
516	301631	壹连科技	500	35,930.00	0.00
517	600339	中油工程	11,700	35,919.00	0.00
518	603444	吉比特	100	35,842.00	0.00
519	600057	厦门象屿	6,600	35,772.00	0.00
520	301095	广立微	300	35,415.00	0.00
521	601208	东材科技	500	35,395.00	0.00
522	600660	福耀玻璃	700	35,308.00	0.00
523	603317	天味食品	2,700	35,127.00	0.00
524	301510	固高科技	1,100	35,123.00	0.00
525	002832	比音勒芬	1,700	35,088.00	0.00
526	600475	华光环能	2,300	35,075.00	0.00
527	601678	滨化股份	5,300	34,927.00	0.00
528	600927	永安期货	2,800	34,860.00	0.00
529	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.00
530	300339	润和软件	900	34,659.00	0.00
531	002541	鸿路钢构	2,000	34,640.00	0.00
532	002516	旷达科技	6,200	34,596.00	0.00
533	300772	运达股份	2,800	34,440.00	0.00
534	000061	农产品	6,100	34,160.00	0.00
535	002557	洽洽食品	1,900	34,124.00	0.00
536	600332	白云山	1,700	34,068.00	0.00
537	600008	首创环保	12,500	34,000.00	0.00
538	600330	天通股份	1,100	33,924.00	0.00
539	601101	昊华能源	3,200	33,792.00	0.00
540	300142	沃森生物	2,600	33,774.00	0.00
541	002838	道恩股份	1,100	33,682.00	0.00
542	688686	奥普特	200	33,678.00	0.00
542	002245	蔚蓝锂芯	1,800	33,678.00	0.00
543	300682	朗新科技	3,400	33,660.00	0.00
544	300127	银河磁体	1,200	33,540.00	0.00
545	002458	益生股份	4,300	33,411.00	0.00
546	600295	鄂尔多斯	3,100	33,232.00	0.00
547	688180	君实生物-U	982	33,211.24	0.00
548	600623	华谊集团	4,100	33,087.00	0.00
549	000950	重药控股	6,600	33,066.00	0.00
550	000949	新乡化纤	5,200	32,968.00	0.00
551	301489	思泉新材	200	32,916.00	0.00

552	600118	中国卫星	400	32,820.00	0.00
553	301263	泰恩康	1,600	32,784.00	0.00
554	002635	安洁科技	1,600	32,720.00	0.00
555	000729	燕京啤酒	3,200	32,416.00	0.00
556	600754	锦江酒店	1,800	32,382.00	0.00
557	000801	四川九洲	2,500	32,350.00	0.00
558	603596	伯特利	1,300	32,292.00	0.00
559	600717	天津港	8,300	32,287.00	0.00
560	002216	三全食品	2,800	32,284.00	0.00
561	002044	美年健康	6,400	32,192.00	0.00
562	300567	精测电子	100	31,760.00	0.00
563	301039	中集车辆	4,500	31,725.00	0.00
564	002938	鹏鼎控股	300	31,614.00	0.00
565	300990	同飞股份	300	31,521.00	0.00
566	301275	汉朔科技	700	31,430.00	0.00
567	603876	鼎胜新材	1,200	31,212.00	0.00
568	002120	韵达股份	4,900	31,164.00	0.00
569	600409	三友化工	5,100	31,161.00	0.00
570	603132	金徽股份	2,000	31,160.00	0.00
571	601608	中信重工	6,500	31,005.00	0.00
572	600985	淮北矿业	2,200	30,910.00	0.00
573	300496	中科创达	500	30,895.00	0.00
574	600316	洪都航空	1,100	30,734.00	0.00
575	688658	悦康药业	2,386	30,683.96	0.00
576	301267	华夏眼科	2,100	30,639.00	0.00
577	300007	汉威科技	800	30,560.00	0.00
578	688281	华秦科技	608	30,539.84	0.00
579	600655	豫园股份	7,400	30,414.00	0.00
580	301662	宏工科技	300	30,396.00	0.00
581	688475	萤石网络	1,111	30,385.85	0.00
582	600446	金证股份	3,000	30,180.00	0.00
583	688062	迈威生物-U	1,068	30,171.00	0.00
584	002320	海峡股份	4,800	30,096.00	0.00
585	600928	西安银行	9,200	30,084.00	0.00
586	001236	弘业期货	4,300	29,885.00	0.00
587	002126	银轮股份	600	29,880.00	0.00
588	688433	华曙高科	349	29,874.40	0.00
589	600580	卧龙电驱	900	29,790.00	0.00
590	300498	温氏股份	2,400	29,568.00	0.00
591	601001	晋控煤业	1,700	29,563.00	0.00
592	300761	立华股份	1,800	29,538.00	0.00
593	688114	华大智造	576	29,422.08	0.00
594	001286	陕西能源	2,900	29,406.00	0.00
595	300337	银邦股份	2,500	29,150.00	0.00

