广发价值回报混合型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发价值回报混合
基金主代码	004852
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 29 日
报告期末基金份额总额	842,092,233.73 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影

	响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。	
业绩比较基准	沪深 300 指数×20%+中债-综合财富（总值）指数×70%+银行活期存款利率（税后）×10%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发价值回报混合 A	广发价值回报混合 C
下属分级基金的交易代码	004852	004853
报告期末下属分级基金的份额总额	477,391,961.61 份	364,700,272.12 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	广发价值回报混合 A	广发价值回报混合 C
1.本期已实现收益	3,425,817.11	1,527,875.85
2.本期利润	17,676,894.88	9,681,254.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0330	0.0292

4.期末基金资产净值	718,417,313.21	528,291,956.41
5.期末基金份额净值	1.5049	1.4486

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

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

3.2 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

1、广发价值回报混合 A：

阶段	净值增长率①	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	1.95%	0.33%	-1.81%	0.26%	3.76%	0.07%
过去六个月	-0.71%	0.38%	1.34%	0.26%	-2.05%	0.12%
过去一年	0.49%	0.35%	1.56%	0.23%	-1.07%	0.12%
过去三年	15.68%	0.41%	13.81%	0.22%	1.87%	0.19%
过去五年	18.25%	0.35%	14.29%	0.22%	3.96%	0.13%
过去七年	37.53%	0.33%	27.73%	0.23%	9.80%	0.10%
自基金合同生效起至今	50.49%	0.30%	40.15%	0.24%	10.34%	0.06%

2、广发价值回报混合 C：

阶段	净值增长率①	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	1.85%	0.33%	-1.81%	0.26%	3.66%	0.07%
过去六个月	-0.91%	0.38%	1.34%	0.26%	-2.25%	0.12%

过去一年	0.10%	0.35%	1.56%	0.23%	-1.46%	0.12%
过去三年	14.30%	0.41%	13.81%	0.22%	0.49%	0.19%
过去五年	15.92%	0.35%	14.29%	0.22%	1.63%	0.13%
过去七年	33.75%	0.33%	27.73%	0.23%	6.02%	0.10%
自基金合同生效起至今	44.86%	0.30%	40.15%	0.24%	4.71%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

广发价值回报混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 11 月 29 日至 2026 年 9 月 30 日)

1、广发价值回报混合 A：



2、广发价值回报混合 C：



注：自 2019 年 11 月 7 日起，本基金的业绩比较基准由“中证全债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%”变更为“沪深 300 指数×20%+中债-综合财富（总值）指数×70%+银行活期存款利率（税后）×10%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张芊	本基金的基金经理；广发聚鑫债券型证券投资基金的基金经理；广发集丰债券型证券投资基金的基金经理；广发汇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发招享混合型证券投资基金的基金经理；广	2026-08-20	-	25.4 年	张芊女士，中国籍，经济学和工商管理双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国银河证券研究中心研究员，中国人保资产管理有限公司高级研究员、投资主管，工银瑞信基金管理有限公司研究员，长盛基金管理有限公司投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部总经理、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 11

	发聚荣一年持有期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；广发增强债券型证券投资基金的基金经理；广发恒昌一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发现金增利货币市场基金的基金经理；广发恒通六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集远债券型证券投资基金的基金经理；广发安润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集轩债券型证券投资基金的基金经理；公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理、混合资产投资部总经理				月 23 日至 2016 年 12 月 8 日)、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 12 月 30 日至 2017 年 2 月 6 日)、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 12 月 29 日至 2018 年 1 月 6 日)、广发集安债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 20 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理(自 2015 年 12 月 25 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发集丰债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 1 日至 2019 年 1 月 8 日)、广发集源债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 20 日至 2019 年 1 月 8 日)、广发集裕债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 5 月 11 日至 2020 年 10 月 27 日)、广发汇优 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 5 日至 2021 年 1 月 27 日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2012 年 12 月 14 日至 2021 年 3 月 12 日)、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 3 月 1 日至 2021 年 4 月 14 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 10 月 27 日至 2021 年 11 月 19 日)、广发安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 19 日至 2025 年 3 月 19 日)。
张雪	本基金的基金经理；广发恒通六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集远债	2022-03-15	-	18.3 年	张雪女士，中国籍，工商管理硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任北京银行资金交易部债券交易员，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

