

广发中小盘精选混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 25 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48

8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
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
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	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
11 影响投资者决策的其他重要信息	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	55
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中小盘精选混合型证券投资基金	
基金简称	广发中小盘精选混合	
基金主代码	005598	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 4 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,761,427,821.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
下属分级基金的交易代码	005598	013955
报告期末下属分级基金的份额总额	783,830,045.11 份	977,597,776.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票，在深入研究的基础上，发掘被市场低估的中小市值公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为一只混合型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为 60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×35%+人民币计价的恒生综合中小型股指数收益率×35%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。 本基金将投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有 风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	广发基金管理有限公司		中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	95105828		95566
传真	020-89899158		010-66594942
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1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1号
邮政编码	510308		100818
法定代表人	孙树明		葛海蛟

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（2023年1月1日至2023年6月30日）	
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C

本期已实现收益	83,322,074.90	87,345,829.85
本期利润	270,640,713.84	283,901,132.48
加权平均基金份额本期利润	0.3441	0.3939
本期加权平均净值利润率	19.83%	22.73%
本期基金份额净值增长率	23.79%	23.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
期末可供分配利润	219,401,270.83	263,376,171.42
期末可供分配基金份额利润	0.2799	0.2694
期末基金资产净值	1,515,332,327.73	1,877,721,552.87
期末基金份额净值	1.9332	1.9208
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
基金份额累计净值增长率	93.32%	4.16%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小盘精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.67%	1.51%	0.91%	0.69%	9.76%	0.82%
过去三个月	13.55%	1.48%	-3.36%	0.61%	16.91%	0.87%
过去六个月	23.79%	1.31%	-0.52%	0.63%	24.31%	0.68%
过去一年	8.59%	1.66%	-4.86%	0.76%	13.45%	0.90%
过去三年	32.18%	1.80%	0.27%	0.88%	31.91%	0.92%
自基金合同生效起至今	93.32%	1.62%	2.03%	0.91%	91.29%	0.71%

广发中小盘精选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.67%	1.51%	0.91%	0.69%	9.76%	0.82%
过去三个月	13.55%	1.48%	-3.36%	0.61%	16.91%	0.87%
过去六个月	23.79%	1.31%	-0.52%	0.63%	24.31%	0.68%
过去一年	8.59%	1.66%	-4.86%	0.76%	13.45%	0.90%
过去三年	32.18%	1.80%	0.27%	0.88%	31.91%	0.92%
自基金合同生效起至今	93.32%	1.62%	2.03%	0.91%	91.29%	0.71%

过去一个月	10.64%	1.51%	0.91%	0.69%	9.73%	0.82%
过去三个月	13.45%	1.48%	-3.36%	0.61%	16.81%	0.87%
过去六个月	23.56%	1.31%	-0.52%	0.63%	24.08%	0.68%
过去一年	8.18%	1.66%	-4.86%	0.76%	13.04%	0.90%
自基金合同生效起至今	4.16%	1.78%	-11.57%	0.89%	15.73%	0.89%

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

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

广发中小盘精选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 5 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日)

广发中小盘精选混合 A



广发中小盘精选混合 C



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈韞中	本基金的基金经理	2021-09-28	-	7 年	陈韞中先生，环境管理硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任上海南土资产管理有限公司研究部研究员，上海南垚资产管理中心

					(有限合伙)研究部研究员，广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员。
--	--	--	--	--	------------------------------------

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 34 次，均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，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

2023 年年初，市场预期宏观经济触底反转，A 股表现亮眼，1 月、2 月成长风格和价值风格的板块均表现较好，各行业的估值从底部反转并有所修复；但二季度 A 股从上涨转为震荡回落，市场活跃的方向基本集中在人工智能、机器人等主题上。今年上半年，人工智能的技术变化引起了产业界的高度关注，并迅速孕育出相关的应用，人工智能主题表现突出，并带动了 TMT 板块的大幅上涨。在人工智能主题中的算力基础设施方向上，伴随着 5 月底海外 GPU 龙头业绩超预期，该赛道的投资正式从主题驱动转向业绩驱动，相较于人工智能的其他方向有了明显的超额收益。机器人与人工智能的结合一直是市场关注的要点，人形机器人可能是这种结合最好的载体，在国内外玩家纷纷入局的背景下，预计这个产业尤其是硬件供应链将在国内孕育出很多值得期待的机会。

操作方面，报告期组合保持高仓位，主要配置 A 股；在风格方面，坚持中小盘风格；在行业配置方面，报告期内集中配置了 TMT、汽车、新能源、军工和机械等行业标的。

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 23.79%，C 类基金份额净值增长率为 23.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初至今，人工智能相关板块已经有了非常可观的超额收益，短期 ChatGPT 海外流量数据增长速度有所放缓，加上更强功能的应用尚未出现，预计相关板块超额收益将会有所收窄，但中长期依旧有非常可观的发展潜力。另外，汇率方面人民币继续贬值的概率较小，因此中国核心资产预计会迎来一波底部修复的机会。在后续组合操作上，我们将会更加均衡，同时关注有业绩兑现预期的 AI 算力、底部启动的机器人和新能源板块。另外，中长期看好内需安全以及一带一路外需驱动的品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

