

# 广发集瑞债券型证券投资基金

## 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	12
§4	管理人报告	13
4.1	基金管理人及基金经理情况	13
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6	审计报告	18
6.1	审计意见	18
6.2	形成审计意见的基础	19
6.3	其他信息	19
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任	19
§7	年度财务报表	20
7.1	资产负债表	20
7.2	利润表	22
7.3	净资产变动表	24
7.4	报表附注	25
§8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	81

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	82
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	82
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	82
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	82
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	82
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12	投资组合报告附注	83
§9	基金份额持有人信息	84
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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	85
§10	开放式基金份额变动	85
§11	重大事件揭示	86
11.1	基金份额持有人大会决议	86
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	86
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4	基金投资策略的改变	86
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	86
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8	其他重大事件	88
§12	影响投资者决策的其他重要信息	88
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	88
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	89
§13	备查文件目录	89
13.1	备查文件目录	89
13.2	存放地点	90
13.3	查阅方式	90

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发集瑞债券型证券投资基金		
基金简称	广发集瑞债券		
基金主代码	003037		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 11 月 18 日		
基金管理人	广发基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	810,981,894.26 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E
下属分级基金的交易代码	003037	003038	025227
报告期末下属分级基金的 份额总额	499,856,639.34 份	225,088,444.34 份	86,036,810.58 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	林盛
	联系电话	020-83936666	010-58560666
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95568
传真		020-34281105	010-57093382
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东 1号保利国际广场南塔31-33楼； 广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		510308	100031
法定代表人		葛长伟	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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		
	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E
本期已实现收益	17,115,072.66	8,707,218.63	697,958.55	4,139,406.65	652.85	-	-2,122,436.07	157,006.54	-
本期利润	18,521,031.28	7,558,300.90	400,901.89	6,725,910.01	1,356.92	-	-210,822.37	932,110.61	-
加权平均基金份额本期利润	0.0662	0.0510	0.0054	0.0240	0.0244	-	-0.0006	0.0427	-
本期加权平均净值利润率	6.19%	4.88%	0.50%	2.36%	2.47%	-	-0.06%	4.31%	-
本期基金份额净值增长率	7.23%	6.80%	2.08%	2.61%	2.29%	-	-0.34%	-0.71%	-
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E
期末可供分配利润	21,549,661.95	5,840,168.19	3,670,185.40	2,697,986.90	-131.84	-	201,684.64	-33,177.85	-
期末可供分配基金份额利润	0.0431	0.0259	0.0427	0.0176	-0.0102	-	0.0007	-0.0242	-
期末基金资产净值	528,531,479.85	233,920,213.29	90,904,668.25	157,496,911.27	12,858.34	-	309,996,059.83	1,337,034.55	-
期末基金份额净值	1.0574	1.0392	1.0566	1.0268	0.9981	-	1.0007	0.9758	-
3.1.3 累计期末指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E

基金份额累计净值增长率	28.92%	24.40%	2.08%	20.23%	16.48%	-	17.17%	13.88%	-
-------------	--------	--------	-------	--------	--------	---	--------	--------	---

注：（1）本基金自 2025 年 8 月 14 日起增设 E 类份额，至披露时点不满一年。

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

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

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

### 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

##### 广发集瑞债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.49%	0.15%	-0.13%	0.07%	1.62%	0.08%
过去六个月	3.92%	0.13%	-1.68%	0.08%	5.60%	0.05%
过去一年	7.23%	0.18%	-2.32%	0.11%	9.55%	0.07%
过去三年	9.65%	0.17%	4.70%	0.10%	4.95%	0.07%
过去五年	9.90%	0.16%	7.29%	0.09%	2.61%	0.07%
自基金合同生效起至今	28.92%	0.13%	8.04%	0.11%	20.88%	0.02%

##### 广发集瑞债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.38%	0.15%	-0.13%	0.07%	1.51%	0.08%
过去六个月	3.70%	0.13%	-1.68%	0.08%	5.38%	0.05%
过去一年	6.80%	0.18%	-2.32%	0.11%	9.12%	0.07%
过去三年	8.46%	0.17%	4.70%	0.10%	3.76%	0.07%
过去五年	7.80%	0.16%	7.29%	0.09%	0.51%	0.07%
自基金合同生效起至今	24.40%	0.13%	8.04%	0.11%	16.36%	0.02%

##### 广发集瑞债券 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	0.15%	-0.13%	0.07%	1.57%	0.08%
自基金合同生效起至今	2.08%	0.14%	-1.14%	0.08%	3.22%	0.06%

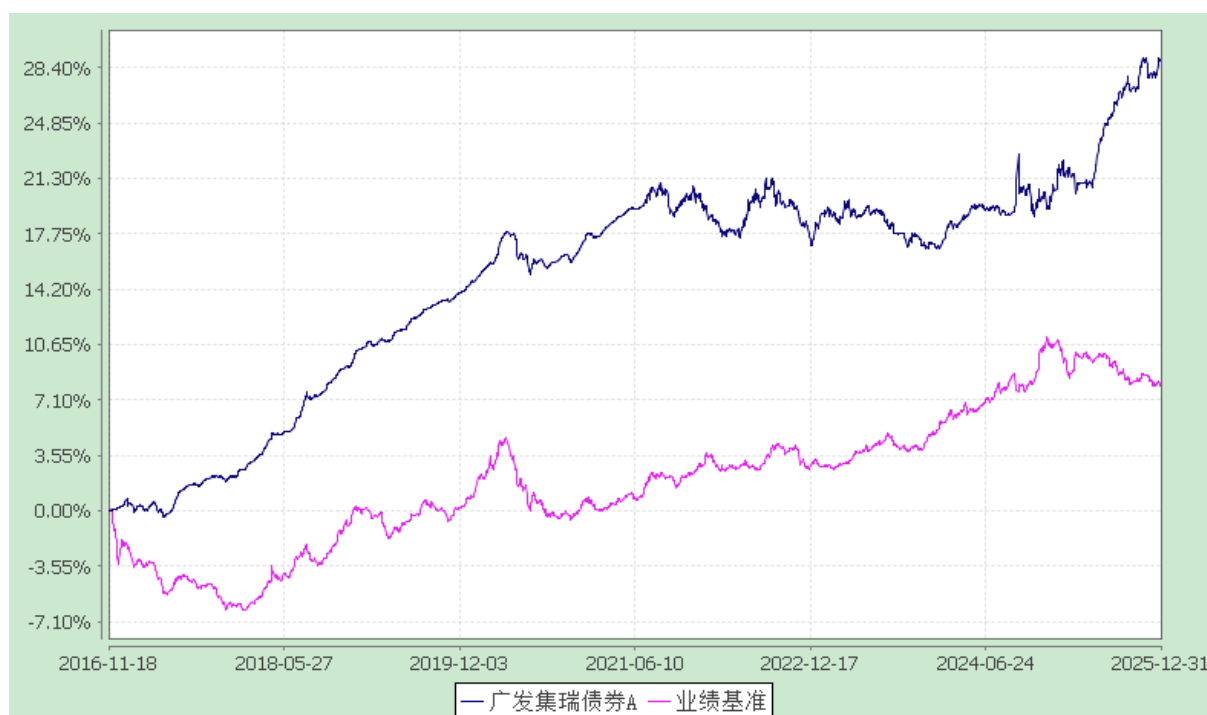
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集瑞债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月18日至2025年12月31日)

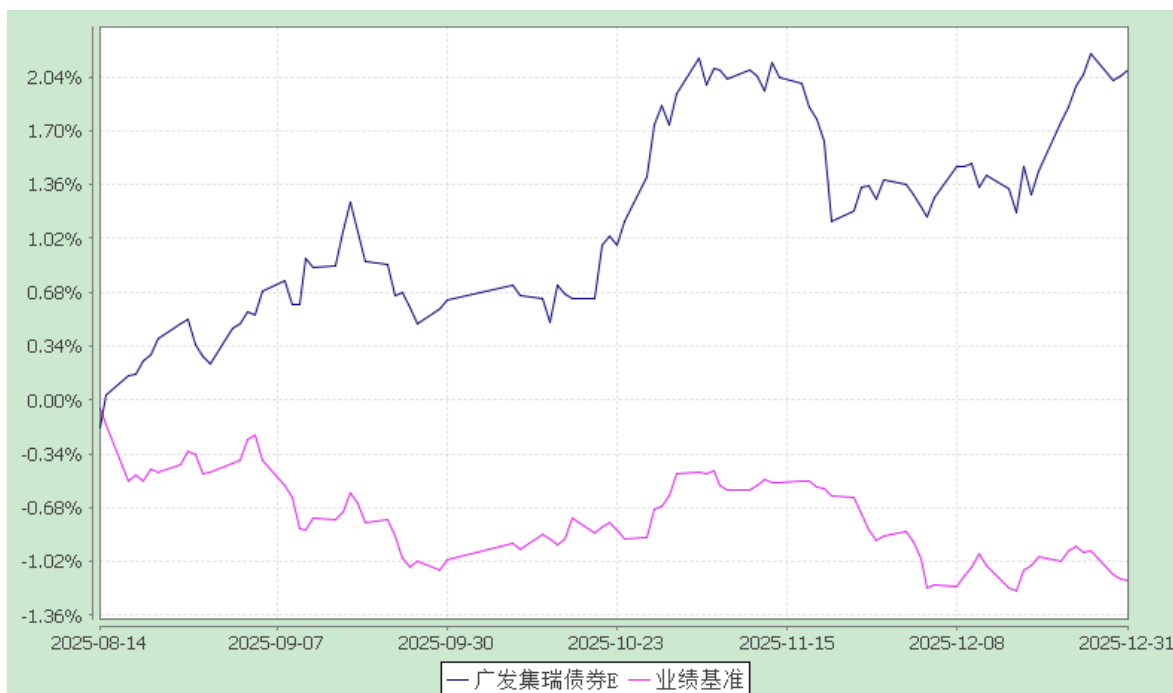
广发集瑞债券 A



广发集瑞债券 C



### 广发集瑞债券 E

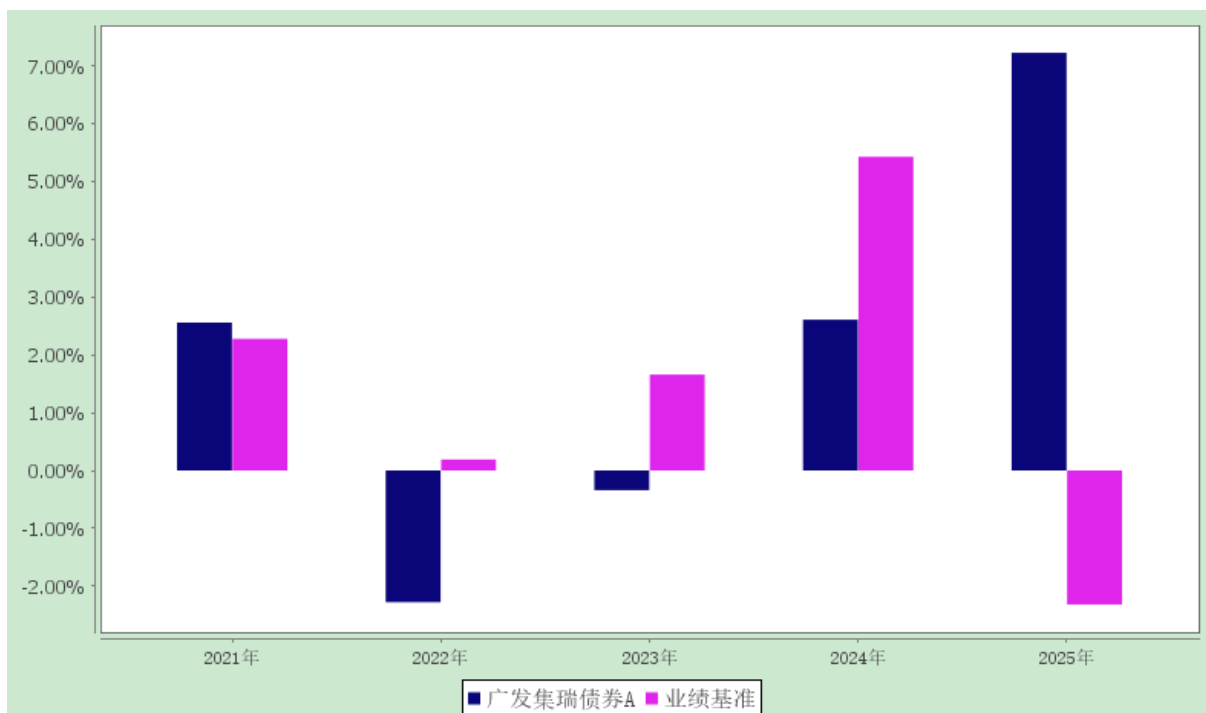


注：本基金自 2025 年 8 月 14 日起增设 E 类份额。

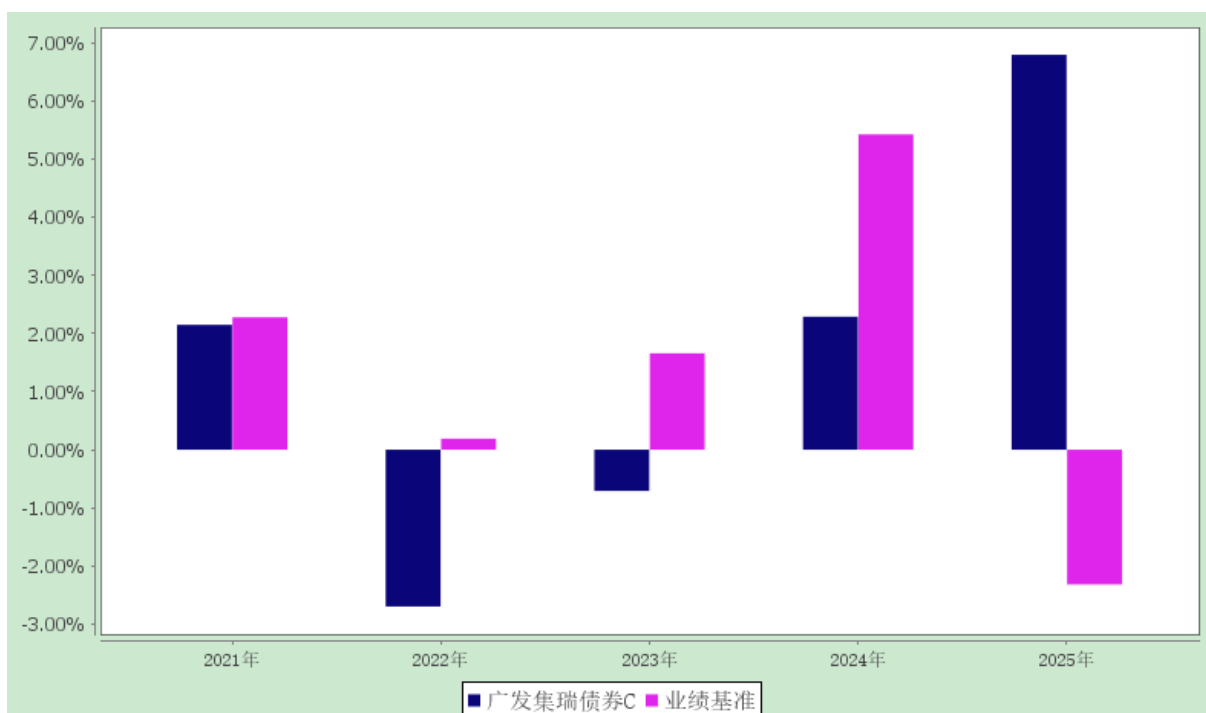
### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发集瑞债券型证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

