

广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金
2025 年年度报告
2025 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 26 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 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	57

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
8.6 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	87
8.7 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	88
8.8 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	88
8.9 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	88
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	88
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	88
8.12 投资组合报告附注	88
§9 基金份额持有人信息	89
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	90
§10 开放式基金份额变动	90
§11 重大事件揭示	91
11.1 基金份额持有人大会决议	91
11.2 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	91
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
11.4 基金投资策略的改变	91
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	91
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	91
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	91
11.8 其他重大事件	92
§12 影响投资者决策的其他重要信息	93
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	93
§13 备查文件目录	93
13.1 备查文件目录	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	94

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	广发鑫和混合	
基金主代码	004750	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 16 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,278,000,303.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发鑫和混合 A	广发鑫和混合 C
下属分级基金的交易代码	004750	004751
报告期末下属分级基金的份额总额	593,783,109.05 份	1,684,217,194.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过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。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	朱绍纲
	联系电话	020-83936666	010-85238309
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		95105828	95577
传真		020-34281105	010-85238680
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市东城区建国门内大街22号（100005）
邮政编码		510308	100005
法定代表人		葛长伟	杨书剑

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利

	国际广场南塔 31-33 楼; 广东省珠海市横琴 新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室
--	---

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	
	广发鑫和混 合 A	广发鑫和混 合 C	广发鑫和混 合 A	广发鑫和混 合 C	广发鑫和混 合 A	广发鑫和混合 C
本期已 实现收 益	19,512,118. 85	58,194,990. 97	6,775,773.91	24,290,344.7 7	1,931,520.36	162,543.46
本期利 润	13,520,247. 58	40,841,579. 71	12,168,486.7 6	38,380,806.0 2	1,482,716.02	-96,367.75
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0395	0.0360	0.1260	0.0884	0.0181	-0.0027
本期加 权平均 净值利 润率	2.70%	2.55%	9.15%	6.65%	1.43%	-0.22%
本期基 金份额 净值增 长率	4.00%	3.59%	13.50%	13.05%	0.05%	-0.35%
3.1.2 期末 数据和指 标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	广发鑫和混合 A	广发鑫和混合 C	广发鑫和混合 A	广发鑫和混合 C	广发鑫和混合 A	广发鑫和混合 C
期末可 供分配 利润	265,479,322 .50	658,209,472 .63	72,000,645.1 9	174,896,746. 72	5,596,671.78	6,963,889.07
期末可 供分配 基金份 额利润	0.4471	0.3908	0.3615	0.3139	0.2481	0.2093
期末基 金资产 净值	878,213,791 .26	2,395,190,3 19.17	283,212,830. 54	764,938,508. 21	28,267,105.7 4	40,406,612.10
期末基	1.4790	1.4221	1.4221	1.3728	1.2529	1.2143

金 份 额 净 值						
3.1.3 累计 期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	广发鑫和混 合 A	广发鑫和混 合 C	广发鑫和混 合 A	广发鑫和混 合 C	广发鑫和混 合 A	广发鑫和混 合 C
基金份 额累 计净 值增 长率	52.47%	46.66%	46.60%	41.58%	29.16%	25.23%

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

广发鑫和混合 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	0.54%	0.07%	0.39%	0.28%	0.15%	-0.21%
过去六个月	2.16%	0.08%	4.70%	0.26%	-2.54%	-0.18%
过去一年	4.00%	0.11%	5.70%	0.27%	-1.70%	-0.16%
过去三年	18.10%	0.18%	17.56%	0.31%	0.54%	-0.13%
过去五年	21.14%	0.19%	15.36%	0.33%	5.78%	-0.14%
自基金合同生 效起至今	52.47%	0.20%	39.67%	0.36%	12.80%	-0.16%

广发鑫和混合 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	0.44%	0.07%	0.39%	0.28%	0.05%	-0.21%
过去六个月	1.96%	0.08%	4.70%	0.26%	-2.74%	-0.18%
过去一年	3.59%	0.11%	5.70%	0.27%	-2.11%	-0.16%

过去三年	16.70%	0.18%	17.56%	0.31%	-0.86%	-0.13%
过去五年	18.75%	0.19%	15.36%	0.33%	3.39%	-0.14%
自基金合同生效起至今	46.66%	0.20%	39.67%	0.36%	6.99%	-0.16%

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

广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 1 月 16 日至 2025 年 12 月 31 日)

广发鑫和混合 A



广发鑫和混合 C

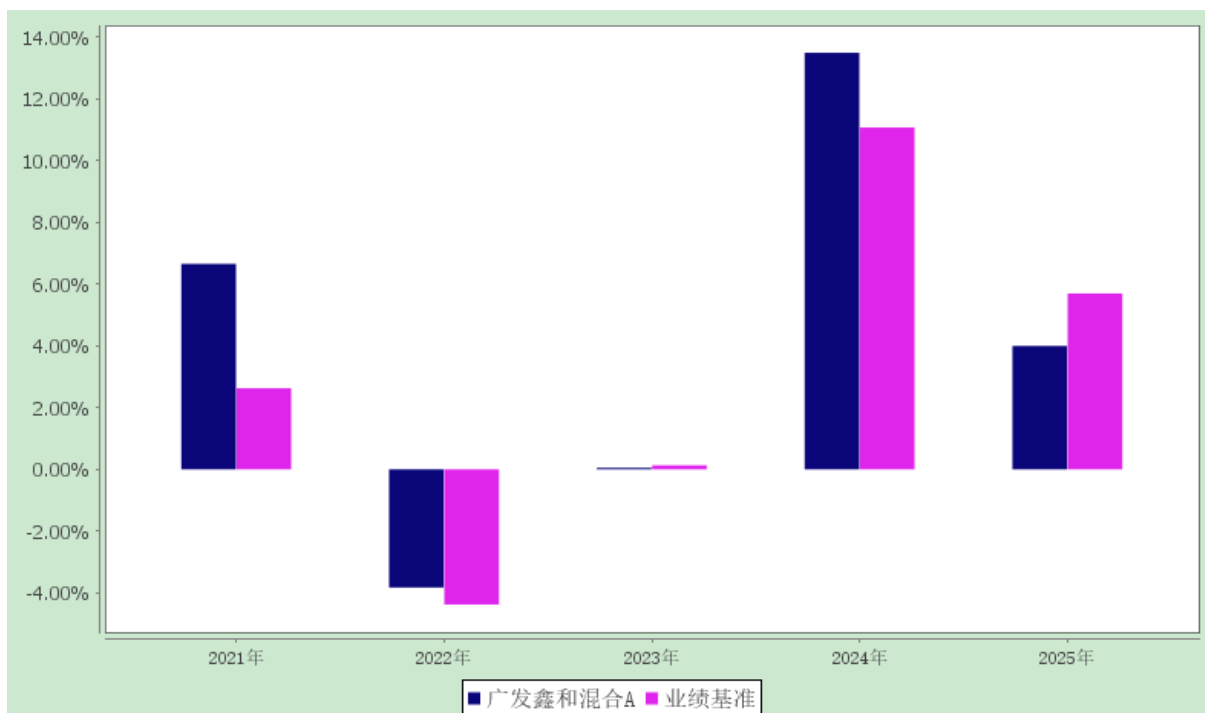


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

广发鑫和混合 A



广发鑫和混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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	2021-04-08	-	11.2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程与风险管理部研

	<p>(LOF)的基金经理；广发景丰纯债债券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；广发恒祥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</p>				<p>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)。</p>
--	---	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

公司根据相关法律法规以及自律规则制定了《广发基金管理有限公司公平交易制度》等制度，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。

公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

公司对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。在本年度本基金与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差专项分析中，未发现存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 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 97 次，其中 84 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 13 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

2025 年股票市场整体趋势上涨，上证指数一度突破 4000 点，创下近 10 年新高。经济修复向上、政策提振投资者风险偏好、海内外 AI 算力科技催化、美联储开启降息周期等多重利好因素叠加，股市上演双创指数引领的牛市行情。结构上，市场热点轮动扩散，全年科技成长主线明朗，计算机、创新药、机器人、半导体及军工军贸等热门概念轮番大涨，通信和有色金属行业跑赢市场。风格上，成长强于价值，小盘优于大盘。转债市场震荡向上，估值维持高位。上半年受宏观事件驱动的正股行情传导，可转债维持向上趋势，三季度受“反内卷”行情和科技主体升温催化以及机构赎回拖累，可转债先上升后震荡，估值泡沫得以消化，四季度正股市场动能转弱，可转债震荡上行，指数宽幅波动。债券市场整体上行后震荡，收益率曲线呈现熊陡状态，信用利差先走阔后震荡收窄，信用债整体表现较好。一季度，资金价格持续抬升打破利率单边下行惯性，叠加风险偏好走强、机构持续卖券行为导致债市回调至年内高点，赎回扰动导致信用利差先走阔后收窄；二季度，受关税摩擦和降准降息落地等因素影响，市场风险偏好显著承压，债市收益率再下台阶，信用债 ETF 快速扩容，成份券走出独立行情推动信用利差主动收窄；三季度，“反内卷”政策升温叠加公募基金新规预期影响，股债跷板效应下债市面临调整压力，信用利差再度主动走阔；四季度，央行虽重启买债但力度不及预期，监管新规持续影响债市，市场普遍担忧超长债供给，30 年国债与 10 年国债间的利差走阔明显。

报告期内，组合秉承“固收+多策略”的投资理念，在权益资产中投入使用和持续优化迭代量化 Alpha 策略模型，同时对权益和可转债个股和个券进行了优化调整，在较好地控制住回撤的基础上提高了投资回报。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 4.00%，C 类基金份额净值增长率为 3.59%，同期业绩比较基准收益率为 5.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，A 股业绩拐点得以验证，负债端或进一步驱动股票行情，权益市场向上仍值得期待，债券市场或维持区间震荡。股票市场负债端配置需求依然较强，居民定存到期的涓滴效应将提供新的边际增量，结构上关注以科技创新为代表的成长赛道和“反内卷”政策受益的优势行业，以及与宏观基本面企稳相关的板块修复机会，此外随着财富效应累积，价值有望接力科技实现估值修复，关注顺周期板块的配置机会；转债市场在配置需求旺盛与供给稀缺的共同驱动下，可转债估值或维持高位震荡，结构性机会或集中于前期超跌的中低价品种。组合未来将优化各类投资策略，权益投资方面主动与被动并行，使组合更加适应不同的市场环境，为投资人带来更好的回报体验。债券市场或仍以区间震荡为主，需持续关注通胀回暖超预期对债市形成抑制、权益市场上涨引发大类资产再配置压力、财政政策集中供给扰动以及货币政策宽松不及预期带来的调整压力等。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，在震荡市场中需要把握票息高位的配置机会，关注季节性、轮动性和赎回波动带来的配置窗口。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，公司严格遵循法律法规、监管规则和自律规范要求，持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作，保障公司各项业务合法、合规、稳健运行。主要工作情况如下：

一是持续推进合规文化建设。积极营造良好的合规经营氛围，通过组织专题培训、合规考试，发布合规资讯与风险提示等多种形式，持续宣导合规要求，强化员工职业操守和道德规范教育，提升全员合规意识，引导员工依法合规履职、勤勉尽责担当。

二是不断强化投资合规与风险管控。持续完善对投资研究、投资决策和交易执行全过程的合规管理和风险管控，加强对公平交易、关联交易、异常交易及内幕交易等监测管控，并通过制度规范、流程优化和系统建设持续提升控制效能，切实维护基金份额持有人利益。

三是持续健全合规管理体系。坚持制度先行、执行为本，结合法律法规、监管政策变化和业务发展需要，持续推进制度的修订与完善，认真履行合规审核和合规咨询职能，扎实做好日常合规管理、培训、考核等工作，全面提升合规管理的质效。

四是有序开展监察稽核工作。以风险为导向，对投资运作、基金销售、运营管理、信息技术、反洗钱等重点领域开展定期和专项检查，督促问题整改，持续提升内部控制和合规管理水平。

五是规范基金销售和投资者适当性管理。持续做好基金宣传推介材料的审核，坚持贯彻基金销售相关法规和监管要求，加强对自媒体账号、对外言论发布、网络直播等领域的合规管理，加大投资者教育和保护力度。

六是持续强化洗钱风险管控能力。严格贯彻落实国家反洗钱法律法规及相关监管要求，扎实开展客户尽职调查、客户资料保存、可疑交易监测与报告等各项工作，积极开展反洗钱宣传教育。持续加强洗钱风险识别、评估与应对机制建设，稳步推进反洗钱信息系统建设与数据治理，不断提升反洗钱工作的系统化、专业化水平，切实防范洗钱风险。

七是严格履行信息披露义务。持续完善信息披露工作流程和工作规范，加强信息披露文件审核，不断提升自动化、智能化系统建设水平，确保信息披露的真实性、准确性、完整性和及时性。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有

人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70009676_G29 号

广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不

确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
冯所腾 黄拥璇
北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
2026 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	51,277,165.31	3,401,488.88
结算备付金		3,329,492.16	4,506,257.86
存出保证金		658,227.41	171,507.10
交易性金融资产	7.4.7.2	3,649,467,994.34	1,237,884,695.77
其中：股票投资		196,050,721.29	21,916,624.00
基金投资		-	-
债券投资		3,453,417,273.05	1,215,968,071.77
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		35,421,032.12	-
应收股利		-	-
应收申购款		254,639.69	10,365,759.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,740,408,551.03	1,256,329,709.22
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		431,977,676.45	197,896,528.64
应付清算款		709,195.06	2,972,062.63
应付赎回款		30,919,360.35	6,258,845.65
应付管理人报酬		1,658,740.12	512,280.77
应付托管费		276,456.68	85,380.15
应付销售服务费		797,275.67	246,705.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		191,299.75	48,130.77
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	474,436.52	158,436.61
负债合计		467,004,440.60	208,178,370.47
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	2,278,000,303.80	756,365,844.45
未分配利润	7.4.7.9	995,403,806.63	291,785,494.30
净资产合计		3,273,404,110.43	1,048,151,338.75
负债和净资产总计		3,740,408,551.03	1,256,329,709.22