值价格的最终决策。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中小盘精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	391,924,457.76	119,537,707.86
结算备付金		12,301,332.28	11,477,941.44
存出保证金		1,318,917.97	943,558.49
交易性金融资产	6.4.7.2	3,227,612,341.60	1,591,257,978.51
其中：股票投资		3,194,033,216.94	1,591,257,978.51
基金投资		-	-
债券投资		33,579,124.66	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		41,512,446.52	-
应收股利		2,050,227.25	-
应收申购款		1,986,543.00	24,092,726.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,678,706,266.38	1,747,309,912.87

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		16,869,219.05	6,376,094.74
应付赎回款		252,813,434.76	13,069,875.37
应付管理人报酬		4,101,829.81	2,297,059.86
应付托管费		683,638.29	382,843.30
应付销售服务费		592,512.02	247,565.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	10,591,751.85	4,278,344.97
负债合计		285,652,385.78	26,651,783.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,761,427,821.28	1,103,757,982.88
未分配利润	6.4.7.9	1,631,626,059.32	616,900,146.55
净资产合计		3,393,053,880.60	1,720,658,129.43
负债和净资产总计		3,678,706,266.38	1,747,309,912.87

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，广发中小盘精选混合 A 基金份额净值人民币 1.9332 元，基金份额总额 783,830,045.11 份；广发中小盘精选混合 C 基金份额净值人民币 1.9208 元，基金份额总额 977,597,776.17 份；总份额总额 1,761,427,821.28 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		579,712,858.31	-261,609,756.77
1.利息收入		550,406.70	176,972.76
其中：存款利息收入	6.4.7.10	550,406.70	176,972.76
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		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		194,795,971.21	-287,263,640.71
其中：股票投资收益	6.4.7.11	179,749,886.14	-289,937,644.85
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	533,924.84	133,640.10
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	-	-
股利收益	6.4.7.17	14,512,160.23	2,540,364.04
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	383,873,941.57	24,430,305.62
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	492,538.83	1,046,605.56
减：二、营业总支出		25,171,011.99	8,624,689.74
1. 管理人报酬		19,333,418.73	6,908,554.15
2. 托管费		3,222,236.38	1,151,425.70
3. 销售服务费		2,462,159.61	437,384.68
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		1.96	0.33
8. 其他费用	6.4.7.21	153,195.31	127,324.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		554,541,846.32	-270,234,446.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		554,541,846.32	-270,234,446.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		554,541,846.32	-270,234,446.51

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	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（基金净值）	1,103,757,982.88	616,900,146.55	1,720,658,129.43
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,103,757,982.88	616,900,146.55	1,720,658,129.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	657,669,838.40	1,014,725,912.77	1,672,395,751.17
（一）、综合收益总额	-	554,541,846.32	554,541,846.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	657,669,838.40	460,184,066.45	1,117,853,904.85
其中：1.基金申购款	1,238,820,217.86	922,980,997.28	2,161,801,215.14
2.基金赎回款	-581,150,379.46	-462,796,930.83	-1,043,947,310.29
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,761,427,821.28	1,631,626,059.32	3,393,053,880.60
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	671,669,873.39	723,987,167.24	1,395,657,040.63
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	671,669,873.39	723,987,167.24	1,395,657,040.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-220,254,411.80	-372,378,352.17	-592,632,763.97
（一）、综合收益总额	-	-270,234,446.51	-270,234,446.51
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-220,254,411.80	-102,143,905.66	-322,398,317.46

号填列)			
其中：1.基金申购款	298,714,565.00	213,872,765.13	512,587,330.13
2.基金赎回款	-518,968,976.80	-316,016,670.79	-834,985,647.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	451,415,461.59	351,608,815.07	803,024,276.66

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：孙树明，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

广发中小盘精选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[2018]53 号《关于准予广发中小盘精选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《广发中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 4 月 9 日向社会公开发行人募集并于 2018 年 5 月 4 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 4 月 9 日至 2018 年 4 月 27 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 811,802,111.33 元，有效认购户数为 14,126 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 137,396.10 元；折合基金份额 137,396.10 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。

本基金自 2021 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。

本基金的财务报表于 2023 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	391,924,457.76
等于：本金	391,901,586.94
加：应计利息	22,870.82
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	391,924,457.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,911,480,152.10	-	3,194,033,216.94	282,553,064.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	33,454,985.00	125,684.66	33,579,124.66	-1,545.00
交易所				

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	33,454,985.00	125,684.66	33,579,124.66	-1,545.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,944,935,137.10	125,684.66	3,227,612,341.60	282,551,519.84

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	301,256.08
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,185,292.46
其中：交易所市场	10,185,292.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	105,203.31
合计	10,591,751.85