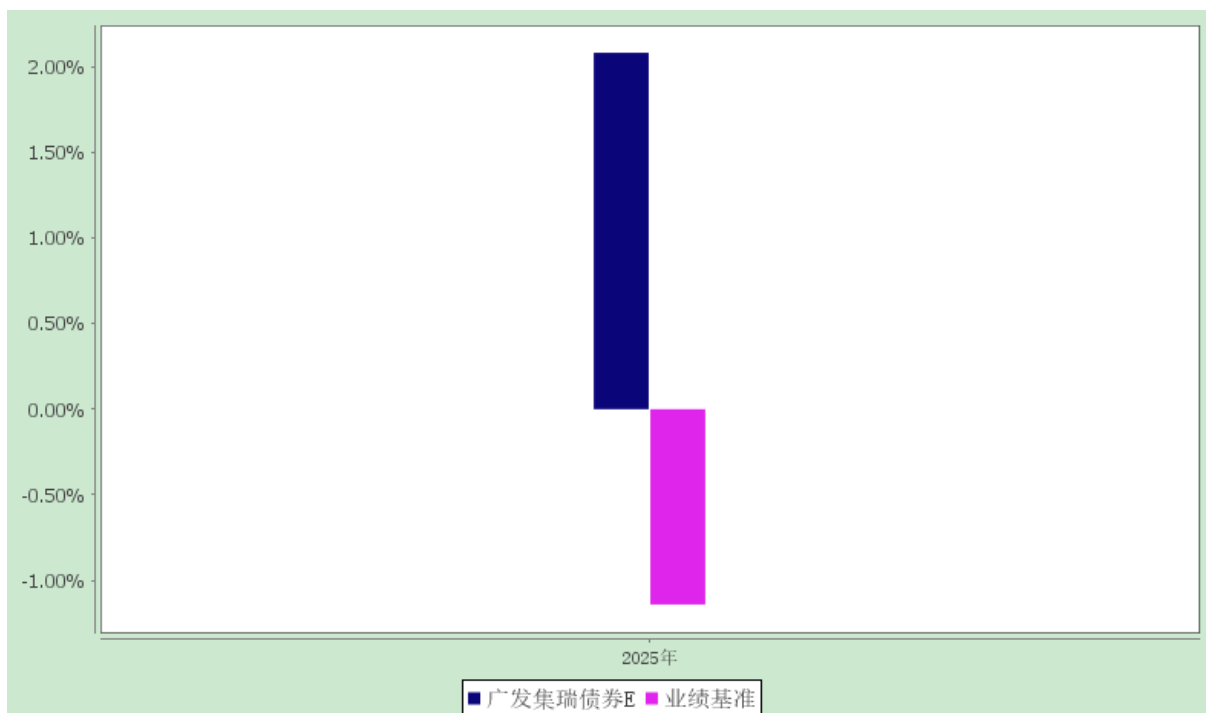
### 广发集瑞债券 A



广发集瑞债券 C



广发集瑞债券 E



注：本基金自 2025 年起增设 E 类份额，E 类份额增设当年（2025 年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

广发集瑞债券 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.433	18,770,178.19	3,270,820.71	22,040,998.90	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.433	18,770,178.19	3,270,820.71	22,040,998.90	-

广发集瑞债券 C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.266	8,203,563.34	963,728.07	9,167,291.41	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.266	8,203,563.34	963,728.07	9,167,291.41	-

广发集瑞债券 E

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.433	4,543,682.15	1,930,701.35	6,474,383.50	-
合计	0.433	4,543,682.15	1,930,701.35	6,474,383.50	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴迪	本基金的基金经理；广发聚源债券型证券投资基金(LOF)的基金经理；广发景丰纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发景益债券型证券投资基金的基金经理；广发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	2025-05-07	-	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

	理；特定策略投资部总经理				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)。
邱世磊	本基金的基金经理；广发稳裕混合型证券投资基金的基金经理；广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发恒裕一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集盛债券型证券投资基金的基金经理	2021-10-14	2025-05-07	16.8 年	邱世磊先生，中国籍，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任海通证券股份有限公司债券业务部项目主办人，渤海证券股份有限公司资产管理总部高级研究员、投资经理，东兴证券股份有限公司资产管理业务总部高级投资经理、高级副总裁，民生加银基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、基金经理、广发集瑞债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 10 月 14 日至 2025 年 5 月 7 日)、广发恒祥债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 5 月 6 日至 2025 年 5 月 7 日)。

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 7.23%，C 类基金份额净值增长率为 6.80%，同期业绩比较基准收益率为-2.32%；本报告期内，本基金 E 类基金份额净值增长率为 2.08%，同期业绩比较基准收益率为-1.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 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，2025 年 12 月 2 日广发集瑞债券 A 类每 10 份基金份额分配 0.433 元，广发集瑞债券 C 类每 10 份基金份额分配 0.266 元，广发集瑞债券 E 类每 10 份基金份额分配 0.433 元。上述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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

#### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70009676\_G141 号

广发集瑞债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了广发集瑞债券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，后附的广发集瑞债券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，公允反映了广发集瑞债券型证券投资基金 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，我们独立于广发集瑞债券型证券投资基金，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

广发集瑞债券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集瑞债券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集瑞债券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，就可能对广发集瑞债券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集瑞债券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：广发集瑞债券型证券投资基金

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
----	-----	-------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	126,860,057.36	1,442,577.13
结算备付金		14,664,404.68	4,285,365.15
存出保证金		193,228.49	104,002.32
交易性金融资产	7.4.7.2	756,063,731.61	164,945,757.44
其中：股票投资		53,819,921.87	22,189,189.62
基金投资		-	-
债券投资		702,243,809.74	142,756,567.82
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		392,538.36	5,482,761.50
应收股利		-	-
应收申购款		285,512.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		898,459,472.50	176,260,463.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		39,956,135.94	17,889,320.38
应付清算款		486,393.79	471,014.19
应付赎回款		3,454,635.53	10,621.64
应付管理人报酬		399,051.59	65,361.32
应付托管费		79,810.30	13,072.25
应付销售服务费		104,419.90	10.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,378.87	5,526.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	596,285.19	295,766.78
负债合计		45,103,111.11	18,750,693.93
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	810,981,894.26	153,402,863.31
未分配利润	7.4.7.9	42,374,467.13	4,106,906.30
净资产合计		853,356,361.39	157,509,769.61
负债和净资产总计		898,459,472.50	176,260,463.54

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，广发集瑞债券 A 基金份额净值人民币 1.0574 元，基金份额总额 499,856,639.34 份；广发集瑞债券 C 基金份额净值人民币 1.0392 元，基金份额总额 225,088,444.34 份；广发集瑞债券 E 基金份额净值人民币 1.0566 元，基金份额总额 86,036,810.58 份；总份额总额 810,981,894.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发集瑞债券型证券投资基金

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	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
一、营业总收入		31,252,906.95	9,237,789.59

1.利息收入		531,465.55	129,226.19
其中：存款利息收入	7.4.7.10	226,630.47	92,746.01
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		304,835.08	36,480.18
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		30,448,383.46	6,521,119.58
其中：股票投资收益	7.4.7.11	14,188,504.46	-2,613,530.16
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	16,079,839.88	8,441,891.74
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	-57,014.00	14,356.65
股利收益	7.4.7.17	237,053.12	678,401.35
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	-40,015.77	2,587,207.43
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	313,073.71	236.39
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,772,672.88</b>	<b>2,510,522.66</b>
1. 管理人报酬		2,401,317.56	1,429,741.96
2. 托管费		480,263.51	285,948.34
3. 销售服务费		632,203.80	224.86
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,022,724.04	571,153.20
其中：卖出回购金融资产支出		1,022,724.04	571,153.20
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-

7. 税金及附加		15,076.75	23,638.31
8. 其他费用	7.4.7.21	221,087.22	199,815.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>26,480,234.07</b>	<b>6,727,266.93</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>26,480,234.07</b>	<b>6,727,266.93</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>26,480,234.07</b>	<b>6,727,266.93</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：广发集瑞债券型证券投资基金

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	153,402,863.31	4,106,906.30	157,509,769.61
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	153,402,863.31	4,106,906.30	157,509,769.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	657,579,030.95	38,267,560.83	695,846,591.78
（一）、综合收益总额	-	26,480,234.07	26,480,234.07
（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）	657,579,030.95	49,470,000.57	707,049,031.52
其中：1.基金申购款	1,546,378,315.26	98,934,807.62	1,645,313,122.88
2.基金赎回款	-888,799,284.31	-49,464,807.05	-938,264,091.36
（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）	-	-37,682,673.81	-37,682,673.81
四、本期期末净资产	810,981,894.26	42,374,467.13	853,356,361.39
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	311,164,587.59	168,506.79	311,333,094.38
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	311,164,587.59	168,506.79	311,333,094.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-157,761,724.28	3,938,399.51	-153,823,324.77
(一)、综合收益总额	-	6,727,266.93	6,727,266.93
(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)	-157,761,724.28	-2,788,867.42	-160,550,591.70
其中：1.基金申购款	55,336,712.43	1,039,807.24	56,376,519.67
2.基金赎回款	-213,098,436.71	-3,828,674.66	-216,927,111.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	153,402,863.31	4,106,906.30	157,509,769.61

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

广发集瑞债券型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2016]1359 号《关于准予广发集瑞债券型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发集瑞债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2016 年 11 月 7 日向社会公开发发行募集并于 2016 年 11 月 18 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2016 年 11 月 7 日至 2016 年 11 月 14 日止，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 200,055,784.72 元，有效认购户数为 225 户。其中广发集瑞债券 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 200,031,240.19 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 4,000.62 元；广发集瑞债券 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 20,543.52 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 0.39 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会

会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额,自 2025 年 8 月 14 日起增设 E 类基金份额。

#### 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	126,860,057.36	1,442,577.13
等于：本金	126,851,360.32	1,441,608.44
加：应计利息	8,697.04	968.69
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	126,860,057.36	1,442,577.13

##### 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	53,013,066.36	-	53,819,921.87	806,855.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	208,699,641.61	1,766,616.94	210,115,971.84	-350,286.71
	银行间市场	489,448,175.07	2,674,837.90	492,127,837.90	4,824.93
	合计	698,147,816.68	4,441,454.84	702,243,809.74	-345,461.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	751,160,883.04	4,441,454.84	756,063,731.61	461,393.73	
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	22,399,395.37	-	22,189,189.62	-210,205.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	837,303.81	77,476,213.95	390,521.55
	银行间市场	738,453.87	65,280,353.87	321,093.70
	合计	1,575,757.68	142,756,567.82	711,615.25
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	162,868,590.26	1,575,757.68	164,945,757.44	501,409.50

#### 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	77.57	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	432,907.62	132,766.78
其中：交易所市场	404,415.14	126,198.25
银行间市场	28,492.48	6,568.53
应付利息	-	-
预提费用	163,300.00	163,000.00
合计	596,285.19	295,766.78

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发集瑞债券 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	153,389,981.01	153,389,981.01
本期申购	703,162,634.06	703,162,634.06
本期赎回（以“-”号填列）	-356,695,975.73	-356,695,975.73
本期末	499,856,639.34	499,856,639.34

金额单位：人民币元

广发集瑞债券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	12,882.30	12,882.30
本期申购	626,877,993.06	626,877,993.06
本期赎回（以“-”号填列）	-401,802,431.02	-401,802,431.02
本期末	225,088,444.34	225,088,444.34

金额单位：人民币元

广发集瑞债券E		
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
本期申购	216,337,688.14	216,337,688.14
本期赎回（以“-”号填列）	-130,300,877.56	-130,300,877.56
本期末	86,036,810.58	86,036,810.58

注：1、自 2025 年 8 月 14 日起，本基金增设 E 类份额，份额首次确认日为 2025 年 8 月 15 日。

2、申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发集瑞债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,697,986.90	1,408,943.36	4,106,930.26
本期期初	2,697,986.90	1,408,943.36	4,106,930.26
本期利润	17,115,072.66	1,405,958.62	18,521,031.28
本期基金份额交易产生的变动数	23,777,601.29	4,310,276.58	28,087,877.87
其中：基金申购款	42,508,381.27	8,654,362.44	51,162,743.71
基金赎回款	-18,730,779.98	-4,344,085.86	-23,074,865.84
本期已分配利润	-22,040,998.90	-	-22,040,998.90
本期末	21,549,661.95	7,125,178.56	28,674,840.51

