

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

理计划

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 8 月 24 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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划于 2020 年 5 月 7 日合同变更生效。本集合计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	8
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	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	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	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	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	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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末投资目标基金明细	错误!未定义书签。
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.4 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	42
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.7 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	47
7.8 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	47
7.9 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	47
7.10 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	47

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.13 本报告期投资基金情况	错误!未定义书签。
7.14 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 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	49
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	错误!未定义书签。
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.9 其他重大事件	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划
基金简称	广发资管价值增长灵活配置混合
基金主代码	871003
交易代码	871003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 日
基金管理人	广发证券资产管理（广东）有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	690,157,820.09 份
基金合同存续期	自本集合合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。自合同变更生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动的资产配置和价值成长策略对股票进行投资布局，实现产品资产在管理期限内稳健增值。
投资策略	本集合计划将采用“自上而下”的分析方法，分析宏观经济的发展趋势，判断当前所处的经济周期阶段和货币政策变化的趋势，并利用当前股票市场的估值状况与国债收益率、利率变化趋势判断股票市场的估值合理程度，然后进行权益类资产与债券类资产、现金等大类资产之间的战略性配置。本集合计划将综合分析未来一段时间内各类资产的预期收益及风险特征，合理制定和调整股票、债券、现金等各类资产的配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% + 中债总指数收益率×30% + 恒生中国企业指数收益率×10%
风险收益特征	本集合计划为灵活配置混合型集合资产管理计划（大集合产品），其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，属于中风险产品。

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		广发证券资产管理（广东）有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	吴顺虎	陆志俊
	联系电话	020-66336029	95559

负责人	电子邮箱	xuyz@gf.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95575	95559
传真		020-87553363	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-285	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦30-32楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		510075	200336
法定代表人		孔维成	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfam.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区马场路26号广发证券大厦30-32楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	139,255,261.24
本期利润	62,017,729.07
加权平均基金份额本期利润	0.0823
本期加权平均净值利润率	5.18%
本期基金份额净值增长率	4.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	510,540,448.88
期末可供分配基金份额利润	0.7397
期末基金资产净值	1,112,059,120.84
期末基金份额净值	1.6113
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)

基金份额累计净值增长率	60.18%
-------------	--------

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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损益。

（3）期末可供分配利润，为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	0.81%	1.05%	-1.38%	0.54%	2.19%	0.51%
过去三个月	6.87%	0.99%	2.28%	0.65%	4.59%	0.34%
过去六个月	4.37%	1.51%	0.95%	0.88%	3.42%	0.63%
过去一年	41.67%	1.41%	17.10%	0.88%	24.57%	0.53%
自基金合同生效起至今	60.18%	1.37%	20.32%	0.85%	39.86%	0.52%

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

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划
 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
 （2020年5月7日至2021年6月30日）



注：按本集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同（第十二部分）的有关约定。

§ 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《关于核准广发证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2013〕1610号）批准，广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“广发资管”）于2014年1月2日成立，系广发证券股份有限公司旗下全资子公司，全面承继了广发证券原资产管理部的相关业务，业务范围为证券资产管理业务。

广发资管始终秉持“知识图强，求实奉献；客户至上，合作共赢”的核心价值观，贯彻执行“稳健经营，持续创新；绩效导向，协同高效”的经营管理理念，以持续完善的全面风险管理体系、卓越的投资管理能力及优质的客户服务水平，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，自成立以来始终是中国资本市场具有重要影响力的证券资产管理机构。广发资管具有证券资产管理业务经营许可、合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务（QDII）资格、中国银行间市场交易商协会会员资格、投资管理人受托管理保险资金资格等业务资格，透过集合资产管理计划（含大集合）、单一资产管理计划和专项资产管理计划在固定收益、主动权益、指数量化、海外投资、资产证券化等领域全面布局。

截至 2021 年 6 月 30 日,公司资产管理总规模为 3,310.44 亿元,其中主动管理资产规模为 2,933.57 亿元。根据中国证券投资基金业协会的统计数据,2021 年第二季度,公司私募资产管理月均规模为 3,234.08 亿元,行业排名第八;私募主动资产管理月均规模为 2,791.19 亿元,行业排名第五。公司各项指标稳定保持在券商资管的第一梯队。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日颁布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的规定,并经中国证监会的批准,截至 2021 年 6 月 30 日,广发资管已有 7 只大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。后续,广发资管将陆续有其他大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。

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		
陈耀波	投资经理助理	2021-05-18	-	6 年	陈耀波先生,中国国籍,管理学硕士,2015 年进入广发证券,历任广发证券资产管理(广东)有限公司权益产品部研究员;现任广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划投资经理助理。
刘宁	投资经理	2020-07-03	-	10 年	刘宁先生,中国国籍,经济学硕士,2013 年进入广发证券,历任资产管理部研究员、广发证券资产管理(广东)有限公司权益产品部投资经理;现任广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划投资经理。

注:注:1、任职日期是指公司决定聘任投资经理管理本集合计划的日期;

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
刘宁	公募基金	1.00	1,112,059,120.84	2020/7/3
	私募资产管理计划	6.00	214,565,213.87	2015/4/23
	其他组合	0.00	0.00	-
	合计	7.00	1,326,624,334.71	