6.4.7.8 实收基金

广发中小盘精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	665,859,770.54	665,859,770.54
本期申购	363,279,399.46	363,279,399.46
本期赎回（以“-”号填列）	-245,309,124.89	-245,309,124.89
本期末	783,830,045.11	783,830,045.11

广发中小盘精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	437,898,212.34	437,898,212.34
本期申购	875,540,818.40	875,540,818.40
本期赎回（以“-”号填列）	-335,841,254.57	-335,841,254.57
本期末	977,597,776.17	977,597,776.17

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

广发中小盘精选混合 A

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	116,513,716.07	257,520,052.12	374,033,768.19
本期利润	83,322,074.90	187,318,638.94	270,640,713.84
本期基金份额交易产生的变动数	19,565,479.86	67,262,320.73	86,827,800.59
其中：基金申购款	78,088,488.99	202,553,424.90	280,641,913.89
基金赎回款	-58,523,009.13	-135,291,104.17	-193,814,113.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	219,401,270.83	512,101,011.79	731,502,282.62

广发中小盘精选混合 C

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	73,776,444.37	169,089,933.99	242,866,378.36
本期利润	87,345,829.85	196,555,302.63	283,901,132.48
本期基金份额交易产生的变动数	102,253,897.20	271,102,368.66	373,356,265.86
其中：基金申购款	178,299,780.80	464,039,302.59	642,339,083.39
基金赎回款	-76,045,883.60	-192,936,933.93	-268,982,817.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	263,376,171.42	636,747,605.28	900,123,776.70

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	368,071.78
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	170,476.84
其他	11,858.08
合计	550,406.70

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	179,749,886.14
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	179,749,886.14

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,818,753,024.57
减：卖出股票成本总额	9,611,097,527.95
减：交易费用	27,905,610.48
买卖股票差价收入	179,749,886.14

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	21,851.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	512,072.94
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	533,924.84

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,126,005.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	58,218,232.00
减：应计利息总额	395,572.98
减：交易费用	127.16
买卖债券差价收入	512,072.94

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,512,160.23
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	14,512,160.23

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	383,873,941.57
——股票投资	383,875,486.57
——债券投资	-1,545.00
——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	383,873,941.57

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	376,892.82
基金转换费收入	115,646.01
合计	492,538.83

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	31,992.06
账户维护费	19,500.00
其他	5,499.94
合计	153,195.31

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、注册登记与过户机构、直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	822,753,864.04	3.98%	13,381,545.72	0.19%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

广发证券股份有限公司	384,400.00	0.25%	363,700.00	7.56%
------------	------------	-------	------------	-------

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	765,486.94	5.02%	303,143.77	2.98%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	13,381.55	0.26%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,333,418.73	6,908,554.15
其中：支付销售机构的客户维护费	2,821,511.12	1,255,473.62

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，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。费用自动扣划后，基金管理人

应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,222,236.38	1,151,425.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	1,921,209.82	1,921,209.82
广发证券股份有限公司	-	146.05	146.05
合计	-	1,921,355.87	1,921,355.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	322,094.66	322,094.66
广发证券股份有限公司	-	-	-

合计	-	322,094.66	322,094.66
----	---	------------	------------

注：本基金自 2021 年 10 月 27 日起增设 C 类份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，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，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	广发中小盘精选混 合A	广发中小盘精选混 合C	广发中小盘精选混 合A	广发中小盘精选混 合C
报告期初持有的基 金份额	10,000,200.02	5,832,604.26	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入 总份额	-	2,963,841.14	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/	10,000,200.02	-	-	-

卖出总份额				
报告期末持有的基金份额	-	8,796,445.40	10,000,200.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.90%	3.09%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发中小盘精选混合 A

份额单位：份

关联方名称	广发中小盘精选混合A本期末 2023年6月30日		广发中小盘精选混合A上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	16,716,259.89	2.13%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

广发中小盘精选混合 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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
中国银行股份有限公司	391,924,457.76	368,071.78	85,774,515.62	131,556.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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。

6.4.11 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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2023-05-26	6 个月	大宗买入流通受限	15.16	22.71	1,850,000.00	28,046,000.00	42,013,500.00	-
688018	乐鑫科技	2023-06-05	6 个月	大宗买入流通受限	145.50	118.90	100,000.00	14,550,000.00	11,890,000.00	-
688018	乐鑫科技	2023-06-20	6 个月	大宗买入流通受限	140.00	118.44	100,000.00	14,000,000.00	11,844,000.00	-

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2023 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 2023 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 2023 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 2023 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	33,579,124.66	-
合计	33,579,124.66	-

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

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运

行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

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、风险价值模型（VaR）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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	391,924,457.76	-	-	-	391,924,457.76
结算备付金	12,301,332.28	-	-	-	12,301,332.28
存出保证金	1,318,917.97	-	-	-	1,318,917.97