单位：人民币元

广发集瑞债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-131.84	107.88	-23.96
本期期初	-131.84	107.88	-23.96
本期利润	8,707,218.63	-1,148,917.73	7,558,300.90
本期基金份额交易产生的变动数	6,300,372.81	4,140,410.61	10,440,783.42
其中：基金申购款	20,643,752.86	7,492,560.72	28,136,313.58
基金赎回款	-14,343,380.05	-3,352,150.11	-17,695,530.16
本期已分配利润	-9,167,291.41	-	-9,167,291.41
本期末	5,840,168.19	2,991,600.76	8,831,768.95

单位：人民币元

广发集瑞债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	697,958.55	-297,056.66	400,901.89
本期基金份额交易产生的	9,446,610.35	1,494,728.93	10,941,339.28

变动数			
其中：基金申购款	16,534,226.67	3,101,523.66	19,635,750.33
基金赎回款	-7,087,616.32	-1,606,794.73	-8,694,411.05
本期已分配利润	-6,474,383.50	-	-6,474,383.50
本期末	3,670,185.40	1,197,672.27	4,867,857.67

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	122,101.50	26,274.81
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	91,381.49	65,464.49
其他	13,147.48	1,006.71
合计	226,630.47	92,746.01

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	14,188,504.46	-2,613,530.16
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	14,188,504.46	-2,613,530.16

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	820,704,749.90	316,104,807.98
减：卖出股票成本总额	805,277,170.64	318,175,214.72

减：交易费用	1,239,074.80	543,123.42
买卖股票差价收入	14,188,504.46	-2,613,530.16

#### 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	8,517,606.59	8,136,043.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,562,233.29	305,847.81
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	16,079,839.88	8,441,891.74

##### 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	5,089,816,047.49	552,776,613.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,059,379,574.17	546,499,420.66
减：应计利息总额	22,776,320.13	5,957,664.95
减：交易费用	97,919.90	13,680.38
买卖债券差价收入	7,562,233.29	305,847.81

#### 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

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
国债期货投资收益	-57,014.00	14,356.65

## 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	237,053.12	678,401.35
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	237,053.12	678,401.35

## 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	-40,015.77	2,587,207.43
——股票投资	1,017,061.26	135,908.00
——债券投资	-1,057,077.03	2,451,299.43
——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	-40,015.77	2,587,207.43

## 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	262,045.87	191.06
基金转换费收入	50,637.84	45.33
其他	390.00	-
合计	313,073.71	236.39

#### 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	34,000.00	34,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	29,487.22	8,615.99
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,600.00	1,200.00
合计	221,087.22	199,815.99

#### 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
中国民生银行股份有限公司	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

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股票交易。

###### 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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

##### 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	2,401,317.56	1,429,741.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	370,163.35	25.72
应支付基金管理人的净管理费	2,031,154.21	1,429,716.24

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 0.50%。

###### 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	480,263.51	285,948.34

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

约定年费率为 0.10%。

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			
	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E	合计
广发基金管理有限公司	-	160,582.35	22.54	160,604.89
广发证券股份有限公司	-	2.23	-	2.23
合计	-	160,584.58	22.54	160,607.12
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			
	广发集瑞债券A	广发集瑞债券C	广发集瑞债券E	合计
广发基金管理有限公司	-	169.83	-	169.83
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
合计	-	169.83	-	169.83

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额、E 类基金份额的销售服务费按前一日各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/E 类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

C 类基金份额、E 类基金份额的约定年费率分别为 0.40%、0.10%。

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

中国民生银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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
中国民生银行股份有限公司	10,229,315.43	-	-	-	-	-

**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固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固有资金投资本基金。

**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**

广发集瑞债券 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发集瑞债券 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发集瑞债券 E

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	126,860,057.36	122,101.50	1,442,577.13	26,274.81

限公司				
-----	--	--	--	--

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国民生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**

广发集瑞债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025-12-02	-	2025-12-02	0.433	18,770,178.19	3,270,820.71	22,040,998.90	-
合计				0.433	18,770,178.19	3,270,820.71	22,040,998.90	-

广发集瑞债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025-12-02	-	2025-12-02	0.266	8,203,563.34	963,728.07	9,167,291.41	-
合计				0.266	8,203,563.34	963,728.07	9,167,291.41	-

广发集瑞债券 E

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场 外					
1	2025-12-02	-	2025- 12-02	0.433	4,543,682.15	1,930,701.3 5	6,474,383.50	-
合计				0.433	4,543,682.15	1,930,701.3 5	6,474,383.50	-

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

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证券。

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 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项 停牌	283.75	2026-01-05	278.00	8,152.00	2,217,224.05	2,313,130.00	-
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项 停牌	78.81	2026-01-15	86.69	900.00	68,679.90	70,929.00	-

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 39,956,135.94 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
250431	25 农发 31	2026-01-05	100.47	425,000.00	42,699,668.49
合计				425,000.00	42,699,668.49

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，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回

购证券款，无抵押债券。

#### 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	1,011,155.07	6,318,489.64
合计	1,011,155.07	6,318,489.64

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、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	266,432,819.15	34,535,608.57
AAA 以下	775,688.71	16,112,569.44
未评级	434,024,146.81	85,789,900.17
合计	701,232,654.67	136,438,078.18

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。

#### 7.4.13.3 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
<b>资产</b>					
货币资金	126,860,057.36	-	-	-	126,860,057.36
结算备付金	14,664,404.68	-	-	-	14,664,404.68
存出保证金	193,228.49	-	-	-	193,228.49
交易性金融资产	84,981,507.30	415,949,410.42	201,312,892.02	53,819,921.87	756,063,731.61
应收清算款	-	-	-	392,538.36	392,538.36
应收申购款	-	-	-	285,512.00	285,512.00
资产总计	226,699,197.83	415,949,410.42	201,312,892.02	54,497,972.23	898,459,472.50
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	39,956,135.94	-	-	-	39,956,135.94
应付清算款	-	-	-	486,393.79	486,393.79
应付赎回款	-	-	-	3,454,635.53	3,454,635.53
应付管理人报酬	-	-	-	399,051.59	399,051.59
应付托管费	-	-	-	79,810.30	79,810.30
应付销售服务费	-	-	-	104,419.90	104,419.90
应交税费	-	-	-	26,378.87	26,378.87
其他负债	-	-	-	596,285.19	596,285.19
负债总计	39,956,135.94	-	-	5,146,975.17	45,103,111.11

					1
利率敏感度缺口	186,743,061.89	415,949,410.42	201,312,892.02	49,350,997.06	853,356,361.39
<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	1,442,577.13	-	-	-	1,442,577.13
结算备付金	4,285,365.15	-	-	-	4,285,365.15
存出保证金	104,002.32	-	-	-	104,002.32
交易性金融资产	87,573,619.44	44,495,661.09	10,687,287.29	22,189,189.62	164,945,757.44
应收清算款	-	-	-	5,482,761.50	5,482,761.50
资产总计	93,405,564.04	44,495,661.09	10,687,287.29	27,671,951.12	176,260,463.54
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	17,889,320.38	-	-	-	17,889,320.38
应付清算款	-	-	-	471,014.19	471,014.19
应付赎回款	-	-	-	10,621.64	10,621.64
应付管理人报酬	-	-	-	65,361.32	65,361.32
应付托管费	-	-	-	13,072.25	13,072.25
应付销售服务费	-	-	-	10.38	10.38
应交税费	-	-	-	5,526.99	5,526.99
其他负债	-	-	-	295,766.78	295,766.78
负债总计	17,889,320.38	-	-	861,373.55	18,750,693.93
利率敏感度缺口	75,516,243.66	44,495,661.09	10,687,287.29	26,810,577.57	157,509,769.61

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	-7,407,321.49	-837,952.40
	市场利率下降 25 个基点	7,541,875.10	879,088.11

#### 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	53,819,921.87	6.31	22,189,189.62	14.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,473,815.25	0.41	20,193,155.00	12.82
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	57,293,737.12	6.71	42,382,344.62	26.91

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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%	2,227,112.90	1,325,214.54
下降 5%	-2,227,112.90	-1,325,214.54	

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	54,909,678.12	42,382,344.62
第二层次	701,154,053.49	122,563,412.82
第三层次	-	-
合计	756,063,731.61	164,945,757.44

##### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无需披露的第三层次公允价值余额及变动情况。

###### 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

本基金本报告期末及上年度末无需披露的使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的项目。

##### 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	53,819,921.87	5.99
	其中：股票	53,819,921.87	5.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	702,243,809.74	78.16
	其中：债券	702,243,809.74	78.16
	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	141,524,462.04	15.75
8	其他各项资产	871,278.85	0.10
9	合计	898,459,472.50	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	390,883.00	0.05
B	采矿业	1,413,646.00	0.17
C	制造业	35,534,822.01	4.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,097,888.00	0.25
E	建筑业	253,650.00	0.03
F	批发和零售业	1,659,560.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,250,046.00	0.15
H	住宿和餐饮业	36,143.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,251,017.88	0.26
J	金融业	3,893,952.00	0.46
K	房地产业	711,586.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,470,010.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	1,249,388.98	0.15

N	水利、环境和公共设施管理业	624,887.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,075.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	934,530.00	0.11
S	综合	24,837.00	0.00
	合计	53,819,921.87	6.31

### 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	688012	中微公司	8,152	2,313,130.00	0.27
2	300750	宁德时代	1,500	550,890.00	0.06
3	600519	贵州茅台	400	550,872.00	0.06
4	300308	中际旭创	700	427,000.00	0.05
5	601318	中国平安	6,200	424,080.00	0.05
6	300008	天海防务	39,900	314,811.00	0.04
7	300140	节能环境	46,400	314,128.00	0.04
8	300071	福石控股	48,100	314,093.00	0.04
9	601899	紫金矿业	9,100	313,677.00	0.04
10	300775	三角防务	10,300	313,120.00	0.04
11	601326	秦港股份	89,200	311,308.00	0.04
12	688365	光云科技	18,434	310,981.58	0.04
13	688062	迈威生物-U	8,011	308,183.17	0.04
14	601019	山东出版	35,600	307,584.00	0.04
15	688182	灿勤科技	10,385	306,565.20	0.04
16	002246	北化股份	16,900	304,538.00	0.04
17	300438	鹏辉能源	5,700	303,354.00	0.04
18	300129	泰胜风能	28,900	302,294.00	0.04
19	300072	海新能科	65,200	299,920.00	0.04
20	301518	长华化学	8,300	295,231.00	0.03
21	605228	神通科技	19,700	294,121.00	0.03
22	301038	深水规院	12,500	293,125.00	0.03
23	600057	厦门象屿	34,100	290,532.00	0.03
24	000421	南京公用	42,000	290,220.00	0.03

25	600724	宁波富达	50,300	289,728.00	0.03
26	605099	共创草坪	8,100	289,089.00	0.03
27	300435	中泰股份	13,000	288,860.00	0.03
28	300662	科锐国际	11,400	288,762.00	0.03
29	002940	昂利康	8,600	288,272.00	0.03
30	300127	银河磁体	9,500	288,135.00	0.03
31	603335	迪生力	51,100	287,693.00	0.03
32	002636	金安国纪	17,200	287,412.00	0.03
33	002696	百洋股份	40,600	287,042.00	0.03
34	601388	怡球资源	95,300	286,853.00	0.03
35	603185	弘元绿能	9,400	286,700.00	0.03
36	600036	招商银行	6,800	286,280.00	0.03
37	002016	世荣兆业	49,500	286,110.00	0.03
38	002593	日上集团	48,400	286,044.00	0.03
39	002314	南山控股	100,000	285,000.00	0.03
40	001258	立新能源	40,000	284,400.00	0.03
41	603489	八方股份	9,300	284,394.00	0.03
42	001313	粤海饲料	38,800	284,016.00	0.03
43	001896	豫能控股	54,600	283,920.00	0.03
44	300358	楚天科技	29,000	283,910.00	0.03
45	300858	科拓生物	16,900	283,413.00	0.03
46	603999	读者传媒	40,300	283,309.00	0.03
47	603190	亚通精工	10,500	283,185.00	0.03
48	002664	信质集团	11,800	282,728.00	0.03
49	603787	新日股份	20,100	282,606.00	0.03
50	688678	福立旺	11,643	281,527.74	0.03
51	002486	嘉麟杰	90,400	281,144.00	0.03
52	301082	久盛电气	15,700	281,030.00	0.03
53	600078	澄星股份	29,300	280,987.00	0.03
54	002671	龙泉股份	53,600	280,864.00	0.03
55	301555	惠柏新材	8,400	280,812.00	0.03
56	000600	建投能源	32,900	280,637.00	0.03
57	603280	南方路机	7,500	280,500.00	0.03
58	600844	金煤科技	97,300	280,224.00	0.03
59	603949	雪龙集团	14,900	279,673.00	0.03
60	300157	新锦动力	61,600	279,664.00	0.03
61	300106	西部牧业	26,000	279,500.00	0.03
62	603697	有友食品	22,800	279,300.00	0.03
63	688091	上海谊众	5,936	278,992.00	0.03
64	300882	万胜智能	14,800	278,240.00	0.03
65	688321	微芯生物	9,512	277,940.64	0.03
66	000017	深中华 A	35,300	277,811.00	0.03
67	300861	美畅股份	18,600	277,698.00	0.03
68	300464	星徽股份	43,800	277,692.00	0.03

