

# 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 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：二〇二二年三月二十九日

## § 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。本年度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 2022 年 3 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。

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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	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、基金净值表现及利润分配情况.....	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	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 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.....	11
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.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9	管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	<b>错误!未定义书签。</b>
§ 5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6	审计报告.....	<b>错误!未定义书签。</b>
§ 7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	17
7.2	利润表.....	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4	报表附注.....	22
§ 8	投资组合报告.....	53
8.1	期末基金资产组合情况.....	53
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	<b>错误!未定义书签。</b>
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	55
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	62
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	62
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	62

8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.11	投资组合报告附注 .....	62
§ 9	基金份额持有人信息 .....	63
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	<b>错误!未定义书签。</b>
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	<b>错误!未定义书签。</b>
§ 10	开放式基金份额变动 .....	64
§ 11	重大事件揭示 .....	64
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4	基金投资策略的改变 .....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8	其他重大事件 .....	65
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
§ 13	备查文件目录 .....	67
13.1	备查文件目录 .....	67
13.2	存放地点 .....	67
13.3	查阅方式 .....	67

## § 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	590,343,324.07 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 负责人	姓名	吴顺虎	陆志俊
	联系电话	020-66336029	95559
	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	秦力	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfam.com.cn
基金年度报告备置地点	广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
---------------	--------	---

本期已实现收益	195,340,816.40	304,004,989.20
本期利润	71,090,042.77	403,892,396.33
加权平均基金份额本期利润	0.1031	0.4697
本期加权平均净值利润率	6.42%	35.06%
本期基金份额净值增长率	5.10%	53.47%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>
期末可供分配利润	486,726,980.83	496,728,201.39
期末可供分配基金份额利润	0.8245	0.5605
期末基金资产净值	957,878,313.75	1,368,136,962.50
期末基金份额净值	1.6226	1.5438
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>
基金份额累计净值增长率	61.31%	53.47%

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）。

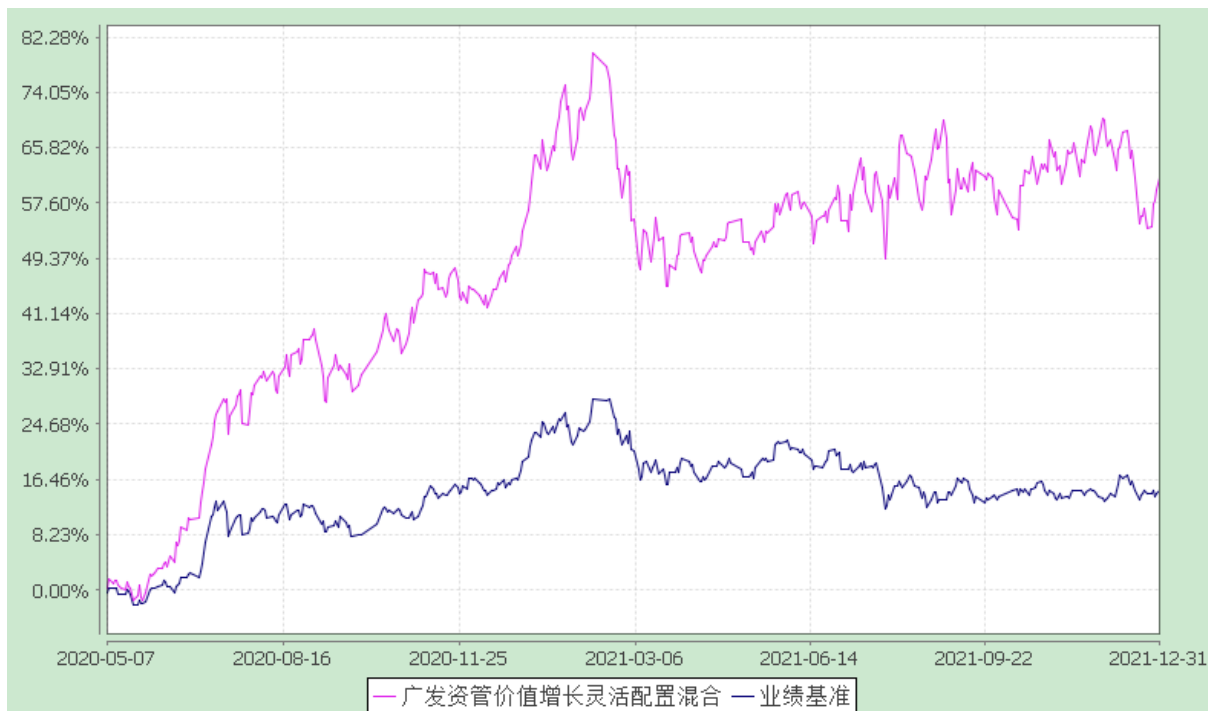
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	1.17%	1.49%	0.84%	0.54%	0.33%	0.95%
过去六个月	0.70%	1.77%	-4.57%	0.72%	5.27%	1.05%
过去一年	5.10%	1.65%	-3.66%	0.80%	8.76%	0.85%
自基金合同生效起至今	61.31%	1.50%	14.82%	0.81%	46.49%	0.69%