交易性金融资产	33,579,124.66	-	-	3,194,033,216.94	3,227,612,341.60
应收清算款	-	-	-	41,512,446.52	41,512,446.52
应收股利	-	-	-	2,050,227.25	2,050,227.25
应收申购款	-	-	-	1,986,543.00	1,986,543.00
资产总计	439,123,832.67	-	-	3,239,582,433.71	3,678,706,266.38
负债					
应付清算款	-	-	-	16,869,219.05	16,869,219.05
应付赎回款	-	-	-	252,813,434.76	252,813,434.76
应付管理人报酬	-	-	-	4,101,829.81	4,101,829.81
应付托管费	-	-	-	683,638.29	683,638.29
应付销售服务费	-	-	-	592,512.02	592,512.02
其他负债	-	-	-	10,591,751.85	10,591,751.85
负债总计	-	-	-	285,652,385.78	285,652,385.78
利率敏感度缺口	439,123,832.67	-	-	2,953,930,047.93	3,393,053,880.60
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	119,537,707.86	-	-	-	119,537,707.86
结算备付金	11,477,941.44	-	-	-	11,477,941.44
存出保证金	943,558.49	-	-	-	943,558.49
交易性金融资产	-	-	-	1,591,257,978.51	1,591,257,978.51
应收申购款	-	-	-	24,092,726.57	24,092,726.57
资产总计	131,959,207.79	-	-	1,615,350,705.08	1,747,309,912.87
负债					
应付清算款	-	-	-	6,376,094.74	6,376,094.74
应付赎回款	-	-	-	13,069,875.37	13,069,875.37
应付管理人报酬	-	-	-	2,297,059.86	2,297,059.86
应付托管费	-	-	-	382,843.30	382,843.30

应付销售服务费	-	-	-	247,565.20	247,565.20
其他负债	-	-	-	4,278,344.97	4,278,344.97
负债总计	-	-	-	26,651,783.44	26,651,783.44
利率敏感度缺口	131,959,207.79	-	-	1,588,698,921.64	1,720,658,129.43

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-67,600.83	-
	市场利率下降 25 个基点	67,874.15	-

注：本基金上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	459,425,501.36	-	459,425,501.36
应收股利	-	2,050,227.25	-	2,050,227.25
资产合计	-	461,475,728.61	-	461,475,728.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	461,475,728.61	-	461,475,728.61
项目	上年度末			

	2022年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险 敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	23,073,786.43	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-23,073,786.43	-

注：本基金上年度末未持有外汇资产。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VaR）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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	3,194,033,216.94	94.13	1,591,257,978.51	92.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	3,194,033,216.94	94.13	1,591,257,978.51	92.48

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	上升 5%	145,642,707.60	40,354,682.37
	下降 5%	-145,642,707.60	-40,354,682.37

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	3,128,285,716.94
第二层次	33,579,124.66
第三层次	65,747,500.00
合计	3,227,612,341.60

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业务等情况，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	3,194,033,216.94	86.82
	其中：普通股	3,194,033,216.94	86.82
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,579,124.66	0.91
	其中：债券	33,579,124.66	0.91
	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	404,225,790.04	10.99
8	其他各项资产	46,868,134.74	1.27
9	合计	3,678,706,266.38	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 459,425,501.36 元，占基金资产净值比例 13.54%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,907,073,799.14	56.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	245,867,750.00	7.25
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	57,971,936.00	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	225,268,035.20	6.64
J	金融业	49,148,512.00	1.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	163,812,679.00	4.83
M	科学研究和技术服务业	85,465,004.24	2.52
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,734,607,715.58	80.59

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	138,097,354.45	4.07
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	52,827,905.07	1.56
信息技术	113,913,026.15	3.36
通讯业务	154,587,215.69	4.56

公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	459,425,501.36	13.54

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002472	双环传动	4,891,600	177,565,080.00	5.23
2	600415	小商品城	19,204,300	163,812,679.00	4.83
3	601138	工业富联	5,732,400	139,849,980.00	4.12
4	00981	中芯国际	6,056,500	113,913,026.15	3.36
5	688676	金盘科技	3,452,939	104,589,522.31	3.08
6	605598	上海港湾	1,878,500	98,921,810.00	2.92
7	002050	三花智控	3,237,200	97,957,672.00	2.89
8	600732	爱旭股份	3,114,640	95,775,180.00	2.82
9	688036	传音控股	628,282	92,357,454.00	2.72
10	300258	精锻科技	6,226,483	90,221,738.67	2.66
11	300416	苏试试验	3,964,054	85,465,004.24	2.52
12	688556	高测股份	1,574,488	83,668,292.32	2.47
13	688472	阿特斯	4,468,064	82,033,655.04	2.42
14	688084	晶品特装	943,619	81,972,182.53	2.42
15	000988	华工科技	2,093,300	79,566,333.00	2.34
16	688072	拓荆科技	171,972	73,254,912.84	2.16
17	00700	腾讯控股	222,000	67,871,742.10	2.00
18	300308	中际旭创	458,700	67,635,315.00	1.99
19	301310	鑫宏业	975,966	67,224,538.08	1.98
20	688777	中控技术	994,710	62,447,893.80	1.84
21	688018	乐鑫科技	476,726	59,658,569.32	1.76
22	301325	曼恩斯特	517,300	59,230,850.00	1.75
23	601800	中国交建	5,345,500	58,319,405.00	1.72
24	001872	招商港口	3,356,800	57,971,936.00	1.71
25	00144	招商局港口	5,598,000	57,083,359.08	1.68
26	002765	蓝黛科技	6,818,700	57,004,332.00	1.68
27	00388	香港交易所	194,100	52,827,905.07	1.56
28	300394	天孚通信	479,805	51,257,568.15	1.51
29	300033	同花顺	280,400	49,148,512.00	1.45
30	600970	中材国际	3,625,900	46,230,225.00	1.36
31	603611	诺力股份	1,715,380	45,183,109.20	1.33
32	00390	中国中铁	9,366,000	44,644,318.40	1.32

