

# 广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

### 2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	51
<b>10 重大事件揭示</b> .....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	54
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>12 备查文件目录</b> .....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发量化多因子混合
基金主代码	005225
交易代码	005225
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 21 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,763,465.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过量化模型构建股票组合，力争实现超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观环境、政策因素、资金供求因素、证券市场基本面等角度进行综合分析，判断各类资产的市场趋势和预期风险收益，在严格控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	王小飞
	联系电话	020-83936666	021-60637103
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828	021-60637228
传真		020-34281105	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道	北京市西城区闹市口大街1号

	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	院1号楼
邮政编码	510308	100033
法定代表人	葛长伟	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	-7,895,418.84
本期利润	-13,040,144.44
加权平均基金份额本期利润	-0.2370
本期加权平均净值利润率	-19.47%
本期基金份额净值增长率	-14.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	8,336,022.88
期末可供分配基金份额利润	0.1642
期末基金资产净值	59,099,488.61
期末基金份额净值	1.1642
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.42%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-6.65%	1.78%	-8.54%	1.50%	1.89%	0.28%
过去三个月	-5.98%	1.94%	-6.70%	1.09%	0.72%	0.85%
过去六个月	-14.47%	2.39%	-4.07%	1.01%	-10.40%	1.38%
过去一年	-14.11%	1.79%	-13.31%	0.89%	-0.80%	0.90%
过去三年	-41.19%	1.39%	-34.02%	0.97%	-7.17%	0.42%
自基金合同生效起至今	16.42%	1.34%	-16.89%	1.11%	33.31%	0.23%

注：（1）自 2024 年 5 月 29 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%”变更为“国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

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

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

广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2018 年 3 月 21 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：自 2024 年 5 月 29 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%”变更为“国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

## 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		
易威	本基金的基金经理；广发对冲套利定期开	2023-07-06	-	11 年	易威先生，应用统计硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司中央交易

	放混合型发起式证券投资基金的基金经理；广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理				部股票交易员、量化投资部量化研究员、量化投资部投资经理。
李育鑫	本基金的基金经理；广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2023-10-23	-	5 年	李育鑫先生，统计学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司资产配置部量化研究员、量化投资部量化研究员。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

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，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗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；稽核岗通过对投资、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 14 次，其中 13 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，权益市场整体震荡调整，大小市值风格分化明显，其中表征大市值风格的上证 50、沪深 300 分别上涨 2.95%、0.89%，而表征中小市值风格的中证 1000、中证 2000 分别下跌 16.84%、23.28%。按照申万一级行业分类，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，而综合、计算机、商贸零售、社会服务、传媒等行业则跌幅较大，综合体现了市场现阶段对行业估值、景气度变化以及盈利的稳定性等多个因素的关注。

报告期间，本基金根据量化模型进行投资运作，通过多模型多策略的方式提高组合的稳定性，力争更充分地利用量化模型在信息广度上的优势，整体保持均衡的投资思路，对基本面类和价量类因子进行均衡配置，持股分散度较高，避免过度集中少数行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-14.47%，同期业绩比较基准收益率为-4.07%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在中短期内，由于市场风险偏好处于较低水平，权益资产在一定程度上仍然承压。但从长期维度来看，当前权益资产估值已经处于历史较低分位，是挖掘长期投资机会的良机。在投资管理上，本产品将继续按照量化模型进行运作，力争获取相对业绩基准的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,279,462.19	384,370.06
结算备付金		322,732.48	397,762.91
存出保证金		16,852.24	481,182.64
交易性金融资产	6.4.7.2	57,954,518.38	76,890,970.89
其中：股票投资		55,416,831.26	73,013,116.59
基金投资		-	-
债券投资		2,537,687.12	3,877,854.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	3,002,825.76
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	161,339.66
应收股利		-	-
应收申购款		29,848.44	27,485.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		59,603,413.73	81,345,937.00
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		49,884.05	-
应付赎回款		169,168.69	108,798.91
应付管理人报酬		53,483.84	50,509.25
应付托管费		10,696.74	10,101.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	220,691.80	267,529.04
负债合计		503,925.12	436,939.06
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.8	50,763,465.73	59,440,895.38
未分配利润	6.4.7.9	8,336,022.88	21,468,102.56
净资产合计		59,099,488.61	80,908,997.94
负债和净资产总计		59,603,413.73	81,345,937.00

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.1642 元，基金份额总额 50,763,465.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-12,571,458.60</b>	<b>5,116,856.27</b>
1.利息收入		6,604.90	16,342.31
其中：存款利息收入	6.4.7.10	5,662.99	16,342.31
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		941.91	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,599,717.42	-1,905,016.60
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-7,989,426.65	-2,232,262.23
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	39,943.90	29,615.93
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-126,794.71	228,679.90
股利收益	6.4.7.17	476,560.04	68,949.80
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-5,144,725.60	6,440,380.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	166,379.52	565,150.06
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>468,685.84</b>	<b>377,738.33</b>
1. 管理人报酬		330,277.79	239,233.32
2. 托管费		66,055.47	59,808.34
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	824.14
8. 其他费用	6.4.7.21	72,352.58	77,872.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-13,040,144.44</b>	<b>4,739,117.94</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-13,040,144.44</b>	<b>4,739,117.94</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-13,040,144.44</b>	<b>4,739,117.94</b>

注：比较数据已根据更新发布的《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>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,440,895.38	21,468,102.56	80,908,997.94
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	59,440,895.38	21,468,102.56	80,908,997.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,677,429.65	-13,132,079.68	-21,809,509.33
（一）、综合收益总额	-	-13,040,144.44	-13,040,144.44
（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）	-8,677,429.65	-91,935.24	-8,769,364.89
其中：1. 基金申购款	22,433,048.01	5,317,863.71	27,750,911.72
2. 基金赎回款	-31,110,477.66	-5,409,798.95	-36,520,276.61
（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	50,763,465.73	8,336,022.88	59,099,488.61
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	82,621,721.01	31,369,874.07	113,991,595.08
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	82,621,721.01	31,369,874.07	113,991,595.08