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，广发鑫和混合 A 基金份额净值人民币 1.4790 元，基金份额总额 593,783,109.05 份；广发鑫和混合 C 基金份额净值人民币 1.4221 元，基金份额总额 1,684,217,194.75 份；总份额总额 2,278,000,303.80 份。

7.2 利润表

会计主体：广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		80,232,898.68	60,583,216.89
1.利息收入		2,899,817.66	1,067,811.07
其中：存款利息收入	7.4.7.10	373,475.81	105,823.53
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		2,526,341.85	961,987.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		97,864,830.24	38,148,939.56
其中：股票投资收益	7.4.7.11	39,685,661.28	5,994,992.81
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	57,214,996.37	31,982,629.20

资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	964,172.59	171,317.55
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）	7.4.7.18	-23,345,282.53	19,483,174.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,813,533.31	1,883,292.16
减：二、营业总支出		25,871,071.39	10,033,924.11
1. 管理人报酬		12,587,629.96	4,295,947.46
2. 托管费		2,097,938.38	715,991.19
3. 销售服务费		6,387,299.37	2,327,904.85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,454,090.57	2,439,371.33
其中：卖出回购金融资产支出		4,454,090.57	2,439,371.33
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		130,613.11	43,439.28
8. 其他费用	7.4.7.21	213,500.00	211,270.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		54,361,827.29	50,549,292.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,361,827.29	50,549,292.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		54,361,827.29	50,549,292.78

7.3 净资产变动表

会计主体：广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	756,365,844.45	291,785,494.30	1,048,151,338.75
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	756,365,844.45	291,785,494.30	1,048,151,338.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,521,634,459.35	703,618,312.33	2,225,252,771.68
(一)、综合收益总额	-	54,361,827.29	54,361,827.29
(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)	1,521,634,459.35	649,256,485.04	2,170,890,944.39
其中：1.基金申购款	5,200,835,544.63	2,175,153,515.66	7,375,989,060.29
2.基金赎回款	-3,679,201,085.28	-1,525,897,030.62	-5,205,098,115.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	2,278,000,303.80	995,403,806.63	3,273,404,110.43
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	55,838,091.16	12,835,626.68	68,673,717.84
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	55,838,091.16	12,835,626.68	68,673,717.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	700,527,753.29	278,949,867.62	979,477,620.91
(一)、综合收益总额	-	50,549,292.78	50,549,292.78
(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)	700,527,753.29	228,400,574.84	928,928,328.13
其中：1.基金申购款	2,995,756,172.26	995,707,369.18	3,991,463,541.44
2.基金赎回款	-2,295,228,418.97	-767,306,794.34	-3,062,535,213.31
(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	756,365,844.45	291,785,494.30	1,048,151,338.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可〔2017〕608 号《关于准予广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2017 年 10 月 20 日向社会公开发行募集并于 2018 年 1 月 16 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2017 年 10 月 20 日至 2018 年 1 月 9 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 402,790,750.10 元，有效认购户数为 431 户。其中广发鑫和混合 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 401,987,382.40 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 8,344.36 元；广发鑫和混合 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 794,807.72 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 215.62 元，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

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

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

（2）金融负债分类

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

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

（3）衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持

有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人

可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

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

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）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。对在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，继续免征增值税直至债券到期。

根据国税发明电（2002）47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起全文废止），以及财政部、税务总局公告 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），基金通过上海黄金交易所交易标准黄金，未发生实物交割出库的，免征增值税。

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

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	51,277,165.31	3,401,488.88
等于：本金	51,267,250.89	3,399,610.10
加：应计利息	9,914.42	1,878.78
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	51,277,165.31	3,401,488.88

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	194,109,631.56	-	196,050,721.29	1,941,089.73	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	595,371,754.24	6,376,502.96	595,803,443.87	-5,944,813.33
	银行间市场	2,823,082,036.35	34,692,901.18	2,857,613,829.18	-161,108.35

	合计	3,418,453,790.59	41,069,404.14	3,453,417,273.05	-6,105,921.68
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,612,563,422.15	41,069,404.14	3,649,467,994.34	-4,164,831.95
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		20,960,037.45	-	21,916,624.00	956,586.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	431,788,551.31	5,253,501.37	440,229,455.07	3,187,402.39
	银行间市场	755,331,538.36	5,370,616.70	775,738,616.70	15,036,461.64
	合计	1,187,120,089.67	10,624,118.07	1,215,968,071.77	18,223,864.03
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,208,080,127.12	10,624,118.07	1,237,884,695.77	19,180,450.58

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	23,766.96	1,984.24
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	385,369.56	96,452.37
其中：交易所市场	335,308.49	65,410.09
银行间市场	50,061.07	31,042.28
应付利息	-	-
预提费用	65,300.00	60,000.00
合计	474,436.52	158,436.61

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发鑫和混合 A		
项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,156,746.57	199,156,746.57
本期申购	792,394,610.59	792,394,610.59
本期赎回（以“-”号填列）	-397,768,248.11	-397,768,248.11
本期末	593,783,109.05	593,783,109.05

金额单位：人民币元

广发鑫和混合C		
项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	557,209,097.88	557,209,097.88
本期申购	4,408,440,934.04	4,408,440,934.04

本期赎回（以“-”号填列）	-3,281,432,837.17	-3,281,432,837.17
本期末	1,684,217,194.75	1,684,217,194.75

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。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发鑫和混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	72,000,645.19	12,055,438.78	84,056,083.97
本期期初	72,000,645.19	12,055,438.78	84,056,083.97
本期利润	19,512,118.85	-5,991,871.27	13,520,247.58
本期基金份额交易产生的变动数	173,966,558.46	12,887,792.20	186,854,350.66
其中：基金申购款	340,243,251.06	27,668,381.18	367,911,632.24
基金赎回款	-166,276,692.60	-14,780,588.98	-181,057,281.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	265,479,322.50	18,951,359.71	284,430,682.21

单位：人民币元

广发鑫和混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	174,896,746.72	32,832,663.61	207,729,410.33
本期期初	174,896,746.72	32,832,663.61	207,729,410.33
本期利润	58,194,990.97	-17,353,411.26	40,841,579.71
本期基金份额交易产生的变动数	425,117,734.94	37,284,399.44	462,402,134.38
其中：基金申购款	1,658,793,825.15	148,448,058.27	1,807,241,883.42
基金赎回款	-1,233,676,090.21	-111,163,658.83	-1,344,839,749.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	658,209,472.63	52,763,651.79	710,973,124.42

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	344,201.37	79,387.25
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	25,706.05	24,893.59
其他	3,568.39	1,542.69
合计	373,475.81	105,823.53

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	39,685,661.28	5,994,992.81
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	39,685,661.28	5,994,992.81

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,861,614,987.02	107,598,051.95
减：卖出股票成本总额	1,819,526,237.76	101,433,076.20
减：交易费用	2,403,087.98	169,982.94
买卖股票差价收入	39,685,661.28	5,994,992.81

7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	45,166,037.02	18,619,070.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,048,959.35	13,363,558.73
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	57,214,996.37	31,982,629.20

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,048,526,675.70	6,414,004,673.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,981,781,116.29	6,342,235,742.03
减：应计利息总额	54,499,992.72	58,304,855.87
减：交易费用	196,607.34	100,516.59
买卖债券差价收入	12,048,959.35	13,363,558.73

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	964,172.59	171,317.55
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	964,172.59	171,317.55

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-23,345,282.53	19,483,174.10
——股票投资	984,503.18	1,792,772.51
——债券投资	-24,329,785.71	17,690,401.59
——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	-23,345,282.53	19,483,174.10

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	2,723,585.82	1,832,466.40
基金转换费收入	89,667.49	50,825.76

其他	280.00	-
合计	2,813,533.31	1,883,292.16

7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	56,000.00	51,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	-	3,070.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,500.00	1,200.00
合计	213,500.00	211,270.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
华夏银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
广发国际资产管理有限公司	基金管理人子公司

瑞元资本管理有限公司	基金管理人子公司
瑞晨股权投资基金管理（广东）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	3,853,737,636.77	100.00%	197,333,448.68	88.92%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	2,937,239,134.82	100.00%	904,200,273.49	99.87%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	4,077,210,000.00	100.00%	3,468,710,000.00	99.43%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	1,225,176.00	100.00%	335,308.49	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	86,035.58	84.39%	65,410.09	100.00%

注：1、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、2024年7月1日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务；

4、自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,587,629.96	4,295,947.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,782,539.38	1,623,958.39
应支付基金管理人的净管理费	7,805,090.58	2,671,989.07

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 0.60%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,097,938.38	715,991.19

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 0.10%。

7.4.10.2.3 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		
	2025年1月1日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发鑫和混合 A	广发鑫和混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	139,338.61	139,338.61
华夏银行股份有限公司	-	5,354,468.96	5,354,468.96

广发证券股份有限公司	-	1,739.08	1,739.08
合计	-	5,495,546.65	5,495,546.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发鑫和混合A	广发鑫和混合C	合计
广发基金管理有限公司	-	113,508.96	113,508.96
华夏银行股份有限公司	-	2,079,442.11	2,079,442.11
广发证券股份有限公司	-	119.49	119.49
合计	-	2,193,070.56	2,193,070.56

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

C类基金份额的约定年费率为0.40%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

7.4.10.3 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 2025年1月1日至2025年12月31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
华夏银行股份有限公司	36,969,013.85	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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
华夏银行股	197,190,348.22	123,248.32	-	-	-	-

份有限公司		8.38			
-------	--	------	--	--	--

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

广发鑫和混合 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。

广发鑫和混合 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	51,277,165.31	344,201.37	3,401,488.88	79,387.25

注：本基金的上述银行存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001280	中国铝业	2025-1-25	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	2,277.00	40,735.53	103,284.72	-
001386	马可波罗	2025-1-0-15	6 个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,626.00	22,357.50	30,129.78	-
001233	海安集团	2025-1-1-18	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	370.00	17,760.00	19,195.60	-
001369	双欣环保	2025-1-2-23	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	897.00	6,144.45	11,562.33	-
603418	友升股份	2025-0-9-16	6 个月	新股流通受限	46.36	59.06	139.00	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-1-0-17	6 个月	新股流通受限	17.08	48.56	169.00	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-1-0-30	6 个月	新股流通受限	46.68	55.66	146.00	6,815.28	8,126.36	-
603248	锡华科技	2025-1-2-16	6 个月	新股流通受限	10.10	16.30	260.00	2,626.00	4,238.00	-
60337	大明	2025-1	6 个月	新股	12.55	26.21	111.00	1,393.	2,909.	-

6	电子	0-28		流通受限				05	31	
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	88.00	2,155.12	2,888.16	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118063	金 05 转债	2025-12-26	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.00	10.00	1,000.00	1,000.02	-

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

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

7.4.12.2 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	5,900.00	457,764.32	464,979.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项停牌	283.75	2026-01-05	278.00	675.00	186,024.84	191,531.25	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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 349,972,720.51 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	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	------	-------	--------

			单价		
102280306	22 渝高速 MTN001	2026-01-07	104.93	500,000.00	52,462,501.37
102280745	22 闽高速 MTN002	2026-01-07	104.46	200,000.00	20,892,311.23
102400585	24 兴创投资 MTN001	2026-01-07	103.90	300,000.00	31,170,838.36
102401017	24 平湖国资 MTN001	2026-01-07	101.57	100,000.00	10,157,210.96
102480932	24 物产中大 MTN001	2026-01-07	102.95	505,000.00	51,988,186.58
102481490	24 肇庆国联 MTN001	2026-01-07	102.75	200,000.00	20,549,189.04
102584311	25 鄂交通 MTN003	2026-01-07	100.51	200,000.00	20,101,680.00
132480071	24 成都公交 GN002	2026-01-07	101.08	100,000.00	10,107,739.73
210408	21 农发 08	2026-01-08	102.05	28,000.00	2,857,439.89
250411	25 农发 11	2026-01-08	101.32	89,000.00	9,017,899.39
250421	25 农发 21	2026-01-08	100.81	780,000.00	78,629,492.06
102280067	22 陕煤化 MTN001	2026-01-09	105.69	736,000.00	77,791,211.49
合计				3,738,000.00	385,725,700.10

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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 82,004,955.94 元，于 2026 年 1 月 5 日、2026 年 1 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,244,068.49	90,774,530.41
合计	20,244,068.49	90,774,530.41

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。

7.4.13.2.2 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	49,171,029.04	-

A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	49,171,029.04	-

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。

7.4.13.2.3 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	1,176,819,594.76	703,102,315.50
AAA 以下	16,987,978.44	3,716,853.29
未评级	2,190,194,602.32	418,374,372.57
合计	3,384,002,175.52	1,125,193,541.36

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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	51,277,165.31	-	-	-	51,277,165.31
结算备付金	3,329,492.16	-	-	-	3,329,492.16
存出保证金	658,227.41	-	-	-	658,227.41
交易性金融资产	406,666,761.56	2,970,057,676.42	76,692,835.07	196,050,721.29	3,649,467,994.34
应收清算款	-	-	-	35,421,032.12	35,421,032.12