69	601086	国芳集团	27,300	277,641.00	0.03
70	600936	广西广电	65,700	277,254.00	0.03
71	300063	天龙集团	32,300	276,811.00	0.03
72	603059	倍加洁	9,200	276,736.00	0.03
73	300707	威唐工业	16,800	276,360.00	0.03
74	600478	科力远	40,100	276,289.00	0.03
75	600067	冠城新材	66,300	275,145.00	0.03
76	301365	矩阵股份	11,500	274,160.00	0.03
77	300080	易成新能	56,400	274,104.00	0.03
78	002418	康盛股份	57,400	273,798.00	0.03
79	600382	广东明珠	38,400	273,792.00	0.03
80	301108	洁雅股份	8,180	272,066.80	0.03
81	688256	寒武纪-U	200	271,110.00	0.03
82	605118	力鼎光电	9,000	270,990.00	0.03
83	603900	莱绅通灵	32,000	270,720.00	0.03
84	600469	风神股份	39,000	270,660.00	0.03
85	601022	宁波远洋	29,400	269,598.00	0.03
86	603616	韩建河山	51,500	267,285.00	0.03
87	688280	精进电动-UW	30,683	266,942.10	0.03
88	003030	祖名股份	13,200	266,508.00	0.03
89	603629	利通电子	10,000	266,500.00	0.03
90	300407	凯发电气	23,400	264,888.00	0.03
91	000892	欢瑞世纪	37,900	264,542.00	0.03
92	301156	美农生物	15,100	264,401.00	0.03
93	603985	恒润股份	17,300	263,652.00	0.03
94	300945	曼卡龙	16,300	263,408.00	0.03
95	603500	祥和实业	21,900	262,362.00	0.03
96	603126	中材节能	39,000	262,080.00	0.03
97	603231	索宝蛋白	14,300	261,976.00	0.03
98	301388	欣灵电气	8,600	261,268.00	0.03
99	002293	罗莱生活	25,400	260,858.00	0.03
100	600569	安阳钢铁	115,300	259,425.00	0.03
101	300739	明阳电路	14,100	259,158.00	0.03
102	002356	赫美集团	65,400	258,984.00	0.03
103	300511	雪榕生物	41,500	258,960.00	0.03
104	300502	新易盛	600	258,528.00	0.03
105	300774	倍杰特	13,600	258,400.00	0.03
106	300505	川金诺	11,400	255,246.00	0.03
107	300509	新美星	19,800	254,232.00	0.03
108	000333	美的集团	3,000	234,450.00	0.03
109	601166	兴业银行	10,700	225,342.00	0.03
110	600030	中信证券	7,200	206,712.00	0.02
111	601398	工商银行	23,700	187,941.00	0.02
112	002475	立讯精密	3,300	187,143.00	0.02

113	300059	东方财富	7,800	180,804.00	0.02
114	600900	长江电力	6,400	174,016.00	0.02
115	300476	胜宏科技	600	172,548.00	0.02
116	603259	药明康德	1,900	172,216.00	0.02
117	601328	交通银行	20,600	149,350.00	0.02
118	688981	中芯国际	1,205	148,010.15	0.02
119	600276	恒瑞医药	2,200	131,054.00	0.02
120	002594	比亚迪	1,300	127,036.00	0.01
121	600919	江苏银行	12,000	124,800.00	0.01
122	601211	国泰海通	6,000	123,300.00	0.01
123	300274	阳光电源	700	119,728.00	0.01
124	601138	工业富联	1,900	117,895.00	0.01
125	600000	浦发银行	9,300	115,692.00	0.01
126	688041	海光信息	505	113,327.05	0.01
127	600150	中国船舶	3,400	113,084.00	0.01
128	600887	伊利股份	3,800	108,680.00	0.01
129	601288	农业银行	13,400	102,912.00	0.01
130	600111	北方稀土	2,200	101,464.00	0.01
131	000100	TCL 科技	21,300	96,702.00	0.01
132	000858	五粮液	900	95,346.00	0.01
133	000725	京东方 A	22,300	93,883.00	0.01
134	601816	京沪高铁	18,000	92,700.00	0.01
135	002371	北方华创	200	91,816.00	0.01
136	000001	平安银行	7,900	90,139.00	0.01
137	688111	金山办公	293	89,971.51	0.01
138	000792	盐湖股份	3,100	87,296.00	0.01
139	688008	澜起科技	726	85,522.80	0.01
140	000651	格力电器	2,100	84,462.00	0.01
141	600309	万华化学	1,100	84,348.00	0.01
142	688271	联影医疗	631	79,190.50	0.01
143	002625	光启技术	1,600	78,016.00	0.01
144	601628	中国人寿	1,700	77,350.00	0.01
145	300760	迈瑞医疗	400	76,180.00	0.01
146	600104	上汽集团	5,000	76,100.00	0.01
147	600031	三一重工	3,600	76,068.00	0.01
148	002142	宁波银行	2,700	75,843.00	0.01
149	002460	赣锋锂业	1,200	75,468.00	0.01
150	601601	中国太保	1,800	75,438.00	0.01
151	601009	南京银行	6,500	74,295.00	0.01
152	601939	建设银行	8,000	74,240.00	0.01
153	603993	洛阳钼业	3,700	74,000.00	0.01
154	600019	宝钢股份	9,800	73,010.00	0.01
155	300433	蓝思科技	2,400	72,648.00	0.01
156	600999	招商证券	4,300	71,552.00	0.01

157	002049	紫光国微	900	70,929.00	0.01
158	601658	邮储银行	13,000	70,850.00	0.01
159	601336	新华保险	1,000	69,700.00	0.01
160	002916	深南电路	300	69,687.00	0.01
161	601012	隆基绿能	3,800	69,160.00	0.01
162	601088	中国神华	1,700	68,850.00	0.01
163	002415	海康威视	2,300	68,632.00	0.01
164	300124	汇川技术	900	67,797.00	0.01
165	600988	赤峰黄金	2,100	65,604.00	0.01
166	002600	领益智造	4,200	65,268.00	0.01
167	600522	中天科技	3,600	65,232.00	0.01
168	600690	海尔智家	2,500	65,225.00	0.01
169	600660	福耀玻璃	1,000	64,770.00	0.01
170	601668	中国建筑	12,600	64,638.00	0.01
171	688506	百利天恒	200	64,620.00	0.01
172	300033	同花顺	200	64,436.00	0.01
173	603986	兆易创新	300	64,275.00	0.01
174	002074	国轩高科	1,600	62,576.00	0.01
175	300418	昆仑万维	1,500	62,550.00	0.01
176	600584	长电科技	1,700	62,526.00	0.01
177	600115	中国东航	10,300	61,800.00	0.01
178	002736	国信证券	4,700	61,664.00	0.01
179	600438	通威股份	3,000	61,560.00	0.01
180	300394	天孚通信	300	60,909.00	0.01
181	601127	赛力斯	500	60,480.00	0.01
182	002027	分众传媒	8,200	60,434.00	0.01
183	600372	中航机载	4,400	59,048.00	0.01
184	600989	宝丰能源	3,000	58,890.00	0.01
185	600029	南方航空	7,300	58,473.00	0.01
186	600795	国电电力	11,600	58,464.00	0.01
187	300442	润泽科技	1,100	58,080.00	0.01
188	600160	巨化股份	1,500	57,630.00	0.01
189	000338	潍柴动力	3,300	56,760.00	0.01
190	300347	泰格医药	1,000	56,700.00	0.01
191	600406	国电南瑞	2,500	56,200.00	0.01
192	002714	牧原股份	1,100	55,638.00	0.01
193	601881	中国银河	3,500	55,020.00	0.01
194	601100	恒立液压	500	54,955.00	0.01
195	603296	华勤技术	600	54,444.00	0.01
196	300058	蓝色光标	4,700	54,144.00	0.01
197	688235	百济神州-U	200	53,720.00	0.01
198	605499	东鹏饮料	200	53,478.00	0.01
199	601688	华泰证券	2,200	51,898.00	0.01
200	301358	湖南裕能	800	51,728.00	0.01

201	600809	山西汾酒	300	51,510.00	0.01
202	603019	中科曙光	600	51,384.00	0.01
203	600039	四川路桥	5,100	50,745.00	0.01
204	300604	长川科技	500	50,655.00	0.01
205	601901	方正证券	6,400	49,920.00	0.01
206	600415	小商品城	3,100	49,445.00	0.01
207	601225	陕西煤业	2,300	49,036.00	0.01
208	600050	中国联通	9,500	48,545.00	0.01
209	000166	申万宏源	9,100	47,957.00	0.01
210	301606	绿联科技	800	46,992.00	0.01
211	300765	新诺威	1,300	46,891.00	0.01
212	000933	神火股份	1,700	46,699.00	0.01
213	601898	中煤能源	3,700	46,028.00	0.01
214	600157	永泰能源	29,300	46,001.00	0.01
215	002195	岩山科技	6,400	45,376.00	0.01
216	600549	厦门钨业	1,100	45,166.00	0.01
217	002222	福晶科技	800	45,072.00	0.01
218	688303	大全能源	1,658	44,467.56	0.01
219	002050	三花智控	800	44,248.00	0.01
220	603659	璞泰来	1,600	43,744.00	0.01
221	601808	中海油服	3,100	43,524.00	0.01
222	600600	青岛啤酒	700	42,840.00	0.01
223	002414	高德红外	2,900	42,543.00	0.00
224	601377	兴业证券	5,700	42,294.00	0.00
225	000733	振华科技	800	41,928.00	0.00
226	000063	中兴通讯	1,100	41,624.00	0.00
227	600875	东方电气	1,700	41,276.00	0.00
228	603799	华友钴业	600	40,956.00	0.00
229	300748	金力永磁	1,200	40,932.00	0.00
230	601857	中国石油	3,900	40,599.00	0.00
231	300999	金龙鱼	1,400	40,236.00	0.00
232	002230	科大讯飞	800	40,232.00	0.00
233	000977	浪潮信息	600	39,960.00	0.00
234	601229	上海银行	3,800	38,380.00	0.00
235	601006	大秦铁路	7,400	38,184.00	0.00
236	688200	华峰测控	200	38,040.00	0.00
237	600089	特变电工	1,700	37,774.00	0.00
238	603501	豪威集团	300	37,770.00	0.00
239	002156	通富微电	1,000	37,700.00	0.00
240	601319	中国人保	4,200	37,590.00	0.00
241	603288	海天味业	1,000	37,020.00	0.00
242	601818	光大银行	10,600	36,994.00	0.00
243	300759	康龙化成	1,300	36,959.00	0.00
244	000938	紫光股份	1,500	36,900.00	0.00

245	002436	兴森科技	1,700	35,989.00	0.00
246	002340	格林美	4,300	35,948.00	0.00
247	601728	中国电信	5,700	35,910.00	0.00
248	301316	慧博云通	800	35,744.00	0.00
249	002185	华天科技	3,200	35,104.00	0.00
250	002558	巨人网络	800	34,632.00	0.00
251	600392	盛和资源	1,600	34,448.00	0.00
252	601390	中国中铁	6,300	34,083.00	0.00
253	600028	中国石化	5,500	33,990.00	0.00
254	002384	东山精密	400	33,860.00	0.00
255	601600	中国铝业	2,700	32,994.00	0.00
256	600236	桂冠电力	4,200	32,886.00	0.00
257	600010	包钢股份	13,800	32,844.00	0.00
258	601111	中国国航	3,500	32,795.00	0.00
259	000425	徐工机械	2,800	32,424.00	0.00
260	601360	三六零	2,900	32,393.00	0.00
261	002085	万丰奥威	2,000	32,020.00	0.00
262	688536	思瑞浦	200	31,976.00	0.00
263	000783	长江证券	3,900	31,785.00	0.00
264	000988	华工科技	400	31,732.00	0.00
265	688052	纳芯微	200	31,636.00	0.00
266	300003	乐普医疗	2,000	31,620.00	0.00
267	601995	中金公司	900	31,500.00	0.00
268	600547	山东黄金	800	30,968.00	0.00
269	002028	思源电气	200	30,918.00	0.00
270	002352	顺丰控股	800	30,656.00	0.00
271	688385	复旦微电	413	30,438.10	0.00
272	688343	云天励飞-U	400	30,432.00	0.00
273	600885	宏发股份	1,000	30,400.00	0.00
274	600096	云天化	900	30,069.00	0.00
275	600487	亨通光电	1,200	29,676.00	0.00
276	002155	湖南黄金	1,400	29,526.00	0.00
277	300458	全志科技	700	29,421.00	0.00
278	600654	中安科	7,800	29,406.00	0.00
279	300224	正海磁材	1,900	29,374.00	0.00
280	002463	沪电股份	400	29,228.00	0.00
281	000932	华菱钢铁	5,200	29,224.00	0.00
282	300073	当升科技	500	28,900.00	0.00
283	002008	大族激光	700	28,833.00	0.00
284	300474	景嘉微	400	28,748.00	0.00
285	002241	歌尔股份	1,000	28,730.00	0.00
286	600909	华安证券	4,200	28,476.00	0.00
287	301236	软通动力	600	28,458.00	0.00
288	601888	中国中免	300	28,368.00	0.00