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-73,703,735.69	-28,199,114.35	-101,902,850.04
（一）、综合收益总额	-	4,739,117.94	4,739,117.94
（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）	-73,703,735.69	-32,938,232.29	-106,641,967.98
其中：1.基金申购款	44,039,867.89	14,986,095.73	59,025,963.62
2.基金赎回款	-117,743,603.58	-47,924,328.02	-165,667,931.60
（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	8,917,985.32	3,170,759.72	12,088,745.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可（2017）1514 号《关于准予广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 2 月 12 日向社会公开发行募集并于 2018 年 3 月 21 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 2 月 12 日至 2018 年 3 月 16 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 237,368,420.96 元，有效认购户数为 1,851 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 48,803.01 元，折合基金份额 48,803.01 份，按照基金合同的有关约定计入

基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### （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费附加

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。

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费附加。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,279,462.19
等于：本金	1,279,238.29
加：应计利息	223.90
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	1,279,462.19

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		60,498,965.26	-	55,416,831.26	-5,082,134.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,506,269.70	32,697.12	2,537,687.12	-1,279.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,506,269.70	32,697.12	2,537,687.12	-1,279.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		63,005,234.96	32,697.12	57,954,518.38	-5,083,413.70

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融工具。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 债权投资**

本基金本报告期末无债权投资。

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	44.85
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	169,428.51
其中：交易所市场	169,428.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	51,218.44
合计	220,691.80

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,440,895.38	59,440,895.38
本期申购	22,433,048.01	22,433,048.01
本期赎回（以“-”号填列）	-31,110,477.66	-31,110,477.66
本期末	50,763,465.73	50,763,465.73

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,919,707.04	-451,604.48	21,468,102.56
本期期初	21,919,707.04	-451,604.48	21,468,102.56
本期利润	-7,895,418.84	-5,144,725.60	-13,040,144.44
本期基金份额交易产生的变动数	-2,892,336.11	2,800,400.87	-91,935.24
其中：基金申购款	5,934,688.66	-616,824.95	5,317,863.71
基金赎回款	-8,827,024.77	3,417,225.82	-5,409,798.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,131,952.09	-2,795,929.21	8,336,022.88

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	3,124.14
其他	196.89

合计	5,662.99
----	----------

### 6.4.7.11 股票投资收益

#### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,989,426.65
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	-7,989,426.65

#### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	233,211,244.22
减：卖出股票成本总额	240,710,214.52
减：交易费用	490,456.35
买卖股票差价收入	-7,989,426.65

### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	30,471.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,472.34
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	39,943.90

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,913,976.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,821,087.06
减：应计利息总额	83,415.85
减：交易费用	1.06
买卖债券差价收入	9,472.34

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-126,794.71

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	476,560.04
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	476,560.04

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-5,164,975.60
——股票投资	-5,158,841.66
——债券投资	-6,133.94
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	20,250.00

——权证投资	-
——股指期货投资	20,250.00
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	-5,144,725.60

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	96,355.53
基金转换费收入	70,023.99
合计	166,379.52

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	11,436.88
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,127.27
其他	20,006.87
合计	72,352.58

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	330,277.79	239,233.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	33,950.56	40,304.11
应支付基金管理人的净管理费	296,327.23	198,929.21

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	66,055.47	59,808.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

根据本基金管理人 2023 年 7 月 8 日发布的《关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金的托管费年费率由 0.25% 调整为本费率。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
报告期初持有的基金份额	22,434,938.68	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	22,434,938.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	44.20%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,279,462.19	2,341.96	133,504.84	9,798.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立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；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。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。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,828,969.72	3,854,852.76
合计	1,828,969.72	3,854,852.76

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	-	-
AAA 以下	-	23,001.54
未评级	708,717.40	-
合计	708,717.40	23,001.54

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。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30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	1,279,462.19	-	-	-	1,279,462.19
结算备付金	322,732.48	-	-	-	322,732.48
存出保证金	16,852.24	-	-	-	16,852.24
交易性金融资产	2,537,687.12	-	-	55,416,831.26	57,954,518.38
应收申购款	-	-	-	29,848.44	29,848.44
资产总计	4,156,734.03	-	-	55,446,679.70	59,603,413.73
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	49,884.05	49,884.05
应付赎回款	-	-	-	169,168.69	169,168.69
应付管理人报酬	-	-	-	53,483.84	53,483.84
应付托管费	-	-	-	10,696.74	10,696.74
其他负债	-	-	-	220,691.80	220,691.80
负债总计	-	-	-	503,925.12	503,925.12
利率敏感度缺口	4,156,734.03	-	-	54,942,754.58	59,099,488.61
<b>上年度末 2023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	384,370.06	-	-	-	384,370.06
结算备付金	397,762.91	-	-	-	397,762.91
存出保证金	481,182.64	-	-	-	481,182.64
交易性金融资产	3,877,854.30	-	-	73,013,116.59	76,890,970.89
买入返售金融资产	3,002,825.76	-	-	-	3,002,825.76
应收清算款	-	-	-	161,339.66	161,339.66
应收申购款	-	-	-	27,485.08	27,485.08
资产总计	8,143,995.67	-	-	73,201,941.33	81,345,937.00
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	108,798.91	108,798.91
应付管理人报酬	-	-	-	50,509.25	50,509.25
应付托管费	-	-	-	10,101.84	10,101.84

应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	267,529.04	267,529.04
负债总计	-	-	-	436,939.06	436,939.06
利率敏感度缺口	8,143,995.67	-	-	72,765,002.27	80,908,997.94

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-1,784.64	-2,945.76
	市场利率下降 25 个基点	1,789.61	2,950.36

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	55,416,831.26	93.77	73,013,116.59	90.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	23,001.54	0.03
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	55,416,831.26	93.77	73,036,118.13	90.27

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	3,214,892.91	3,365,357.52
	下降 5%	-3,214,892.91	-3,365,357.52

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	55,416,831.26
第二层次	2,537,687.12
第三层次	-
合计	57,954,518.38