应收申购款	-	-	-	254,639.69	254,639.69
资产总计	461,931,646.44	2,970,057,676.42	76,692,835.07	231,726,393.10	3,740,408,551.03
负债					
卖出回购金融资产款	431,977,676.45	-	-	-	431,977,676.45
应付清算款	-	-	-	709,195.06	709,195.06
应付赎回款	-	-	-	30,919,360.35	30,919,360.35
应付管理人报酬	-	-	-	1,658,740.12	1,658,740.12
应付托管费	-	-	-	276,456.68	276,456.68
应付销售服务费	-	-	-	797,275.67	797,275.67
应交税费	-	-	-	191,299.75	191,299.75
其他负债	-	-	-	474,436.52	474,436.52
负债总计	431,977,676.45	-	-	35,026,764.15	467,004,440.60
利率敏感度缺口	29,953,969.99	2,970,057,676.42	76,692,835.07	196,699,628.95	3,273,404,110.43
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,401,488.88	-	-	-	3,401,488.88
结算备付金	4,506,257.86	-	-	-	4,506,257.86
存出保证金	171,507.10	-	-	-	171,507.10
交易性金融资产	166,517,000.47	622,296,328.24	427,154,743.06	21,916,624.00	1,237,884,695.77
应收申购款	-	-	-	10,365,759.61	10,365,759.61
资产总计	174,596,254.31	622,296,328.24	427,154,743.06	32,282,383.61	1,256,329,709.22
负债					
卖出回购金融资产款	197,896,528.64	-	-	-	197,896,528.64
应付清算款	-	-	-	2,972,062.63	2,972,062.63
应付赎回款	-	-	-	6,258,845.65	6,258,845.65
应付管理人报酬	-	-	-	512,280.77	512,280.77
应付托管费	-	-	-	85,380.15	85,380.15
应付销售服务费	-	-	-	246,705.25	246,705.25
应交税费	-	-	-	48,130.77	48,130.77
其他负债	-	-	-	158,436.61	158,436.61
负债总计	197,896,528.64	-	-	10,281,841.83	208,178,370.47
利率敏感度缺口	-23,300,274.33	622,296,328.24	427,154,743.06	22,000,541.78	1,048,151,338.75

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-16,213,428.62	-18,218,449.71
市场利率下降 25 个基点	16,349,744.74	18,843,890.41	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	196,050,721.29	5.99	21,916,624.00	2.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	17,791,356.21	0.54	25,730,017.80	2.45
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	213,842,077.50	6.53	47,646,641.80	4.55

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	上升 5%	4,074,520.67	1,678,949.20
	下降 5%	-4,074,520.67	-1,678,949.20

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	212,182,439.22	46,852,805.83
第二层次	3,437,086,804.88	1,191,031,889.94
第三层次	198,750.24	-
合计	3,649,467,994.34	1,237,884,695.77

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	109,317.49	109,317.49
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-

当期利得或损失总额	-	89,432.75	89,432.75
其中：计入损益的利得或损失	-	89,432.75	89,432.75
期末余额	-	198,750.24	198,750.24
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	89,432.75	89,432.75
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	198,750.24	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	22.08%-295.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	196,050,721.29	5.24
	其中：股票	196,050,721.29	5.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,453,417,273.05	92.33
	其中：债券	3,453,417,273.05	92.33
	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	54,606,657.47	1.46
8	其他各项资产	36,333,899.22	0.97
9	合计	3,740,408,551.03	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	906,886.00	0.03

B	采矿业	7,854,013.72	0.24
C	制造业	121,899,674.42	3.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,888,244.00	0.18
E	建筑业	1,760,434.00	0.05
F	批发和零售业	3,667,264.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	5,175,164.00	0.16
H	住宿和餐饮业	334,680.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,467,352.16	0.44
J	金融业	22,949,129.16	0.70
K	房地产业	1,876,585.00	0.06
L	租赁和商务服务业	2,948,295.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	3,396,597.83	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	1,020,770.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	231,159.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,424,884.00	0.04
S	综合	249,589.00	0.01
	合计	196,050,721.29	5.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	7,860	2,886,663.60	0.09
2	600519	贵州茅台	1,800	2,478,924.00	0.08
3	601318	中国平安	31,800	2,175,120.00	0.07
4	300308	中际旭创	3,400	2,074,000.00	0.06

5	601899	紫金矿业	46,700	1,609,749.00	0.05
6	600036	招商银行	34,900	1,469,290.00	0.04
7	300476	胜宏科技	4,700	1,351,626.00	0.04
8	300502	新易盛	2,900	1,249,552.00	0.04
9	000333	美的集团	15,400	1,203,510.00	0.04
10	601166	兴业银行	55,400	1,166,724.00	0.04
11	600030	中信证券	37,400	1,073,754.00	0.03
12	002475	立讯精密	17,000	964,070.00	0.03
13	601398	工商银行	121,300	961,909.00	0.03
14	688256	寒武纪-U	691	936,685.05	0.03
15	300059	东方财富	39,400	913,292.00	0.03
16	603259	药明康德	10,000	906,400.00	0.03
17	600900	长江电力	32,400	880,956.00	0.03
18	601328	交通银行	105,200	762,700.00	0.02
19	688981	中芯国际	5,936	729,118.88	0.02
20	002594	比亚迪	6,900	674,268.00	0.02
21	600276	恒瑞医药	11,300	673,141.00	0.02
22	688041	海光信息	2,936	658,867.76	0.02
23	601211	国泰海通	31,800	653,490.00	0.02
24	600150	中国船舶	18,900	628,614.00	0.02
25	600919	江苏银行	60,200	626,080.00	0.02
26	600988	赤峰黄金	19,800	618,552.00	0.02
27	300274	阳光电源	3,600	615,744.00	0.02
28	601138	工业富联	9,900	614,295.00	0.02
29	600000	浦发银行	47,900	595,876.00	0.02
30	600887	伊利股份	20,200	577,720.00	0.02
31	300058	蓝色光标	49,000	564,480.00	0.02
32	600111	北方稀土	12,200	562,664.00	0.02
33	601288	农业银行	68,900	529,152.00	0.02
34	000001	平安银行	43,300	494,053.00	0.02
35	000100	TCL 科技	108,600	493,044.00	0.02
36	000858	五粮液	4,600	487,324.00	0.01
37	000725	京东方 A	114,700	482,887.00	0.01
38	000792	盐湖股份	16,900	475,904.00	0.01
39	601816	京沪高铁	91,700	472,255.00	0.01
40	002049	紫光国微	5,900	464,979.00	0.01
41	002195	岩山科技	65,500	464,395.00	0.01
42	600157	永泰能源	292,500	459,225.00	0.01
43	301358	湖南裕能	7,100	459,086.00	0.01
44	002371	北方华创	1,000	459,080.00	0.01
45	600309	万华化学	5,900	452,412.00	0.01
46	300008	天海防务	55,900	441,051.00	0.01
47	300438	鹏辉能源	8,200	436,404.00	0.01
48	002340	格林美	51,600	431,376.00	0.01

49	688062	迈威生物-U	11,132	428,248.04	0.01
50	688008	澜起科技	3,596	423,608.80	0.01
51	600549	厦门钨业	10,300	422,918.00	0.01
52	300775	三角防务	13,900	422,560.00	0.01
53	600104	上汽集团	27,700	421,594.00	0.01
54	000933	神火股份	15,300	420,291.00	0.01
55	688111	金山办公	1,364	418,843.48	0.01
56	300033	同花顺	1,300	418,834.00	0.01
57	300604	长川科技	4,100	415,371.00	0.01
58	002156	通富微电	11,000	414,700.00	0.01
59	002222	福晶科技	7,300	411,282.00	0.01
60	000651	格力电器	10,200	410,244.00	0.01
61	002558	巨人网络	9,300	402,597.00	0.01
62	600019	宝钢股份	53,600	399,320.00	0.01
63	002436	兴森科技	18,700	395,879.00	0.01
64	601326	秦港股份	113,300	395,417.00	0.01
65	002916	深南电路	1,700	394,893.00	0.01
66	600999	招商证券	23,500	391,040.00	0.01
67	603659	璞泰来	14,300	390,962.00	0.01
68	600031	三一重工	18,500	390,905.00	0.01
69	600487	亨通光电	15,700	388,261.00	0.01
70	601628	中国人寿	8,500	386,750.00	0.01
71	002625	光启技术	7,900	385,204.00	0.01
72	002142	宁波银行	13,700	384,833.00	0.01
73	603993	洛阳钼业	19,200	384,000.00	0.01
74	601601	中国太保	9,100	381,381.00	0.01
75	601939	建设银行	40,900	379,552.00	0.01
76	300418	昆仑万维	9,100	379,470.00	0.01
77	300765	新诺威	10,493	378,482.51	0.01
78	601009	南京银行	33,100	378,333.00	0.01
79	688271	联影医疗	3,010	377,755.00	0.01
80	002460	赣锋锂业	6,000	377,340.00	0.01
81	300140	节能环境	55,500	375,735.00	0.01
82	000988	华工科技	4,700	372,851.00	0.01
83	601088	中国神华	9,200	372,600.00	0.01
84	000733	振华科技	7,000	366,870.00	0.01
85	300124	汇川技术	4,800	361,584.00	0.01
86	300748	金力永磁	10,600	361,566.00	0.01
87	002415	海康威视	12,100	361,064.00	0.01
88	600392	盛和资源	16,500	355,245.00	0.01
89	301316	慧博云通	7,900	352,972.00	0.01
90	300433	蓝思科技	11,600	351,132.00	0.01
91	002414	高德红外	23,900	350,613.00	0.01
92	600522	中天科技	19,300	349,716.00	0.01

93	601012	隆基绿能	19,200	349,440.00	0.01
94	601336	新华保险	5,000	348,500.00	0.01
95	002402	和而泰	8,900	348,168.00	0.01
96	002185	华天科技	31,600	346,652.00	0.01
97	301606	绿联科技	5,900	346,566.00	0.01
98	600372	中航机载	25,800	346,236.00	0.01
99	688235	百济神州-U	1,279	343,539.40	0.01
100	600660	福耀玻璃	5,300	343,281.00	0.01
101	300760	迈瑞医疗	1,800	342,810.00	0.01
102	300347	泰格医药	5,900	334,530.00	0.01
103	600690	海尔智家	12,800	333,952.00	0.01
104	002600	领益智造	21,400	332,556.00	0.01
105	600989	宝丰能源	16,900	331,747.00	0.01
106	601668	中国建筑	64,500	330,885.00	0.01
107	601658	邮储银行	60,700	330,815.00	0.01
108	002008	大族激光	8,000	329,520.00	0.01
109	601019	山东出版	38,100	329,184.00	0.01
110	600115	中国东航	54,200	325,200.00	0.01
111	300073	当升科技	5,600	323,680.00	0.01
112	688385	复旦微电	4,389	323,469.30	0.01
113	002085	万丰奥威	20,200	323,402.00	0.01
114	002027	分众传媒	43,600	321,332.00	0.01
115	605499	东鹏饮料	1,200	320,868.00	0.01
116	002155	湖南黄金	15,200	320,568.00	0.01
117	600438	通威股份	15,600	320,112.00	0.01
118	600885	宏发股份	10,500	319,200.00	0.01
119	688333	铂力特	2,830	315,573.30	0.01
120	600584	长电科技	8,500	312,630.00	0.01
121	002736	国信证券	23,700	310,944.00	0.01
122	600057	厦门象屿	36,300	309,276.00	0.01
123	002074	国轩高科	7,900	308,969.00	0.01
124	300394	天孚通信	1,500	304,545.00	0.01
125	000338	潍柴动力	17,700	304,440.00	0.01
126	300037	新宙邦	5,800	303,920.00	0.01
127	601020	华钰矿业	11,300	303,518.00	0.01
127	600160	巨化股份	7,900	303,518.00	0.01
128	601881	中国银河	19,300	303,396.00	0.01
129	601127	赛力斯	2,500	302,400.00	0.01
130	002624	完美世界	18,400	301,576.00	0.01
131	603986	兆易创新	1,400	299,950.00	0.01
132	300373	扬杰科技	4,400	299,200.00	0.01
133	600100	同方股份	33,500	298,820.00	0.01
134	688525	佰维存储	2,603	298,798.37	0.01
135	600016	民生银行	77,600	297,208.00	0.01

136	600029	南方航空	37,100	297,171.00	0.01
137	601108	财通证券	34,000	296,480.00	0.01
138	002487	大金重工	5,700	296,001.00	0.01
139	600406	国电南瑞	13,100	294,488.00	0.01
140	000783	长江证券	36,000	293,400.00	0.01
141	300003	乐普医疗	18,400	290,904.00	0.01
142	600096	云天化	8,700	290,667.00	0.01
143	300442	润泽科技	5,500	290,400.00	0.01
144	600795	国电电力	57,400	289,296.00	0.01
145	300049	福瑞医科	4,100	288,681.00	0.01
146	300474	景嘉微	4,000	287,480.00	0.01
147	601100	恒立液压	2,600	285,766.00	0.01
148	688343	云天励飞-U	3,753	285,528.24	0.01
149	688182	灿勤科技	9,576	282,683.52	0.01
150	603019	中科曙光	3,300	282,612.00	0.01
151	000997	新大陆	9,900	280,368.00	0.01
152	002966	苏州银行	33,600	278,544.00	0.01
153	300224	正海磁材	18,000	278,280.00	0.01
154	000893	亚钾国际	5,800	278,226.00	0.01
155	002517	恺英网络	12,700	277,749.00	0.01
156	300458	全志科技	6,600	277,398.00	0.01
157	002317	众生药业	14,600	277,108.00	0.01
158	600141	兴发集团	8,000	276,640.00	0.01
159	002389	航天彩虹	11,500	275,770.00	0.01
160	603606	东方电缆	4,600	274,850.00	0.01
161	600039	四川路桥	27,600	274,620.00	0.01
162	688506	百利天恒	849	274,311.90	0.01
163	000932	华菱钢铁	48,700	273,694.00	0.01
164	601688	华泰证券	11,600	273,644.00	0.01
165	002714	牧原股份	5,400	273,132.00	0.01
166	688220	翱捷科技-U	3,265	269,721.65	0.01
167	600415	小商品城	16,900	269,555.00	0.01
168	601198	东兴证券	19,400	269,272.00	0.01
169	300953	震裕科技	1,600	268,832.00	0.01
170	300142	沃森生物	24,600	268,386.00	0.01
171	002636	金安国纪	16,000	267,360.00	0.01
172	600909	华安证券	39,200	265,776.00	0.01
173	002544	普天科技	7,700	265,573.00	0.01
174	603005	晶方科技	9,600	265,536.00	0.01
175	605358	立昂微	7,600	264,632.00	0.01
176	603296	华勤技术	2,900	263,146.00	0.01
177	002294	信立泰	5,300	262,615.00	0.01
178	001696	宗申动力	12,100	262,449.00	0.01
179	300339	润和软件	5,300	262,350.00	0.01