596	688192	迪哲医药-U	729	29,108.97	0.00
597	603816	顾家家居	1,300	29,068.00	0.00
598	600971	恒源煤电	4,200	28,980.00	0.00
599	000636	风华高科	400	28,896.00	0.00
600	000830	鲁西化工	2,400	28,800.00	0.00
601	002195	岩山科技	4,400	28,776.00	0.00
602	603766	隆鑫通用	2,400	28,632.00	0.00
603	002230	科大讯飞	700	28,588.00	0.00
604	601068	中铝国际	6,600	28,512.00	0.00
605	601969	海南矿业	3,600	28,476.00	0.00
606	603501	豪威集团	300	28,455.00	0.00
607	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.00
608	002292	奥飞娱乐	4,300	28,208.00	0.00
609	002352	顺丰控股	900	28,134.00	0.00
610	300969	恒帅股份	300	28,128.00	0.00
611	000990	诚志股份	3,400	27,812.00	0.00
612	002017	东信和平	1,900	27,797.00	0.00
613	300322	硕贝德	1,100	27,720.00	0.00
614	300861	美畅股份	1,100	27,709.00	0.00
615	002222	福晶科技	300	27,684.00	0.00
616	600657	信达地产	11,900	27,489.00	0.00
617	600926	杭州银行	1,900	27,455.00	0.00
618	688469	芯联集成-U	2,587	27,448.07	0.00
619	002643	万润股份	1,300	27,235.00	0.00
620	601333	广深铁路	9,900	27,225.00	0.00
621	600072	中船科技	3,200	27,168.00	0.00
622	000680	山推股份	2,700	27,135.00	0.00
623	605376	博迁新材	100	27,130.00	0.00
624	002317	众生药业	1,100	27,027.00	0.00
624	600773	西藏城投	2,100	27,027.00	0.00
625	603939	益丰药房	1,500	26,970.00	0.00
626	600158	中体产业	4,000	26,960.00	0.00
627	688353	华盛锂电	232	26,928.24	0.00
628	601179	中国西电	1,800	26,856.00	0.00
629	688779	五矿新能	3,304	26,795.44	0.00
630	600025	华能水电	3,000	26,670.00	0.00
631	688628	优利德	269	26,614.86	0.00
632	600690	海尔智家	1,300	26,533.00	0.00
633	000750	国海证券	7,200	26,496.00	0.00
634	688183	生益电子	200	26,480.00	0.00
635	688612	威迈斯	891	26,364.69	0.00
636	002922	伊戈尔	800	26,240.00	0.00
637	601985	中国核电	2,900	26,187.00	0.00
638	300723	一品红	700	26,096.00	0.00