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	55,416,831.26	92.98
	其中：普通股	55,398,426.26	92.95
	存托凭证	18,405.00	0.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,537,687.12	4.26
	其中：债券	2,537,687.12	4.26
	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	1,602,194.67	2.69
8	其他各项资产	46,700.68	0.08
9	合计	59,603,413.73	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	129,992.00	0.22
B	采矿业	1,424,978.00	2.41

C	制造业	37,647,027.06	63.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,472,219.00	4.18
E	建筑业	1,132,452.00	1.92
F	批发和零售业	1,929,028.00	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	577,523.00	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,681,009.80	7.92
J	金融业	296,129.00	0.50
K	房地产业	1,560,493.00	2.64
L	租赁和商务服务业	537,428.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	1,014,493.80	1.72
N	水利、环境和公共设施管理业	1,385,221.60	2.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	39,851.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	588,986.00	1.00
S	综合	-	-
	合计	55,416,831.26	93.77

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000601	韶能股份	128,000	472,320.00	0.80
2	300047	天源迪科	69,700	455,838.00	0.77
3	601886	江河集团	92,900	453,352.00	0.77
4	603330	天洋新材	93,300	446,907.00	0.76
5	603727	博迈科	32,800	431,648.00	0.73

6	002286	保龄宝	76,900	423,719.00	0.72
7	601616	广电电气	144,800	421,368.00	0.71
8	300194	福安药业	112,500	420,750.00	0.71
9	002923	润都股份	45,300	419,478.00	0.71
10	603909	建发合诚	49,960	415,667.20	0.70
11	600693	东百集团	145,200	408,012.00	0.69
12	002479	富春环保	114,200	401,984.00	0.68
13	603318	水发燃气	70,400	398,464.00	0.67
14	300380	安硕信息	25,800	396,288.00	0.67
15	600736	苏州高新	93,400	388,544.00	0.66
16	601700	风范股份	86,300	378,857.00	0.64
17	300016	北陆药业	85,200	375,732.00	0.64
18	300048	合康新能	80,000	370,400.00	0.63
19	002358	森源电气	104,000	355,680.00	0.60
20	000920	沃顿科技	47,400	347,442.00	0.59
21	603112	华翔股份	32,800	344,728.00	0.58
22	603618	杭电股份	76,600	335,508.00	0.57
23	002135	东南网架	84,200	333,432.00	0.56
24	002412	汉森制药	64,100	331,397.00	0.56
25	300679	电连技术	8,100	325,863.00	0.55
26	002688	金河生物	89,700	325,611.00	0.55
27	000852	石化机械	60,500	324,280.00	0.55
28	600603	广汇物流	63,100	318,024.00	0.54
29	002753	永东股份	54,400	316,064.00	0.53
30	000926	福星股份	99,200	314,464.00	0.53
31	002237	恒邦股份	27,300	314,223.00	0.53
32	000949	新乡化纤	90,900	309,060.00	0.52
33	002876	三利谱	12,700	306,324.00	0.52
34	002054	德美化工	61,600	302,456.00	0.51
35	603158	腾龙股份	42,900	302,016.00	0.51
36	000795	英洛华	54,500	301,930.00	0.51
37	300422	博世科	62,800	298,928.00	0.51
38	300566	激智科技	21,000	293,790.00	0.50
39	600658	电子城	88,400	290,836.00	0.49
40	002066	瑞泰科技	36,400	289,380.00	0.49
41	600758	辽宁能源	99,900	285,714.00	0.48
42	002376	新北洋	52,800	284,592.00	0.48
43	603186	华正新材	11,900	282,982.00	0.48
44	002277	友阿股份	130,000	280,800.00	0.48
45	605305	中际联合	10,740	276,984.60	0.47
46	300857	协创数据	4,800	273,600.00	0.46
47	688365	光云科技	45,400	273,308.00	0.46
48	600778	友好集团	70,200	273,078.00	0.46
49	002082	万邦德	64,500	271,545.00	0.46

50	605066	天正电气	48,725	271,398.25	0.46
51	600336	澳柯玛	62,900	269,212.00	0.46
52	300441	鲍斯股份	45,200	268,036.00	0.45
53	300565	科信技术	26,500	266,325.00	0.45
54	600222	太龙药业	63,100	265,020.00	0.45
55	000600	建投能源	41,700	262,710.00	0.44
56	600526	菲达环保	70,300	260,813.00	0.44
57	300535	达威股份	21,800	257,240.00	0.44
58	002296	辉煌科技	24,700	254,657.00	0.43
59	002100	天康生物	36,700	254,331.00	0.43
60	600067	冠城大通	143,800	251,650.00	0.43
61	600784	鲁银投资	52,700	249,798.00	0.42
62	603626	科森科技	42,700	237,412.00	0.40
63	301260	格力博	17,300	235,626.00	0.40
64	603577	汇金通	33,800	234,572.00	0.40
65	300213	佳讯飞鸿	41,100	234,270.00	0.40
66	600284	浦东建设	43,600	232,824.00	0.39
67	000550	江铃汽车	10,600	230,126.00	0.39
68	002519	银河电子	46,300	227,333.00	0.38
69	002616	长青集团	52,400	226,368.00	0.38
70	002469	三维化学	39,700	226,290.00	0.38
71	002209	达意隆	29,600	225,848.00	0.38
72	688468	科美诊断	35,400	224,082.00	0.38
73	002438	江苏神通	20,600	222,686.00	0.38
74	603337	杰克股份	8,400	221,088.00	0.37
75	300463	迈克生物	19,100	217,358.00	0.37
76	002364	中恒电气	39,300	216,150.00	0.37
77	300378	鼎捷软件	13,200	214,764.00	0.36
78	601121	宝地矿业	37,200	211,668.00	0.36
79	300626	华瑞股份	28,200	211,218.00	0.36
80	002979	雷赛智能	11,600	211,120.00	0.36
81	603496	恒为科技	8,600	210,270.00	0.36
82	300203	聚光科技	20,800	209,872.00	0.36
83	001309	德明利	2,410	208,224.00	0.35
84	301056	森赫股份	27,100	207,857.00	0.35
85	002454	松芝股份	37,000	206,830.00	0.35
86	600710	苏美达	25,100	204,565.00	0.35
87	600475	华光环能	23,300	202,943.00	0.34
88	000593	德龙汇能	43,500	202,710.00	0.34
89	301030	仕净科技	8,140	200,406.80	0.34
90	600114	东睦股份	13,900	200,021.00	0.34
91	603169	兰石重装	44,400	199,800.00	0.34
92	600629	华建集团	45,600	198,816.00	0.34
93	688579	山大地纬	24,000	188,400.00	0.32