33	00772	阅文集团	1,435,800	43,618,514.23	1.29
34	03888	金山软件	1,515,200	43,096,959.36	1.27
35	000928	中钢国际	4,393,400	42,396,310.00	1.25
36	873593	鼎智科技	299,194	39,912,479.60	1.18
37	688531	日联科技	261,633	38,855,116.83	1.15
38	603662	柯力传感	1,044,616	38,441,868.80	1.13
39	01186	中国铁建	6,848,500	36,369,676.97	1.07
40	688111	金山办公	75,064	35,446,722.08	1.04
41	002605	姚记科技	735,000	34,126,050.00	1.01
42	688281	华秦科技	167,811	33,981,727.50	1.00
43	000063	中兴通讯	745,100	33,931,854.00	1.00
44	300002	神州泰岳	2,399,200	33,588,800.00	0.99
45	688372	伟测科技	208,963	32,002,683.45	0.94
46	688141	杰华特	810,174	31,677,803.40	0.93
47	300487	蓝晓科技	435,876	27,207,379.92	0.80
48	601689	拓普集团	332,501	26,832,830.70	0.79
49	603728	鸣志电器	332,052	26,663,775.60	0.79
50	600326	西藏天路	3,391,600	22,825,468.00	0.67
51	300660	江苏雷利	184,398	7,044,003.60	0.21
52	688582	芯动联科	28,796	1,349,092.60	0.04

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	00981	中芯国际	163,515,745.04	9.50
1	688981	中芯国际	82,560,961.60	4.80
2	601138	工业富联	223,632,843.06	13.00
3	000063	中兴通讯	210,947,930.57	12.26
4	000938	紫光股份	188,819,680.87	10.97
5	002472	双环传动	187,795,377.32	10.91
6	601800	中国交建	121,368,715.06	7.05
6	01800	中国交通建设	55,720,722.10	3.24
7	000021	深科技	165,074,766.26	9.59
8	600415	小商品城	161,238,230.68	9.37
9	002371	北方华创	151,935,095.00	8.83
10	601117	中国化学	148,833,744.72	8.65
11	002463	沪电股份	134,262,253.24	7.80
12	601186	中国铁建	88,236,732.60	5.13
12	01186	中国铁建	40,318,189.94	2.34

13	00388	香港交易所	121,954,903.56	7.09
14	300058	蓝色光标	120,044,280.76	6.98
15	00700	腾讯控股	118,276,998.65	6.87
16	002050	三花智控	114,308,969.21	6.64
17	688018	乐鑫科技	112,977,583.98	6.57
18	688472	阿特斯	112,081,716.43	6.51
19	688599	天合光能	105,574,347.57	6.14
20	688036	传音控股	102,460,686.31	5.95
21	300033	同花顺	100,362,620.99	5.83
22	603662	柯力传感	99,548,509.65	5.79
23	688012	中微公司	98,524,545.10	5.73
24	601390	中国中铁	52,888,762.26	3.07
24	00390	中国中铁	44,710,313.66	2.60
25	600732	爱旭股份	94,388,376.79	5.49
26	300660	江苏雷利	93,696,330.48	5.45
27	601689	拓普集团	91,432,509.34	5.31
28	600853	龙建股份	88,481,161.92	5.14
29	688676	金盘科技	86,801,995.89	5.04
30	000988	华工科技	85,335,064.56	4.96
31	002236	大华股份	84,795,843.38	4.93
32	300002	神州泰岳	83,981,842.47	4.88
33	03690	美团-W	83,820,300.80	4.87
34	002941	新疆交建	83,583,767.11	4.86
35	688556	高测股份	81,892,755.84	4.76
36	688084	晶品特装	80,483,777.01	4.68
37	688072	拓荆科技	80,297,612.83	4.67
38	601226	华电重工	78,838,874.88	4.58
39	605598	上海港湾	78,554,346.77	4.57
40	688531	日联科技	77,904,482.73	4.53
41	600326	西藏天路	77,591,621.46	4.51
42	688111	金山办公	77,272,999.19	4.49
43	300308	中际旭创	74,153,263.00	4.31
44	600248	陕建股份	73,240,237.88	4.26
45	301030	仕净科技	73,147,677.74	4.25
46	600970	中材国际	72,596,366.83	4.22
47	300258	精锻科技	72,565,590.19	4.22
48	002765	蓝黛科技	71,973,096.63	4.18
49	002558	巨人网络	71,169,999.50	4.14
50	603728	鸣志电器	70,207,588.80	4.08
51	688110	东芯股份	69,877,328.17	4.06
52	301310	鑫宏业	69,341,975.59	4.03
53	688141	杰华特	68,916,358.77	4.01
54	688777	中控技术	67,616,746.08	3.93
55	000617	中油资本	67,593,435.07	3.93