注:报告期内,刘宁先生兼任投资经理的私募资产管理计划,有 2 只提前终止或到期终止。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及本集合计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益。报告期，本集合计划运作合法合规，不存在违法违规或未履行本集合计划合同承诺的情形，不存在损害计划持有人利益的行为。

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

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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 5% 的交易。

本报告期内，未发现本集合计划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

二季度经济形势及金融条件出现一些变化，一方面国内经济数据开始走平，显示本轮经济复苏已近尾声，通胀预期也随之见顶回落；另一方面上半年国内出现了较为明显的信用收缩，考虑到经济数据的变化，管理人判断该紧缩过程也已趋近拐点；此外，海外经济尚处于波动中恢复的过程中。

由于宏观经济及金融条件的上述变化，权益市场上即表现为较为明显的风格转换，5 月开始成长类板块显著跑赢市场。管理人在二季度中后段也进行了较大范围的结构调整，增配医药、电动车、

光伏、日常消费等板块，对原持仓的可选消费等进行一定减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划的净值数据和同期业绩比较基准数据详见本报告“3 主要财务指标和基金净值表现”的披露内容。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本宏观经济形势与金融条件有望维持二季度的发展趋势，管理人对市场整体判断谨慎乐观，同时认为结构风格得到延续的概率较高，本产品预计将维持目前的行业配置不变。同时管理人还将对一些潜在变化点进行密切关注，一是国内日常消费在需求端及成本端出现正向改善的可能性，二是海外流动性出现较大波动的可能性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、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集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划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。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责对投资品种的估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本集合计划合同要求及本集合计划实际运作情况，本集合计划本报告期内未实施利润分配。

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，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者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，集合计划托管人在广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害集合计划持有人利益的行为。

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

本报告期内，广发证券资产管理（广东）有限公司在广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

本报告期内本集合计划未进行收益分配，符合集合计划合同的规定。

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

本报告期内，由广发证券资产管理（广东）有限公司编制并经托管人复核审查的有关广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	85,597,531.54	189,099,708.40
结算备付金		4,182,336.90	21,370,767.06
存出保证金		631,591.90	931,976.93
交易性金融资产	6.4.7.2	1,032,365,748.56	1,247,794,592.91
其中：股票投资		1,032,365,748.56	1,247,794,592.91
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	95,336.89
应收利息	6.4.7.5	23,818.76	55,813.97
应收股利		28,235.34	-
应收申购款		202,359.97	1,198,210.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,123,031,622.97	1,460,546,406.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		43.93	71,414,234.45
应付赎回款		5,516,643.99	12,329,050.61
应付管理人报酬		1,097,433.23	1,374,970.61
应付托管费		164,614.95	206,245.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	568,899.76	427,906.31
应交税费		3,518,113.28	6,579,009.16
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	106,752.99	78,027.61
负债合计		10,972,502.13	92,409,444.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	433,998,250.66	557,291,248.13
未分配利润	6.4.7.10	678,060,870.18	810,845,714.37
所有者权益合计		1,112,059,120.84	1,368,136,962.50

负债和所有者权益总计		1,123,031,622.97	1,460,546,406.83
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，本集合计划份额净值人民币 1.6113 元，份额总额 690,157,820.09 份。

6.2 利润表

会计主体：广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 7 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		76,699,060.73	69,195,539.92
1.利息收入		977,405.78	80,183.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	977,104.26	80,183.28
债券利息收入		301.52	-
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）		151,809,491.02	28,784,336.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	150,052,078.48	25,305,630.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	137,816.76	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,619,595.78	3,478,705.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-77,237,532.17	40,328,561.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,149,696.10	2,458.39
减：二、费用		14,681,331.66	2,230,619.19
1. 管理人报酬		7,170,823.79	974,186.44
2. 托管费		1,075,623.54	146,127.98
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,796,418.62	1,069,938.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		540,684.71	29,511.80

7. 其他费用	6.4.7.19	97,781.00	10,854.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,017,729.07	66,964,920.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,017,729.07	66,964,920.73

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，上年度可比期间不完整。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	557,291,248.13	810,845,714.37	1,368,136,962.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,017,729.07	62,017,729.07
三、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）	-123,292,997.47	-194,802,573.26	-318,095,570.73
其中：1.基金申购款	65,743,233.29	101,397,650.90	167,140,884.19
2.基金赎回款	-189,036,230.76	-296,200,224.16	-485,236,454.92
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	433,998,250.66	678,060,870.18	1,112,059,120.84
项目	上年度可比期间 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	324,739,465.29	219,275,051.24	544,014,516.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,964,920.73	66,964,920.73
三、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）	-26,759,532.45	-19,746,220.50	-46,505,752.95

其中：1.基金申购款	190,535.23	139,658.93	330,194.16
2.基金赎回款	-26,950,067.68	-19,885,879.43	-46,835,947.11
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	297,979,932.84	266,493,751.47	564,473,684.31

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，上年度可比期间不完整。

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：杨龙，主管会计工作负责人：李卉，会计机构负责人：梁杰锋