94	300396	迪瑞医疗	9,200	186,852.00	0.32
95	002361	神剑股份	57,200	185,328.00	0.31
96	300810	中科海讯	12,100	185,251.00	0.31
97	001256	炜冈科技	13,300	182,476.00	0.31
98	600235	民丰特纸	39,600	182,160.00	0.31
99	600662	外服控股	45,100	180,851.00	0.31
100	600292	远达环保	38,300	179,627.00	0.30
101	002741	光华科技	19,500	175,110.00	0.30
102	601609	金田股份	30,900	174,894.00	0.30
103	300509	新美星	37,200	174,096.00	0.29
104	600819	耀皮玻璃	41,200	173,864.00	0.29
105	688018	乐鑫科技	1,760	173,676.80	0.29
106	000541	佛山照明	35,500	172,885.00	0.29
107	002730	电光科技	24,400	171,776.00	0.29
108	002666	德联集团	47,100	170,502.00	0.29
109	600237	铜峰电子	32,600	170,172.00	0.29
110	603686	福龙马	22,300	169,926.00	0.29
111	002225	濮耐股份	41,400	169,326.00	0.29
112	688313	仕佳光子	17,600	167,552.00	0.28
113	301098	金埔园林	22,100	167,297.00	0.28
114	300800	力合科技	16,100	166,796.00	0.28
115	002139	拓邦股份	15,700	166,734.00	0.28
116	600590	泰豪科技	43,600	166,116.00	0.28
117	300113	顺网科技	16,200	165,888.00	0.28
118	600817	宇通重工	20,200	165,640.00	0.28
119	600602	云赛智联	15,000	165,600.00	0.28
120	600105	永鼎股份	44,400	165,168.00	0.28
121	002189	中光学	11,600	161,704.00	0.27
122	000534	万泽股份	16,200	160,866.00	0.27
123	688678	福立旺	14,800	160,284.00	0.27
124	300797	钢研纳克	17,000	157,420.00	0.27
125	301066	万事利	19,300	156,330.00	0.26
126	600810	神马股份	25,100	155,620.00	0.26
127	688766	普冉股份	1,600	155,472.00	0.26
128	000501	武商集团	23,300	155,411.00	0.26
129	300006	莱美药业	66,200	154,908.00	0.26
130	688208	道通科技	6,400	154,496.00	0.26
131	600293	三峡新材	61,900	154,131.00	0.26
132	603045	福达合金	15,500	153,915.00	0.26
133	002039	黔源电力	8,700	153,120.00	0.26
134	603681	永冠新材	11,900	151,725.00	0.26
135	300176	派生科技	33,800	149,058.00	0.25
136	603103	横店影视	10,700	148,088.00	0.25
137	603258	电魂网络	9,100	146,965.00	0.25

138	688095	福昕软件	3,200	146,592.00	0.25
139	605166	聚合顺	13,900	145,811.00	0.25
140	300515	三德科技	14,700	145,089.00	0.25
141	300173	福能东方	37,600	141,752.00	0.24
142	300218	安利股份	9,300	140,244.00	0.24
143	600216	浙江医药	12,700	139,446.00	0.24
144	300145	中金环境	54,500	136,250.00	0.23
145	003003	天元股份	17,000	135,490.00	0.23
146	688026	洁特生物	13,400	133,464.00	0.23
147	000975	山金国际	8,100	131,949.00	0.22
148	300369	绿盟科技	25,800	131,838.00	0.22
149	600327	大东方	41,000	131,200.00	0.22
150	300790	宇瞳光学	9,700	130,950.00	0.22
151	002378	章源钨业	22,700	130,298.00	0.22
152	000639	西王食品	54,600	129,948.00	0.22
153	301161	唯万密封	8,300	128,899.00	0.22
154	688307	中润光学	6,200	128,278.00	0.22
155	600232	金鹰股份	29,700	128,007.00	0.22
156	603507	振江股份	3,900	127,998.00	0.22
157	300226	上海钢联	7,500	127,050.00	0.21
158	688077	大地熊	8,000	126,640.00	0.21
159	688486	龙迅股份	2,200	126,060.00	0.21
160	002845	同兴达	9,500	125,590.00	0.21
161	300241	瑞丰光电	30,300	124,230.00	0.21
161	605500	森林包装	20,200	124,230.00	0.21
162	688409	富创精密	3,360	124,118.40	0.21
163	603926	铁流股份	14,900	123,670.00	0.21
164	300835	龙磁科技	4,200	122,010.00	0.21
165	000928	中钢国际	21,900	121,545.00	0.21
166	605189	富春染织	11,400	121,524.00	0.21
167	001234	泰慕士	7,100	120,629.00	0.20
168	301003	江苏博云	5,600	120,456.00	0.20
169	300120	经纬辉开	23,100	119,889.00	0.20
170	601991	大唐发电	39,600	119,196.00	0.20
171	300388	节能国祯	21,400	118,556.00	0.20
172	300508	维宏股份	6,100	118,523.00	0.20
173	002948	青岛银行	34,600	116,602.00	0.20
174	603113	金能科技	21,200	115,964.00	0.20
175	600488	津药药业	33,600	115,248.00	0.20
176	688253	英诺特	3,000	114,330.00	0.19
177	688159	有方科技	3,000	113,580.00	0.19
178	002879	长缆科技	8,500	111,605.00	0.19
179	000521	长虹美菱	14,700	111,426.00	0.19
180	603979	金诚信	2,200	111,166.00	0.19