#### 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

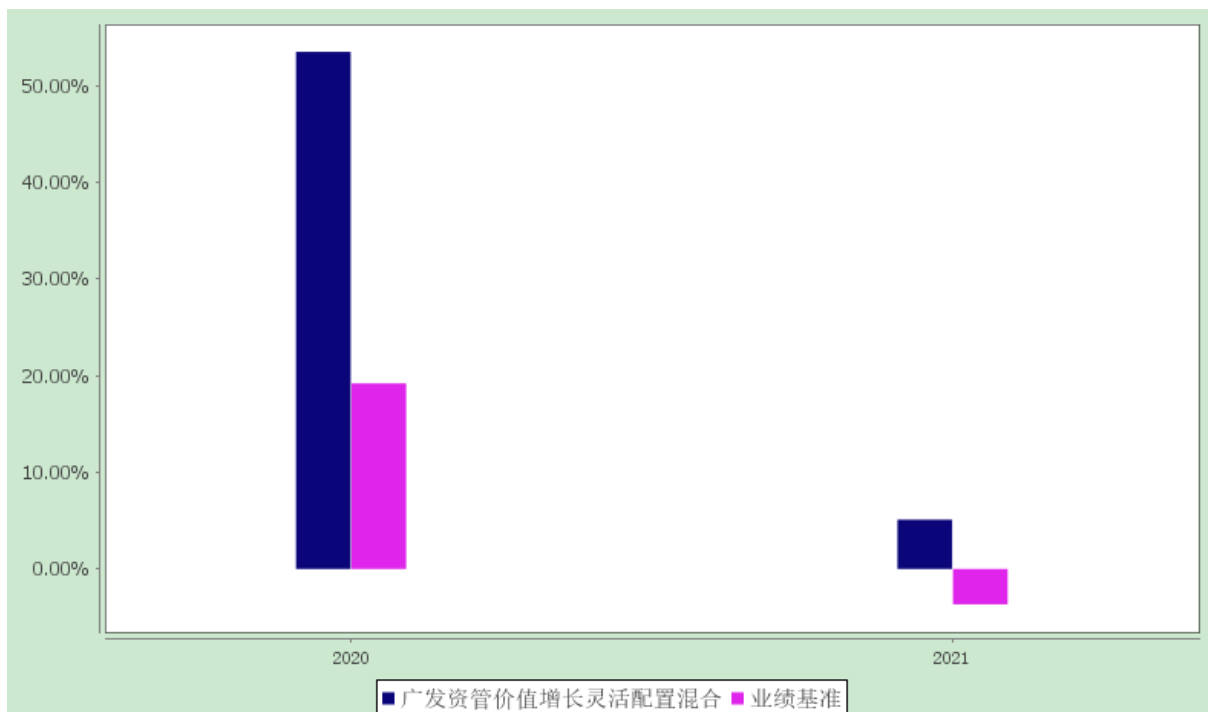
广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2020 年 5 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日）



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，合同变更生效当年（2020 年）相关数据和指标按实际存续期计算，未按自然年度计算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	-	-	-	-	-
2020年	0.600	10,726,541.51	17,044,887.16	27,771,428.67	-
合计	0.600	10,726,541.51	17,044,887.16	27,771,428.67	-