289	300142	沃森生物	2,600	28,366.00	0.00
290	001696	宗申动力	1,300	28,197.00	0.00
291	002624	完美世界	1,700	27,863.00	0.00
292	001337	四川黄金	1,000	27,860.00	0.00
293	600027	华电国际	5,600	27,776.00	0.00
294	002311	海大集团	500	27,690.00	0.00
295	600141	兴发集团	800	27,664.00	0.00
296	600011	华能国际	3,700	27,602.00	0.00
297	300661	圣邦股份	400	27,456.00	0.00
298	002402	和而泰	700	27,384.00	0.00
299	600176	中国巨石	1,600	27,360.00	0.00
299	300567	精测电子	300	27,360.00	0.00
299	601061	中信金属	1,900	27,360.00	0.00
300	601919	中远海控	1,800	27,324.00	0.00
301	300373	扬杰科技	400	27,200.00	0.00
302	601108	财通证券	3,100	27,032.00	0.00
303	601872	招商轮船	3,000	26,940.00	0.00
304	601020	华钰矿业	1,000	26,860.00	0.00
305	301215	中汽股份	3,900	26,715.00	0.00
306	601865	福莱特	1,700	26,639.00	0.00
307	688636	智明达	618	26,475.12	0.00
308	601198	东兴证券	1,900	26,372.00	0.00
309	300619	金银河	600	26,340.00	0.00
310	688110	东芯股份	200	26,270.00	0.00
311	002517	恺英网络	1,200	26,244.00	0.00
312	300037	新宙邦	500	26,200.00	0.00
313	600704	物产中大	4,700	26,179.00	0.00
314	002487	大金重工	500	25,965.00	0.00
315	688301	奕瑞科技	254	25,681.94	0.00
316	000997	新大陆	900	25,488.00	0.00
317	300498	温氏股份	1,500	25,320.00	0.00
318	300146	汤臣倍健	2,100	25,221.00	0.00
319	601991	大唐发电	7,200	25,128.00	0.00
320	688123	聚辰股份	200	25,116.00	0.00
321	600166	福田汽车	8,600	25,112.00	0.00
322	688700	东威科技	708	24,978.24	0.00
323	603005	晶方科技	900	24,894.00	0.00
324	002294	信立泰	500	24,775.00	0.00
325	300339	润和软件	500	24,750.00	0.00
326	000729	燕京啤酒	2,200	24,706.00	0.00
327	600120	浙江东方	4,000	24,680.00	0.00
328	600233	圆通速递	1,500	24,630.00	0.00
329	688220	翱捷科技-U	298	24,617.78	0.00
330	600580	卧龙电驱	500	24,550.00	0.00

331	688778	厦钨新能	317	24,526.29	0.00
332	301308	江波龙	100	24,484.00	0.00
333	603379	三美股份	400	24,288.00	0.00
334	002544	普天科技	700	24,143.00	0.00
335	002312	川发龙蟒	2,200	24,046.00	0.00
336	002389	航天彩虹	1,000	23,980.00	0.00
337	002400	省广集团	2,700	23,949.00	0.00
338	603606	东方电缆	400	23,900.00	0.00
339	002603	以岭药业	1,400	23,898.00	0.00
340	688396	华润微	452	23,892.72	0.00
341	002153	石基信息	2,200	23,826.00	0.00
342	600170	上海建工	8,900	23,585.00	0.00
343	002952	亚世光电	1,200	23,568.00	0.00
344	600848	上海临港	2,000	23,400.00	0.00
345	688521	芯原股份	170	23,284.90	0.00
346	000568	泸州老窖	200	23,244.00	0.00
347	002815	崇达技术	1,700	23,222.00	0.00
348	000831	中国稀土	500	23,220.00	0.00
349	600100	同方股份	2,600	23,192.00	0.00
350	300454	深信服	200	23,032.00	0.00
351	600511	国药股份	800	23,000.00	0.00
352	600765	中航重机	1,200	22,992.00	0.00
353	688525	佰维存储	200	22,958.00	0.00
354	300852	四会富仕	600	22,908.00	0.00
355	600126	杭钢股份	2,800	22,848.00	0.00
356	600517	国网英大	3,800	22,838.00	0.00
357	002317	众生药业	1,200	22,776.00	0.00
358	600754	锦江酒店	900	22,743.00	0.00
359	600728	佳都科技	3,400	22,712.00	0.00
360	600573	惠泉啤酒	1,900	22,667.00	0.00
361	600998	九州通	4,400	22,528.00	0.00
362	601766	中国中车	3,300	22,506.00	0.00
363	601169	北京银行	4,100	22,468.00	0.00
364	300735	光弘科技	900	22,374.00	0.00
365	600188	兖矿能源	1,700	22,355.00	0.00
366	002493	荣盛石化	1,900	22,249.00	0.00
367	000062	深圳华强	900	22,158.00	0.00
368	600095	湘财股份	2,000	22,120.00	0.00
369	002244	滨江集团	2,200	22,110.00	0.00
369	600933	爱柯迪	1,100	22,110.00	0.00
370	601717	中创智领	900	22,095.00	0.00
371	601162	天风证券	5,300	22,048.00	0.00
372	688578	艾力斯	210	21,871.50	0.00
373	000519	中兵红箭	1,200	21,852.00	0.00

374	301326	捷邦科技	200	21,832.00	0.00
375	603728	鸣志电器	300	21,705.00	0.00
376	000800	一汽解放	3,200	21,696.00	0.00
377	000603	盛达资源	700	21,672.00	0.00
378	688347	华虹公司	200	21,574.00	0.00
379	002966	苏州银行	2,600	21,554.00	0.00
380	300034	钢研高纳	1,100	21,538.00	0.00
381	000555	神州信息	1,300	21,515.00	0.00
382	002299	圣农发展	1,300	21,502.00	0.00
383	002237	恒邦股份	1,600	21,472.00	0.00
384	688548	广钢气体	1,474	21,431.96	0.00
385	600183	生益科技	300	21,423.00	0.00
386	600578	京能电力	4,200	21,420.00	0.00
387	600926	杭州银行	1,400	21,392.00	0.00
388	600871	石化油服	9,900	21,384.00	0.00
389	601988	中国银行	3,700	21,201.00	0.00
390	600938	中国海油	700	21,126.00	0.00
391	300049	福瑞医科	300	21,123.00	0.00
392	600808	马钢股份	5,000	21,100.00	0.00
393	601126	四方股份	700	21,056.00	0.00
394	600026	中远海能	1,800	21,024.00	0.00
395	002281	光迅科技	300	20,985.00	0.00
396	605358	立昂微	600	20,892.00	0.00
397	000598	兴蓉环境	2,900	20,793.00	0.00
398	300850	新强联	500	20,685.00	0.00
399	301097	天益医疗	400	20,648.00	0.00
400	600332	白云山	800	20,592.00	0.00
401	301217	铜冠铜箔	600	20,568.00	0.00
402	688297	中无人机	428	20,552.56	0.00
403	600516	方大炭素	3,600	20,484.00	0.00
404	688146	中船特气	506	20,442.40	0.00
405	001287	中电港	900	20,394.00	0.00
406	600206	有研新材	1,000	20,330.00	0.00
407	300012	华测检测	1,500	20,325.00	0.00
408	300496	中科创达	300	20,250.00	0.00
409	300409	道氏技术	900	20,241.00	0.00
410	600941	中国移动	200	20,210.00	0.00
410	601868	中国能建	8,600	20,210.00	0.00
411	603085	天成自控	1,700	20,145.00	0.00
412	002410	广联达	1,600	20,128.00	0.00
413	603077	和邦生物	8,900	20,114.00	0.00
414	600995	南网储能	1,600	20,112.00	0.00
415	300395	菲利华	200	20,060.00	0.00
416	600741	华域汽车	1,000	20,000.00	0.00

417	300450	先导智能	400	19,992.00	0.00
418	300184	力源信息	2,000	19,980.00	0.00
419	600685	中船防务	700	19,915.00	0.00
420	300101	振芯科技	700	19,901.00	0.00
421	002038	双鹭药业	2,700	19,899.00	0.00
422	601187	厦门银行	2,700	19,818.00	0.00
423	002841	视源股份	500	19,815.00	0.00
424	603025	大豪科技	1,100	19,756.00	0.00
425	300014	亿纬锂能	300	19,728.00	0.00
426	000582	北部湾港	2,100	19,698.00	0.00
427	600801	华新建材	800	19,632.00	0.00
428	601975	招商南油	6,500	19,630.00	0.00
429	600320	振华重工	3,800	19,570.00	0.00
430	600018	上港集团	3,600	19,512.00	0.00
431	000975	山金国际	800	19,464.00	0.00
432	002987	京北方	900	19,377.00	0.00
433	600012	皖通高速	1,300	19,266.00	0.00
434	000893	亚钾国际	400	19,188.00	0.00
435	600378	昊华科技	600	19,176.00	0.00
436	300693	盛弘股份	500	19,140.00	0.00
437	002398	垒知集团	3,400	19,108.00	0.00
438	601555	东吴证券	2,100	19,026.00	0.00
439	300247	融捷健康	3,700	18,981.00	0.00
440	300747	锐科激光	700	18,921.00	0.00
441	600977	中国电影	1,200	18,864.00	0.00
442	603316	诚邦股份	1,300	18,850.00	0.00
443	601069	西部黄金	700	18,676.00	0.00
444	300068	南都电源	1,200	18,648.00	0.00
445	300136	信维通信	300	18,600.00	0.00
445	300115	长盈精密	400	18,600.00	0.00
446	000887	中鼎股份	800	18,568.00	0.00
447	000895	双汇发展	700	18,529.00	0.00
448	688779	五矿新能	2,470	18,500.30	0.00
449	688295	中复神鹰	563	18,472.03	0.00
450	603816	顾家家居	600	18,444.00	0.00
451	301027	华蓝集团	1,000	18,410.00	0.00
452	002075	沙钢股份	3,200	18,400.00	0.00
453	600596	新安股份	1,600	18,352.00	0.00
454	002895	川恒股份	500	18,330.00	0.00
455	600651	飞乐音响	2,500	18,225.00	0.00
456	002080	中材科技	500	18,170.00	0.00
457	600201	生物股份	1,200	18,084.00	0.00
458	601000	唐山港	4,700	18,048.00	0.00
459	301536	星辰科技	300	17,973.00	0.00

460	603893	瑞芯微	100	17,828.00	0.00
461	000426	兴业银锡	500	17,800.00	0.00
462	603917	合力科技	1,200	17,748.00	0.00
463	600927	永安期货	1,100	17,677.00	0.00
464	600968	海油发展	4,600	17,664.00	0.00
465	002645	华宏科技	1,200	17,568.00	0.00
466	301526	国际复材	2,500	17,500.00	0.00
467	603327	福蓉科技	1,600	17,376.00	0.00
468	300346	南大光电	400	17,160.00	0.00
469	300772	运达股份	900	17,154.00	0.00
470	600507	方大特钢	2,900	17,081.00	0.00
471	300348	长亮科技	1,100	17,028.00	0.00
472	300357	我武生物	600	17,010.00	0.00
472	002444	巨星科技	500	17,010.00	0.00
473	300925	法本信息	800	16,992.00	0.00
474	688772	珠海冠宇	789	16,987.17	0.00
475	605589	圣泉集团	600	16,980.00	0.00
476	002276	万马股份	1,000	16,910.00	0.00
477	603341	龙旗科技	400	16,904.00	0.00
478	300857	协创数据	100	16,868.00	0.00
479	603162	海通发展	1,400	16,856.00	0.00
480	002404	嘉欣丝绸	2,400	16,824.00	0.00
481	603505	金石资源	900	16,812.00	0.00
482	300953	震裕科技	100	16,802.00	0.00
483	002242	九阳股份	1,600	16,704.00	0.00
484	000811	冰轮环境	900	16,668.00	0.00
485	000785	居然智家	5,700	16,644.00	0.00
486	300130	新国都	600	16,638.00	0.00
487	688561	奇安信-U	467	16,615.86	0.00
488	002716	湖南白银	2,400	16,608.00	0.00
489	601168	西部矿业	600	16,584.00	0.00
490	603915	国茂股份	900	16,569.00	0.00
491	002176	江特电机	1,700	16,558.00	0.00
492	600366	宁波韵升	1,200	16,548.00	0.00
493	600338	西藏珠峰	1,100	16,544.00	0.00
494	603171	税友股份	300	16,539.00	0.00
495	000612	焦作万方	1,500	16,530.00	0.00
496	600572	康恩贝	3,700	16,502.00	0.00
497	000810	创维数字	1,400	16,492.00	0.00
498	601696	中银证券	1,100	16,489.00	0.00
499	300185	通裕重工	5,800	16,472.00	0.00
500	601890	亚星锚链	1,600	16,464.00	0.00
501	688183	生益电子	172	16,458.68	0.00
502	600598	北大荒	1,100	16,445.00	0.00

503	601985	中国核电	1,900	16,435.00	0.00
504	601216	君正集团	3,400	16,388.00	0.00
505	300390	天华新能	300	16,383.00	0.00
506	002612	朗姿股份	800	16,352.00	0.00
507	300428	立中集团	700	16,345.00	0.00
508	300036	超图软件	900	16,344.00	0.00
509	600867	通化东宝	2,000	16,340.00	0.00
510	603267	鸿远电子	300	16,329.00	0.00
511	001389	广合科技	200	16,326.00	0.00
512	300777	中简科技	400	16,320.00	0.00
513	002756	永兴材料	300	16,275.00	0.00
514	000970	中科三环	1,200	16,272.00	0.00
515	300363	博腾股份	700	16,268.00	0.00
516	002023	海特高新	1,200	16,248.00	0.00
517	002897	意华股份	300	16,221.00	0.00
518	002006	精工科技	700	16,212.00	0.00
519	688519	南亚新材	200	16,172.00	0.00
520	688333	铂力特	145	16,168.95	0.00
521	603486	科沃斯	200	16,136.00	0.00
522	605020	永和股份	600	16,134.00	0.00
523	603456	九洲药业	900	16,110.00	0.00
524	600996	贵广网络	1,600	16,064.00	0.00
525	002096	易普力	1,200	15,984.00	0.00
526	002225	濮耐股份	2,800	15,960.00	0.00
527	603043	广州酒家	900	15,867.00	0.00
528	002941	新疆交建	1,000	15,850.00	0.00
529	003022	联泓新科	800	15,848.00	0.00
530	001286	陕西能源	1,700	15,827.00	0.00
531	302132	中航成飞	200	15,800.00	0.00
532	000564	供销大集	6,300	15,750.00	0.00
533	002738	中矿资源	200	15,710.00	0.00
534	300171	东富龙	1,000	15,700.00	0.00
535	688331	荣昌生物	200	15,558.00	0.00
536	002967	广电计量	700	15,407.00	0.00
537	603596	伯特利	300	15,381.00	0.00
538	688549	中巨芯-U	1,678	15,303.36	0.00
539	002906	华阳集团	500	15,290.00	0.00
540	300726	宏达电子	300	15,273.00	0.00
541	601778	晶科科技	4,100	15,252.00	0.00
542	300682	朗新集团	1,000	15,210.00	0.00
543	601099	太平洋	3,700	15,207.00	0.00
544	002020	京新药业	800	15,184.00	0.00
545	601963	重庆银行	1,400	15,162.00	0.00
546	002516	旷达科技	2,300	15,157.00	0.00