181	003000	劲仔食品	9,200	110,860.00	0.19
182	002284	亚太股份	16,100	108,836.00	0.18
183	301028	东亚机械	12,200	106,994.00	0.18
184	600750	江中药业	4,600	106,306.00	0.18
185	002111	威海广泰	10,000	104,200.00	0.18
186	003019	宸展光电	4,100	103,853.00	0.18
187	002686	亿利达	24,600	103,074.00	0.17
188	300986	志特新材	15,200	102,904.00	0.17
189	002467	二六三	30,600	102,204.00	0.17
190	000551	创元科技	11,700	102,141.00	0.17
191	603020	爱普股份	15,300	102,051.00	0.17
192	000797	中国武夷	43,600	101,588.00	0.17
193	603859	能科科技	4,800	100,896.00	0.17
194	002073	软控股份	13,600	100,504.00	0.17
195	002215	诺普信	13,400	99,830.00	0.17
196	300451	创业慧康	28,700	99,302.00	0.17
197	300774	倍杰特	15,100	98,603.00	0.17
198	300755	华致酒行	7,200	98,352.00	0.17
199	300872	天阳科技	7,400	98,050.00	0.17
200	300448	浩云科技	22,900	95,951.00	0.16
201	603308	应流股份	7,600	94,392.00	0.16
202	002897	意华股份	2,500	94,150.00	0.16
203	002035	华帝股份	15,100	94,073.00	0.16
204	688689	银河微电	4,400	93,412.00	0.16
205	300694	鑫湖股份	10,900	92,759.00	0.16
206	300440	运达科技	17,500	91,875.00	0.16
207	001211	双枪科技	6,000	91,440.00	0.15
208	601101	昊华能源	9,900	90,981.00	0.15
209	300102	乾照光电	14,100	90,522.00	0.15
210	603322	超讯通信	3,400	90,134.00	0.15
211	600502	安徽建工	20,900	89,870.00	0.15
212	605136	丽人丽妆	16,300	89,813.00	0.15
213	300685	艾德生物	5,000	88,200.00	0.15
214	002707	众信旅游	15,000	86,100.00	0.15
215	600163	中闽能源	17,800	85,796.00	0.15
216	300291	百纳千成	20,100	85,626.00	0.14
217	600359	新农开发	15,200	84,968.00	0.14
218	002567	唐人神	15,800	84,688.00	0.14
219	600320	振华重工	24,600	84,132.00	0.14
220	002110	三钢闽光	28,400	83,780.00	0.14
221	301018	申菱环境	4,300	83,592.00	0.14
222	688281	华秦科技	1,000	83,320.00	0.14
223	600458	时代新材	8,200	82,820.00	0.14
224	002582	好想你	15,300	82,161.00	0.14

225	300426	唐德影视	12,100	82,038.00	0.14
226	300573	兴齐眼药	500	82,000.00	0.14
227	603192	汇得科技	6,100	81,923.00	0.14
228	603976	正川股份	5,800	81,838.00	0.14
229	002613	北玻股份	23,100	80,388.00	0.14
230	603173	福斯达	3,700	80,327.00	0.14
231	002851	麦格米特	3,100	80,104.00	0.14
232	002476	宝莫股份	21,800	80,006.00	0.14
233	300453	三鑫医疗	12,500	79,875.00	0.14
234	600152	维科技术	16,600	79,680.00	0.13
235	600691	阳煤化工	46,500	79,515.00	0.13
236	300278	华昌达	27,600	79,212.00	0.13
237	300410	正业科技	15,400	78,848.00	0.13
238	603171	税友股份	2,900	78,416.00	0.13
239	002905	金逸影视	12,400	76,880.00	0.13
240	300528	幸福蓝海	12,200	76,616.00	0.13
241	688685	迈信林	3,120	76,284.00	0.13
242	301391	卡莱特	1,720	75,301.60	0.13
243	002017	东信和平	9,000	74,970.00	0.13
244	300333	兆日科技	15,200	73,416.00	0.12
245	300737	科顺股份	17,000	73,100.00	0.12
246	002765	蓝黛科技	15,300	71,910.00	0.12
247	300707	威唐工业	5,800	71,804.00	0.12
248	301065	本立科技	4,500	71,550.00	0.12
249	300245	天玑科技	13,300	71,421.00	0.12
250	301298	东利机械	5,600	71,400.00	0.12
251	688379	华光新材	5,200	71,292.00	0.12
252	002381	双箭股份	10,500	70,455.00	0.12
253	300659	中孚信息	5,400	70,038.00	0.12
254	603867	新化股份	3,000	69,990.00	0.12
255	600201	生物股份	9,700	69,937.00	0.12
256	688601	力芯微	1,600	69,904.00	0.12
257	300662	科锐国际	4,300	69,359.00	0.12
258	600982	宁波能源	19,300	68,901.00	0.12
259	000758	中色股份	13,500	68,580.00	0.12
260	603380	易德龙	3,400	68,272.00	0.12
261	300228	富瑞特装	12,500	68,250.00	0.12
262	688798	艾为电子	1,200	67,944.00	0.11
263	688516	奥特维	1,600	66,896.00	0.11
264	688252	天德钰	4,600	66,838.00	0.11
265	603590	康辰药业	2,600	66,404.00	0.11
266	300560	中富通	6,100	66,002.00	0.11
267	300687	赛意信息	4,700	65,424.00	0.11
268	603313	梦百合	8,700	64,989.00	0.11