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，自本集合计划合同变更生效日至本报告期末，本集合计划进行了一次分红，详见管理人于 2020 年 7 月 9 日披露的《广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划分红公告》。

## § 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 12 月 31 日，公司资产管理总规模达到 4,932.44 亿元；其中，集合资产管理规模 3,525.61 亿元；单一资产管理规模 1,297.97 亿元。根据中国证券投资基金业协会的统计，公司私募主动管理资产月均规模（2021 年四季度）4,748.97 亿元，行业排名第三，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 12 月 31 日，广发资管已有 8 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		
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：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	957,878,313.75	2020/07/03
	私募资产管理计划	9.00	254,541,086.54	2015/04/23
	其他组合	0.00	0.00	0
	合计	10.00	1,212,419,400.29	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本集合计划基金经理的薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，结合本公司实际情况，制定了《公募产品公平交易及异常交易管理规定》，内容主要包括公平交易的管理组织的职责与分工、交易执行的内部控制、行为监控和分析、报告和信息披露、检查和评价等内容。公平交易制度所规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等与投资管理活动相关的各个环节，也包括事后的检查分析和信息披露。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：①设立交易室，将交易执行职能独立于投资管理职能，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并在投资交易系统中设置公平交易模块，严格执行公平的交易分配制度。②根据交易所公开竞价交易、债券一级市场申购、非公开发行股票申购、以及银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的不同特点，分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待。③对特殊情况需要发生的交易，需要经过严格的公平性审核，相关投资经理应提供决策依据，通过内部请示提交部门负责人及合规部门和风控部门审批后方可执行。④建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核。对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。公司在交易系统设置不同投资组合之间同日反向交易的风控指标。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，相关投资经理应提供决策依据，通过内部审批及合规部门和风控部门审批后方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

报告期内，本集合计划基金经理存在兼任私募资产管理计划投资经理的情形。为有效防范相关兼任行为潜在利益冲突的发生，本集合计划管理人增加执行了以下措施：在投资指令管理方面，要求投资指令下达环节做到“同时同价”，基金经理管理的多个组合同日购入或出售同一证券时，同时发送投资指令，并通过公平交易系统进行价差监控管理。因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，已做好授权管理，加强事后分析。在系统控制方面，管理人在交易系统中已设置“禁止同一投资经理管理的单个或多个产品之间进行反向交易”。在日常交易监控和分析方面，管理人已对本集合计划基金经理管理的公募产品和私募产品间同日及隔日的同反向交易价差进行日常监控和分析，并与业务部门保持持续的沟通及提醒，报告期内，未发生存在异常的情形。在事后分析报告方面，管理人每季度对本集合计划基金经理管理的多个组合的收益率差异进行分析，并对公平交易机制的潜在问题和完善情况进行说明，形成《关于同一投资经理管理的公私募投资组合相关情况的说明》并及时报送广东证监局。

报告期内，本集合计划管理人严格按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等有关公平交易制度进行落实，本集合计划基金经理管理的公募产品和私募产品，未有发现不公平交易情形。

#### 4.3.3 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

2021 年宏观环境特征主要表现为经济增速的见顶回落，政策层面的主要基调是信用收缩及调结构，产业层面的主题是“碳中和”、“碳达峰”，在此背景下 A 股市场呈现较为极致的结构分化，以新能源车、光伏、半导体等为代表的高景气制造业表现优异，而消费、医药等传统领域在疫情和政策的压制下持续低迷。本集合计划前期持有较多的可选消费个股，随着经济拐点的出现，逐步加大制造业相关个股的配置力度，在进入到四季度之后，亦适当增持了稳增长相关个股。

#### 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 2022 年，国内外宏观经济政策走势、中观的行业景气仍是影响市场的核心变量。

从经济及政策维度来看，目前国内“稳增长”的基调已较为明确，但政策的出台及实现效果存在时滞，同时市场对稳增长的抓手及其力度的担忧也需要时间来验证；美联储的缩表及加息进程对市场冲击最显著的时刻可能发生在一季度，国内外经济及政策的完全反向在一季度仍会持续。因而管理人判断一季度市场的波动率仍然会较高，待渡过政策的混沌期，二季度开始市场可能真正步入“以我为主”的逻辑线条中。