639	301571	国科天成	400	26,072.00	0.00
640	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.00
641	300759	康龙化成	900	26,037.00	0.00
642	300363	博腾股份	1,600	25,984.00	0.00
643	002709	天赐材料	500	25,715.00	0.00
644	000021	深科技	400	25,708.00	0.00
645	000960	锡业股份	600	25,614.00	0.00
646	600654	中安科	9,600	25,536.00	0.00
647	002881	美格智能	700	25,508.00	0.00
648	603486	科沃斯	500	25,375.00	0.00
649	301488	豪恩汽电	200	25,364.00	0.00
650	002131	利欧股份	5,300	25,175.00	0.00
651	688153	唯捷创芯	781	25,085.72	0.00
652	000739	普洛药业	1,500	24,990.00	0.00
653	601212	白银有色	4,900	24,892.00	0.00
654	000552	甘肃能化	11,100	24,864.00	0.00
655	300140	节能环保	5,000	24,850.00	0.00
656	000712	锦龙股份	2,800	24,808.00	0.00
657	300592	华凯易佰	1,400	24,780.00	0.00
658	688700	东威科技	277	24,763.80	0.00
659	603156	养元饮品	500	24,535.00	0.00
660	000539	粤电力 A	3,600	24,516.00	0.00
661	301369	联动科技	100	24,500.00	0.00
662	002340	格林美	3,700	24,457.00	0.00
663	300276	三丰智能	3,400	24,378.00	0.00
664	300497	富祥股份	1,100	24,376.00	0.00
665	000402	金融街	10,100	24,341.00	0.00
666	688068	热景生物	280	24,248.00	0.00
667	600711	盛屯矿业	2,200	24,134.00	0.00
668	002534	西子洁能	1,300	24,115.00	0.00
669	603233	大参林	1,600	24,048.00	0.00
670	301087	可孚医疗	500	23,825.00	0.00
671	002081	金螳螂	5,500	23,815.00	0.00
672	002032	苏泊尔	600	23,760.00	0.00
673	600686	金龙汽车	2,100	23,709.00	0.00
674	601319	中国人保	3,500	23,660.00	0.00
675	300437	清水源	2,100	23,646.00	0.00
676	300342	天银机电	500	23,500.00	0.00
677	600123	兰花科创	4,400	23,496.00	0.00
678	600507	方大特钢	5,800	23,490.00	0.00
679	603871	嘉友国际	2,300	23,483.00	0.00
680	002378	章源钨业	700	23,436.00	0.00
681	002163	海南发展	2,800	23,352.00	0.00
682	300909	汇创达	400	23,288.00	0.00

683	000568	泸州老窖	300	23,256.00	0.00
684	002099	海翔药业	4,400	23,232.00	0.00
685	300185	通裕重工	8,500	23,205.00	0.00
686	688691	灿芯股份	200	23,186.00	0.00
687	002755	奥赛康	1,700	23,154.00	0.00
688	002670	国盛证券	2,100	23,100.00	0.00
689	603353	和顺石油	600	23,052.00	0.00
690	688091	上海谊众	571	22,954.20	0.00
691	002345	潮宏基	2,500	22,925.00	0.00
692	002299	圣农发展	1,500	22,740.00	0.00
693	688586	江航装备	1,943	22,713.67	0.00
694	601139	深圳燃气	4,000	22,640.00	0.00
695	002261	拓维信息	800	22,408.00	0.00
696	300298	三诺生物	1,600	22,320.00	0.00
697	688631	莱斯信息	475	22,282.25	0.00
698	603108	润达医疗	2,500	22,250.00	0.00
699	600201	生物股份	1,900	22,135.00	0.00
700	000709	河钢股份	11,400	22,116.00	0.00
701	600126	杭钢股份	3,600	22,068.00	0.00
702	601997	贵阳银行	4,300	22,059.00	0.00
703	603599	广信股份	2,300	22,034.00	0.00
704	000800	一汽解放	3,700	22,015.00	0.00
705	002045	国光电器	2,800	21,980.00	0.00
706	688231	隆达股份	598	21,964.54	0.00
707	002138	顺络电子	300	21,930.00	0.00
708	600783	鲁信创投	1,100	21,912.00	0.00
709	603228	景旺电子	300	21,723.00	0.00
710	603737	三棵树	900	21,690.00	0.00
711	688351	微电生理	955	21,640.30	0.00
712	300284	苏交科	4,300	21,500.00	0.00
713	600871	石化油服	10,500	21,315.00	0.00
714	600096	云天化	700	21,280.00	0.00
715	600267	海正药业	2,100	21,231.00	0.00
716	600160	巨化股份	400	21,204.00	0.00
717	300341	麦克奥迪	1,600	21,200.00	0.00
718	301153	中科江南	1,300	21,177.00	0.00
719	600320	振华重工	5,100	21,063.00	0.00
720	000686	东北证券	2,500	21,000.00	0.00
721	301268	铭利达	1,500	20,970.00	0.00
722	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.00
723	600929	雪天盐业	4,600	20,884.00	0.00
724	301371	敷尔佳	800	20,800.00	0.00
725	600882	妙可蓝多	1,300	20,787.00	0.00
726	300579	数字认证	1,000	20,700.00	0.00