269	688179	阿拉丁	6,680	64,595.60	0.11
270	601975	招商南油	17,800	63,902.00	0.11
271	603998	方盛制药	6,200	63,674.00	0.11
272	002811	郑中设计	9,500	63,270.00	0.11
273	000552	甘肃能化	18,200	63,154.00	0.11
274	300611	美力科技	8,100	61,722.00	0.10
275	603693	江苏新能	5,300	61,586.00	0.10
276	300992	泰福泵业	3,900	61,542.00	0.10
277	002212	天融信	12,500	60,875.00	0.10
278	601375	中原证券	17,700	60,357.00	0.10
279	300158	振东制药	15,800	60,356.00	0.10
280	002387	维信诺	9,900	60,192.00	0.10
281	600684	珠江股份	22,800	59,964.00	0.10
282	002302	西部建设	11,500	59,800.00	0.10
283	001205	盛航股份	3,700	59,792.00	0.10
284	603501	韦尔股份	600	59,622.00	0.10
285	002026	山东威达	7,100	58,930.00	0.10
286	603269	海鸥股份	6,000	58,920.00	0.10
287	603351	威尔药业	2,900	58,754.00	0.10
288	002969	嘉美包装	20,600	58,710.00	0.10
289	600125	铁龙物流	9,700	57,909.00	0.10
290	000710	贝瑞基因	8,000	57,440.00	0.10
291	002020	京新药业	5,400	56,538.00	0.10
292	000897	津滨发展	27,400	56,170.00	0.10
293	002909	集泰股份	13,500	55,350.00	0.09
294	300885	海昌新材	6,200	55,118.00	0.09
295	600979	广安爱众	16,300	54,768.00	0.09
296	002593	日上集团	17,100	54,720.00	0.09
297	600557	康缘药业	3,400	53,380.00	0.09
298	688210	统联精密	2,400	53,160.00	0.09
299	002468	申通快递	6,200	52,080.00	0.09
300	603629	利通电子	2,800	51,688.00	0.09
301	000810	创维数字	6,000	51,480.00	0.09
302	301149	隆华新材	5,500	50,820.00	0.09
303	688019	安集科技	400	50,320.00	0.09
304	600551	时代出版	7,100	50,268.00	0.09
305	600761	安徽合力	2,300	49,772.00	0.08
306	688028	沃尔德	3,000	49,290.00	0.08
307	600510	黑牡丹	13,100	48,732.00	0.08
308	300230	永利股份	14,400	48,384.00	0.08
309	002990	盛视科技	2,400	48,312.00	0.08
310	002347	泰尔股份	12,800	48,256.00	0.08
311	002181	粤传媒	14,900	48,127.00	0.08
312	688176	亚虹医药-U	9,400	48,034.00	0.08

313	688148	芳源股份	11,400	47,994.00	0.08
314	603516	淳中科技	1,500	47,355.00	0.08
315	300131	英唐智控	10,500	46,725.00	0.08
316	600312	平高电气	2,400	46,680.00	0.08
317	688235	百济神州-U	400	46,336.00	0.08
318	300035	中科电气	5,400	45,954.00	0.08
319	301067	显盈科技	2,300	45,333.00	0.08
320	300521	爱司凯	4,400	45,320.00	0.08
321	300522	世名科技	4,100	45,305.00	0.08
322	000065	北方国际	4,300	44,591.00	0.08
323	601636	旗滨集团	6,900	44,505.00	0.08
324	603206	嘉环科技	3,500	44,205.00	0.07
325	000922	佳电股份	3,700	44,141.00	0.07
326	300921	南凌科技	2,500	43,300.00	0.07
327	600967	内蒙一机	6,000	43,200.00	0.07
328	300348	长亮科技	6,300	42,966.00	0.07
329	002446	盛路通信	7,600	42,940.00	0.07
330	002550	千红制药	7,900	42,581.00	0.07
331	000544	中原环保	5,400	42,498.00	0.07
332	002166	莱茵生物	6,200	42,408.00	0.07
333	002426	胜利精密	26,800	42,344.00	0.07
334	002911	佛燃能源	4,600	42,044.00	0.07
335	301053	远信工业	2,100	41,916.00	0.07
336	603861	白云电器	5,000	41,850.00	0.07
337	003021	兆威机电	900	41,535.00	0.07
338	002340	格林美	6,500	41,405.00	0.07
339	300387	富邦股份	6,900	41,331.00	0.07
340	600262	北方股份	2,500	41,075.00	0.07
341	300980	祥源新材	2,600	40,976.00	0.07
342	000973	佛塑科技	11,100	40,959.00	0.07
343	002392	北京利尔	13,000	40,950.00	0.07
344	600861	北京人力	2,500	40,800.00	0.07
345	002533	金杯电工	4,100	40,795.00	0.07
346	688636	智明达	1,788	40,766.40	0.07
347	300673	佩蒂股份	3,100	40,672.00	0.07
348	000530	冰山冷热	11,200	40,544.00	0.07
349	603151	邦基科技	3,500	40,390.00	0.07
350	603080	新疆火炬	3,000	40,380.00	0.07
351	300248	新开普	6,200	40,238.00	0.07
352	301228	实朴检测	4,300	40,205.00	0.07
353	603385	惠达卫浴	7,300	40,077.00	0.07
354	002536	飞龙股份	4,200	39,984.00	0.07
355	002213	大为股份	4,100	39,975.00	0.07
356	300011	鼎汉技术	8,000	39,920.00	0.07

357	600126	杭钢股份	9,700	39,867.00	0.07
358	600664	哈药股份	15,100	39,864.00	0.07
359	600619	海立股份	7,700	39,809.00	0.07
360	688051	佳华科技	2,400	39,792.00	0.07
361	605566	福莱茵特	2,600	39,598.00	0.07
362	000626	远大控股	9,500	39,425.00	0.07
363	300582	英飞特	4,600	39,376.00	0.07
364	300204	舒泰神	6,900	39,054.00	0.07
365	601108	财通证券	5,900	38,999.00	0.07
366	600577	精达股份	9,700	38,509.00	0.07
367	603538	美诺华	3,400	37,978.00	0.06
368	300953	震裕科技	700	37,940.00	0.06
369	688378	奥来德	1,600	37,536.00	0.06
370	301002	崧盛股份	2,200	37,114.00	0.06
371	301197	工大科雅	2,800	36,736.00	0.06
372	000498	山东路桥	7,000	36,610.00	0.06
373	002283	天润工业	8,500	36,465.00	0.06
374	000788	北大医药	7,300	36,427.00	0.06
375	000962	东方钨业	3,500	35,735.00	0.06
376	002011	盾安环境	3,600	35,388.00	0.06
377	300878	维康药业	2,400	34,896.00	0.06
378	300771	智莱科技	3,900	34,281.00	0.06
379	002887	绿茵生态	4,900	31,899.00	0.05
380	603916	苏博特	4,700	31,537.00	0.05
381	000725	京东方 A	7,700	31,493.00	0.05
382	002053	云南能投	2,600	31,434.00	0.05
383	300897	山科智能	1,700	31,348.00	0.05
384	002203	海亮股份	3,900	31,122.00	0.05
385	000090	天健集团	7,700	30,954.00	0.05
386	688418	震有科技	1,800	30,834.00	0.05
387	603726	朗迪集团	2,300	30,820.00	0.05
388	300250	初灵信息	2,800	30,520.00	0.05
388	002106	莱宝高科	2,800	30,520.00	0.05
389	300383	光环新网	3,600	30,420.00	0.05
390	002152	广电运通	2,900	30,334.00	0.05
391	688011	新光光电	2,000	30,300.00	0.05
392	600981	汇鸿集团	17,900	30,251.00	0.05
393	300049	福瑞股份	600	30,204.00	0.05
394	600547	山东黄金	1,100	30,118.00	0.05
395	688316	青云科技-U	1,000	29,910.00	0.05
396	600308	华泰股份	9,500	29,830.00	0.05
397	002075	沙钢股份	7,900	29,783.00	0.05
398	001230	劲旅环境	2,140	29,724.60	0.05
399	688484	南芯科技	800	29,680.00	0.05