从中观的行业景气层面以及微观的企业盈利来讲，因 2022 年处于“经济衰退-筑底-弱反弹”的周期中，高景气行业数量较去年将有所减少，企业盈利也面临较大回落压力，因此管理人判断 2022 年可能不会出现非常明显的领涨行业，随着政策、经济预期的波动，结构层面可能更多呈现出此起彼伏的轮动状态。

基于以上的宏观、中观分析，管理人坚持以产业趋势及公司业绩增长为核心考量点，后续会提升自下而上维度选股的权重。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

作为从事证券资产管理业务的证券公司，本集合计划管理人参照公募基金运作管理本集合计划，建立并持续完善相关参照公募基金运作的制度、流程、系统、机制等，确保本集合计划依法合规规范运作。除此以外，本集合计划管理人还须按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等运作管理私募资产管理计划。

本报告期内，管理人以维护集合计划份额持有人利益为宗旨，持续加强合规与风险管理工作。管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，通过法规解读、监管精神传达、合规培训，以及相关制度、流程、机制、系统的建立、健全和优化完善、合规审核与检查、系统监控、信息披露等方式，严守合规底线、排查防控重大风险，不断推进合规文化建设与员工执业与投资行为管理；母公司稽核部根据外部监管的要求及管理人年度稽核工作计划开展稽核项目，包括基金销售、关联交易、投资经理离任审查、信息技术等，关注内部控制的健全性和有效性，促进完善公司内控机制。管理人通过前述各项措施，有效保障了本集合计划及公司各项业务合法合规、稳健有序开展。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障本集合计划份额持有人的

合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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以及本集合计划实际运作情况，本集合计划本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本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、集合计划收益分配等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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年度报告中财务指标、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 审计报告

安永华明（2022）审字第 61103118\_G02 号

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划全体份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划管理人对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理人负责评估广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在



审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	84,446,213.43	189,099,708.40
结算备付金		1,925,158.05	21,370,767.06
存出保证金		644,682.70	931,976.93
交易性金融资产	7.4.7.2	868,198,163.70	1,247,794,592.91
其中：股票投资		868,198,163.70	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,737,477.89	95,336.89
应收利息	7.4.7.5	17,016.24	55,813.97
应收股利		-	-

应收申购款		-	1,198,210.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>965,968,712.01</b>	<b>1,460,546,406.83</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,569,369.34	71,414,234.45
应付赎回款		-	12,329,050.61
应付管理人报酬		991,359.01	1,374,970.61
应付托管费		148,703.86	206,245.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	330,792.45	427,906.31
应交税费		856,173.60	6,579,009.16
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	194,000.00	78,027.61
<b>负债合计</b>		<b>8,090,398.26</b>	<b>92,409,444.33</b>
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	371,230,959.29	557,291,248.13
未分配利润	7.4.7.10	586,647,354.46	810,845,714.37
<b>所有者权益合计</b>		<b>957,878,313.75</b>	<b>1,368,136,962.50</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>965,968,712.01</b>	<b>1,460,546,406.83</b>

注：1、本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，2020 年度实际报告期间为 2020 年 5

月 7 日至 2020 年 12 月 31 日。

2、于报告截止日 2021 年 12 月 31 日，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净值人民币 1.6226 元，集合计划份额总额 590,343,324.07 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 7 日（基 金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>99,646,221.69</b>	<b>422,683,608.18</b>
1.利息收入		1,392,346.77	1,228,222.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,392,045.25	1,189,706.32
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		-	38,516.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		220,951,719.98	317,646,737.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	217,121,653.01	313,224,223.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	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	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,692,250.21	4,422,514.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-124,250,773.63	99,887,407.13

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,552,928.57	3,921,240.69
<b>减：二、费用</b>		<b>28,556,178.92</b>	<b>18,791,211.85</b>
1. 管理人报酬		13,357,066.82	9,049,697.31
2. 托管费		2,003,560.03	1,357,454.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	12,181,925.06	7,270,246.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		816,503.75	1,066,157.40
7. 其他费用	7.4.7.19	197,123.26	47,655.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>71,090,042.77</b>	<b>403,892,396.33</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>71,090,042.77</b>	<b>403,892,396.33</b>