	券型证券投资基金的基金经理；广发安润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集轩债券型证券投资基金的基金经理；广发稳致混合型证券投资基金的基金经理；混合资产投资部副总经理				固定收益投资部基金经理、固定收益投资部总监助理兼基金经理、固定收益投资部副总监兼基金经理，曾兼任广发基金管理有限公司固定收益研究部副总经理、广发聚财信用债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 4 月 29 日至 2024 年 2 月 22 日)。

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 29 次，其中 27 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 2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，债市中长端收益率震荡下行，短端相对承压，收益率曲线进一步走平。具体来看，7 月，政策利率换锚预期落空和超长债供给担忧一度压制市场，随后经济金融数据承压与权益市场调整为长端债市提供利多支撑；下旬，随着 MLF 增量续作及政治局会议释放偏宽松信号，长端和超长端收益率加速下行。8 月，债市在上旬窄幅震荡后，内需数据偏弱、央行首次于月中开展隔夜逆回购等因素推动长端收益率继续突破下行；下旬，受资金价格回升、交易盘止盈以及 MLF 缩量续作的影响，债市转入调整，直至月末央行加大流动性投放。进入 9 月，跨月后资金转松和权益市场调整推动长债走强，期间长端虽受到税期资金面收敛、油价攀升及输入性通胀等因素的扰动，但内需读数和融资需求承压继续支撑债市维持震荡偏强格局。整体来看，三季度债市延续年初以来长端利率震荡下行态势，短端则受到资金价格约束，曲线进一步平坦化，信贷需求偏弱与机构配置需求成为债市的核心驱动因素。权益市场方面，三季度从此前的极端分化走向风格再平衡。上半年被集中定价的方向，本季度波动明显加大。定价重心由估值扩张转向盈利验证，市场更加关注产业趋势能否落到可兑现的业绩上，尤其是资本开支的持续性、商业化进程能否形成收入和利润，而非仅凭叙事推升估值。人工智能相关产业链仍处于拉锯状态，成长方向波动加大，但这更多是前期集中交易之后的再定价，产业趋势本身并未出现逆转。与此同时，资源与红利方向阶段性相对偏强，行情不再集中于少数成长链条。全季成交较阶段高位明显收敛，增量资金推动的普涨难以延续。季内市场先经历较深调整，此后有所修复，临近季末

则重新转为缩量震荡，个股和行业之间的差异比市场整体方向更为突出。

报告期内，组合密切跟踪市场动向，债券方面，组合灵活调整持仓券种结构、杠杆和久期分布；权益方面，组合对持仓的行业结构进行了调整，降低了有色金属和石油石化的配置，行业分布较二季度更为分散。调整落在行业之间的相对比重上，持仓覆盖的行业较二季度更广，单一行业对组合的影响相应下降。在维持产品既定风险收益特征的前提下，组合后续将逐步引入量化指数增强策略。指数标的将以市值加权宽基指数为主，以更好匹配产品的风险定位及投资约束。相关策略将结合市场环境分步推进。

展望 2026 年四季度，预计债券市场的主线在于基本面、资金面和供需格局。基本面方面，关注新型政策性金融工具等稳投资手段落地后实物工作量的变化情况，输入性通胀或阶段性加大经济结构分化；资金面有望保持均衡宽松，资金价格继续围绕政策利率窄幅波动，关注政策利率换锚对资金价格中枢的影响；供需格局方面，关注四季度政府债和政金债供给放量节奏，以及机构配置意愿的变化。总体来看，四季度债市多空交织。在经济转型和新旧动能分化的背景下，资金面宽松、信贷需求偏弱和机构欠配对债市的基础性支撑有望延续，但资金价格中枢和政府债供给等因素制约债市收益率的下行空间，债市不具备结构性牛市的基础，收益率中短端震荡，关注长端结构性机会。权益市场方面，预计仍将呈现盈利验证驱动下的结构分化，整体更可能演绎震荡中的结构性行情，而不是单一方向的快速扩张。人工智能相关产业链的内部分化还会延续，成长方向难以再只靠估值扩张推进；资源等阶段性相对偏强的方向，也需要业绩进一步确认，难以直接成为新的单一主线。组合将继续跟踪产业发展，把观察重点放在企业能否释放业绩上，并结合市场节奏调整持仓结构，保持结构相对均衡。在业绩得到进一步确认之前，不宜用单一产业叙事替代对基本面的跟踪。