180	688536	思瑞浦	1,638	261,883.44	0.01
181	002400	省广集团	29,200	259,004.00	0.01
182	601126	四方股份	8,600	258,688.00	0.01
183	601162	天风证券	61,700	256,672.00	0.01
184	601901	方正证券	32,900	256,620.00	0.01
185	300496	中科创达	3,800	256,500.00	0.01
186	600704	物产中大	46,000	256,220.00	0.01
187	002603	以岭药业	15,000	256,050.00	0.01
188	000831	中国稀土	5,500	255,420.00	0.01
189	600170	上海建工	96,200	254,930.00	0.01
190	688521	芯原股份	1,860	254,764.20	0.01
191	600848	上海临港	21,700	253,890.00	0.01
192	002895	川恒股份	6,900	252,954.00	0.01
193	688347	华虹公司	2,329	251,229.23	0.01
194	002593	日上集团	42,500	251,175.00	0.01
195	600166	福田汽车	85,600	249,952.00	0.01
196	688200	华峰测控	1,299	247,069.80	0.01
197	600977	中国电影	15,700	246,804.00	0.01
198	600120	浙江东方	40,000	246,800.00	0.01
199	300567	精测电子	2,700	246,240.00	0.01
200	300127	银河磁体	8,100	245,673.00	0.01
201	688301	奕瑞科技	2,425	245,191.75	0.01
202	001337	四川黄金	8,800	245,168.00	0.01
203	301308	江波龙	1,000	244,840.00	0.01
204	688052	纳芯微	1,544	244,229.92	0.01
205	002246	北化股份	13,500	243,270.00	0.01
206	601225	陕西煤业	11,400	243,048.00	0.01
207	000166	申万宏源	45,900	241,893.00	0.01
208	300146	汤臣倍健	20,100	241,401.00	0.01
209	600933	爱柯迪	12,000	241,200.00	0.01
210	300072	海新能科	52,400	241,040.00	0.01
211	300850	新强联	5,800	239,946.00	0.01
212	601377	兴业证券	32,300	239,666.00	0.01
213	300034	钢研高纳	12,200	238,876.00	0.01
214	601898	中煤能源	19,200	238,848.00	0.01
215	000519	中兵红箭	13,100	238,551.00	0.01
216	000603	盛达资源	7,700	238,392.00	0.01
217	601717	中创智领	9,700	238,135.00	0.01
218	002281	光迅科技	3,400	237,830.00	0.01
219	600050	中国联通	46,500	237,615.00	0.01
220	601808	中海油服	16,900	237,276.00	0.01
221	688548	广钢气体	16,280	236,711.20	0.01
222	300777	中简科技	5,800	236,640.00	0.01
223	002312	川发龙蟒	21,600	236,088.00	0.01

224	600998	九州通	46,000	235,520.00	0.01
225	000555	神州信息	14,200	235,010.00	0.01
226	601061	中信金属	16,300	234,720.00	0.01
227	300129	泰胜风能	22,400	234,304.00	0.01
228	002841	视源股份	5,900	233,817.00	0.01
229	000598	兴蓉环境	32,500	233,025.00	0.01
230	688303	大全能源	8,685	232,931.70	0.01
231	603185	弘元绿能	7,600	231,800.00	0.01
232	600236	桂冠电力	29,600	231,768.00	0.01
233	600320	振华重工	45,000	231,750.00	0.01
234	000063	中兴通讯	6,100	230,824.00	0.01
235	603379	三美股份	3,800	230,736.00	0.01
236	600654	中安科	61,200	230,724.00	0.01
237	300454	深信服	2,000	230,320.00	0.01
238	300068	南都电源	14,800	229,992.00	0.01
239	300450	先导智能	4,600	229,908.00	0.01
240	600206	有研新材	11,300	229,729.00	0.01
241	601069	西部黄金	8,600	229,448.00	0.01
242	300136	信维通信	3,700	229,400.00	0.01
243	603799	华友钴业	3,360	229,353.60	0.01
244	688778	厦钨新能	2,950	228,241.50	0.01
245	688772	珠海冠宇	10,591	228,024.23	0.01
246	600126	杭钢股份	27,900	227,664.00	0.01
247	600511	国药股份	7,900	227,125.00	0.01
248	601187	厦门银行	30,900	226,806.00	0.01
249	002815	崇达技术	16,600	226,756.00	0.01
250	603077	和邦生物	100,300	226,678.00	0.01
251	600517	国网英大	37,700	226,577.00	0.01
252	000977	浪潮信息	3,400	226,440.00	0.01
253	301511	德福科技	6,300	225,477.00	0.01
254	002276	万马股份	13,300	224,903.00	0.01
255	605099	共创草坪	6,300	224,847.00	0.01
256	301215	中汽股份	32,700	223,995.00	0.01
257	300735	光弘科技	9,000	223,740.00	0.01
258	600809	山西汾酒	1,300	223,210.00	0.01
259	600201	生物股份	14,800	223,036.00	0.01
260	600728	佳都科技	33,200	221,776.00	0.01
261	002410	广联达	17,600	221,408.00	0.01
262	603816	顾家家居	7,200	221,328.00	0.01
263	002050	三花智控	4,000	221,240.00	0.01
264	601865	福莱特	14,100	220,947.00	0.01
265	600578	京能电力	43,300	220,830.00	0.01
266	600765	中航重机	11,500	220,340.00	0.01
267	600600	青岛啤酒	3,600	220,320.00	0.01

268	600754	锦江酒店	8,700	219,849.00	0.01
269	688123	聚辰股份	1,750	219,765.00	0.01
270	688561	奇安信-U	6,168	219,457.44	0.01
271	601991	大唐发电	62,800	219,172.00	0.01
272	002299	圣农发展	13,200	218,328.00	0.01
273	603728	鸣志电器	3,000	217,050.00	0.01
274	000729	燕京啤酒	19,300	216,739.00	0.01
275	000062	深圳华强	8,800	216,656.00	0.01
276	000582	北部湾港	23,000	215,740.00	0.01
277	002153	石基信息	19,900	215,517.00	0.01
278	300357	我武生物	7,600	215,460.00	0.01
279	688700	东威科技	6,094	214,996.32	0.01
280	002244	滨江集团	21,300	214,065.00	0.01
281	600801	华新建材	8,700	213,498.00	0.01
282	300602	飞荣达	6,400	212,224.00	0.01
283	603444	吉比特	500	211,925.00	0.01
284	002038	双鹭药业	28,700	211,519.00	0.01
285	002230	科大讯飞	4,200	211,218.00	0.01
286	601216	君正集团	43,700	210,634.00	0.01
287	600095	湘财股份	19,000	210,140.00	0.01
288	600875	东方电气	8,600	208,808.00	0.01
289	003022	联泓新科	10,500	208,005.00	0.01
290	002484	江海股份	7,000	207,900.00	0.01
290	301526	国际复材	29,700	207,900.00	0.01
291	600685	中船防务	7,300	207,685.00	0.01
292	300390	天华新能	3,800	207,518.00	0.01
293	002396	星网锐捷	6,800	206,040.00	0.01
294	301217	铜冠铜箔	6,000	205,680.00	0.01
295	002738	中矿资源	2,600	204,230.00	0.01
296	601555	东吴证券	22,500	203,850.00	0.01
297	600089	特变电工	9,100	202,202.00	0.01
298	300475	香农芯创	1,400	202,076.00	0.01
299	000887	中鼎股份	8,700	201,927.00	0.01
300	300101	振芯科技	7,100	201,853.00	0.01
300	300759	康龙化成	7,100	201,853.00	0.01
301	000422	湖北宜化	14,200	201,782.00	0.01
302	603486	科沃斯	2,500	201,700.00	0.01
303	300083	创世纪	21,900	201,699.00	0.01
304	688365	光云科技	11,946	201,529.02	0.01
305	688027	国盾量子	400	201,516.00	0.01
306	600901	江苏金租	32,900	201,348.00	0.01
307	688072	拓荆科技	610	201,300.00	0.01
308	300348	长亮科技	13,000	201,240.00	0.01
309	601818	光大银行	57,600	201,024.00	0.01

310	600808	马钢股份	47,600	200,872.00	0.01
311	300184	力源信息	20,100	200,799.00	0.01
312	688146	中船特气	4,952	200,060.80	0.01
313	300435	中泰股份	9,000	199,980.00	0.01
314	600012	皖通高速	13,400	198,588.00	0.01
315	603171	税友股份	3,600	198,468.00	0.01
316	601229	上海银行	19,600	197,960.00	0.01
317	601857	中国石油	19,000	197,790.00	0.01
318	300358	楚天科技	20,200	197,758.00	0.01
319	600478	科力远	28,700	197,743.00	0.01
320	688578	艾力斯	1,897	197,572.55	0.01
321	002020	京新药业	10,400	197,392.00	0.01
322	300573	兴齐眼药	2,800	196,812.00	0.01
323	600737	中粮糖业	11,400	196,194.00	0.01
324	002237	恒邦股份	14,600	195,932.00	0.01
325	002987	京北方	9,100	195,923.00	0.01
326	300432	富临精工	11,700	195,390.00	0.01
327	601975	招商南油	64,600	195,092.00	0.01
328	600378	昊华科技	6,100	194,956.00	0.01
329	001287	中电港	8,600	194,876.00	0.01
330	002940	昂利康	5,800	194,416.00	0.01
331	600598	北大荒	13,000	194,350.00	0.01
332	601319	中国人保	21,700	194,215.00	0.01
333	300012	华测检测	14,300	193,765.00	0.01
334	300619	金银河	4,400	193,160.00	0.01
335	601778	晶科科技	51,900	193,068.00	0.01
336	300999	金龙鱼	6,700	192,558.00	0.01
337	000970	中科三环	14,200	192,552.00	0.01
338	300036	超图软件	10,600	192,496.00	0.01
339	688091	上海谊众	4,095	192,465.00	0.01
340	600516	方大炭素	33,800	192,322.00	0.01
341	601696	中银证券	12,800	191,872.00	0.01
342	688012	中微公司	675	191,531.25	0.01
343	688636	智明达	4,470	191,494.80	0.01
344	600580	卧龙电驱	3,900	191,490.00	0.01
345	300130	新国都	6,900	191,337.00	0.01
346	002353	杰瑞股份	2,700	191,241.00	0.01
347	000785	居然智家	65,200	190,384.00	0.01
348	688390	固德威	3,062	190,242.06	0.01
349	600995	南网储能	15,100	189,807.00	0.01
350	605228	神通科技	12,700	189,611.00	0.01
351	002906	华阳集团	6,200	189,596.00	0.01
352	000938	紫光股份	7,700	189,420.00	0.01
353	600596	新安股份	16,500	189,255.00	0.01

354	300747	锐科激光	7,000	189,210.00	0.01
355	603288	海天味业	5,100	188,802.00	0.01
356	000829	天音控股	17,300	188,743.00	0.01
357	002075	沙钢股份	32,800	188,600.00	0.01
358	000600	建投能源	22,100	188,513.00	0.01
359	603456	九洲药业	10,500	187,950.00	0.01
360	601000	唐山港	48,900	187,776.00	0.01
361	000612	焦作万方	17,000	187,340.00	0.01
362	688183	生益电子	1,956	187,169.64	0.01
363	605589	圣泉集团	6,600	186,780.00	0.01
364	600338	西藏珠峰	12,400	186,496.00	0.01
365	002716	湖南白银	26,900	186,148.00	0.01
366	600078	澄星股份	19,400	186,046.00	0.01
367	601728	中国电信	29,500	185,850.00	0.01
368	601388	怡球资源	61,660	185,596.60	0.01
369	301326	捷邦科技	1,700	185,572.00	0.01
370	600332	白云山	7,200	185,328.00	0.01
371	603267	鸿远电子	3,400	185,062.00	0.01
372	002664	信质集团	7,700	184,492.00	0.01
373	600459	贵研铂业	9,900	184,239.00	0.01
374	300693	盛弘股份	4,800	183,744.00	0.01
375	300803	指南针	1,400	183,218.00	0.01
376	688331	荣昌生物	2,354	183,117.66	0.01
377	300772	运达股份	9,600	182,976.00	0.01
378	688779	五矿新能	24,422	182,920.78	0.01
379	300409	道氏技术	8,100	182,169.00	0.01
380	300779	惠城环保	1,400	182,154.00	0.01
381	300080	易成新能	37,400	181,764.00	0.01
382	000811	冰轮环境	9,800	181,496.00	0.01
383	300115	长盈精密	3,900	181,350.00	0.01
384	603730	岱美股份	20,700	181,332.00	0.01
385	600867	通化东宝	22,125	180,761.25	0.01
386	603489	八方股份	5,900	180,422.00	0.01
387	300346	南大光电	4,200	180,180.00	0.01
388	002928	华夏航空	16,300	180,115.00	0.01
389	300428	立中集团	7,700	179,795.00	0.01
390	300852	四会富仕	4,700	179,446.00	0.01
391	603596	伯特利	3,500	179,445.00	0.01
392	601995	中金公司	5,100	178,500.00	0.01
393	601006	大秦铁路	34,500	178,020.00	0.01
394	603025	大豪科技	9,900	177,804.00	0.01
395	688110	东芯股份	1,353	177,716.55	0.01
396	688297	中无人机	3,686	177,001.72	0.01
397	600366	宁波韵升	12,800	176,512.00	0.01