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为广发集合资产管理计划（3 号）（以下简称“原集合计划”），于 2005 年 11 月 10 日经中国证监会许可（2005）122 号文核准设立，自 2005 年 11 月 28 日开始募集，于 2006 年 1 月 13 日结束募集工作，并于 2006 年 1 月 18 日成立。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币 393,816,465.14 元（含利息转份额），折合 393,816,465.14 份集合计划份额，上述资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司审验。原集合计划原管理人为广发证券股份有限公司，后变更为广发证券资产管理（广东）有限公司，托管人为交通银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]39 号）的规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自 2020 年 5 月 7 日起，《广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划合同》生效，原《广发集合资产管理计划（3 号）资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式大集合产品，系管理人依据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的相关证券市场股票及其

他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本集合计划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

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和资产净值变动情况。

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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

6.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。

本集合计划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。

6.4.6.2 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	85,597,531.54
定期存款	-
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	-
合计	85,597,531.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	944,713,588.11	1,032,365,748.56	87,652,160.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	944,713,588.11	1,032,365,748.56	87,652,160.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本集合计划本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	20,748.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,813.99
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	255.78
合计	23,818.76

6.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	568,899.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	568,899.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	10,549.68
应付证券出借违约金	-
预提费用	96,203.31
合计	106,752.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	886,221,333.14	557,291,248.13
本期申购	104,546,552.48	65,743,233.29
本期赎回（以“-”号填列）	-300,610,065.53	-189,036,230.76
本期末	690,157,820.09	433,998,250.66

6.4.7.10 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	496,728,201.39	314,117,512.98	810,845,714.37
本期利润	139,255,261.24	-77,237,532.17	62,017,729.07
本期基金份额交易产生的变动数	-125,443,013.75	-69,359,559.51	-194,802,573.26
其中：基金申购款	68,522,260.81	32,875,390.09	101,397,650.90
基金赎回款	-193,965,274.56	-102,234,949.60	-296,200,224.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	510,540,448.88	167,520,421.30	678,060,870.18

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	64,447.86
其他	7,305.01
合计	977,104.26

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	2,040,087,921.76

买卖股票差价收入	150,052,078.48
----------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,056,261.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	918,134.50
减：应收利息总额	310.51
买卖债券差价收入	137,816.76

6.4.7.14 衍生工具收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,619,595.78
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	1,619,595.78

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-79,554,658.13
——股票投资	-79,554,658.13
——债券投资	-
——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	-2,317,125.96
合计	-77,237,532.17

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,149,696.10
合计	1,149,696.10

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	5,796,418.62
银行间市场交易费用	-
合计	5,796,418.62

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	1,577.69
合计	97,781.00

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，本集合计划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，本集合计划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

本集合计划本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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
广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“广发资管”）	本集合计划管理人、销售机构
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	本集合计划托管人、销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	本集合计划管理人母公司、销售机构
吉林敖东药业集团股份有限公司	本集合计划管理人的关联方

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日） 至2020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	4,091,473,124.68	100.00%	789,450,934.59	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日） 至2020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	1,969,951.26	100.00%	-	-

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 2021年1月1日至2021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	2,788,481.55	100.00%	568,899.76	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日）至2020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	555,162.75	100.00%	399,935.54	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的征管费和经手费的净额列示。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生 效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,170,823.79	974,186.44
其中：支付销售机构的客户维护费	3,537,925.53	58,220.74

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.2% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人自动于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生 效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,075,623.54	146,127.98

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.18% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人自动于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本集合计划本报告期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

本集合计划本报告期及上年度可比期间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

本集合计划本报告期及上年度可比期间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 2021年1月1日至2021年6月30 日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效 日）至2020年6月30日
报告期初持有的基金份额	36,567,000.14	-
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	36,567,000.14	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	5.30%	-

注：本集合计划管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本集合计划份额变动的相关费用按资产管理合同等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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
吉林敖东药业集团 股份有限公司	4,969,594.26	0.72%	4,969,594.26	0.56%

注：本集合计划除管理人外的其他关联方本报告期内及上年度可比期间内持有本集合计划份额变动的相关费用按资产管理合同等相关法律文件有关规定支付。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月7日(基金合同生效日) 至2020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
交通银行	85,597,531.54	905,351.39	48,309,189.06	73,141.64

注：本集合计划的上述银行存款由托管人交通银行保管，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

本集合计划本报告期及上年度可比期间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

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	158.00	1,452.02	6,380.04	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	10.76	22.20	181.00	1,947.56	4,018.20	2021-05-19 除权除息，派息比例 0.0500（含税）
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	100.00	1,339.00	3,010.00	2021-06-21 除权除息，派息

										比例 0.2100 (含 税)
30092 9	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-20	新股 流通 受限	13.87	29.55	90.00	1,248. 30	2,659. 50	2021-0 6-18 除权 除息, 派息 比例 0.1200 (含 税)
30093 1	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 流通 受限	4.31	13.11	218.00	939.58	2,857. 98	-
30093 2	三友 联众	2021-0 1-15	2021-0 7-22	新股 流通 受限	24.69	31.71	201.00	4,962. 69	6,373. 71	2021-0 5-28 除权 除息, 派息 比例 0.3500 (含 税)
30093 3	中辰 股份	2021-0 1-15	2021-0 7-22	新股 流通 受限	3.37	10.44	606.00	2,042. 22	6,326. 64	2021-0 6-18 除权 除息, 派息 比例 0.0300 (含 税)
30093 7	药易 购	2021-0 1-20	2021-0 7-27	新股 流通 受限	12.25	53.71	92.00	1,127. 00	4,941. 32	2021-0 5-21 除权 除息, 派息 比例 0.2000 (含 税)
30094 0	南极 光	2021-0 1-27	2021-0 8-03	新股 流通	12.76	43.38	139.00	1,773. 64	6,029. 82	2021-0 6-18