56	000977	浪潮信息	67,259,078.28	3.91
57	300389	艾比森	67,008,821.47	3.89
58	001872	招商港口	66,546,660.80	3.87
59	000928	中钢国际	63,612,334.84	3.70
60	300677	英科医疗	63,472,062.60	3.69
61	300502	新易盛	61,702,173.35	3.59
62	002555	三七互娱	61,016,053.06	3.55
63	00144	招商局港口	60,648,702.00	3.52
64	688121	卓然股份	59,734,208.48	3.47
65	300394	天孚通信	58,331,735.64	3.39
66	300487	蓝晓科技	57,449,279.79	3.34
67	873593	鼎智科技	57,333,499.97	3.33
68	002045	国光电器	57,320,602.79	3.33
69	600203	福日电子	55,575,787.00	3.23
70	000028	国药一致	54,899,624.02	3.19
71	003022	联泓新科	54,717,408.00	3.18
72	600536	中国软件	54,603,487.00	3.17
73	601877	正泰电器	54,598,455.90	3.17
74	688498	源杰科技	54,363,155.67	3.16
75	300364	中文在线	54,195,931.00	3.15
76	600720	祁连山	53,228,395.53	3.09
77	301325	曼恩斯特	53,079,733.34	3.08
78	000065	北方国际	52,322,103.32	3.04
79	300423	昇辉科技	51,759,592.03	3.01
80	300299	富春股份	51,361,258.57	2.98
81	600717	天津港	51,021,402.30	2.97
82	688372	伟测科技	50,839,806.91	2.95
83	002605	姚记科技	50,595,510.00	2.94
84	300719	安达维尔	50,446,941.95	2.93
85	002384	东山精密	50,033,052.50	2.91
86	300738	奥飞数据	49,397,873.31	2.87
87	600584	长电科技	48,364,592.95	2.81
88	300474	景嘉微	47,978,810.56	2.79
89	603611	诺力股份	47,043,928.55	2.73
90	300604	长川科技	46,948,331.23	2.73
91	03888	金山软件	46,423,114.56	2.70
92	002241	歌尔股份	46,154,369.03	2.68
93	002051	中工国际	45,355,243.88	2.64
94	002517	恺英网络	45,257,670.54	2.63
95	300678	中科信息	44,528,759.09	2.59
96	00772	阅文集团	43,749,606.31	2.54
97	605123	派克新材	42,787,326.44	2.49
98	300393	中来股份	42,698,213.88	2.48
99	600837	海通证券	42,408,765.41	2.46

100	300092	科新机电	42,081,761.01	2.45
101	603986	兆易创新	41,930,911.32	2.44
102	688048	长光华芯	41,728,847.08	2.43
103	002043	兔宝宝	41,552,228.00	2.41
104	688281	华秦科技	41,460,621.34	2.41
105	688468	科美诊断	41,325,264.18	2.40
106	002368	太极股份	40,550,087.40	2.36
107	300773	拉卡拉	40,463,738.28	2.35
108	688126	沪硅产业	40,034,305.65	2.33
109	688535	华海诚科	39,644,039.18	2.30
110	300634	彩讯股份	39,487,642.30	2.29
111	300260	新莱应材	38,316,031.00	2.23
112	300585	奥联电子	37,940,374.00	2.20
113	003031	中瓷电子	37,614,115.29	2.19
114	002151	北斗星通	37,562,742.50	2.18
115	300628	亿联网络	37,191,467.61	2.16
116	600277	亿利洁能	35,561,707.76	2.07
117	300418	昆仑万维	35,359,741.46	2.06
118	601858	中国科传	35,220,835.02	2.05
119	688385	复旦微电	35,212,817.31	2.05
120	605377	华旺科技	35,196,841.70	2.05
121	300624	万兴科技	35,144,155.55	2.04

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	000938	紫光股份	212,889,601.18	12.37
2	000063	中兴通讯	179,874,873.74	10.45
3	000021	深科技	169,215,287.64	9.83
4	601117	中国化学	159,187,296.79	9.25
5	002384	东山精密	152,011,578.62	8.83
6	002371	北方华创	150,019,405.78	8.72
7	601138	工业富联	143,359,777.14	8.33
8	002463	沪电股份	133,709,684.96	7.77
9	002050	三花智控	132,026,026.42	7.67
10	688981	中芯国际	86,278,817.50	5.01