398	600871	石化油服	81,700	176,472.00	0.01
399	603501	豪威集团	1,400	176,260.00	0.01
400	002541	鸿路钢构	10,700	175,908.00	0.01
401	600315	上海家化	7,800	175,656.00	0.01
402	301236	软通动力	3,700	175,491.00	0.01
403	301297	富乐德	4,900	175,420.00	0.01
404	002292	奥飞娱乐	19,800	175,230.00	0.01
405	600435	北方导航	11,300	174,246.00	0.01
406	600547	山东黄金	4,500	174,195.00	0.01
407	000543	皖能电力	21,900	174,105.00	0.01
408	600961	株冶集团	10,800	173,880.00	0.01
409	301536	星宸科技	2,900	173,739.00	0.01
410	600927	永安期货	10,800	173,556.00	0.01
411	600724	宁波富达	30,100	173,376.00	0.01
412	002023	海特高新	12,800	173,312.00	0.01
413	002378	章源钨业	12,200	172,996.00	0.01
414	688321	微芯生物	5,913	172,777.86	0.01
415	000810	创维数字	14,600	171,988.00	0.01
416	600996	贵广网络	17,100	171,684.00	0.01
417	002967	广电计量	7,800	171,678.00	0.01
418	001896	豫能控股	33,000	171,600.00	0.01
419	601038	一拖股份	12,100	171,457.00	0.01
420	600968	海油发展	44,500	170,880.00	0.01
421	600572	康恩贝	38,300	170,818.00	0.01
422	002080	中材科技	4,700	170,798.00	0.01
423	002444	巨星科技	5,000	170,100.00	0.01
424	601963	重庆银行	15,700	170,031.00	0.01
425	688678	福立旺	7,027	169,912.86	0.01
426	601600	中国铝业	13,900	169,858.00	0.01
427	601890	亚星锚链	16,500	169,785.00	0.01
428	002384	东山精密	2,000	169,300.00	0.01
429	000425	徐工机械	14,600	169,068.00	0.01
430	600936	广西广电	40,000	168,800.00	0.01
431	603327	福蓉科技	15,500	168,330.00	0.01
432	301031	中熔电气	1,500	168,285.00	0.01
433	003031	中瓷电子	2,300	168,268.00	0.01
434	600010	包钢股份	70,700	168,266.00	0.01
435	603505	金石资源	9,000	168,120.00	0.01
436	600507	方大特钢	28,500	167,865.00	0.01
437	001258	立新能源	23,600	167,796.00	0.01
438	601111	中国国航	17,900	167,723.00	0.01
439	002174	游族网络	13,700	167,688.00	0.01
440	001286	陕西能源	18,000	167,580.00	0.01
441	601360	三六零	15,000	167,550.00	0.01

442	600028	中国石化	27,100	167,478.00	0.01
443	300185	通裕重工	58,839	167,102.76	0.01
444	603915	国茂股份	9,000	165,690.00	0.01
445	301097	天益医疗	3,200	165,184.00	0.01
446	688153	唯捷创芯	4,388	165,164.32	0.01
447	301095	广立微	2,300	164,933.00	0.01
448	002099	海翔药业	26,400	164,736.00	0.01
449	001313	粤海饲料	22,500	164,700.00	0.01
450	600602	云赛智联	8,800	164,472.00	0.01
451	002314	南山控股	57,700	164,445.00	0.01
452	600651	飞乐音响	22,500	164,025.00	0.01
453	300071	福石控股	25,100	163,903.00	0.01
454	002096	易普力	12,300	163,836.00	0.01
455	301518	长华化学	4,600	163,622.00	0.00
456	300363	博腾股份	7,000	162,680.00	0.00
457	688295	中复神鹰	4,954	162,540.74	0.00
458	002242	九阳股份	15,500	161,820.00	0.00
459	300171	东富龙	10,300	161,710.00	0.00
460	002901	大博医疗	3,400	161,058.00	0.00
461	688336	三生国健	2,699	160,779.43	0.00
462	600067	冠城新材	38,700	160,605.00	0.00
463	300395	菲利华	1,600	160,480.00	0.00
464	002025	航天电器	3,200	160,416.00	0.00
465	600619	海立股份	7,600	160,360.00	0.00
466	002837	英维克	1,500	160,335.00	0.00
467	601390	中国中铁	29,600	160,136.00	0.00
468	002488	金固股份	18,200	159,978.00	0.00
469	002176	江特电机	16,400	159,736.00	0.00
470	688006	杭可科技	5,450	159,630.50	0.00
471	301071	力量钻石	4,400	157,696.00	0.00
472	000833	粤桂股份	8,100	157,626.00	0.00
473	600573	惠泉啤酒	13,200	157,476.00	0.00
474	300925	法本信息	7,400	157,176.00	0.00
475	000426	兴业银锡	4,400	156,640.00	0.00
476	601908	京运通	40,000	156,400.00	0.00
477	601615	明阳智能	10,800	156,384.00	0.00
478	600353	旭光电子	9,700	156,364.00	0.00
479	603496	恒为科技	5,700	155,496.00	0.00
480	000800	一汽解放	22,900	155,262.00	0.00
481	601168	西部矿业	5,600	154,784.00	0.00
482	603529	爱玛科技	5,200	154,440.00	0.00
482	600323	瀚蓝环境	5,400	154,440.00	0.00
483	600176	中国巨石	9,000	153,900.00	0.00
484	688543	国科军工	2,477	153,747.39	0.00

485	601099	太平洋	37,300	153,303.00	0.00
486	002952	亚世光电	7,800	153,192.00	0.00
487	600269	赣粤高速	29,500	153,105.00	0.00
488	002993	奥海科技	3,500	152,985.00	0.00
489	002006	精工科技	6,600	152,856.00	0.00
490	300726	宏达电子	3,000	152,730.00	0.00
491	002130	沃尔核材	5,800	152,656.00	0.00
492	600361	创新新材	36,000	152,640.00	0.00
493	002241	歌尔股份	5,300	152,269.00	0.00
494	002756	永兴材料	2,800	151,900.00	0.00
495	601595	上海电影	5,300	151,739.00	0.00
496	300157	新锦动力	33,400	151,636.00	0.00
497	601086	国芳集团	14,900	151,533.00	0.00
498	002897	意华股份	2,800	151,396.00	0.00
499	600363	联创光电	2,400	151,344.00	0.00
500	000421	南京公用	21,900	151,329.00	0.00
501	300723	一品红	4,500	150,975.00	0.00
502	002456	欧菲光	14,200	150,804.00	0.00
503	605020	永和股份	5,600	150,584.00	0.00
504	301038	深水规院	6,400	150,080.00	0.00
505	002016	世荣兆业	25,900	149,702.00	0.00
506	603280	南方路机	4,000	149,600.00	0.00
507	002311	海大集团	2,700	149,526.00	0.00
508	688519	南亚新材	1,849	149,510.14	0.00
509	603697	有友食品	12,200	149,450.00	0.00
510	002612	朗姿股份	7,300	149,212.00	0.00
511	002941	新疆交建	9,400	148,990.00	0.00
512	688141	杰华特	3,425	148,747.75	0.00
513	603663	三祥新材	4,200	148,470.00	0.00
514	002675	东诚药业	10,800	148,392.00	0.00
515	603162	海通发展	12,300	148,092.00	0.00
516	600116	三峡水利	22,600	147,804.00	0.00
517	300888	稳健医疗	3,900	147,576.00	0.00
518	688248	南网科技	3,293	147,328.82	0.00
519	002398	垒知集团	26,200	147,244.00	0.00
520	002077	大港股份	9,900	147,213.00	0.00
521	002489	浙江永强	38,300	146,689.00	0.00
522	300017	网宿科技	14,300	146,575.00	0.00
523	603335	迪生力	26,000	146,380.00	0.00
524	002696	百洋股份	20,700	146,349.00	0.00
525	603043	广州酒家	8,300	146,329.00	0.00
526	688549	中巨芯-U	16,041	146,293.92	0.00
527	002463	沪电股份	2,000	146,140.00	0.00
528	603085	天成自控	12,300	145,755.00	0.00

529	601919	中远海控	9,600	145,728.00	0.00
530	603190	亚通精工	5,400	145,638.00	0.00
531	600839	四川长虹	16,000	145,600.00	0.00
532	688017	绿的谐波	757	145,419.70	0.00
533	603317	天味食品	11,600	145,232.00	0.00
534	301082	久盛电气	8,100	144,990.00	0.00
535	002651	利君股份	12,400	144,956.00	0.00
536	300882	万胜智能	7,700	144,760.00	0.00
537	002946	新乳业	7,800	144,534.00	0.00
538	000088	盐田港	32,400	144,180.00	0.00
539	600416	湘电股份	9,100	143,598.00	0.00
540	600295	鄂尔多斯	11,600	143,376.00	0.00
541	000155	川能动力	12,300	143,295.00	0.00
542	002043	兔宝宝	9,900	142,659.00	0.00
543	603893	瑞芯微	800	142,624.00	0.00
544	002671	龙泉股份	27,200	142,528.00	0.00
545	601888	中国中免	1,500	141,840.00	0.00
546	300861	美畅股份	9,500	141,835.00	0.00
547	002516	旷达科技	21,500	141,685.00	0.00
548	300682	朗新集团	9,300	141,453.00	0.00
549	600844	金煤科技	49,100	141,408.00	0.00
550	688584	上海合晶	6,444	141,381.36	0.00
551	601880	辽港股份	88,200	141,120.00	0.00
552	000058	深赛格	15,000	141,000.00	0.00
553	000686	东北证券	15,100	140,732.00	0.00
554	600143	金发科技	7,200	140,688.00	0.00
555	002028	思源电气	900	139,131.00	0.00
556	301365	矩阵股份	5,800	138,272.00	0.00
557	300926	博俊科技	4,200	137,676.00	0.00
558	002498	汉缆股份	35,900	137,497.00	0.00
559	002430	杭氧股份	4,600	137,402.00	0.00
560	300633	开立医疗	5,200	137,384.00	0.00
561	002511	中顺洁柔	16,000	136,960.00	0.00
562	600186	莲花控股	22,800	136,344.00	0.00
563	603316	诚邦股份	9,400	136,300.00	0.00
564	002004	华邦健康	28,500	136,230.00	0.00
565	002645	华宏科技	9,300	136,152.00	0.00
566	603949	雪龙集团	7,200	135,144.00	0.00
567	002418	康盛股份	28,300	134,991.00	0.00
568	300857	协创数据	800	134,944.00	0.00
569	688322	奥比中光-UW	1,501	134,594.67	0.00
570	000935	四川双马	5,400	134,136.00	0.00
571	000778	新兴铸管	32,000	133,760.00	0.00
572	603013	亚普股份	5,400	133,218.00	0.00

573	601083	锦江航运	11,900	132,804.00	0.00
573	600335	国机汽车	20,400	132,804.00	0.00
574	603156	养元饮品	4,600	132,250.00	0.00
575	002486	嘉麟杰	42,500	132,175.00	0.00
576	601872	招商轮船	14,700	132,006.00	0.00
577	600618	氯碱化工	11,100	131,868.00	0.00
578	300662	科锐国际	5,200	131,716.00	0.00
579	002157	正邦科技	40,600	131,544.00	0.00
580	600298	安琪酵母	3,000	131,220.00	0.00
581	600027	华电国际	26,400	130,944.00	0.00
582	688819	天能股份	3,940	130,886.80	0.00
583	301027	华蓝集团	7,100	130,711.00	0.00
584	001389	广合科技	1,600	130,608.00	0.00
585	688498	源杰科技	203	130,323.97	0.00
586	600575	淮河能源	38,300	130,220.00	0.00
587	601001	晋控煤业	9,900	130,185.00	0.00
588	600562	国睿科技	4,600	129,996.00	0.00
589	300707	威唐工业	7,900	129,955.00	0.00
590	301029	怡合达	4,900	129,948.00	0.00
591	600382	广东明珠	18,200	129,766.00	0.00
592	000899	赣能股份	13,100	129,690.00	0.00
593	600601	方正科技	11,000	128,920.00	0.00
594	603858	步长制药	8,200	128,248.00	0.00
595	600233	圆通速递	7,800	128,076.00	0.00
596	603103	横店影视	7,700	127,666.00	0.00
597	301109	军信股份	8,500	127,500.00	0.00
598	603530	神马电力	3,100	127,348.00	0.00
599	002354	天娱数科	19,900	126,763.00	0.00
600	002044	美年健康	24,000	126,720.00	0.00
601	002352	顺丰控股	3,300	126,456.00	0.00
602	000791	甘肃能源	19,600	126,420.00	0.00
603	600782	新钢股份	32,500	126,100.00	0.00
604	300558	贝达药业	2,700	126,063.00	0.00
605	600403	大有能源	18,000	125,640.00	0.00
606	603118	共进股份	10,900	125,350.00	0.00
607	600641	先导基电	7,100	125,244.00	0.00
608	300919	中伟股份	2,700	125,091.00	0.00
609	300498	温氏股份	7,400	124,912.00	0.00
610	002532	天山铝业	7,700	124,586.00	0.00
611	002913	奥士康	2,900	123,946.00	0.00
612	603999	读者传媒	17,600	123,728.00	0.00
613	600380	健康元	10,700	123,585.00	0.00
614	300661	圣邦股份	1,800	123,552.00	0.00
615	601678	滨化股份	29,100	123,384.00	0.00