				受限						除权 除息， 派息 比例 0.0790 (含 税)
30094 1	创识 科技	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 流通 受限	21.31	49.94	258.00	5,497. 98	12,884 .52	2021-0 6-29 除权 除息， 派息 比例 0.3000 (含 税)
30094 2	易瑞 生物	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 流通 受限	5.31	28.52	243.00	1,290. 33	6,930. 36	2021-0 6-02 除权 除息， 派息 比例 0.0450 (含 税)
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	9.79	23.01	151.00	1,478. 29	3,474. 51	2021-0 6-17 除权 除息， 派息 比例 0.1000 (含 税)
30094 5	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	4.56	18.88	218.00	994.08	4,115. 84	2021-0 6-09 除权 除息， 派息 比例 0.0950 (含 税)
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新股 流通	13.00	27.42	134.00	1,157. 00	3,674. 28	2021-0 6-04

				受限						除权 除息， 派息 比例 0.0800 (含 税)， 送转 比例 0.5000
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 流通 受限	8.41	39.13	103.00	866.23	4,030. 39	2021-0 6-01 除权 除息， 派息 比例 0.1000 (含 税)
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-11	新股 流通 受限	11.72	27.08	172.00	2,015. 84	4,657. 76	2021-0 6-03 除权 除息， 派息 比例 0.2200 (含 税)
30095 3	震裕 科技	2021-0 3-11	2021-0 9-18	新股 流通 受限	28.77	99.85	91.00	2,618. 07	9,086. 35	2021-0 6-17 除权 除息， 派息 比例 0.1400 (含 税)
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 流通 受限	16.53	46.07	113.00	1,867. 89	5,205. 91	2021-0 6-28 除权 除息， 派息 比例 0.4100 (含

										税)
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股流通受限	8.53	27.22	153.00	1,305.09	4,164.66	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	126.00	1,522.08	2,905.56	2021-06-23 除权除息, 派息比例 0.4000 (含税)
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	222.00	1,882.56	4,899.54	2021-06-11 除权除息, 派息比例 0.0530 (含税)
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-09	新股流通受限	3.40	16.37	290.00	986.00	4,747.30	2021-06-10 除权除息, 派息比例 0.1600 (含税)
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-09	新股流通受限	12.13	22.49	138.00	1,673.94	3,103.62	2021-06-11 除权除息, 派息比例 0.1500 (含税)
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-09	新股流通受限	8.24	31.54	124.00	1,021.76	3,910.96	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通	6.87	12.07	579.00	3,977.73	6,988.53	-

				受限						
30097 1	博亚 精工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	新股 流通 受限	18.24	28.29	105.00	1,915. 20	2,970. 45	2021-0 6-11 除 权除 息, 派 息比 例 0.4000 (含 税)
30097 2	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 流通 受限	7.19	12.65	119.00	855.61	1,505. 35	-
30097 3	立高 食品	2021-0 4-08	2021-1 0-15	新股 流通 受限	28.28	115.71	234.00	6,617. 52	27,076 .14	2021-0 6-22 除 权除 息, 派 息比 例 0.5000 (含 税)
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 流通 受限	5.48	13.03	241.00	1,320. 68	3,140. 23	2021-0 6-08 除 权除 息, 派 息比 例 0.0360 (含 税)
30097 8	东箭 科技	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	8.42	13.60	217.00	1,827. 14	2,951. 20	2021-0 6-25 除 权除 息, 派 息比 例 0.5000 (含 税)
30097 9	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	33.22	87.50	900.00	29,898 .00	78,750 .00	-
30098 1	中红 医疗	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通	48.59	90.39	454.00	22,059 .86	41,037 .06	-

				受限						
30098 2	苏文 电能	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通 受限	15.83	45.29	168.00	2,659. 44	7,608. 72	2021-0 6-18 除权 除息, 派息 比例 0.5000 (含 税)
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 流通 受限	24.90	24.81	170.00	4,233. 00	4,217. 70	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 0-30	新股 流通 受限	14.79	30.57	135.00	1,996. 65	4,126. 95	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 流通 受限	6.79	26.81	147.00	998.13	3,941. 07	-
30099 1	创益 通	2021-0 5-12	2021-1 1-20	新股 流通 受限	13.06	26.51	119.00	1,554. 14	3,154. 69	-
30099 2	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.36	20.32	91.00	851.76	1,849. 12	-
30099 3	玉马 遮阳	2021-0 5-17	2021-1 1-24	新股 流通 受限	12.10	19.29	182.00	2,202. 20	3,510. 78	-
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	74.00	1,089. 28	1,725. 68	-
30099 6	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	新股 流通 受限	20.81	42.23	103.00	2,143. 43	4,349. 69	-
30099 7	欢乐 家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 流通 受限	4.94	13.05	556.00	2,746. 64	7,255. 80	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	100.00	602.00	2,132. 00	-
30100 2	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	新股 流通 受限	18.71	57.62	96.00	1,796. 16	5,531. 52	-
30100 4	嘉益 股份	2021-0 6-18	2021-1 2-25	新股 流通	7.81	21.94	128.00	999.68	2,808. 32	-