10	00981	中芯国际	43,922,699.68	2.55
11	300660	江苏雷利	128,829,021.20	7.49
12	002472	双环传动	128,818,932.20	7.49
13	300260	新莱应材	123,802,672.97	7.20
14	601800	中国交建	64,247,933.00	3.73
14	01800	中国交通建设	54,298,750.65	3.16
15	601689	拓普集团	118,356,086.80	6.88
16	300124	汇川技术	108,244,879.37	6.29
17	603728	鸣志电器	99,219,666.59	5.77
18	600853	龙建股份	97,651,073.86	5.68
19	688012	中微公司	97,065,607.91	5.64
20	300058	蓝色光标	96,072,617.97	5.58
21	300585	奥联电子	90,627,852.42	5.27
22	003031	中瓷电子	89,728,416.20	5.21
23	601186	中国铁建	86,550,295.43	5.03
24	002236	大华股份	86,060,011.88	5.00
25	000977	浪潮信息	84,574,215.74	4.92
26	600248	陕建股份	83,798,141.01	4.87
27	603662	柯力传感	83,694,240.78	4.86
28	300389	艾比森	82,958,611.98	4.82
29	300002	神州泰岳	80,417,658.44	4.67
30	002941	新疆交建	79,628,506.06	4.63
31	002979	雷赛智能	78,892,510.01	4.59
32	000065	北方国际	78,713,405.65	4.57
33	688599	天合光能	77,036,948.74	4.48
34	03690	美团-W	76,767,234.57	4.46
35	000617	中油资本	74,706,317.31	4.34
36	002558	巨人网络	73,899,985.88	4.29
37	00388	香港交易所	73,023,412.40	4.24
38	301030	仕净科技	71,663,557.90	4.16
39	300678	中科信息	71,217,647.15	4.14
40	688110	东芯股份	68,668,366.04	3.99
41	301391	卡莱特	68,169,300.36	3.96
42	000028	国药一致	67,831,493.68	3.94
43	603915	国茂股份	67,822,223.97	3.94
44	002555	三七互娱	65,680,523.32	3.82
45	300847	中船汉光	65,380,703.44	3.80
46	600536	中国软件	64,974,101.58	3.78
47	601226	华电重工	64,447,133.00	3.75
48	603986	兆易创新	62,404,928.55	3.63
49	688498	源杰科技	62,121,001.21	3.61
50	688111	金山办公	61,588,814.79	3.58
51	002045	国光电器	61,331,339.48	3.56
52	300423	昇辉科技	60,997,743.56	3.55

53	300502	新易盛	60,710,181.80	3.53
54	601858	中国科传	60,106,549.01	3.49
55	688121	卓然股份	58,167,661.67	3.38
56	300364	中文在线	58,053,588.16	3.37
57	300677	英科医疗	57,214,634.20	3.33
58	603056	德邦股份	56,398,103.00	3.28
59	300299	富春股份	56,004,387.13	3.25
60	002043	兔宝宝	54,918,086.39	3.19
61	688305	科德数控	54,811,948.96	3.19
62	688200	华峰测控	53,636,659.17	3.12
63	300033	同花顺	53,517,255.66	3.11
64	688122	西部超导	53,005,993.33	3.08
65	688084	晶品特装	51,717,328.87	3.01
66	600326	西藏天路	51,391,127.18	2.99
67	00700	腾讯控股	51,376,560.91	2.99
68	300624	万兴科技	51,234,939.20	2.98
69	300474	景嘉微	50,971,103.07	2.96
70	600203	福日电子	50,334,713.47	2.93
71	601390	中国中铁	50,004,119.05	2.91
72	600584	长电科技	49,693,256.30	2.89
73	688018	乐鑫科技	49,193,958.22	2.86
74	301029	怡合达	49,017,472.00	2.85
75	600875	东方电气	48,400,739.18	2.81
76	300738	奥飞数据	47,693,822.10	2.77
77	300719	安达维尔	46,650,600.35	2.71
78	600720	祁连山	46,397,217.77	2.70
79	688472	阿特斯	46,288,800.07	2.69
80	601877	正泰电器	46,231,202.35	2.69
81	300604	长川科技	46,054,999.40	2.68
82	600717	天津港	46,034,741.92	2.68
83	002517	恺英网络	45,794,076.69	2.66
84	300693	盛弘股份	45,764,749.65	2.66
85	002241	歌尔股份	44,708,980.00	2.60
86	300394	天孚通信	43,852,859.14	2.55
87	688697	纽威数控	43,801,389.03	2.55
88	300418	昆仑万维	43,526,863.20	2.53
89	003022	联泓新科	43,069,858.81	2.50
90	688468	科美诊断	43,062,475.48	2.50
91	688048	长光华芯	42,873,329.95	2.49
92	002368	太极股份	42,626,337.19	2.48
93	605123	派克新材	41,677,439.57	2.42
94	002520	日发精机	40,229,589.08	2.34
95	300308	中际旭创	39,953,323.37	2.32
96	688676	金盘科技	39,807,880.35	2.31