616	301108	洁雅股份	3,700	123,062.00	0.00
617	688396	华润微	2,319	122,582.34	0.00
618	603341	龙旗科技	2,900	122,554.00	0.00
619	601990	南京证券	15,400	121,968.00	0.00
620	601022	宁波远洋	13,300	121,961.00	0.00
621	603218	日月股份	9,200	121,900.00	0.00
622	688114	华大智造	2,001	121,580.76	0.00
623	300763	锦浪科技	1,700	121,397.00	0.00
624	300098	高新兴	19,900	121,390.00	0.00
625	600941	中国移动	1,200	121,260.00	0.00
626	688001	华兴源创	4,017	121,233.06	0.00
627	300858	科拓生物	7,200	120,744.00	0.00
628	002397	梦洁股份	29,900	120,497.00	0.00
629	688692	达梦数据	461	120,445.47	0.00
630	301555	惠柏新材	3,600	120,348.00	0.00
631	002564	天沃科技	15,600	120,120.00	0.00
632	300134	大富科技	9,600	120,000.00	0.00
633	300247	融捷健康	23,200	119,016.00	0.00
634	002787	华源控股	9,500	118,275.00	0.00
635	300443	金雷股份	4,200	118,146.00	0.00
636	300302	同有科技	6,500	117,910.00	0.00
637	600011	华能国际	15,800	117,868.00	0.00
638	603039	泛微网络	2,200	117,788.00	0.00
639	002110	三钢闽光	26,800	117,652.00	0.00
640	000723	美锦能源	25,000	117,500.00	0.00
641	300296	利亚德	18,400	116,288.00	0.00
642	600292	远达环保	8,900	116,145.00	0.00
643	000017	深中华 A	14,700	115,689.00	0.00
644	603737	三棵树	2,500	115,675.00	0.00
645	688372	伟测科技	1,059	115,526.31	0.00
646	300464	星徽股份	18,200	115,388.00	0.00
647	601900	南方传媒	8,600	115,326.00	0.00
648	002493	荣盛石化	9,800	114,758.00	0.00
649	600282	南钢股份	21,800	114,668.00	0.00
650	605118	力鼎光电	3,800	114,418.00	0.00
651	002461	珠江啤酒	12,300	114,267.00	0.00
652	600183	生益科技	1,600	114,256.00	0.00
653	688612	威迈斯	3,465	114,241.05	0.00
654	000019	深粮控股	16,400	113,980.00	0.00
655	002608	江苏国信	15,400	113,806.00	0.00
656	600686	金龙汽车	6,400	113,536.00	0.00
657	002273	水晶光电	4,500	113,040.00	0.00
658	002225	濮耐股份	19,800	112,860.00	0.00
659	600056	中国医药	10,900	112,597.00	0.00

660	002258	利尔化学	8,600	112,230.00	0.00
661	600258	首旅酒店	6,700	112,225.00	0.00
662	000880	潍柴重机	4,100	112,012.00	0.00
663	300027	华谊兄弟	51,600	111,972.00	0.00
664	002701	奥瑞金	18,800	111,860.00	0.00
665	603059	倍加洁	3,700	111,296.00	0.00
666	002056	横店东磁	5,700	111,150.00	0.00
667	301015	百洋医药	4,700	110,920.00	0.00
668	000657	中钨高新	4,000	110,840.00	0.00
669	300106	西部牧业	10,300	110,725.00	0.00
670	688206	概伦电子	3,176	110,620.08	0.00
671	600210	紫江企业	15,000	110,250.00	0.00
672	600114	东睦股份	3,600	109,980.00	0.00
673	600895	张江高科	2,500	109,750.00	0.00
674	300341	麦克奥迪	6,700	109,478.00	0.00
675	000564	供销大集	43,700	109,250.00	0.00
676	603556	海兴电力	3,000	109,200.00	0.00
677	601155	新城控股	7,800	108,810.00	0.00
678	600970	中材国际	10,400	108,056.00	0.00
679	600026	中远海能	9,200	107,456.00	0.00
680	002373	千方科技	9,100	107,107.00	0.00
681	600060	海信视像	4,400	106,832.00	0.00
682	002266	浙富控股	25,600	106,496.00	0.00
683	301153	中科江南	4,300	106,296.00	0.00
684	600429	三元股份	20,500	106,190.00	0.00
685	002216	三全食品	9,400	106,126.00	0.00
686	000960	锡业股份	3,800	105,944.00	0.00
687	600094	大名城	25,400	105,664.00	0.00
688	600938	中国海油	3,500	105,630.00	0.00
689	300416	苏试试验	5,900	105,256.00	0.00
690	300014	亿纬锂能	1,600	105,216.00	0.00
691	603917	合力科技	7,100	105,009.00	0.00
692	002773	康弘药业	3,500	104,895.00	0.00
693	000568	泸州老窖	900	104,598.00	0.00
694	300678	中科信息	3,400	104,584.00	0.00
695	600132	重庆啤酒	2,000	104,480.00	0.00
696	601868	中国能建	44,300	104,105.00	0.00
697	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
698	688148	芳源股份	11,722	102,801.94	0.00
699	003035	南网能源	22,400	102,592.00	0.00
700	301238	瑞泰新材	5,000	102,000.00	0.00
701	600018	上港集团	18,800	101,896.00	0.00
702	688777	中控技术	2,054	101,344.36	0.00
703	600764	中国海防	3,700	101,158.00	0.00

704	601107	四川成渝	16,600	100,928.00	0.00
705	688099	晶晨股份	1,157	100,925.11	0.00
706	601169	北京银行	18,400	100,832.00	0.00
707	601003	柳钢股份	20,000	100,600.00	0.00
708	688122	西部超导	1,341	100,011.78	0.00
709	002202	金风科技	4,900	99,960.00	0.00
710	601858	中国科传	5,500	99,825.00	0.00
711	688690	纳微科技	3,860	99,626.60	0.00
712	002041	登海种业	10,400	99,216.00	0.00
713	002851	麦格米特	1,100	99,077.00	0.00
714	688120	华海清科	660	99,052.80	0.00
715	301487	盟固利	4,500	98,685.00	0.00
716	688310	迈得医疗	6,418	98,387.94	0.00
717	688469	芯联集成-U	14,563	97,426.47	0.00
718	688639	华恒生物	2,986	97,283.88	0.00
719	601766	中国中车	14,200	96,844.00	0.00
720	301175	中科环保	16,300	96,333.00	0.00
721	002409	雅克科技	1,300	96,330.00	0.00
722	002261	拓维信息	2,900	95,990.00	0.00
723	600879	航天电子	4,500	95,940.00	0.00
724	003039	顺控发展	6,000	95,580.00	0.00
725	603236	移远通信	1,000	95,410.00	0.00
726	688209	英集芯	4,780	95,313.20	0.00
727	603885	吉祥航空	6,400	95,232.00	0.00
728	601068	中铝国际	18,000	95,220.00	0.00
729	600428	中远海特	13,400	95,140.00	0.00
730	300113	顺网科技	4,700	95,128.00	0.00
731	001914	招商积余	8,900	95,052.00	0.00
732	600348	华阳股份	11,500	94,990.00	0.00
733	000975	山金国际	3,900	94,887.00	0.00
734	002755	奥赛康	5,800	94,714.00	0.00
735	000065	北方国际	7,600	94,696.00	0.00
736	002537	海联金汇	10,400	94,224.00	0.00
737	301565	中仑新材	3,900	94,146.00	0.00
738	600021	上海电力	4,700	94,094.00	0.00
739	603083	剑桥科技	700	94,066.00	0.00
740	601089	福元医药	3,900	93,600.00	0.00
741	688443	智翔金泰-U	3,436	93,596.64	0.00
742	301626	苏州天脉	500	93,150.00	0.00
743	000895	双汇发展	3,500	92,645.00	0.00
744	300001	特锐德	3,600	92,448.00	0.00
745	002968	新大正	7,600	92,416.00	0.00
746	600673	东阳光	4,100	91,963.00	0.00
747	688615	合合信息	404	91,942.32	0.00

748	601988	中国银行	16,000	91,680.00	0.00
749	301551	无线传媒	2,900	91,495.00	0.00
750	002126	银轮股份	2,400	90,720.00	0.00
751	002654	万润科技	6,400	90,048.00	0.00
752	600259	中稀有金	1,600	90,016.00	0.00
753	603707	健友股份	9,900	89,397.00	0.00
754	688515	裕太微-U	865	88,705.75	0.00
755	300257	开山股份	6,300	88,515.00	0.00
756	600518	康美药业	46,200	88,242.00	0.00
757	600741	华域汽车	4,400	88,000.00	0.00
758	600884	杉杉股份	6,500	87,815.00	0.00
759	301207	华兰疫苗	4,700	87,561.00	0.00
760	002668	TCL 智家	8,400	87,192.00	0.00
761	600926	杭州银行	5,700	87,096.00	0.00
762	002508	老板电器	4,500	87,075.00	0.00
763	600188	兖矿能源	6,600	86,790.00	0.00
764	300917	特发服务	2,200	86,020.00	0.00
765	601128	常熟银行	12,204	85,916.16	0.00
766	301091	深城交	3,200	85,568.00	0.00
767	000766	通化金马	3,100	85,219.00	0.00
768	300548	长芯博创	600	85,200.00	0.00
769	603219	富佳股份	5,000	84,200.00	0.00
770	002497	雅化集团	3,400	84,150.00	0.00
771	600967	内蒙一机	5,000	84,000.00	0.00
772	600563	法拉电子	800	83,960.00	0.00
773	600198	大唐电信	8,700	83,955.00	0.00
774	603129	春风动力	300	83,604.00	0.00
775	002279	久其软件	10,400	83,096.00	0.00
776	301000	肇民科技	2,100	82,677.00	0.00
777	688002	睿创微纳	817	82,353.60	0.00
778	003006	百亚股份	3,700	80,808.00	0.00
779	301571	国科天成	1,400	80,752.00	0.00
780	301286	侨源股份	1,900	80,351.00	0.00
781	000825	太钢不锈	16,400	80,196.00	0.00
782	002404	嘉欣丝绸	11,400	79,914.00	0.00
783	688552	航天南湖	2,191	79,577.12	0.00
784	603900	莱绅通灵	9,400	79,524.00	0.00
785	603345	安井食品	1,000	79,280.00	0.00
786	002846	英联股份	4,900	79,086.00	0.00
787	605198	安德利	2,100	79,002.00	0.00
788	302132	中航成飞	1,000	79,000.00	0.00
789	002850	科达利	500	78,930.00	0.00
790	603712	七一二	3,800	78,926.00	0.00
791	600710	苏美达	7,300	78,913.00	0.00

792	000423	东阿阿胶	1,600	78,528.00	0.00
793	301251	威尔高	1,500	78,420.00	0.00
794	600744	华银电力	13,300	78,204.00	0.00
794	300323	华灿光电	9,800	78,204.00	0.00
795	002138	顺络电子	2,200	78,166.00	0.00
796	603093	南华期货	4,000	77,960.00	0.00
797	301177	迪阿股份	2,700	77,949.00	0.00
798	688629	华丰科技	777	77,746.62	0.00
799	002545	东方铁塔	4,200	77,490.00	0.00
800	688107	安路科技	2,844	77,299.92	0.00
801	605277	新亚电子	3,500	77,000.00	0.00
802	002345	潮宏基	6,100	76,250.00	0.00
803	300244	迪安诊断	4,800	76,080.00	0.00
804	603939	益丰药房	3,500	76,020.00	0.00
805	600118	中国卫星	800	75,960.00	0.00
806	601608	中信重工	11,500	75,785.00	0.00
807	301345	涛涛车业	300	75,396.00	0.00
808	300047	天源迪科	6,000	75,300.00	0.00
809	002847	盐津铺子	1,100	75,141.00	0.00
810	002204	大连重工	9,800	74,970.00	0.00
811	603629	利通电子	2,800	74,620.00	0.00
812	688439	振华风光	1,151	74,354.60	0.00
813	002709	天赐材料	1,600	74,128.00	0.00
814	002690	美亚光电	3,600	74,052.00	0.00
815	600246	万通发展	6,000	73,800.00	0.00
816	000066	中国长城	5,100	73,491.00	0.00
817	600316	洪都航空	2,100	73,311.00	0.00
818	000990	诚志股份	9,200	72,864.00	0.00
819	002270	华明装备	2,900	72,616.00	0.00
820	688213	思特威-W	760	72,268.40	0.00
821	002797	第一创业	10,500	72,135.00	0.00
822	300451	创业慧康	14,900	72,116.00	0.00
823	000959	首钢股份	14,700	72,030.00	0.00
824	002777	久远银海	4,000	71,760.00	0.00
825	600177	雅戈尔	9,400	71,440.00	0.00
826	002472	双环传动	1,500	71,115.00	0.00
827	002097	山河智能	5,700	70,737.00	0.00
828	601636	旗滨集团	11,900	70,567.00	0.00
829	688063	派能科技	1,240	70,456.80	0.00
830	300382	斯莱克	4,500	70,020.00	0.00
831	002468	申通快递	5,200	69,784.00	0.00
832	001309	德明利	300	69,567.00	0.00
833	000059	华锦股份	13,000	69,550.00	0.00
834	600699	均胜电子	2,200	68,992.00	0.00