				受限						
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	147.00	777.63	2,122.68	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	334.00	4,188.36	9,315.26	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-18	新股流通受限	7.83	17.61	100.00	783.00	1,761.00	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股流通受限	14.20	33.84	78.00	1,107.60	2,639.52	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	83.00	668.15	2,013.58	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	199.00	1,520.36	7,727.17	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	108.00	1,485.00	3,561.84	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	3,288.00	29,131.68	29,131.68	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	366.00	3,242.76	3,242.76	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	10.64	10.64	1,326.00	14,108.64	14,108.64	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	10.64	148.00	1,574.72	1,574.72	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	1,132.00	10,708.72	10,708.72	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	126.00	1,191.96	1,191.96	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股流通受限	6.07	6.07	330.00	2,003.10	2,003.10	-
60528	德才	2021-0	2021-0	新股	31.56	31.56	105.00	3,313.	3,313.	-

7	股份	6-28	7-06	流通受限				80	80	
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	1,189.00	26,110.44	26,110.44	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	1,305.00	8,378.10	8,378.10	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股流通受限	11.48	11.48	1,233.00	14,154.84	14,154.84	-

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本集合计划无因认购新发/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，本集合计划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 2021 年 6 月 30 日止，本集合计划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 2021 年 6 月 30 日止，本集合计划无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本集合计划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

本集合计划为混合型集合产品，集合计划的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划通过主动的资产配置和价值成长策略对股票进行投资布局，力争实现产品资产在管理期限内的稳健增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人奉行全面风险管理的理念，公司实行“董事会—高级管理层（风险控制委员会）—风险管理部—各业务部门与各职能部门”的四级风险管理组织体系，各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责，超过权限需报上一级风险管理组织和人员决策。董事会是公司风险管理的最高决策机构，履行一级风险防范的职能；高级管理层及下设的风险控制委员会履行二级风险

防范的职能。风险控制委员会协助高级管理层确定、调整公司风险容忍度及业务风险限额，评估和决策重大风险事项，并监督公司的风险管理状况；公司风险管理部作为风险管理工作的职能部门，负责监测、评估、报告公司整体风险水平，并负责协助、指导和检查各部门风险管理工作，公司其他职能部门根据各自职责分工，履行相应风险管理职责。公司各业务部门履行直接的风险管理职责，承担本部门风险管理的第一责任。

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，将对本集合计划资产造成的损失。为了防范信用风险，本集合计划针对投资标的和交易对手分别建立了准入标准及风险限额，在投资前需履行相应的尽职调查和内部审批程序。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管人交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易。本集合计划管理人建立了科学的资产负债管理和头寸管理机制，并通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

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，导致本集合计划收益水平变化而产生的风险，反映了本集合计划资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。

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。本集合计划管理人通过设置久期、偏离度、VaR 等指标对利率风险进行管理。本集合计划持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本集合计划的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，受市场利率变动影响较小。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	85,597,531.54	-	-	-	85,597,531.54
结算备付金	4,182,336.90	-	-	-	4,182,336.90
存出保证金	631,591.90	-	-	-	631,591.90
交易性金融资产	-	-	-	1,032,365,748.56	1,032,365,748.56

					56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	23,818.76	23,818.76
应收股利	-	-	-	28,235.34	28,235.34
应收申购款	-	-	-	202,359.97	202,359.97
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	90,411,460.34	-	-	1,032,620,162.63	1,123,031,622.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	43.93	43.93
应付赎回款	-	-	-	5,516,643.99	5,516,643.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,097,433.23	1,097,433.23
应付托管费	-	-	-	164,614.95	164,614.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	568,899.76	568,899.76
应交税费	-	-	-	3,518,113.28	3,518,113.28
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	106,752.99	106,752.99
负债总计	-	-	-	10,972,502.13	10,972,502.13
利率敏感度缺口	90,411,460.34	-	-	1,021,647,660.50	1,112,059,120.84
上年度末 2020 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	189,099,708.40	-	-	-	189,099,708.40
结算备付金	21,370,767.06	-	-	-	21,370,767.06
存出保证金	931,976.93	-	-	-	931,976.93
交易性金融资产	-	-	-	1,247,794,592.91	1,247,794,592.91
应收证券清算款	-	-	-	95,336.89	95,336.89
应收利息	-	-	-	55,813.97	55,813.97

应收申购款	-	-	-	1,198,210.67	1,198,210.67
资产总计	211,402,452.39	-	-	1,249,143,954.44	1,460,546,406.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	71,414,234.45	71,414,234.45
应付赎回款	-	-	-	12,329,050.61	12,329,050.61
应付管理人报酬	-	-	-	1,374,970.61	1,374,970.61
应付托管费	-	-	-	206,245.58	206,245.58
应付交易费用	-	-	-	427,906.31	427,906.31
应交税费	-	-	-	6,579,009.16	6,579,009.16
其他负债	-	-	-	78,027.61	78,027.61
负债总计	-	-	-	92,409,444.33	92,409,444.33
利率敏感度缺口	211,402,452.39	-	-	1,156,734,510.11	1,368,136,962.50