4.5 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 1.95%，C 类基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为-1.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	257,135,131.27	20.16
	其中：股票	257,135,131.27	20.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	996,139,262.06	78.10
	其中：债券	996,139,262.06	78.10
	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	17,000,764.49	1.33
	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	4,628,170.25	0.36
8	其他资产	512,957.78	0.04
9	合计	1,275,416,285.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	29,971,264.75	2.40
C	制造业	165,106,197.29	13.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	372,077.58	0.03

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,009,500.00	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,489,291.65	0.36
J	金融业	30,060,400.00	2.41
K	房地产业	1,014,000.00	0.08
L	租赁和商务服务业	5,676,000.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	2,752,000.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	2,684,400.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	257,135,131.27	20.63

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601601	中国太保	300,000	9,318,000.00	0.75
2	600031	三一重工	519,959	9,094,082.91	0.73
3	601899	紫金矿业	300,000	8,937,000.00	0.72
4	600309	万华化学	120,000	8,268,000.00	0.66
5	002028	思源电气	62,700	7,552,842.00	0.61
6	688825	长鑫科技	185,849	7,422,936.53	0.60
7	300750	宁德时代	25,000	7,277,750.00	0.58
8	002001	新和成	280,000	7,266,000.00	0.58
9	600426	华鲁恒升	369,200	7,173,556.00	0.58
10	600362	江西铜业	160,000	6,688,000.00	0.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	65,475,821.31	5.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	226,094,317.26	18.14
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	486,379,077.80	39.01
5	企业短期融资券	20,017,521.10	1.61
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	198,172,524.59	15.90
9	其他	-	-
10	合计	996,139,262.06	79.90

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	112605266.IB	26 建设银行 CD266	1,000,000	99,454,708.70	7.98
2	112617071.IB	26 光大银行 CD071	1,000,000	98,717,815.89	7.92
3	240505.SH	24 中证 G2	700,000	71,337,978.08	5.72
4	2228014.IB	22 交通银行二级 01	600,000	61,709,063.01	4.95
5	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	500,000	52,210,260.27	4.19

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司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。交通银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中泰证券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或其分支行的处罚。中国光大银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

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。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	101,288.98
2	应收证券清算款	366,938.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,730.01
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	512,957.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	6,608,647.55	0.53	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发价值回报混合A	广发价值回报混合C
报告期期初基金份额总额	572,146,086.45	416,506,096.22
报告期期间基金总申购份额	4,843,929.94	78,177,945.49
减：报告期期间基金总赎回份额	99,598,054.78	129,983,769.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	477,391,961.61	364,700,272.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的

情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20260713-20260930	180,590,330.50	-	-	180,590,330.50	21.45%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定，在履行规定审批程序并经基金托管人同意后，本基金参加了上海燧原科技股份有限公司（以下简称“燧原科技”）首次公开发行股票的申购。燧原科技本次发行的联席主承销商广发证券股份有限公司为本公司的控股股东，保荐人（主承销商）中信证券股份有限公司、联席主承销商国泰海通证券股份有限公司为本公司旗下部分公募基金托管人及其关联方。详情可见本基金管理人网站

（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告》。

2、根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规、基金合同及招募说明书等规定，在履行规定审批程序并经基金托管人同意后，本基金参加了粤芯半导体技术股份有限公司（以下简称“粤芯半导体”）首次公开发行股票的申购。粤芯半导体本次发行的保荐人（联席主承销商）广发证券股份有限公司为本基金管理人的控股股东，联席主承销商国泰海通证券股份有限公司为本基金管理人旗下部分公募基金托管人及其关联方。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会注册广发价值回报混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发价值回报混合型证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发价值回报混合型证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、营业执照

7.基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日