547	002396	星网锐捷	500	15,150.00	0.00
548	600269	赣粤高速	2,900	15,051.00	0.00
549	300432	富临精工	900	15,030.00	0.00
550	600429	三元股份	2,900	15,022.00	0.00
551	002787	华源控股	1,200	14,940.00	0.00
552	688122	西部超导	200	14,916.00	0.00
553	603730	岱美股份	1,700	14,892.00	0.00
554	688114	华大智造	245	14,886.20	0.00
555	002077	大港股份	1,000	14,870.00	0.00
556	002456	欧菲光	1,400	14,868.00	0.00
557	002484	江海股份	500	14,850.00	0.00
557	603529	爱玛科技	500	14,850.00	0.00
558	002946	新乳业	800	14,824.00	0.00
559	603013	亚普股份	600	14,802.00	0.00
560	002541	鸿路钢构	900	14,796.00	0.00
561	600782	新钢股份	3,800	14,744.00	0.00
562	300083	创世纪	1,600	14,736.00	0.00
563	600901	江苏金租	2,400	14,688.00	0.00
564	688584	上海合晶	667	14,633.98	0.00
565	003031	中瓷电子	200	14,632.00	0.00
566	688248	南网科技	327	14,629.98	0.00
567	002532	天山铝业	900	14,562.00	0.00
568	600353	旭光电子	900	14,508.00	0.00
569	601615	明阳智能	1,000	14,480.00	0.00
570	300475	香农芯创	100	14,434.00	0.00
571	600361	创新新材	3,400	14,416.00	0.00
572	688148	芳源股份	1,643	14,409.11	0.00
573	600186	莲花控股	2,400	14,352.00	0.00
574	301095	广立微	200	14,342.00	0.00
575	301511	德福科技	400	14,316.00	0.00
576	601595	上海电影	500	14,315.00	0.00
577	300763	锦浪科技	200	14,282.00	0.00
578	002901	大博医疗	300	14,211.00	0.00
579	000422	湖北宜化	1,000	14,210.00	0.00
580	002378	章源钨业	1,000	14,180.00	0.00
581	002498	汉缆股份	3,700	14,171.00	0.00
582	002353	杰瑞股份	200	14,166.00	0.00
583	002292	奥飞娱乐	1,600	14,160.00	0.00
584	600562	国睿科技	500	14,130.00	0.00
585	600601	方正科技	1,200	14,064.00	0.00
585	002488	金固股份	1,600	14,064.00	0.00
586	300573	兴齐眼药	200	14,058.00	0.00
587	002651	利君股份	1,200	14,028.00	0.00
588	300558	贝达药业	300	14,007.00	0.00

589	688336	三生国健	235	13,998.95	0.00
590	601880	辽港股份	8,700	13,920.00	0.00
591	300919	中伟股份	300	13,899.00	0.00
591	002709	天赐材料	300	13,899.00	0.00
592	000088	盐田港	3,100	13,795.00	0.00
593	000778	新兴铸管	3,300	13,794.00	0.00
594	002489	浙江永强	3,600	13,788.00	0.00
595	603317	天味食品	1,100	13,772.00	0.00
596	600737	中粮糖业	800	13,768.00	0.00
597	002675	东诚药业	1,000	13,740.00	0.00
598	600143	金发科技	700	13,678.00	0.00
599	600839	四川长虹	1,500	13,650.00	0.00
600	000833	粤桂股份	700	13,622.00	0.00
601	600295	鄂尔多斯	1,100	13,596.00	0.00
602	301109	军信股份	900	13,500.00	0.00
603	002174	游族网络	1,100	13,464.00	0.00
603	601990	南京证券	1,700	13,464.00	0.00
604	603083	剑桥科技	100	13,438.00	0.00
605	300723	一品红	400	13,420.00	0.00
606	600258	首旅酒店	800	13,400.00	0.00
607	002968	新大正	1,100	13,376.00	0.00
608	300017	网宿科技	1,300	13,325.00	0.00
609	300602	飞荣达	400	13,264.00	0.00
610	600895	张江高科	300	13,170.00	0.00
611	002130	沃尔核材	500	13,160.00	0.00
612	600298	安琪酵母	300	13,122.00	0.00
613	300926	博俊科技	400	13,112.00	0.00
614	000829	天音控股	1,200	13,092.00	0.00
615	300803	指南针	100	13,087.00	0.00
616	600602	云赛智联	700	13,083.00	0.00
617	600292	远达环保	1,000	13,050.00	0.00
618	600459	贵研铂业	700	13,027.00	0.00
619	300779	惠城环保	100	13,011.00	0.00
620	002846	英联股份	800	12,912.00	0.00
621	002397	梦洁股份	3,200	12,896.00	0.00
622	000899	赣能股份	1,300	12,870.00	0.00
623	300001	特锐德	500	12,840.00	0.00
624	601038	一拖股份	900	12,753.00	0.00
625	002354	天娱数科	2,000	12,740.00	0.00
626	002110	三钢闽光	2,900	12,731.00	0.00
627	600619	海立股份	600	12,660.00	0.00
628	600363	联创光电	200	12,612.00	0.00
629	002273	水晶光电	500	12,560.00	0.00
630	603858	步长制药	800	12,512.00	0.00

631	000019	深粮控股	1,800	12,510.00	0.00
632	000935	四川双马	500	12,420.00	0.00
633	688543	国科军工	200	12,414.00	0.00
634	688001	华兴源创	411	12,403.98	0.00
635	688209	英集芯	619	12,342.86	0.00
636	603530	神马电力	300	12,324.00	0.00
637	002564	天沃科技	1,600	12,320.00	0.00
638	002157	正邦科技	3,800	12,312.00	0.00
639	601083	锦江航运	1,100	12,276.00	0.00
640	000791	甘肃能源	1,900	12,255.00	0.00
641	002202	金风科技	600	12,240.00	0.00
642	002928	华夏航空	1,100	12,155.00	0.00
643	000686	东北证券	1,300	12,116.00	0.00
644	002773	康弘药业	400	11,988.00	0.00
645	600618	氯碱化工	1,000	11,880.00	0.00
646	688469	芯联集成-U	1,775	11,874.75	0.00
647	601001	晋控煤业	900	11,835.00	0.00
648	301000	肇民科技	300	11,811.00	0.00
649	000723	美锦能源	2,500	11,750.00	0.00
650	688612	威迈斯	356	11,737.32	0.00
651	600335	国机汽车	1,800	11,718.00	0.00
652	600489	中金黄金	500	11,680.00	0.00
653	000155	川能动力	1,000	11,650.00	0.00
654	002044	美年健康	2,200	11,616.00	0.00
655	603103	横店影视	700	11,606.00	0.00
656	300098	高新兴	1,900	11,590.00	0.00
657	601107	四川成渝	1,900	11,552.00	0.00
658	600380	健康元	1,000	11,550.00	0.00
659	603118	共进股份	1,000	11,500.00	0.00
659	603156	养元饮品	400	11,500.00	0.00
660	002004	华邦健康	2,400	11,472.00	0.00
661	600323	瀚蓝环境	400	11,440.00	0.00
662	600970	中材国际	1,100	11,429.00	0.00
663	300888	稳健医疗	300	11,352.00	0.00
664	605198	安德利	300	11,286.00	0.00
665	000058	深赛格	1,200	11,280.00	0.00
666	000959	首钢股份	2,300	11,270.00	0.00
666	600961	株冶集团	700	11,270.00	0.00
667	600315	上海家化	500	11,260.00	0.00
668	002099	海翔药业	1,800	11,232.00	0.00
669	301031	中熔电气	100	11,219.00	0.00
670	600673	东阳光	500	11,215.00	0.00
671	601003	柳钢股份	2,200	11,066.00	0.00
672	600416	湘电股份	700	11,046.00	0.00

673	605277	新亚电子	500	11,000.00	0.00
674	301487	盟固利	500	10,965.00	0.00
675	600585	海螺水泥	500	10,930.00	0.00
676	000880	潍柴重机	400	10,928.00	0.00
677	603496	恒为科技	400	10,912.00	0.00
678	300302	同有科技	600	10,884.00	0.00
679	688006	杭可科技	369	10,808.01	0.00
680	600435	北方导航	700	10,794.00	0.00
681	301071	力量钻石	300	10,752.00	0.00
682	301297	富乐德	300	10,740.00	0.00
683	603039	泛微网络	200	10,708.00	0.00
684	002837	英维克	100	10,689.00	0.00
685	600879	航天电子	500	10,660.00	0.00
686	600686	金龙汽车	600	10,644.00	0.00
687	688153	唯捷创芯	282	10,614.48	0.00
688	301029	怡合达	400	10,608.00	0.00
689	603663	三祥新材	300	10,605.00	0.00
690	300223	北京君正	100	10,604.00	0.00
691	300633	开立医疗	400	10,568.00	0.00
692	688690	纳微科技	409	10,556.29	0.00
693	600563	法拉电子	100	10,495.00	0.00
694	002041	登海种业	1,100	10,494.00	0.00
695	600116	三峡水利	1,600	10,464.00	0.00
696	301251	威尔高	200	10,456.00	0.00
697	600132	重庆啤酒	200	10,448.00	0.00
698	002258	利尔化学	800	10,440.00	0.00
699	002608	江苏国信	1,400	10,346.00	0.00
700	000543	皖能电力	1,300	10,335.00	0.00
701	600221	海航控股	5,700	10,317.00	0.00
702	002511	中顺洁柔	1,200	10,272.00	0.00
703	300970	华绿生物	500	10,255.00	0.00
704	002602	世纪华通	600	10,236.00	0.00
705	002461	珠江啤酒	1,100	10,219.00	0.00
706	002025	航天电器	200	10,026.00	0.00
707	600021	上海电力	500	10,010.00	0.00
708	300134	大富科技	800	10,000.00	0.00
709	688390	固德威	160	9,940.80	0.00
710	002261	拓维信息	300	9,930.00	0.00
711	301153	中科江南	400	9,888.00	0.00
712	688777	中控技术	200	9,868.00	0.00
713	300341	麦克奥迪	600	9,804.00	0.00
714	688639	华恒生物	300	9,774.00	0.00
715	002170	芭田股份	800	9,744.00	0.00
716	600198	大唐电信	1,000	9,650.00	0.00

717	601089	福元医药	400	9,600.00	0.00
718	003039	顺控发展	600	9,558.00	0.00
719	603236	移远通信	100	9,541.00	0.00
720	000767	晋控电力	3,400	9,520.00	0.00
721	600118	中国卫星	100	9,495.00	0.00
722	002472	双环传动	200	9,482.00	0.00
723	688819	天能股份	285	9,467.70	0.00
724	601900	南方传媒	700	9,387.00	0.00
725	688310	迈得医疗	608	9,320.64	0.00
726	600056	中国医药	900	9,297.00	0.00
727	603737	三棵树	200	9,254.00	0.00
728	300678	中科信息	300	9,228.00	0.00
729	600575	淮河能源	2,700	9,180.00	0.00
730	600114	东睦股份	300	9,165.00	0.00
731	003035	南网能源	2,000	9,160.00	0.00
732	600348	华阳股份	1,100	9,086.00	0.00
733	600403	大有能源	1,300	9,074.00	0.00
734	601077	渝农商行	1,400	9,044.00	0.00
735	002091	江苏国泰	1,000	9,030.00	0.00
736	002851	麦格米特	100	9,007.00	0.00
737	002430	杭氧股份	300	8,961.00	0.00
738	601678	滨化股份	2,100	8,904.00	0.00
739	600032	浙江新能	1,200	8,892.00	0.00
740	300296	利亚德	1,400	8,848.00	0.00
741	600641	先导基电	500	8,820.00	0.00
742	002993	奥海科技	200	8,742.00	0.00
743	003006	百亚股份	400	8,736.00	0.00
744	688141	杰华特	200	8,686.00	0.00
745	000066	中国长城	600	8,646.00	0.00
745	002043	兔宝宝	600	8,646.00	0.00
746	688443	智翔金泰-U	317	8,635.08	0.00
747	601908	京运通	2,200	8,602.00	0.00
748	002913	奥士康	200	8,548.00	0.00
749	001914	招商积余	800	8,544.00	0.00
750	301286	侨源股份	200	8,458.00	0.00
751	002595	豪迈科技	100	8,451.00	0.00
752	000408	藏格矿业	100	8,440.00	0.00
753	300443	金雷股份	300	8,439.00	0.00
754	688206	概伦电子	241	8,394.03	0.00
755	601155	新城控股	600	8,370.00	0.00
756	002701	奥瑞金	1,400	8,330.00	0.00
757	000657	中钨高新	300	8,313.00	0.00
758	000625	长安汽车	700	8,302.00	0.00
759	000099	中信海直	400	8,300.00	0.00