97	688126	沪硅产业	38,764,430.06	2.25
98	002151	北斗星通	38,354,003.80	2.23
99	873593	鼎智科技	38,110,167.49	2.21
100	300773	拉卡拉	37,791,133.46	2.20
101	600837	海通证券	37,505,645.50	2.18
102	300393	中来股份	36,873,183.93	2.14
103	688535	华海诚科	36,661,524.65	2.13
104	002051	中工国际	36,603,520.00	2.13
105	301308	江波龙	36,523,734.69	2.12
106	300634	彩讯股份	36,030,559.00	2.09
107	600415	小商品城	35,188,510.00	2.05
108	688361	中科飞测-U	35,065,460.90	2.04
109	300092	科新机电	35,014,340.00	2.03
110	002605	姚记科技	34,976,475.00	2.03
111	603998	方盛制药	34,705,946.00	2.02
112	300965	恒宇信通	34,558,925.85	2.01

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	10,829,997,279.81
卖出股票收入（成交）总额	9,818,753,024.57

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	33,579,124.66	0.99
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	33,579,124.66	0.99
----	----	---------------	------

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	019703	23 国债 10	334,000	33,579,124.66	0.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海港湾基础建设（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方人民政府的处罚。

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。

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	1,318,917.97
2	应收清算款	41,512,446.52
3	应收股利	2,050,227.25
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,986,543.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,868,134.74

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

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	601138	工业富联	42,013,500.00	1.24	大宗买入流 通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
广发中小盘精	18,589	42,166.34	563,719,4	71.92%	220,110,5	28.08%

选混合 A			86.24		58.87	
广发中小盘精 选混合 C	4,432	220,577.12	953,990,1 86.17	97.59%	23,607,59 0.00	2.41%
合计	23,021	76,513.96	1,517,709 ,672.41	86.16%	243,718,1 48.87	13.84%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发中小盘精选混合 A	1,989,200.47	0.2538%
	广发中小盘精选混合 C	326,674.20	0.0334%
	合计	2,315,874.67	0.1315%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发中小盘精选混合 A	50~100
	广发中小盘精选混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中小盘精选混合 A	10~50
	广发中小盘精选混合 C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
基金合同生效日（2018 年 5 月 4 日）基金份额总额	811,802,111.33	-
本报告期期初基金份额总额	665,859,770.54	437,898,212.34
本报告期基金总申购份额	363,279,399.46	875,540,818.40
减：本报告期基金总赎回份额	245,309,124.89	335,841,254.57

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	783,830,045.11	977,597,776.17

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

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	
中信证券	3	2,868,039,518.32	13.89%	2,096,137.39	13.75%	-
开源证券	2	2,688,269,164.33	13.02%	1,960,907.73	12.86%	-
海通证券	2	2,459,640,045.55	11.91%	1,798,940.56	11.80%	-
招商证券	3	2,086,880,003.65	10.11%	1,526,140.82	10.01%	新增 1 个
华创证券	1	1,964,187,681.59	9.51%	1,436,415.76	9.42%	-
长江证券	2	1,840,761,884.04	8.91%	1,345,053.16	8.82%	-

安信证券	1	1,584,718,551.43	7.67%	1,158,903.84	7.60%	-
国金证券	4	1,291,000,382.30	6.25%	938,742.02	6.16%	-
广发证券	3	822,753,864.04	3.98%	765,486.94	5.02%	-
西南证券	1	743,489,166.86	3.60%	539,285.50	3.54%	-
银河证券	2	567,486,220.70	2.75%	415,007.66	2.72%	-
国盛证券	2	424,803,921.99	2.06%	310,659.00	2.04%	-
中泰证券	2	402,923,082.63	1.95%	294,645.25	1.93%	-
东莞证券	1	303,981,028.61	1.47%	222,301.26	1.46%	-
华金证券	2	259,309,999.33	1.26%	189,633.93	1.24%	-
万和证券	2	245,062,121.55	1.19%	179,213.71	1.18%	新增 1 个
申万宏源	1	95,443,667.46	0.46%	66,810.74	0.44%	-
民生证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东兴证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
大同证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
首创证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
财通证券	2	-	-	-	-	-

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 and 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	114,555,897.88	75.72%	-	-	-	-
海通证券	33,561,910.75	22.18%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	531,402.92	0.35%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	384,400.00	0.25%	-	-	-	-
西南证券	2,265,000.00	1.50%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金 2023 年 1 月 19 日至 2023 年 1 月 29 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-17
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
3	广发基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金分红方式变更规则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-23
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
5	关于旗下部分基金 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 4 月 10 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-04
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
7	关于旗下部分基金 2023 年 5 月 26 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-24
8	关于广发中小盘精选混合型证券投资基金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	2023-06-07

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	20230101-20230226,20230421-20230424,20230426-20230627	293,680,456.84	109,119,160.15	100,000,000.00	302,799,616.99	17.19%
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 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发中小盘精选混合型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中小盘精选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.《广发中小盘精选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

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日