注：各期限分类的标准为按金融资产或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

本集合计划于 2021 年 06 月 30 日未持有债券资产，持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。其中，持有的银行存款为活期存款，受市场利率变动影响较小。

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。本集合计划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

其他价格风险是指以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。

为对市场风险进行有效的管理，本集合计划管理人建立了市场风险指标管理体系，针对权益价格风险，设置了净值增长率、波动率、预警线、止损线、VaR 等指标。同时，制定各指标相应的风险限额，并持续跟踪限额执行情况和市场变化，对其进行动态调整。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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	1,032,365,748.56	92.83	1,247,794,592.91	91.20
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	1,032,365,748.56	92.83	1,247,794,592.91	91.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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	上年度末
		2021年6月30日	2020年12月31日
	各板块市场指数上涨 5%	62,336,738.46	67,449,910.99
	各板块市场指数下跌 5%	-62,336,738.46	-67,449,910.99

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 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。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本集合计划持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 1,031,885,668.98 元，属于第二层级的余额为人民币 480,079.58 元，无属于第三层级的余额

（2020 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为人民币 1,236,060,630.63 元，属于第二层级的余额为人民币 11,733,962.28 元，无属于第三层级的余额）。

（iii）公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,032,365,748.56	91.93
	其中：股票	1,032,365,748.56	91.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	89,779,868.44	7.99
8	其他各项资产	886,005.97	0.08
9	合计	1,123,031,622.97	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 199,408,482.00 元，占集合计划资产净值的比例为 17.93%。

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	1,505.35	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	736,577,812.52	66.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,290.70	0.00
E	建筑业	10,922.52	0.00
F	批发和零售业	21,346,282.24	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,798.72	0.00
J	金融业	8,220.96	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	28,218,708.00	2.54
M	科学研究和技术服务业	46,736,947.53	4.20
N	水利、环境和公共设施管理业	21,778.02	0.00
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	832,957,266.56	74.90

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（%）
原材料	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
非日常生活消费品	118,647,744.00	10.67
日常消费品	45,492,240.00	4.09
能源	-	-
金融	-	-

医疗保健	9,951,545.00	0.89
工业	-	-
通信服务	25,316,953.00	2.28
信息技术	-	-
合计	199,408,482.00	17.93

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	占基金资产净值比例（%）
1	603659	璞泰来	492,800.00	67,316,480.00	6.05
2	300750	宁德时代	124,200.00	66,422,160.00	5.97
3	601012	隆基股份	733,620.00	65,174,800.80	5.86
4	02020	安踏体育	412,000.00	62,665,200.00	5.64
5	603456	九洲药业	1,200,765.00	58,333,163.70	5.25
6	300630	普利制药	1,096,110.00	57,436,164.00	5.16
7	002511	中顺洁柔	2,058,691.00	56,716,937.05	5.10
8	01999	敏华控股	3,604,800.00	55,982,544.00	5.03
9	603259	药明康德	298,467.00	46,736,947.53	4.20
10	00168	青岛啤酒股份	654,000.00	45,492,240.00	4.09
11	300763	锦浪科技	239,717.00	43,292,890.20	3.89
12	603799	华友钴业	375,600.00	42,893,520.00	3.86
13	002850	科达利	466,850.00	40,802,690.00	3.67
14	300601	康泰生物	252,067.00	37,557,983.00	3.38
15	000568	泸州老窖	145,900.00	34,423,646.00	3.10
16	601689	拓普集团	837,400.00	31,343,882.00	2.82
17	002027	分众传媒	2,998,800.00	28,218,708.00	2.54
18	00700	腾讯控股	52,100.00	25,316,953.00	2.28
19	300919	中伟股份	150,742.00	24,570,946.00	2.21
20	300073	当升科技	432,900.00	24,324,651.00	2.19
21	000858	五粮液	73,200.00	21,805,548.00	1.96
22	603712	七一二	598,300.00	21,598,630.00	1.94
23	603233	大参林	414,668.00	21,193,681.48	1.91
24	300482	万孚生物	326,500.00	21,121,285.00	1.90