760	000766	通化金马	300	8,247.00	0.00
761	002797	第一创业	1,200	8,244.00	0.00
762	002373	千方科技	700	8,239.00	0.00
763	600905	三峡能源	2,000	8,180.00	0.00
764	002755	奥赛康	500	8,165.00	0.00
765	301238	瑞泰新材	400	8,160.00	0.00
766	002537	海联金汇	900	8,154.00	0.00
767	300651	金陵体育	400	8,152.00	0.00
768	300113	顺网科技	400	8,096.00	0.00
769	601066	中信建投	300	8,031.00	0.00
770	301091	深城交	300	8,022.00	0.00
771	601068	中铝国际	1,500	7,935.00	0.00
772	603345	安井食品	100	7,928.00	0.00
773	300100	双林股份	200	7,924.00	0.00
774	002216	三全食品	700	7,903.00	0.00
775	300917	特发服务	200	7,820.00	0.00
776	600428	中远海特	1,100	7,810.00	0.00
777	002056	横店东磁	400	7,800.00	0.00
778	002508	老板电器	400	7,740.00	0.00
779	601689	拓普集团	100	7,718.00	0.00
780	301175	中科环保	1,300	7,683.00	0.00
781	600518	康美药业	4,000	7,640.00	0.00
782	603979	金诚信	100	7,615.00	0.00
783	300027	华谊兄弟	3,500	7,595.00	0.00
784	000021	深科技	300	7,584.00	0.00
785	002126	银轮股份	200	7,560.00	0.00
786	688097	博众精工	200	7,550.00	0.00
787	300047	天源迪科	600	7,530.00	0.00
788	300054	鼎龙股份	200	7,520.00	0.00
789	600352	浙江龙盛	700	7,462.00	0.00
790	301207	华兰疫苗	400	7,452.00	0.00
791	603885	吉祥航空	500	7,440.00	0.00
792	002409	雅克科技	100	7,410.00	0.00
793	600210	紫江企业	1,000	7,350.00	0.00
794	000825	太钢不锈	1,500	7,335.00	0.00
795	603228	景旺电子	100	7,309.00	0.00
796	002372	伟星新材	700	7,301.00	0.00
797	603556	海兴电力	200	7,280.00	0.00
798	002668	TCL 智家	700	7,266.00	0.00
799	600025	华能水电	800	7,264.00	0.00
799	688552	航天南湖	200	7,264.00	0.00
800	601858	中国科传	400	7,260.00	0.00
800	300451	创业慧康	1,500	7,260.00	0.00
801	301565	中仑新材	300	7,242.00	0.00

802	301363	美好医疗	300	7,215.00	0.00
803	600218	全柴动力	700	7,196.00	0.00
804	002279	久其软件	900	7,191.00	0.00
805	300416	苏试试验	400	7,136.00	0.00
806	000990	诚志股份	900	7,128.00	0.00
807	002138	顺络电子	200	7,106.00	0.00
808	301015	百洋医药	300	7,080.00	0.00
809	600546	山煤国际	700	7,063.00	0.00
810	601128	常熟银行	1,000	7,040.00	0.00
811	002654	万润科技	500	7,035.00	0.00
812	600316	洪都航空	200	6,982.00	0.00
813	688586	江航装备	532	6,937.28	0.00
814	000513	丽珠集团	200	6,892.00	0.00
815	601233	桐昆股份	400	6,884.00	0.00
816	600015	华夏银行	1,000	6,870.00	0.00
817	600177	雅戈尔	900	6,840.00	0.00
818	002847	盐津铺子	100	6,831.00	0.00
819	603087	甘李药业	100	6,807.00	0.00
820	600884	杉杉股份	500	6,755.00	0.00
821	603219	富佳股份	400	6,736.00	0.00
822	600967	内蒙一机	400	6,720.00	0.00
823	002017	东信和平	300	6,690.00	0.00
824	688249	晶合集成	200	6,638.00	0.00
825	603218	日月股份	500	6,625.00	0.00
826	000029	深深房 A	300	6,606.00	0.00
827	601608	中信重工	1,000	6,590.00	0.00
828	000807	云铝股份	200	6,568.00	0.00
829	603939	益丰药房	300	6,516.00	0.00
830	300244	迪安诊断	400	6,340.00	0.00
831	301551	无线传媒	200	6,310.00	0.00
832	002465	海格通信	400	6,300.00	0.00
832	002078	太阳纸业	400	6,300.00	0.00
833	600699	均胜电子	200	6,272.00	0.00
834	603712	七一二	300	6,231.00	0.00
835	301381	赛维时代	300	6,177.00	0.00
836	002690	美亚光电	300	6,171.00	0.00
837	002101	广东鸿图	500	6,160.00	0.00
838	600246	万通发展	500	6,150.00	0.00
839	002204	大连重工	800	6,120.00	0.00
840	301152	天力锂能	200	6,112.00	0.00
841	000898	鞍钢股份	2,400	6,072.00	0.00
842	601636	旗滨集团	1,000	5,930.00	0.00
843	000059	华锦股份	1,100	5,885.00	0.00
844	603093	南华期货	300	5,847.00	0.00

845	600282	南钢股份	1,100	5,786.00	0.00
846	301177	迪阿股份	200	5,774.00	0.00
847	301571	国科天成	100	5,768.00	0.00
848	601665	齐鲁银行	1,000	5,740.00	0.00
849	000538	云南白药	100	5,676.00	0.00
850	600259	中稀有色	100	5,626.00	0.00
851	300257	开山股份	400	5,620.00	0.00
852	603223	恒通股份	600	5,580.00	0.00
853	000960	锡业股份	200	5,576.00	0.00
854	603997	继峰股份	400	5,560.00	0.00
855	002466	天齐锂业	100	5,538.00	0.00
856	002545	东方铁塔	300	5,535.00	0.00
857	002673	西部证券	700	5,523.00	0.00
858	600764	中国海防	200	5,468.00	0.00
859	301389	隆扬电子	100	5,458.00	0.00
860	600725	云维股份	1,300	5,434.00	0.00
861	002554	惠博普	1,700	5,423.00	0.00
862	603707	健友股份	600	5,418.00	0.00
863	600094	大名城	1,300	5,408.00	0.00
864	600710	苏美达	500	5,405.00	0.00
865	002468	申通快递	400	5,368.00	0.00
866	603318	水发燃气	800	5,360.00	0.00
867	601619	嘉泽新能	1,200	5,328.00	0.00
868	301141	中科磁业	100	5,222.00	0.00
869	000650	仁和药业	900	5,085.00	0.00
870	002114	罗平锌电	600	5,052.00	0.00
871	002270	华明装备	200	5,008.00	0.00
872	002345	潮宏基	400	5,000.00	0.00
873	002266	浙富控股	1,200	4,992.00	0.00
874	000065	北方国际	400	4,984.00	0.00
875	601965	中国汽研	300	4,980.00	0.00
875	601096	宏盛华源	1,200	4,980.00	0.00
876	000639	西王食品	1,500	4,965.00	0.00
877	002097	山河智能	400	4,964.00	0.00
878	002497	雅化集团	200	4,950.00	0.00
879	300684	中石科技	100	4,922.00	0.00
880	300251	光线传媒	300	4,914.00	0.00
881	000423	东阿阿胶	100	4,908.00	0.00
882	600060	海信视像	200	4,856.00	0.00
883	002911	佛燃能源	400	4,848.00	0.00
884	603009	北特科技	100	4,816.00	0.00
885	000617	中油资本	500	4,800.00	0.00
886	000993	闽东电力	400	4,792.00	0.00
887	603011	合锻智能	200	4,742.00	0.00

888	600195	中牧股份	600	4,722.00	0.00
889	002555	三七互娱	200	4,720.00	0.00
890	002127	南极电商	1,400	4,718.00	0.00
891	000429	粤高速 A	400	4,712.00	0.00
892	688222	成都先导	200	4,690.00	0.00
893	600109	国金证券	500	4,650.00	0.00
894	601825	沪农商行	500	4,645.00	0.00
895	600536	中国软件	100	4,630.00	0.00
896	603619	中曼石油	200	4,610.00	0.00
897	300408	三环集团	100	4,575.00	0.00
898	600329	达仁堂	100	4,562.00	0.00
899	300031	宝通科技	200	4,546.00	0.00
900	300676	华大基因	100	4,536.00	0.00
901	300377	赢时胜	200	4,510.00	0.00
902	688107	安路科技	162	4,403.16	0.00
903	000534	万泽股份	200	4,400.00	0.00
904	600958	东方证券	400	4,360.00	0.00
905	600956	新天绿能	600	4,350.00	0.00
906	603868	飞科电器	100	4,328.00	0.00
907	601866	中远海发	1,700	4,284.00	0.00
908	605008	长鸿高科	300	4,281.00	0.00
909	002959	小熊电器	100	4,223.00	0.00
910	601933	永辉超市	900	4,221.00	0.00
911	300805	电声股份	400	4,220.00	0.00
912	605305	中际联合	100	4,166.00	0.00
913	002635	安洁科技	300	4,158.00	0.00
914	301078	孩子王	400	4,148.00	0.00
915	600639	浦东金桥	400	4,108.00	0.00
916	000878	云南铜业	200	4,102.00	0.00
917	002572	索菲亚	300	4,083.00	0.00
918	002271	东方雨虹	300	4,077.00	0.00
919	601456	国联民生	400	4,068.00	0.00
920	002587	奥拓电子	600	4,056.00	0.00
921	002948	青岛银行	900	4,032.00	0.00
922	600763	通策医疗	100	4,021.00	0.00
923	002250	联化科技	300	4,014.00	0.00
924	002741	光华科技	200	4,012.00	0.00
925	600906	财达证券	600	4,002.00	0.00
925	600203	福日电子	300	4,002.00	0.00
926	000006	深振业 A	400	3,980.00	0.00
927	300957	贝泰妮	100	3,961.00	0.00
928	300949	奥雅股份	100	3,920.00	0.00
929	000034	神州数码	100	3,891.00	0.00
930	601577	长沙银行	400	3,880.00	0.00

931	300168	万达信息	600	3,876.00	0.00
932	002507	涪陵榨菜	300	3,873.00	0.00
933	300206	理邦仪器	300	3,837.00	0.00
934	002426	胜利精密	1,000	3,830.00	0.00
935	002223	鱼跃医疗	100	3,821.00	0.00
936	600748	上实发展	700	3,794.00	0.00
936	002563	森马服饰	700	3,794.00	0.00
937	603638	艾迪精密	200	3,786.00	0.00
938	601117	中国化学	500	3,765.00	0.00
939	600496	精工钢构	900	3,735.00	0.00
940	600928	西安银行	1,000	3,700.00	0.00
941	300738	奥飞数据	200	3,698.00	0.00
942	600666	奥瑞德	1,100	3,696.00	0.00
943	603256	宏和科技	100	3,681.00	0.00
944	600935	华塑股份	1,500	3,675.00	0.00
945	300278	华昌达	600	3,660.00	0.00
945	002065	东华软件	400	3,660.00	0.00
946	002839	张家港行	800	3,656.00	0.00
947	300024	机器人	200	3,638.00	0.00
948	002039	黔源电力	200	3,634.00	0.00
949	000050	深天马 A	400	3,612.00	0.00
950	002405	四维图新	400	3,604.00	0.00
951	601512	中新集团	400	3,600.00	0.00
952	600755	厦门国贸	500	3,595.00	0.00
953	000539	粤电力 A	800	3,536.00	0.00
954	600744	华银电力	600	3,528.00	0.00
955	601997	贵阳银行	600	3,522.00	0.00
956	300627	华测导航	100	3,491.00	0.00
957	300002	神州泰岳	300	3,456.00	0.00
958	002181	粤传媒	400	3,448.00	0.00
959	300328	宜安科技	200	3,414.00	0.00
960	300267	尔康制药	1,000	3,410.00	0.00
961	300043	星辉娱乐	600	3,390.00	0.00
962	688127	蓝特光学	87	3,348.63	0.00
963	600326	西藏天路	300	3,309.00	0.00
964	000915	华特达因	100	3,304.00	0.00
965	300607	拓斯达	100	3,294.00	0.00
966	002950	奥美医疗	300	3,276.00	0.00
967	605599	菜百股份	200	3,274.00	0.00
968	688322	奥比中光-UW	36	3,228.12	0.00
969	600733	北汽蓝谷	400	3,212.00	0.00
970	300323	华灿光电	400	3,192.00	0.00
971	300696	爱乐达	100	3,191.00	0.00
972	002985	北摩高科	100	3,173.00	0.00

973	601158	重庆水务	700	3,129.00	0.00
974	301508	中机认检	100	3,126.00	0.00
975	300382	斯莱克	200	3,112.00	0.00
976	688629	华丰科技	31	3,101.86	0.00
977	300499	高澜股份	100	3,068.00	0.00
978	002939	长城证券	300	3,060.00	0.00
979	300568	星源材质	200	3,050.00	0.00
980	002882	金龙羽	100	3,016.00	0.00
981	601375	中原证券	700	3,010.00	0.00
982	300790	宇瞳光学	100	2,991.00	0.00
983	000009	中国宝安	300	2,955.00	0.00
984	301339	通行宝	200	2,908.00	0.00
985	300153	科泰电源	100	2,907.00	0.00
986	300009	安科生物	300	2,871.00	0.00
987	600373	中文传媒	300	2,802.00	0.00
988	603613	国联股份	100	2,800.00	0.00
989	002926	华西证券	300	2,784.00	0.00
990	601179	中国西电	300	2,730.00	0.00
991	600163	中闽能源	500	2,710.00	0.00
992	603899	晨光股份	100	2,706.00	0.00
993	600679	上海凤凰	200	2,686.00	0.00
994	002171	楚江新材	200	2,652.00	0.00
995	300975	商络电子	200	2,538.00	0.00
996	000728	国元证券	300	2,505.00	0.00
997	600759	洲际油气	800	2,496.00	0.00
998	002326	永太科技	100	2,492.00	0.00
999	000629	钒钛股份	800	2,480.00	0.00
1,000	300702	天宇股份	100	2,360.00	0.00
1,001	000719	中原传媒	200	2,352.00	0.00
1,001	601226	华电科工	300	2,352.00	0.00
1,002	000060	中金岭南	400	2,340.00	0.00
1,003	001267	汇绿生态	100	2,190.00	0.00
1,004	002249	大洋电机	200	2,180.00	0.00
1,005	301100	风光股份	100	2,131.00	0.00
1,006	601777	千里科技	200	2,126.00	0.00
1,007	002791	坚朗五金	100	2,121.00	0.00
1,008	600637	东方明珠	200	1,970.00	0.00
1,009	600125	铁龙物流	300	1,932.00	0.00
1,010	301321	翰博高新	100	1,905.00	0.00
1,011	300170	汉得信息	100	1,892.00	0.00
1,011	600004	白云机场	200	1,892.00	0.00
1,012	300645	正元智慧	100	1,873.00	0.00
1,013	300191	潜能恒信	100	1,848.00	0.00
1,014	002777	久远银海	100	1,794.00	0.00