835	600546	山煤国际	6,700	67,603.00	0.00
836	000767	晋控电力	24,000	67,200.00	0.00
837	002271	东方雨虹	4,900	66,591.00	0.00
838	601997	贵阳银行	11,300	66,331.00	0.00
839	601665	齐鲁银行	11,500	66,010.00	0.00
840	603997	继峰股份	4,700	65,330.00	0.00
841	002091	江苏国泰	7,200	65,016.00	0.00
842	601985	中国核电	7,500	64,875.00	0.00
843	600536	中国软件	1,400	64,820.00	0.00
844	300223	北京君正	600	63,624.00	0.00
845	601619	嘉泽新能	14,300	63,492.00	0.00
846	000021	深科技	2,500	63,200.00	0.00
847	000987	越秀资本	7,700	62,678.00	0.00
848	603009	北特科技	1,300	62,608.00	0.00
849	002017	东信和平	2,800	62,440.00	0.00
850	002673	西部证券	7,900	62,331.00	0.00
851	002170	芭田股份	5,100	62,118.00	0.00
852	600221	海航控股	34,200	61,902.00	0.00
853	002372	伟星新材	5,900	61,537.00	0.00
854	002602	世纪华通	3,600	61,416.00	0.00
855	600585	海螺水泥	2,800	61,208.00	0.00
856	603638	艾迪精密	3,200	60,576.00	0.00
857	300972	万辰集团	300	60,321.00	0.00
858	000099	中信海直	2,900	60,175.00	0.00
859	600266	城建发展	11,800	59,826.00	0.00
860	000539	粤电力 A	13,500	59,670.00	0.00
861	000029	深深房 A	2,700	59,454.00	0.00
862	002595	豪迈科技	700	59,157.00	0.00
863	600352	浙江龙盛	5,500	58,630.00	0.00
864	688608	恒玄科技	257	58,323.58	0.00
865	688097	博众精工	1,543	58,248.25	0.00
866	601965	中国汽研	3,500	58,100.00	0.00
867	688249	晶合集成	1,716	56,954.04	0.00
868	601233	桐昆股份	3,300	56,793.00	0.00
869	688361	中科飞测	369	56,453.31	0.00
870	300054	鼎龙股份	1,500	56,400.00	0.00
871	300970	华绿生物	2,700	55,377.00	0.00
872	600326	西藏天路	5,000	55,150.00	0.00
873	600195	中牧股份	7,000	55,090.00	0.00
874	301152	天力锂能	1,800	55,008.00	0.00
875	002127	南极电商	16,200	54,594.00	0.00
876	600218	全柴动力	5,300	54,484.00	0.00
877	688586	江航装备	4,150	54,116.00	0.00
878	600032	浙江新能	7,300	54,093.00	0.00

879	688019	安集科技	245	53,390.40	0.00
880	000898	鞍钢股份	21,100	53,383.00	0.00
881	300809	华辰装备	1,400	53,298.00	0.00
882	000429	粤高速 A	4,500	53,010.00	0.00
883	300651	金陵体育	2,600	52,988.00	0.00
884	002554	惠博普	16,300	51,997.00	0.00
885	301381	赛维时代	2,500	51,475.00	0.00
886	600489	中金黄金	2,200	51,392.00	0.00
887	000878	云南铜业	2,500	51,275.00	0.00
888	603228	景旺电子	700	51,163.00	0.00
889	600446	金证股份	3,200	50,944.00	0.00
890	000408	藏格矿业	600	50,640.00	0.00
891	600733	北汽蓝谷	6,300	50,589.00	0.00
892	000969	安泰科技	2,400	50,424.00	0.00
893	300738	奥飞数据	2,700	49,923.00	0.00
894	601096	宏盛华源	12,000	49,800.00	0.00
895	002911	佛燃能源	4,100	49,692.00	0.00
896	002465	海格通信	3,100	48,825.00	0.00
897	603057	紫燕食品	2,400	48,816.00	0.00
898	600163	中闽能源	9,000	48,780.00	0.00
899	605196	华通线缆	1,400	48,636.00	0.00
900	600109	国金证券	5,200	48,360.00	0.00
901	001267	汇绿生态	2,200	48,180.00	0.00
902	300328	宜安科技	2,800	47,796.00	0.00
903	603355	莱克电气	1,500	47,595.00	0.00
904	002839	张家港行	10,400	47,528.00	0.00
905	002078	太阳纸业	3,000	47,250.00	0.00
906	002293	罗莱生活	4,600	47,242.00	0.00
907	601512	中新集团	5,200	46,800.00	0.00
908	000922	佳电股份	3,400	46,784.00	0.00
909	601577	长沙银行	4,800	46,560.00	0.00
910	301382	蜂助手	1,300	46,072.00	0.00
911	601117	中国化学	6,100	45,933.00	0.00
912	000006	深振业 A	4,600	45,770.00	0.00
913	300975	商络电子	3,600	45,684.00	0.00
914	601066	中信建投	1,700	45,509.00	0.00
915	300031	宝通科技	2,000	45,460.00	0.00
916	000936	华西股份	5,500	45,265.00	0.00
917	601077	渝农商行	7,000	45,220.00	0.00
918	601226	华电科工	5,600	43,904.00	0.00
919	600022	山东钢铁	29,000	43,790.00	0.00
920	688222	成都先导	1,866	43,757.70	0.00
921	301389	隆扬电子	800	43,664.00	0.00
922	002101	广东鸿图	3,500	43,120.00	0.00

923	688522	纳睿雷达	1,079	43,084.47	0.00
924	600851	海欣股份	6,300	43,029.00	0.00
925	000034	神州数码	1,100	42,801.00	0.00
926	000625	长安汽车	3,600	42,696.00	0.00
927	002507	涪陵榨菜	3,300	42,603.00	0.00
928	002555	三七互娱	1,800	42,480.00	0.00
929	603166	福达股份	2,700	42,390.00	0.00
930	300043	星辉娱乐	7,500	42,375.00	0.00
931	601866	中远海发	16,600	41,832.00	0.00
932	300408	三环集团	900	41,175.00	0.00
933	300872	天阳科技	2,000	41,120.00	0.00
934	603087	甘李药业	600	40,842.00	0.00
935	002543	万和电气	4,000	40,840.00	0.00
936	603233	大参林	2,300	40,526.00	0.00
937	002590	万安科技	2,700	40,500.00	0.00
938	000060	中金岭南	6,900	40,365.00	0.00
939	603890	春秋电子	2,500	40,325.00	0.00
940	002065	东华软件	4,400	40,260.00	0.00
941	688709	成都华微	874	40,195.26	0.00
942	600203	福日电子	3,000	40,020.00	0.00
943	603901	永创智能	2,800	39,760.00	0.00
944	000538	云南白药	700	39,732.00	0.00
945	002239	奥特佳	13,300	39,634.00	0.00
946	300100	双林股份	1,000	39,620.00	0.00
947	300769	德方纳米	900	39,609.00	0.00
948	300684	中石科技	800	39,376.00	0.00
949	300456	赛微电子	700	39,172.00	0.00
950	300002	神州泰岳	3,400	39,168.00	0.00
951	601689	拓普集团	500	38,590.00	0.00
952	300009	安科生物	4,000	38,280.00	0.00
953	300724	捷佳伟创	400	38,240.00	0.00
954	603979	金诚信	500	38,075.00	0.00
955	300596	利安隆	900	37,989.00	0.00
956	300702	天宇股份	1,600	37,760.00	0.00
957	300251	光线传媒	2,300	37,674.00	0.00
958	603179	新泉股份	500	36,940.00	0.00
959	600125	铁龙物流	5,600	36,064.00	0.00
960	605599	菜百股份	2,200	36,014.00	0.00
961	000750	国海证券	8,400	35,616.00	0.00
962	000617	中油资本	3,700	35,520.00	0.00
963	688037	芯源微	239	35,493.89	0.00
964	000415	渤海租赁	8,600	34,830.00	0.00
965	000513	丽珠集团	1,000	34,460.00	0.00
966	688676	金盘科技	380	34,329.20	0.00

967	301529	福赛科技	300	33,930.00	0.00
968	002466	天齐锂业	600	33,228.00	0.00
969	002882	金龙羽	1,100	33,176.00	0.00
970	600666	奥瑞德	9,800	32,928.00	0.00
971	600639	浦东金桥	3,200	32,864.00	0.00
972	000807	云铝股份	1,000	32,840.00	0.00
973	605008	长鸿高科	2,300	32,821.00	0.00
974	002741	光华科技	1,600	32,096.00	0.00
975	600331	宏达股份	2,500	31,975.00	0.00
976	002181	粤传媒	3,700	31,894.00	0.00
977	688266	泽璟制药-U	341	31,610.70	0.00
978	603160	汇顶科技	400	31,600.00	0.00
979	301141	中科磁业	600	31,332.00	0.00
980	300277	海联讯	2,400	31,320.00	0.00
981	301363	美好医疗	1,300	31,265.00	0.00
982	605389	长龄液压	400	31,200.00	0.00
983	300278	华昌达	5,100	31,110.00	0.00
984	002975	博杰股份	400	30,800.00	0.00
985	002223	鱼跃医疗	800	30,568.00	0.00
986	301339	通行宝	2,100	30,534.00	0.00
987	600184	光电股份	1,600	30,496.00	0.00
988	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
989	300267	尔康制药	8,700	29,667.00	0.00
990	600928	西安银行	8,000	29,600.00	0.00
991	002114	罗平锌电	3,500	29,470.00	0.00
992	600958	东方证券	2,700	29,430.00	0.00
993	300620	光库科技	200	29,410.00	0.00
994	601968	宝钢包装	5,500	29,370.00	0.00
995	605305	中际联合	700	29,162.00	0.00
996	603061	金海通	200	28,080.00	0.00
997	300627	华测导航	800	27,928.00	0.00
998	603223	恒通股份	3,000	27,900.00	0.00
999	600490	鹏欣资源	3,600	27,828.00	0.00
1,000	600725	云维股份	6,600	27,588.00	0.00
1,001	001322	箭牌家居	3,100	27,497.00	0.00
1,002	300676	华大基因	600	27,216.00	0.00
1,003	300893	松原安全	1,140	26,949.60	0.00
1,004	600732	爱旭股份	2,000	26,800.00	0.00
1,005	688280	精进电动-UW	3,045	26,491.50	0.00
1,006	000993	闽东电力	2,200	26,356.00	0.00
1,007	003030	祖名股份	1,300	26,247.00	0.00
1,008	002356	赫美集团	6,600	26,136.00	0.00
1,009	600577	精达股份	2,100	26,103.00	0.00
1,010	688083	中望软件	370	25,200.70	0.00

1,011	601677	明泰铝业	1,700	25,143.00	0.00
1,012	300568	星源材质	1,600	24,400.00	0.00
1,013	000650	仁和药业	4,300	24,295.00	0.00
1,014	601606	长城军工	500	24,060.00	0.00
1,015	002129	TCL 中环	2,800	23,996.00	0.00
1,016	002243	力合科创	2,400	23,880.00	0.00
1,017	600025	华能水电	2,600	23,608.00	0.00
1,018	300757	罗博特科	100	23,330.00	0.00
1,019	300570	太辰光	200	23,110.00	0.00
1,020	002250	联化科技	1,700	22,746.00	0.00
1,021	002335	科华数据	400	22,212.00	0.00
1,022	605060	联德股份	600	22,176.00	0.00
1,023	600048	保利发展	3,600	21,960.00	0.00
1,024	002039	黔源电力	1,200	21,804.00	0.00
1,025	000009	中国宝安	2,200	21,670.00	0.00
1,026	601878	浙商证券	2,000	21,620.00	0.00
1,027	601118	海南橡胶	3,600	21,060.00	0.00
1,028	002405	四维图新	2,300	20,723.00	0.00
1,029	300123	亚光科技	2,500	20,250.00	0.00
1,030	601777	千里科技	1,900	20,197.00	0.00
1,031	603318	水发燃气	3,000	20,100.00	0.00
1,032	601800	中国交建	2,400	19,776.00	0.00
1,033	002307	北新路桥	3,900	19,695.00	0.00
1,034	600009	上海机场	600	19,656.00	0.00
1,035	300949	奥雅股份	500	19,600.00	0.00
1,036	002245	蔚蓝锂芯	1,100	19,580.00	0.00
1,037	000636	风华高科	1,200	19,536.00	0.00
1,038	300948	冠中生态	900	19,521.00	0.00
1,039	002082	万邦德	1,400	19,502.00	0.00
1,040	002926	华西证券	2,100	19,488.00	0.00
1,041	603766	隆鑫通用	1,200	19,332.00	0.00
1,042	300407	凯发电气	1,700	19,244.00	0.00
1,043	600905	三峡能源	4,700	19,223.00	0.00
1,044	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
1,045	688799	华纳药厂	400	19,080.00	0.00
1,046	300168	万达信息	2,900	18,734.00	0.00
1,047	300015	爱尔眼科	1,700	18,666.00	0.00
1,048	600859	王府井	1,200	18,636.00	0.00
1,049	603170	宝立食品	1,300	18,564.00	0.00
1,050	688208	道通科技	502	18,473.60	0.00
1,051	300166	东方国信	1,800	18,396.00	0.00
1,052	600158	中体产业	2,100	18,333.00	0.00
1,053	300139	晓程科技	600	18,216.00	0.00
1,054	002803	吉宏股份	1,100	17,996.00	0.00