400	600354	敦煌种业	6,200	29,574.00	0.05
401	603856	东宏股份	2,900	29,522.00	0.05
402	601555	东吴证券	5,000	29,500.00	0.05
403	300054	鼎龙股份	1,300	29,484.00	0.05
404	002205	国统股份	4,700	29,469.00	0.05
405	300094	国联水产	11,600	29,464.00	0.05
406	002065	东华软件	6,500	29,380.00	0.05
407	600738	丽尚国潮	8,000	29,360.00	0.05
408	600037	歌华有线	4,900	29,302.00	0.05
409	300460	惠伦晶体	3,400	29,002.00	0.05
410	300170	汉得信息	4,700	28,858.00	0.05
411	601003	柳钢股份	11,400	28,842.00	0.05
412	000919	金陵药业	4,600	28,796.00	0.05
413	603811	诚意药业	4,600	28,750.00	0.05
414	002153	石基信息	5,000	28,650.00	0.05
415	300867	圣元环保	2,700	28,647.00	0.05
416	600433	冠豪高新	10,800	28,620.00	0.05
417	688038	中科通达	3,000	28,560.00	0.05
418	600197	伊力特	1,600	28,496.00	0.05
419	601038	一拖股份	1,800	28,458.00	0.05
420	688590	新致软件	2,200	28,380.00	0.05
421	300436	广生堂	1,800	28,278.00	0.05
422	300409	道氏技术	3,300	28,248.00	0.05
423	601865	福莱特	1,400	28,140.00	0.05
424	603733	仙鹤股份	1,600	28,128.00	0.05
425	300144	宋城演艺	3,500	28,105.00	0.05
426	000402	金融街	11,900	27,965.00	0.05
427	603711	香飘飘	2,000	27,700.00	0.05
428	603633	徕木股份	3,500	27,685.00	0.05
429	603708	家家悦	3,400	27,574.00	0.05
430	600730	中国高科	6,900	27,531.00	0.05
431	300772	运达股份	2,800	26,880.00	0.05
432	000707	双环科技	3,900	26,676.00	0.05
433	002580	圣阳股份	4,300	26,445.00	0.04
434	688628	优利德	800	26,216.00	0.04
435	605555	德昌股份	1,400	26,054.00	0.04
436	002478	常宝股份	5,200	25,896.00	0.04
437	603897	长城科技	1,400	24,570.00	0.04
438	002301	齐心集团	4,900	23,667.00	0.04
439	601900	南方传媒	1,900	23,617.00	0.04
440	688205	德科立	800	23,048.00	0.04
441	605020	永和股份	1,200	23,016.00	0.04
442	600909	华安证券	5,400	22,734.00	0.04
443	300233	金城医药	1,500	22,380.00	0.04

444	000657	中钨高新	2,400	21,936.00	0.04
445	688698	伟创电气	800	21,576.00	0.04
446	688280	精进电动-UW	5,200	21,164.00	0.04
447	000682	东方电子	1,900	20,976.00	0.04
448	002919	名臣健康	1,800	20,898.00	0.04
449	688239	航宇科技	600	20,880.00	0.04
450	600376	首开股份	9,800	20,580.00	0.03
451	688016	心脉医疗	200	19,610.00	0.03
452	002095	生意宝	1,600	19,584.00	0.03
453	300123	亚光科技	4,200	19,488.00	0.03
454	688150	莱特光电	1,000	19,400.00	0.03
455	688300	联瑞新材	400	19,240.00	0.03
456	002036	联创电子	2,800	18,900.00	0.03
457	000153	丰原药业	3,480	18,722.40	0.03
458	300428	立中集团	1,000	18,590.00	0.03
459	688408	中信博	200	18,416.00	0.03
460	689009	九号公司	500	18,405.00	0.03
461	688221	前沿生物-U	3,200	17,760.00	0.03
462	601999	出版传媒	3,400	17,748.00	0.03
463	002947	恒铭达	500	17,600.00	0.03
464	002267	陕天然气	2,300	17,388.00	0.03
465	000931	中关村	4,900	17,297.00	0.03
466	688621	阳光诺和	400	17,080.00	0.03
467	000547	航天发展	2,900	16,994.00	0.03
468	300497	富祥药业	1,900	16,967.00	0.03
469	300472	新元科技	3,800	16,834.00	0.03
470	002398	垒知集团	4,500	16,740.00	0.03
471	301071	力量钻石	600	16,626.00	0.03
472	002187	广百股份	3,900	16,107.00	0.03
473	603323	苏农银行	3,300	15,873.00	0.03
474	603379	三美股份	400	15,656.00	0.03
475	603689	皖天然气	1,900	15,618.00	0.03
476	688533	上声电子	600	15,522.00	0.03
477	300674	宇信科技	1,400	15,512.00	0.03
478	300087	荃银高科	2,500	15,450.00	0.03
479	300636	同和药业	1,500	15,255.00	0.03
480	000045	深纺织 A	1,900	15,238.00	0.03
481	300805	电声股份	2,300	14,628.00	0.02
482	688158	优刻得-W	1,400	14,322.00	0.02
483	300420	五洋自控	6,500	14,235.00	0.02
484	603871	嘉友国际	800	14,152.00	0.02
485	300638	广和通	800	13,680.00	0.02
486	002276	万马股份	1,900	13,623.00	0.02
487	002083	孚日股份	3,200	13,536.00	0.02