727	300285	国瓷材料	200	20,636.00	0.00
728	000059	华锦股份	5,500	20,625.00	0.00
729	300492	华图山鼎	600	20,610.00	0.00
730	603887	城地香江	2,200	20,548.00	0.00
731	603013	亚普股份	1,300	20,527.00	0.00
732	002221	东华能源	3,900	20,514.00	0.00
733	601187	厦门银行	3,000	20,490.00	0.00
734	600015	华夏银行	3,200	20,448.00	0.00
735	003816	中国广核	5,200	20,332.00	0.00
736	600640	国脉文化	2,100	20,307.00	0.00
737	002439	启明星辰	1,600	20,240.00	0.00
738	601801	皖新传媒	4,100	20,213.00	0.00
739	600863	华能蒙电	4,300	20,210.00	0.00
740	002737	葵花药业	1,800	20,178.00	0.00
741	600335	国机汽车	4,300	20,124.00	0.00
742	603057	紫燕食品	900	20,070.00	0.00
743	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.00
744	000959	首钢股份	2,700	9,477.00	0.00
745	603606	东方电缆	200	8,302.00	0.00
746	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
747	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
748	301511	德福科技	8	1,150.80	0.00
749	301338	凯格精机	7	1,140.23	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002371	北方华创	464,429,370.15	17.88
2	688072	拓荆科技	352,873,148.26	13.59
3	688012	中微公司	325,790,090.99	12.54
4	01347	华虹宏力	222,885,556.53	8.58
4	688347	华虹宏力	17,220,094.89	0.66
5	300308	中际旭创	226,127,945.80	8.71
6	300236	上海新阳	163,755,215.45	6.31
7	300394	天孚通信	155,360,377.94	5.98
8	301511	德福科技	130,858,873.64	5.04
9	603061	金海通	129,573,621.40	4.99
10	300757	罗博特科	117,769,581.18	4.53
11	688545	兴福电子	113,318,746.07	4.36

12	688008	澜起科技	109,154,902.14	4.20
13	002428	云南锗业	104,768,786.45	4.03
14	688041	海光信息	98,828,054.49	3.81
15	300502	新易盛	97,066,925.20	3.74
16	03986	兆易创新	81,529,716.16	3.14
16	603986	兆易创新	14,731,861.00	0.57
17	00189	东岳集团	95,326,998.46	3.67
18	301421	波长光电	95,053,103.78	3.66
19	688766	普冉股份	92,274,800.55	3.55
20	688313	仕佳光子	91,887,541.85	3.54
21	688233	神工股份	82,099,581.54	3.16
22	002837	英维克	64,800,828.20	2.50
23	002281	光迅科技	61,511,634.62	2.37
24	688082	盛美上海	60,853,558.62	2.34

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002371	北方华创	292,266,048.88	11.25
2	688072	拓荆科技	290,970,836.96	11.20
3	01347	华虹宏力	186,755,642.79	7.19
3	688347	华虹宏力	16,170,235.64	0.62
4	688012	中微公司	181,926,904.45	7.00
5	300308	中际旭创	169,612,604.07	6.53
6	301511	德福科技	139,202,025.02	5.36
7	300236	上海新阳	124,136,732.91	4.78
8	300757	罗博特科	115,607,752.25	4.45
9	603061	金海通	115,017,533.05	4.43
10	688008	澜起科技	101,209,444.79	3.90
11	300502	新易盛	98,257,176.70	3.78
12	301421	波长光电	93,709,658.22	3.61
13	688082	盛美上海	73,354,867.92	2.82
14	002428	云南锗业	68,176,823.43	2.63
15	002837	英维克	63,890,658.23	2.46
16	688361	中科飞测	63,528,381.16	2.45
17	300394	天孚通信	62,255,966.79	2.40