1,055	601375	中原证券	4,100	17,630.00	0.00
1,056	600640	国脉文化	1,400	17,584.00	0.00
1,057	603856	东宏股份	1,400	17,458.00	0.00
1,058	300212	易华录	1,000	17,450.00	0.00
1,059	000921	海信家电	700	17,367.00	0.00
1,060	002831	裕同科技	600	17,106.00	0.00
1,061	601005	重庆钢铁	11,700	17,082.00	0.00
1,062	300170	汉得信息	900	17,028.00	0.00
1,063	600098	广州发展	2,600	17,004.00	0.00
1,064	000506	招金黄金	1,300	16,978.00	0.00
1,065	300119	瑞普生物	900	16,893.00	0.00
1,066	600436	片仔癀	100	16,878.00	0.00
1,067	603613	国联股份	600	16,800.00	0.00
1,068	600959	江苏有线	4,800	16,512.00	0.00
1,069	300024	机器人	900	16,371.00	0.00
1,070	300065	海兰信	900	16,353.00	0.00
1,071	002249	大洋电机	1,500	16,350.00	0.00
1,072	300389	艾比森	1,000	16,230.00	0.00
1,073	301080	百普赛斯	300	16,200.00	0.00
1,074	300007	汉威科技	300	16,080.00	0.00
1,075	300696	爱乐达	500	15,955.00	0.00
1,076	000728	国元证券	1,900	15,865.00	0.00
1,076	002985	北摩高科	500	15,865.00	0.00
1,077	600506	统一股份	600	15,726.00	0.00
1,078	301468	博盈特焊	300	15,684.00	0.00
1,079	600986	浙文互联	2,000	15,640.00	0.00
1,080	000718	苏宁环球	6,800	15,572.00	0.00
1,081	300144	宋城演艺	1,900	15,561.00	0.00
1,082	000589	贵州轮胎	3,000	15,540.00	0.00
1,083	688363	华熙生物	355	15,506.40	0.00
1,084	002653	海思科	300	15,396.00	0.00
1,085	000719	中原传媒	1,300	15,288.00	0.00
1,086	000639	西王食品	4,600	15,226.00	0.00
1,087	002938	鹏鼎控股	300	15,174.00	0.00
1,088	300681	英搏尔	600	15,036.00	0.00
1,089	600373	中文传媒	1,600	14,944.00	0.00
1,090	688116	天奈科技	316	14,899.40	0.00
1,091	001236	弘业期货	1,400	14,840.00	0.00
1,092	600583	海油工程	2,700	14,823.00	0.00
1,093	600679	上海凤凰	1,100	14,773.00	0.00
1,094	000567	海德股份	2,300	14,766.00	0.00
1,095	300153	科泰电源	500	14,535.00	0.00
1,096	603920	世运电路	300	14,523.00	0.00
1,097	688065	凯赛生物	287	14,292.60	0.00

1,098	000999	华润三九	500	14,230.00	0.00
1,099	300624	万兴科技	200	14,130.00	0.00
1,100	600557	康缘药业	1,000	14,110.00	0.00
1,101	601933	永辉超市	3,000	14,070.00	0.00
1,102	301156	美农生物	800	14,008.00	0.00
1,103	601825	沪农商行	1,500	13,935.00	0.00
1,104	301069	凯盛新材	500	13,900.00	0.00
1,105	002635	安洁科技	1,000	13,860.00	0.00
1,106	300182	捷成股份	2,500	13,800.00	0.00
1,107	300805	电声股份	1,300	13,715.00	0.00
1,108	300322	硕贝德	500	13,645.00	0.00
1,109	002663	普邦股份	7,200	13,608.00	0.00
1,110	601106	中国一重	3,400	13,566.00	0.00
1,111	300505	川金诺	600	13,434.00	0.00
1,112	002426	胜利精密	3,500	13,405.00	0.00
1,113	300912	凯龙高科	800	13,200.00	0.00
1,113	600776	东方通信	800	13,200.00	0.00
1,114	600637	东方明珠	1,300	12,805.00	0.00
1,115	002093	国脉科技	1,100	12,650.00	0.00
1,116	605338	巴比食品	400	12,528.00	0.00
1,117	603308	应流股份	300	12,525.00	0.00
1,118	002669	康达新材	800	12,160.00	0.00
1,119	301120	新特电气	700	12,089.00	0.00
1,120	601528	瑞丰银行	2,100	11,970.00	0.00
1,121	688800	瑞可达	142	11,786.00	0.00
1,122	300468	四方精创	300	11,649.00	0.00
1,123	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
1,124	300206	理邦仪器	900	11,511.00	0.00
1,125	300774	倍杰特	600	11,400.00	0.00
1,126	300383	光环新网	900	11,259.00	0.00
1,127	600469	风神股份	1,600	11,104.00	0.00
1,128	603363	傲农生物	2,400	11,064.00	0.00
1,129	300290	荣科科技	400	11,012.00	0.00
1,130	002550	千红制药	1,400	11,004.00	0.00
1,131	002782	可立克	600	10,896.00	0.00
1,132	002658	雪迪龙	1,200	10,836.00	0.00
1,133	603937	丽岛新材	900	10,791.00	0.00
1,134	688180	君实生物-U	315	10,760.40	0.00
1,135	301507	民生健康	700	10,752.00	0.00
1,136	000151	中成股份	900	10,692.00	0.00
1,137	002423	中粮资本	900	10,530.00	0.00
1,138	688031	星环科技-U	97	10,494.43	0.00
1,139	600496	精工钢构	2,500	10,375.00	0.00
1,140	003040	楚天龙	500	10,340.00	0.00

1,141	002240	盛新锂能	300	10,329.00	0.00
1,142	300595	欧普康视	700	10,283.00	0.00
1,143	601456	国联民生	1,000	10,170.00	0.00
1,144	002064	华峰化学	900	9,900.00	0.00
1,145	002139	拓邦股份	700	9,646.00	0.00
1,146	002828	贝肯能源	900	9,594.00	0.00
1,147	688577	浙海德曼	99	9,589.14	0.00
1,148	000528	柳工	800	9,496.00	0.00
1,149	300709	精研科技	200	9,432.00	0.00
1,150	600171	上海贝岭	300	9,375.00	0.00
1,151	000902	新洋丰	600	9,372.00	0.00
1,152	601958	金铂股份	600	9,348.00	0.00
1,153	002821	凯莱英	100	9,293.00	0.00
1,154	688192	迪哲医药-U	161	9,273.60	0.00
1,155	300094	国联水产	2,600	9,256.00	0.00
1,156	300666	江丰电子	100	9,200.00	0.00
1,157	002677	浙江美大	1,100	9,185.00	0.00
1,158	600740	山西焦化	2,400	9,024.00	0.00
1,159	600497	驰宏锌锗	1,200	8,772.00	0.00
1,160	300773	拉卡拉	300	8,544.00	0.00
1,161	301100	风光股份	400	8,524.00	0.00
1,162	600508	上海能源	700	8,239.00	0.00
1,163	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
1,164	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
1,165	600388	龙净环保	500	8,155.00	0.00
1,166	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
1,167	300699	光威复材	200	7,892.00	0.00
1,168	300013	新宁物流	2,000	7,880.00	0.00
1,169	000761	本钢板材	2,300	7,705.00	0.00
1,170	002948	青岛银行	1,700	7,616.00	0.00
1,171	600748	上实发展	1,400	7,588.00	0.00
1,172	600971	恒源煤电	1,200	7,488.00	0.00
1,173	002326	永太科技	300	7,476.00	0.00
1,174	000016	深康佳 A	1,500	7,455.00	0.00
1,175	601156	东航物流	400	7,364.00	0.00
1,176	002772	众兴菌业	500	7,295.00	0.00
1,177	600663	陆家嘴	900	7,119.00	0.00
1,178	600874	创业环保	1,100	6,534.00	0.00
1,179	300487	蓝晓科技	100	6,175.00	0.00
1,180	600369	西南证券	1,300	5,824.00	0.00
1,181	300158	振东制药	1,000	5,810.00	0.00
1,182	002745	木林森	600	5,742.00	0.00
1,183	301321	翰博高新	300	5,715.00	0.00
1,184	603882	金域医学	200	5,672.00	0.00

1,185	300285	国瓷材料	200	5,482.00	0.00
1,186	002563	森马服饰	1,000	5,420.00	0.00
1,187	002614	奥佳华	700	5,117.00	0.00
1,188	600862	中航高科	200	4,726.00	0.00
1,189	000552	甘肃能化	1,900	4,389.00	0.00
1,190	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
1,191	600569	安阳钢铁	1,800	4,050.00	0.00
1,192	600763	通策医疗	100	4,021.00	0.00
1,193	300085	银之杰	100	4,009.00	0.00
1,194	600893	航发动力	100	4,003.00	0.00
1,195	603127	昭衍新药	100	3,501.00	0.00
1,196	603839	安正时尚	400	3,268.00	0.00
1,197	688018	乐鑫科技	18	3,060.00	0.00
1,198	001330	博纳影业	400	3,040.00	0.00
1,199	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
1,200	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
1,201	601208	东材科技	100	2,709.00	0.00
1,202	301073	君亭酒店	100	2,606.00	0.00
1,203	000400	许继电气	100	2,571.00	0.00
1,204	600595	中孚实业	200	1,570.00	0.00
1,205	001289	龙源电力	100	1,504.00	0.00
1,206	603126	中材节能	200	1,344.00	0.00
1,207	301279	金道科技	30	1,038.00	0.00
1,208	300459	汤姆猫	200	918.00	0.00
1,209	600208	衢州发展	200	774.00	0.00
1,210	601918	新集能源	100	661.00	0.00
1,211	600635	大众公用	100	654.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601688	华泰证券	21,093,520.82	2.01
2	600519	贵州茅台	13,391,720.00	1.28
3	688256	寒武纪-U	12,173,107.14	1.16
4	300124	汇川技术	11,520,534.00	1.10
5	002050	三花智控	11,154,487.00	1.06
6	688188	柏楚电子	10,548,391.01	1.01
7	300750	宁德时代	10,092,338.00	0.96

8	300394	天孚通信	8,367,299.00	0.80
9	002463	沪电股份	8,217,966.00	0.78
10	688041	海光信息	8,126,227.26	0.78
11	600900	长江电力	8,048,546.00	0.77
12	688072	拓荆科技	7,424,913.91	0.71
13	300674	宇信科技	7,350,889.40	0.70
14	300059	东方财富	7,287,724.00	0.70
15	601318	中国平安	7,287,204.00	0.70
16	688981	中芯国际	7,246,660.20	0.69
17	603296	华勤技术	7,143,232.00	0.68
18	300476	胜宏科技	6,998,654.00	0.67
19	300033	同花顺	6,683,061.00	0.64
20	688111	金山办公	6,636,446.57	0.63

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

8.4.2 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	601688	华泰证券	22,682,814.04	2.16
2	600519	贵州茅台	15,110,675.00	1.44
3	300124	汇川技术	14,836,324.00	1.42
4	688256	寒武纪-U	12,014,806.81	1.15
5	002463	沪电股份	10,973,757.80	1.05
6	002050	三花智控	10,792,598.00	1.03
7	688188	柏楚电子	10,662,143.69	1.02
8	688111	金山办公	10,258,303.09	0.98
9	300750	宁德时代	8,392,284.00	0.80
10	688041	海光信息	7,802,818.92	0.74
11	600900	长江电力	7,620,686.00	0.73
12	300394	天孚通信	7,607,520.00	0.73
13	688072	拓荆科技	7,362,580.01	0.70
14	603296	华勤技术	6,991,180.00	0.67
15	300674	宇信科技	6,863,962.00	0.65
16	688981	中芯国际	6,842,500.43	0.65

17	603288	海天味业	6,251,028.60	0.60
18	300059	东方财富	6,242,441.00	0.60
19	300476	胜宏科技	6,208,240.00	0.59
20	601225	陕西煤业	6,179,134.00	0.59

8.4.3 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	1,992,675,831.87
卖出股票收入（成交）总额	1,861,614,987.02

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	506,030,936.44	15.46
	其中：政策性金融债	244,562,197.26	7.47
4	企业债券	578,012,087.66	17.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,302,411,863.70	70.34
7	可转债（可交换债）	17,791,356.21	0.54
8	同业存单	49,171,029.04	1.50
9	其他	-	-
10	合计	3,453,417,273.05	105.50

8.6 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	102480795.IB	24 苏州国	1,200,000	123,581,227.40	3.78

		际 MTN001A			
2	250421.IB	25 农发 21	1,100,000	110,887,745.21	3.39
3	102481391.IB	24 大连港 MTN002A	1,000,000	102,748,345.21	3.14
4	242580007.IB	25 兴业银 行永续债 01BC	1,000,000	100,834,367.12	3.08
5	102280067.IB	22 陕煤化 MTN001	900,000	95,125,122.74	2.91

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 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	658,227.41
2	应收清算款	35,421,032.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	254,639.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,333,899.22

8.12.4 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	132026.SH	G 三峡 EB2	803,377.77	0.02

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
广发鑫和混合 A	5,734	103,554.78	34,288,661.59	5.77%	559,494,447.46	94.23%
广发鑫和混合 C	13,302	126,613.83	569,051,540.06	33.79%	1,115,165,654. 69	66.21%
合计	19,036	119,668.01	603,340,201.65	26.49%	1,674,660,102. 15	73.51%

9.2 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	广发鑫和混合 A	416,127.41	0.0701%
	广发鑫和混合 C	144,435.41	0.0086%
	合计	560,562.82	0.0246%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	广发鑫和混合 A	10~50
	广发鑫和混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	广发鑫和混合 A	10~50
	广发鑫和混合 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发鑫和混合 A	广发鑫和混合 C
基金合同生效日（2018 年 1 月 16 日）基金份额总额	401,995,726.76	795,023.34
本报告期期初基金份额总额	199,156,746.57	557,209,097.88
本报告期基金总申购份额	792,394,610.59	4,408,440,934.04
减：本报告期基金总赎回份额	397,768,248.11	3,281,432,837.17

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	593,783,109.05	1,684,217,194.75

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 8 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 56,000 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			额的比例		比例	
广发证券	3	3,853,737,636.77	100.00%	1,225,176.00	100.00%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择标准

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

2、选择流程

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	2,937,239,134.82	100.00%	4,077,210,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年	中国证监会规定报刊及	2025-01-21

	第 4 季度报告提示性公告	网站	
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-29
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-07-18
5	关于广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额调整赎回费率并修订法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-28
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-30
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-28

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者的投资需求，降低投资者的投资成本，经与基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致，本基金管理人自 2025 年 8 月 29 日起调整本基金 A 类基金份额（基金代码：004750）的赎回费率，同时根据最新法律法规对《广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行了相应修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额调整赎回费率并修订法律文件的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

13.3 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

二〇二六年三月三十日