1,015	002245	蔚蓝锂芯	100	1,780.00	0.00
1,016	603233	大参林	100	1,762.00	0.00
1,017	601827	三峰环境	200	1,694.00	0.00
1,018	002333	罗普斯金	300	1,686.00	0.00
1,019	600583	海油工程	300	1,647.00	0.00
1,020	601228	广州港	500	1,620.00	0.00
1,020	000415	渤海租赁	400	1,620.00	0.00
1,021	603766	隆鑫通用	100	1,611.00	0.00
1,022	600446	金证股份	100	1,592.00	0.00
1,023	000737	北方铜业	100	1,539.00	0.00
1,024	301507	民生健康	100	1,536.00	0.00
1,025	300075	数字政通	100	1,534.00	0.00
1,026	002669	康达新材	100	1,520.00	0.00
1,027	600662	外服控股	300	1,506.00	0.00
1,028	601677	明泰铝业	100	1,479.00	0.00
1,029	002614	奥佳华	200	1,462.00	0.00
1,029	600497	驰宏锌锗	200	1,462.00	0.00
1,030	002772	众兴菌业	100	1,459.00	0.00
1,031	600557	康缘药业	100	1,411.00	0.00
1,032	603363	傲农生物	300	1,383.00	0.00
1,033	600833	第一医药	100	1,293.00	0.00
1,034	600331	宏达股份	100	1,279.00	0.00
1,035	600640	国脉文化	100	1,256.00	0.00
1,036	300383	光环新网	100	1,251.00	0.00
1,037	600971	恒源煤电	200	1,248.00	0.00
1,038	600577	精达股份	100	1,243.00	0.00
1,039	600048	保利发展	200	1,220.00	0.00
1,040	300256	星星科技	300	1,209.00	0.00
1,041	000151	中成股份	100	1,188.00	0.00
1,042	000528	柳工	100	1,187.00	0.00
1,043	002423	中粮资本	100	1,170.00	0.00
1,044	002093	国脉科技	100	1,150.00	0.00
1,045	601528	瑞丰银行	200	1,140.00	0.00
1,046	600740	山西焦化	300	1,128.00	0.00
1,047	002064	华峰化学	100	1,100.00	0.00
1,048	300015	爱尔眼科	100	1,098.00	0.00
1,049	601878	浙商证券	100	1,081.00	0.00
1,050	000576	甘化科工	100	1,053.00	0.00
1,051	000016	深康佳 A	200	994.00	0.00
1,052	300459	汤姆猫	200	918.00	0.00
1,053	002658	雪迪龙	100	903.00	0.00
1,054	000750	国海证券	200	848.00	0.00
1,055	002936	郑州银行	400	772.00	0.00
1,056	000090	天健集团	100	370.00	0.00

1,057	000761	本钢板材	100	335.00	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	300308	中际旭创	24,672,248.00	15.66
2	002916	深南电路	21,340,094.60	13.55
3	002050	三花智控	19,922,080.00	12.65
4	603228	景旺电子	19,551,979.00	12.41
5	688498	源杰科技	11,432,732.78	7.26
6	300236	上海新阳	11,070,052.00	7.03
7	002384	东山精密	9,200,337.00	5.84
8	300476	胜宏科技	9,047,455.00	5.74
9	300033	同花顺	9,040,184.00	5.74
10	688256	寒武纪-U	8,760,040.92	5.56
11	300383	光环新网	7,519,642.00	4.77
12	600089	特变电工	6,561,706.07	4.17
13	601336	新华保险	6,395,269.00	4.06
14	688072	拓荆科技	5,984,815.91	3.80
15	300450	先导智能	5,787,626.00	3.67
16	688472	阿特斯	5,749,651.05	3.65
17	001309	德明利	5,331,563.96	3.38
18	688676	金盘科技	5,316,497.63	3.38
19	688599	天合光能	5,308,795.36	3.37
20	002517	恺英网络	4,816,591.00	3.06
21	601088	中国神华	4,798,994.00	3.05
22	002602	世纪华通	4,511,073.00	2.86
23	002463	沪电股份	4,380,225.50	2.78
24	688041	海光信息	4,041,247.92	2.57
25	000688	国城矿业	3,924,259.00	2.49
26	603179	新泉股份	3,880,800.00	2.46
27	688521	芯原股份	3,878,064.97	2.46
28	300750	宁德时代	3,826,430.00	2.43
29	300570	太辰光	3,807,710.00	2.42
30	300274	阳光电源	3,790,682.00	2.41
31	002028	思源电气	3,770,962.00	2.39
32	688668	鼎通科技	3,725,629.24	2.37
33	688183	生益电子	3,647,378.91	2.32
34	688266	泽璟制药-U	3,456,516.62	2.19

35	600309	万华化学	3,435,455.00	2.18
36	002422	科伦药业	3,426,020.00	2.18
37	002126	银轮股份	3,398,796.00	2.16
38	002812	恩捷股份	3,327,700.00	2.11
39	300059	东方财富	3,323,878.00	2.11
40	002074	国轩高科	3,302,425.00	2.10
41	603986	兆易创新	3,231,085.00	2.05
42	601899	紫金矿业	3,220,223.00	2.04
43	301219	腾远钴业	3,202,661.00	2.03
44	688516	奥特维	3,188,974.43	2.02

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	300308	中际旭创	25,710,580.00	16.32
2	002050	三花智控	21,725,391.00	13.79
3	603228	景旺电子	21,111,795.00	13.40
4	002916	深南电路	20,359,057.57	12.93
5	688498	源杰科技	12,627,406.43	8.02
6	300236	上海新阳	11,042,766.00	7.01
7	002384	东山精密	9,588,431.00	6.09
8	300033	同花顺	9,173,344.00	5.82
9	300476	胜宏科技	9,116,662.05	5.79
10	688256	寒武纪-U	8,243,810.61	5.23
11	300383	光环新网	8,151,122.00	5.17
12	688072	拓荆科技	7,091,634.14	4.50
13	601336	新华保险	6,643,842.00	4.22
14	600089	特变电工	6,383,322.98	4.05
15	688676	金盘科技	6,258,334.71	3.97
16	300450	先导智能	5,751,046.00	3.65
17	001309	德明利	5,627,780.00	3.57
18	688041	海光信息	5,308,197.22	3.37
19	688472	阿特斯	5,191,019.95	3.30
20	601088	中国神华	4,750,286.00	3.02

21	002463	沪电股份	4,599,073.00	2.92
22	002517	恺英网络	4,581,354.00	2.91
23	688599	天合光能	4,533,416.76	2.88
24	300750	宁德时代	4,250,259.40	2.70
25	000688	国城矿业	3,999,655.00	2.54
26	002028	思源电气	3,879,613.12	2.46
27	688521	芯原股份	3,856,609.17	2.45
28	603986	兆易创新	3,796,591.00	2.41
29	300570	太辰光	3,755,087.00	2.38
30	002422	科伦药业	3,703,528.00	2.35
31	300274	阳光电源	3,697,567.00	2.35
32	688183	生益电子	3,697,535.46	2.35
33	002126	银轮股份	3,571,426.92	2.27
34	688668	鼎通科技	3,543,522.40	2.25
35	601398	工商银行	3,539,276.00	2.25
36	002602	世纪华通	3,516,418.00	2.23
37	600309	万华化学	3,433,403.00	2.18
38	600362	江西铜业	3,409,062.00	2.16
39	300059	东方财富	3,408,023.00	2.16
40	301219	腾远钴业	3,352,830.00	2.13
41	002851	麦格米特	3,344,218.00	2.12
42	002484	江海股份	3,338,927.00	2.12
43	688266	泽璟制药-U	3,285,720.98	2.09
44	603179	新泉股份	3,280,476.00	2.08
45	688279	峰昭科技	3,263,403.90	2.07
46	002905	金逸影视	3,243,302.00	2.06
47	601899	紫金矿业	3,174,873.00	2.02
48	002812	恩捷股份	3,153,466.00	2.00

#### 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	835,890,841.63
卖出股票收入（成交）总额	820,704,749.90

#### 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	202,324,047.09	23.71
2	央行票据	-	-

3	金融债券	162,298,608.22	19.02
	其中：政策性金融债	121,837,167.12	14.28
4	企业债券	203,660,319.44	23.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	130,487,019.74	15.29
7	可转债（可交换债）	3,473,815.25	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	702,243,809.74	82.29

#### 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	250022.IB	25 付息国债 22	2,000,000	199,342,209.94	23.36
2	250431.IB	25 农发 31	700,000	70,328,865.75	8.24
3	220208.IB	22 国开 08	500,000	51,508,301.37	6.04
4	243594.SH	25 东兴 G1	500,000	50,478,591.78	5.92
5	102200189.IB	22 知识城 MTN006	500,000	50,329,832.88	5.90

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 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

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

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

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

### 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，东兴证券股份有限公司在本期曾被中国证券监督管理委员会或其派出机构立案调查。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。国家开发银行、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。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	193,228.49
2	应收清算款	392,538.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	285,512.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	871,278.85

### 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	123107.SZ	温氏转债	1,803,341.06	0.21
2	128129.SZ	青农转债	894,785.48	0.10
3	113045.SH	环旭转债	648,558.94	0.08
4	113048.SH	晶科转债	125,380.46	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	2,313,130.00	0.27	重大事项停牌

§ 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
广发集瑞债券 A	324	1,542,767.4 1	458,854,716.07	91.80%	41,001,923.27	8.20%
广发集瑞债券 C	1,876	119,983.18	206,833,671.37	91.89%	18,254,772.97	8.11%
广发集瑞债券 E	33	2,607,176.0 8	85,669,717.01	99.57%	367,093.57	0.43%
合计	2,233	363,180.43	751,358,104.45	92.65%	59,623,789.81	7.35%

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	广发集瑞债券 A	18,296,745.40	3.6604%

有本基金	广发集瑞债券 C	50,503.30	0.0224%
	广发集瑞债券 E	48,389.94	0.0562%
	合计	18,395,638.64	2.2683%

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	广发集瑞债券 A	>100
	广发集瑞债券 C	0
	广发集瑞债券 E	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发集瑞债券 A	>100
	广发集瑞债券 C	0
	广发集瑞债券 E	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发集瑞债券 A	广发集瑞债券 C	广发集瑞债券 E
基金合同生效日（2016年 11 月 18 日）基金份额总额	200,035,240.81	20,543.91	-
本报告期期初基金份额总额	153,389,981.01	12,882.30	-
本报告期基金总申购份额	703,162,634.06	626,877,993.06	216,337,688.14
减：本报告期基金总赎回份额	356,695,975.73	401,802,431.02	130,300,877.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	499,856,639.34	225,088,444.34	86,036,810.58

注：广发集瑞债券型证券投资基金自 2025 年 8 月 14 日起增设 E 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

## § 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、公募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 34,000 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，未收到本托管人关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

#### 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，未收到本托管人证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

### 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	1,241,979,775.16	74.97%	541,508.22	75.06%	-
申万宏源证券	2	333,125,611.34	20.11%	145,242.44	20.13%	-
中信证券	2	66,470,804.39	4.01%	28,981.30	4.02%	-

方正证券	1	15,019,400.64	0.91%	5,707.45	0.79%	新增 1 个
国联民生	2	-	-	-	-	-
中国银河	1	-	-	-	-	-
光大证券	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
招商证券	686,067,073.65	49.36%	745,549,000.00	69.71%	-	-
申万宏源证券	151,462,123.59	10.90%	270,000,000.00	25.24%	-	-
中信证券	552,426,437.57	39.74%	54,000,000.00	5.05%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

### 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 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-29
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21
4	广发集瑞债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-07
5	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
6	关于广发集瑞债券型证券投资基金 E 类基金份额开放日常申购、赎回和转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-13
7	关于广发集瑞债券型证券投资基金 E 类基金份额暂停大额申购(含转换转入)业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-13
8	关于广发集瑞债券型证券投资基金新增 E 类基金份额并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-13
9	关于广发集瑞债券型证券投资基金开放日常定期投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-19
10	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
11	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	关于广发集瑞债券型证券投资基金 A 类和 C 类基金份额暂停机构投资者大额申购(含转换转入、定期定额和不定额投资)业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-20
13	广发集瑞债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-28
14	关于广发集瑞债券型证券投资基金 A 类和 C 类基金份额恢复机构投资者大额申购(含转换转入、定期定额和不定额投资)业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-12-02

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250101-20250513	50,115,192.	-	50,115,192.	-	-

			29		29		
2	20250609-20250611		-	29,717,682.02	-	29,717,682.02	3.66%
3	20250101-20250126,20250211-20250211,20250325-20250326,20250508-20250605	34,451,225.51		-	34,451,225.51	-	-
4	20250514-20250611		-	29,055,302.66	29,055,302.66	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的投资需求，本基金管理人经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，自2025年8月14日起在本基金现有份额的基础上增设E类基金份额(基金代码:025227)，原A类和C类基金份额保持不变，并根据最新法律法规对《广发集瑞债券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《关于广发集瑞债券型证券投资基金新增E类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发集瑞债券型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发集瑞债券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.《广发集瑞债券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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二六年三月三十日