25	605369	拱东医疗	102,140.00	11,748,142.80	1.06
26	01530	三生制药	1,245,500.00	9,951,545.00	0.89
27	688276	百克生物	85,909.00	8,984,363.22	0.81
28	688161	威高骨科	1,729.00	183,360.45	0.02
29	301015	百洋医药	1,985.00	108,028.93	0.01
30	300979	华利集团	900.00	78,750.00	0.01
31	301016	雷尔伟	1,077.00	45,364.50	0.00
32	300981	中红医疗	454.00	41,037.06	0.00
33	301017	漱玉平民	3,654.00	32,374.44	0.00
34	605499	东鹏饮料	129.00	32,353.20	0.00
35	300973	立高食品	234.00	27,076.14	0.00
36	688087	英科再生	1,189.00	26,110.44	0.00
37	300894	火星人	266.00	18,088.00	0.00
38	688367	工大高科	820.00	17,687.40	0.00
39	301020	密封科技	1,474.00	15,683.36	0.00
40	688239	航宇科技	1,233.00	14,154.84	0.00
41	300941	创识科技	258.00	12,884.52	0.00
42	301021	英诺激光	1,258.00	11,900.68	0.00
43	605339	南侨食品	254.00	10,967.72	0.00
44	605089	味知香	108.00	9,398.16	0.00
45	301009	可靠股份	334.00	9,315.26	0.00
46	300953	震裕科技	91.00	9,086.35	0.00
47	688226	威腾电气	1,305.00	8,378.10	0.00
48	601528	瑞丰银行	528.00	8,220.96	0.00
49	300925	法本信息	296.00	7,781.84	0.00
50	300982	苏文电能	168.00	7,608.72	0.00
51	300997	欢乐家	556.00	7,255.80	0.00
52	300968	格林精密	579.00	6,988.53	0.00
53	300942	易瑞生物	243.00	6,930.36	0.00
54	300614	百川畅银	158.00	6,380.04	0.00
55	300932	三友联众	201.00	6,373.71	0.00
56	300933	中辰股份	606.00	6,326.64	0.00
57	300940	南极光	139.00	6,029.82	0.00
58	001207	联科科技	174.00	5,761.14	0.00
59	300918	南山智尚	546.00	5,683.86	0.00
60	301002	崧盛股份	96.00	5,531.52	0.00
61	603511	爱慕股份	158.00	5,214.00	0.00
62	300955	嘉亨家化	113.00	5,205.91	0.00
63	605300	佳禾食品	180.00	5,004.00	0.00
64	300937	药易购	92.00	4,941.32	0.00
65	300961	深水海纳	222.00	4,899.54	0.00
66	300962	中金辐照	290.00	4,747.30	0.00
67	300952	恒辉安防	172.00	4,657.76	0.00

68	300996	普联软件	103.00	4,349.69	0.00
69	300985	致远新能	170.00	4,217.70	0.00
70	001208	华菱线缆	545.00	4,212.85	0.00
71	300958	建工修复	153.00	4,164.66	0.00
72	300986	志特新材	135.00	4,126.95	0.00
73	300945	曼卡龙	218.00	4,115.84	0.00
74	300950	德固特	103.00	4,030.39	0.00
75	300926	博俊科技	181.00	4,018.20	0.00
76	300987	川网传媒	147.00	3,941.07	0.00
77	300966	共同药业	124.00	3,910.96	0.00
78	300948	冠中生态	134.00	3,674.28	0.00
79	300993	玉马遮阳	182.00	3,510.78	0.00
80	300943	春晖智控	151.00	3,474.51	0.00
81	605287	德才股份	105.00	3,313.80	0.00
82	300991	创益通	119.00	3,154.69	0.00
83	300975	商络电子	241.00	3,140.23	0.00
84	300963	中洲特材	138.00	3,103.62	0.00
85	300927	江天化学	100.00	3,010.00	0.00
86	300971	博亚精工	105.00	2,970.45	0.00
87	300978	东箭科技	217.00	2,951.20	0.00
88	300960	通业科技	126.00	2,905.56	0.00
89	300931	通用电梯	218.00	2,857.98	0.00
90	603171	税友股份	148.00	2,841.60	0.00
91	301004	嘉益股份	128.00	2,808.32	0.00
92	300929	华骐环保	90.00	2,659.50	0.00
93	301011	华立科技	78.00	2,639.52	0.00
94	300998	宁波方正	100.00	2,132.00	0.00
95	301007	德迈仕	147.00	2,122.68	0.00
96	301012	扬电科技	83.00	2,013.58	0.00
97	605162	新中港	330.00	2,003.10	0.00
98	300992	泰福泵业	91.00	1,849.12	0.00
99	301010	晶雪节能	100.00	1,761.00	0.00
100	300995	奇德新材	74.00	1,725.68	0.00
101	300972	万辰生物	119.00	1,505.35	0.00
102	605011	杭州热电	145.00	1,287.60	0.00

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	300601	康泰生物	111,704,378.87	8.16
2	601689	拓普集团	76,115,057.88	5.56
3	002511	中顺洁柔	72,781,476.28	5.32
4	300122	智飞生物	67,102,059.40	4.90
5	01999	敏华控股	66,891,034.65	4.89
6	00168	青岛啤酒股份	65,692,154.51	4.80
7	002078	太阳纸业	59,750,010.39	4.37
8	002027	分众传媒	58,613,958.08	4.28
9	02020	安踏体育	52,946,102.96	3.87
10	603456	九洲药业	52,720,810.94	3.85
11	000568	泸州老窖	52,466,709.95	3.83
12	603659	璞泰来	51,696,834.71	3.78
13	300750	宁德时代	49,880,090.00	3.65
14	02313	申洲国际	47,734,670.64	3.49
15	601799	星宇股份	45,982,056.42	3.36
16	603259	药明康德	44,594,546.98	3.26
17	300630	普利制药	40,608,260.72	2.97
18	601012	隆基股份	40,390,201.12	2.95
19	002850	科达利	38,742,112.00	2.83
20	603799	华友钴业	38,222,186.00	2.79
21	002311	海大集团	34,596,874.64	2.53
22	603520	司太立	34,151,989.00	2.50
23	603712	七一二	34,090,437.40	2.49
24	300482	万孚生物	33,438,717.88	2.44
25	00939	建设银行	32,850,011.56	2.40
26	603288	海天味业	32,769,752.00	2.40
27	605369	拱东医疗	32,592,975.80	2.38
28	00700	腾讯控股	32,438,011.02	2.37
29	300073	当升科技	31,680,548.60	2.32
30	300763	锦浪科技	31,108,636.60	2.27
31	002607	中公教育	28,712,079.54	2.10
32	603233	大参林	28,019,409.01	2.05
33	06862	海底捞	27,371,530.93	2.00