18	002281	光迅科技	57,266,586.38	2.21
19	03986	兆易创新	39,442,261.85	1.52
19	603986	兆易创新	15,925,560.00	0.61
20	688766	普冉股份	49,420,370.70	1.90

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	8,761,200,111.06
卖出股票收入（成交）总额	7,901,714,575.83

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	249,874,726.03	3.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,013,304,745.21	24.20
	其中：政策性金融债	1,952,643,145.21	23.48
4	企业债券	1,835,020,395.92	22.06
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,975,334,965.48	23.75
7	可转债（可交换债）	236,791.01	0.00
8	同业存单	19,980,985.71	0.24
9	其他	656,512,099.94	7.89
10	合计	6,750,264,709.30	81.15

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	220208.IB	22 国开 08	2,950,000	299,190,616.44	3.60
2	2605254.IB	26 内蒙古 债 01	2,600,000	266,845,913.04	3.21
3	260013.IB	26 付息国 债 13	2,500,000	249,874,726.03	3.00

4	230203.IB	23 国开 03	2,000,000	206,657,972.60	2.48
5	235921.IB	26 贵州 09	1,900,000	193,140,814.21	2.32

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

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，以及对债券市场的分析，采用流动性好、交易活跃的期货合约，调节债券组合的久期和流动性，降低投资组合的整体风险，实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货投资为基金的久期控制提供了更便利、更具有流动性的工具，有效降低了基金净值波动，提高了净值增长的平稳性。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行或其分支行的处罚。国家开发银行、中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。中国进出口银行、中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	3,369,518.58
2	应收清算款	102,126,435.25
3	应收股利	317,845.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,209,613.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,023,412.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	113062.SH	常银转债	157,236.25	0.00
2	118034.SH	晶能转债	76,732.90	0.00
3	110075.SH	南航转债	1,096.85	0.00

7.12.5 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	688072	拓荆科技	107,291,226.11	1.29	重大事项停牌

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	持有份额	占总份额比

				例		例
广发恒祥债券 A	4,963	827,284.34	3,757,250 ,276.11	91.51%	348,561,9 01.43	8.49%
广发恒祥债券 C	24,620	118,462.40	2,599,131 ,855.43	89.12%	317,412,5 04.35	10.88%
合计	29,583	237,378.11	6,356,382 ,131.54	90.52%	665,974,4 05.78	9.48%

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	广发恒祥债券 A	13,872,949.70	0.3379%
	广发恒祥债券 C	214,738.57	0.0074%
	合计	14,087,688.27	0.2006%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	广发恒祥债券 A	>100
	广发恒祥债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发恒祥债券 A	>100
	广发恒祥债券 C	0
	合计	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发恒祥债券 A	广发恒祥债券 C
基金合同生效日（2022 年 5 月 6 日）基金份额总额	116,469,995.19	108,106,605.92
本报告期期初基金份额总额	1,535,819,015.02	838,243,346.57

本报告期基金总申购份额	3,262,993,780.99	3,659,112,618.13
减：本报告期基金总赎回份额	693,000,618.47	1,580,811,604.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,105,812,177.54	2,916,544,359.78

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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无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	
广发证券	2	16,662,286,118.11	100.00%	3,082,561.10	100.00%	-
方正证券	1	628,568.78	0.00%	56.48	0.00%	-

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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
广发证券	3,246,992,700.26	100.00%	5,418,400,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-01
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	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-21
6	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-29

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）中国证监会注册广发恒祥债券型证券投资基金募集的文件
- （二）《广发恒祥债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （四）《广发恒祥债券型证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1

号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日