488	600888	新疆众和	1,900	13,433.00	0.02
489	601579	会稽山	1,300	13,312.00	0.02
490	002099	海翔药业	2,600	13,286.00	0.02
491	688330	宏力达	639	13,029.21	0.02
492	002697	红旗连锁	2,800	12,964.00	0.02
493	002322	理工能科	800	12,816.00	0.02
494	001260	坤泰股份	900	12,537.00	0.02
495	603520	司太立	1,300	12,402.00	0.02
496	000526	学大教育	200	12,320.00	0.02
497	002893	京能热力	1,300	12,298.00	0.02
498	688123	聚辰股份	200	12,166.00	0.02
499	002807	江阴银行	3,200	12,064.00	0.02
500	600366	宁波韵升	2,300	12,006.00	0.02
501	688733	壹石通	800	11,960.00	0.02
502	600966	博汇纸业	2,500	11,950.00	0.02
503	600184	光电股份	1,400	11,914.00	0.02
504	001217	华尔泰	1,300	11,895.00	0.02
505	300997	欢乐家	1,000	11,820.00	0.02
506	603668	天马科技	1,040	11,804.00	0.02
507	300435	中泰股份	1,000	11,770.00	0.02
508	300873	海晨股份	800	11,664.00	0.02
509	002878	元隆雅图	900	11,313.00	0.02
510	688800	瑞可达	400	11,232.00	0.02
511	300445	康斯特	600	9,660.00	0.02
512	002440	闰土股份	1,600	8,688.00	0.01
513	600226	亨通股份	4,400	8,668.00	0.01
514	600556	天下秀	2,000	7,280.00	0.01
515	002126	银轮股份	400	6,964.00	0.01
516	688199	久日新材	486	6,512.40	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002277	友阿股份	920,739.00	1.14
2	000601	韶能股份	860,546.00	1.06
3	600284	浦东建设	837,111.00	1.03
4	000920	沃顿科技	833,871.00	1.03
5	300194	福安药业	803,788.00	0.99
6	300016	北陆药业	793,381.97	0.98

7	600979	广安爱众	777,388.00	0.96
8	600880	博瑞传播	773,212.00	0.96
9	300228	富瑞特装	741,916.00	0.92
10	600603	广汇物流	734,201.00	0.91
11	000863	三湘印象	726,855.00	0.90
12	002519	银河电子	714,999.00	0.88
13	300441	鲍斯股份	692,277.00	0.86
14	300006	莱美药业	681,988.00	0.84
15	600114	东睦股份	671,641.50	0.83
16	301018	申菱环境	665,872.00	0.82
17	002376	新北洋	652,468.00	0.81
18	603300	华铁应急	624,445.00	0.77
19	603330	天洋新材	623,428.00	0.77
20	600526	菲达环保	619,756.00	0.77

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

**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600979	广安爱众	1,126,903.00	1.39
2	600880	博瑞传播	917,648.00	1.13
3	002616	长青集团	813,026.00	1.00
4	000680	山推股份	788,268.00	0.97
5	002641	公元股份	779,881.00	0.96
6	600284	浦东建设	779,836.60	0.96
7	002588	史丹利	758,692.00	0.94
8	300386	飞天诚信	755,405.00	0.93
9	300381	溢多利	753,544.00	0.93
10	603111	康尼机电	751,259.00	0.93
11	300215	电科院	736,250.00	0.91
12	600710	苏美达	728,043.00	0.90
13	000863	三湘印象	725,960.07	0.90
14	300102	乾照光电	724,780.00	0.90
15	002073	软控股份	721,754.00	0.89
16	600480	凌云股份	708,236.00	0.88
17	600114	东睦股份	704,496.00	0.87
18	600502	安徽建工	696,306.00	0.86

19	603283	赛腾股份	680,681.00	0.84
20	300441	鲍斯股份	677,498.64	0.84

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	228,272,770.85
卖出股票收入（成交）总额	233,211,244.22

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,537,687.12	4.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,537,687.12	4.29

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23 国债 16	15,000	1,523,422.60	2.58
2	019698	23 国债 05	7,000	708,717.40	1.20
3	019727	23 国债 24	3,000	305,547.12	0.52

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

**7.12.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,852.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,848.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	46,700.68

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,182	12,138.56	26,428,439. 96	52.06%	24,335,025. 77	47.94%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,176,550.49	14.1372%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 3 月 21 日）基金份额总额	237,368,420.96
本报告期期初基金份额总额	59,440,895.38
本报告期基金总申购份额	22,433,048.01
减：本报告期基金总赎回份额	31,110,477.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	50,763,465.73

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2024 年 4 月 24 日起至 2024 年 5 月 27 日止以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2024 年 5 月 28 日审议并通过了《关于广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准、调低赎回费率及修改基金合同有关事项的议案》。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
国投证券	4	277,722,803.31	60.18%	207,156.34	60.18%	-
中信建投证券	2	183,761,211.76	39.82%	137,062.53	39.82%	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国海证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

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

10.7.2 基金租用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
国投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	6,106,864.42	100.00%	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
3	关于以通讯方式召开广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
5	关于以通讯方式召开广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-22
6	关于以通讯方式召开广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-23
7	关于广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-29

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	20240101-20240630	22,434,938.68	-	-	22,434,938.68	44.20%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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</p>							

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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2024 年 4 月 24 日至 2024 年 5 月 27 日 15:00 止以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2024 年 5 月 28 日审议并通过了《关于广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准、调低赎回费率及修改基金合同有关事项的议案》，自 2024 年 5 月 29 日起，本基金按调整后的条款执行，修订后的《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》《广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》等法律文件于同日生效。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于以通讯方式召开广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》《关于广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 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

### 12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日