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括集合计划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	000333	美的集团	103,593,051.73	7.57
2	002027	分众传媒	94,413,160.15	6.90
3	002511	中顺洁柔	89,460,802.50	6.54
4	600690	海尔智家	87,425,986.79	6.39
5	601318	中国平安	79,084,301.62	5.78
6	300601	康泰生物	78,390,814.20	5.73
7	600438	通威股份	77,811,312.78	5.69
8	02020	安踏体育	68,312,963.96	4.99
9	300122	智飞生物	65,132,605.48	4.76
10	09922	九毛九	58,533,474.35	4.28
11	00175	吉利汽车	58,182,089.73	4.25
12	603658	安图生物	56,995,754.63	4.17
13	601012	隆基股份	55,141,805.83	4.03
14	002078	太阳纸业	51,333,432.08	3.75
15	600176	中国巨石	49,460,496.81	3.62
16	06862	海底捞	48,795,202.50	3.57
17	601689	拓普集团	48,639,092.79	3.56
18	02313	申洲国际	47,806,165.71	3.49
19	601799	星宇股份	46,533,725.80	3.40
20	002241	歌尔股份	46,091,138.00	3.37
21	688063	派能科技	40,637,644.95	2.97
22	300715	凯伦股份	39,518,186.06	2.89
23	600036	招商银行	37,288,751.00	2.73
24	300450	先导智能	37,214,617.48	2.72
25	603288	海天味业	36,299,535.50	2.65
26	603520	司太立	36,251,275.30	2.65
27	002142	宁波银行	36,160,095.90	2.64
28	000001	平安银行	36,119,997.00	2.64
29	605369	拱东医疗	33,515,766.80	2.45
30	002311	海大集团	32,358,489.36	2.37
31	603816	顾家家居	31,702,442.00	2.32
32	00939	建设银行	30,897,478.41	2.26
33	002607	中公教育	30,410,949.13	2.22
34	603712	七一二	28,565,263.57	2.09
35	00700	腾讯控股	27,855,642.41	2.04

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	1,899,712,173.18
卖出股票收入（成交）总额	2,190,140,000.24

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本集合计划本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本集合计划本报告期内未进行股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本集合计划本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本集合计划本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本集合计划的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出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	631,591.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	28,235.34
4	应收利息	23,818.76
5	应收申购款	202,359.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	886,005.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划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

本集合计划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
11,065	62,373.05	49,307,473.19	7.14%	640,850,346.90	92.86%

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	2,001,748.08	0.29%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

	单位：份
本报告期期初基金份额总额	886,221,333.14
本报告期基金总申购份额	104,546,552.48
减：本报告期基金总赎回份额	300,610,065.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	690,157,820.09

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划本报告期内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，本集合计划管理人未发生重大人事变动，托管人的托管部负责人由袁庆伟变更为

徐铁。

2021 年 7 月，本集合计划管理人的副总经理、首席信息官叶秋彬先生拟内部退休，不再担任公司副总经理、首席信息官职务，公司聘任柯学先生为首席信息官；本集合计划管理人的总经理孔维成先生辞去总经理职务，由本集合计划管理人的董事长杨龙先生代为履行公司总经理职务，代为履行职务的时间不超过 6 个月。

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，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期内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

本集合计划本报告期内未发生改聘会计师事务所的情形。

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

本报告期内本集合计划管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
广发证券	2	4,091,473,124.68	100.00%	2,788,481.55	100.00%	-

注：佣金指本集合计划通过单一券商的交易单元进行股票、债券、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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
广发证券	1,969,951.26	100.00%	-	-	-	-

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	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年第一季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-04-20
2	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-04-20
3	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2020 年年度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-03-30
4	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2020 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-03-30
5	关于旗下部分集合资产管理计划 2021 年非港股通交易日暂停申购(含定期定额申购)、赎回等业务的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-02-04
6	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2020 年第四季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-01-20
7	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2020 年第 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-01-20

§ 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

本报告期内，本集合计划未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过本集合计划总份额 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，除已公告信息外，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《关于准予广发集合资产管理计划（3 号）合同变更的回函》（机构部函【2020】713 号）；
- 2、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 5、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议；
- 6、管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼。

12.3 查阅方式

- 1、书面查阅：可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2、网络查阅：管理人网站：www.gfam.com.cn。

广发证券资产管理（广东）有限公司

二〇二一年八月二十七日