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，2020 年度实际报告期间为 2020 年 5 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	71,090,042.77	71,090,042.77
三、本期基金份额交易	-186,060,288.84	-295,288,402.68	-481,348,691.52

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	89,481,640.39	139,595,485.75	229,077,126.14
2.基金赎回款	-275,541,929.23	-434,883,888.43	-710,425,817.66
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)	371,230,959.29	586,647,354.46	957,878,313.75
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12月31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)	-	403,892,396.33	403,892,396.33
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)	232,551,782.84	215,449,695.47	448,001,478.31
其中: 1.基金申购款	654,394,436.04	708,361,238.03	1,362,755,674.07
2.基金赎回款	-421,842,653.20	-492,911,542.56	-914,754,195.76
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)	-	-27,771,428.67	-27,771,428.67
五、期末所有者权益(基	557,291,248.13	810,845,714.37	1,368,136,962.50

金净值)			
------	--	--	--

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 7 日，2020 年度实际报告期间为 2020 年 5 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：秦力，主管会计工作负责人：李卉，会计机构负责人：梁杰锋

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度会计期间的经营成果和资产净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟上一会计期间为自 2020 年 5 月 7 日（集合计划合同变更生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本集合计划根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

## （2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本集合计划初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技



术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。本集合计划管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，本集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发

行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对集合计划合同约定费率和计算方法的费用，本集合计划在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关本集合计划分红条件的前提下，由管理人根据产品特点自行约定收益分配次数、比例等，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 本集合计划收益分配后某类集合计划份额的份额净值不能低于面值；即本集合计划收益分配日的某类份额的份额净值减去每单位该类份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1会计政策变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6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：

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### 7.4.6.3 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。

##### 7.4.6.4 境外投资

本集合计划运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 7.4.7重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	84,446,213.43	189,099,708.40
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	84,446,213.43	189,099,708.40

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	829,256,046.66	868,198,163.70	38,942,117.04
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	829,256,046.66	868,198,163.70	38,942,117.04
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,080,587,774.33	1,247,794,592.91	167,206,818.58
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		1,080,587,774.33	1,247,794,592.91	167,206,818.58

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	15,596.35	52,768.48
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	1,129.79	2,655.89
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	290.10	389.60
合计	17,016.24	55,813.97

#### 7.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	330,792.45	427,906.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	330,792.45	427,906.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	25,027.61
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	194,000.00	53,000.00
合计	194,000.00	78,027.61

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	142,296,212.34	89,481,640.39
本期赎回（以“-”号填列）	-438,174,221.41	-275,541,929.23

本期末	590,343,324.07	371,230,959.29
-----	----------------	----------------

注：本期申购含红利再投资份（金）额。

#### 7.4.7.10 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	195,340,816.40	-124,250,773.63	71,090,042.77
本期基金份额交易产生的变动数	-205,342,036.96	-89,946,365.72	-295,288,402.68
其中：基金申购款	99,245,007.18	40,350,478.57	139,595,485.75
基金赎回款	-304,587,044.14	-130,296,844.29	-434,883,888.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	486,726,980.83	99,920,373.63	586,647,354.46

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,256,606.38	1,127,662.50
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	120,987.37	54,671.29
其他	14,451.50	7,372.53
合计	1,392,045.25	1,189,706.32

#### 7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

卖出股票成交总额	4,633,746,840.64	2,604,335,591.31
减：卖出股票成本总额	4,416,625,187.63	2,291,111,368.10
买卖股票差价收入	217,121,653.01	313,224,223.21

#### 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月7日(基金合同生效日)至2020年12月31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	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本集合计划本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月7日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,692,250.21	4,422,514.17
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	3,692,250.21	4,422,514.17

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月7日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-128,264,701.54	103,397,266.52
——股票投资	-128,264,701.54	103,397,266.52
——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	-4,013,927.91	3,509,859.39
合计	-124,250,773.63	99,887,407.13

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,552,928.57	3,921,035.44
其他	-	205.25
合计	1,552,928.57	3,921,240.69

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日）至 2020年12月31日
交易所市场交易费用	12,181,925.06	7,270,246.97
银行间市场交易费用	-	-
合计	12,181,925.06	7,270,246.97

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日）
----	--------------------------	-------------------------------

	31日	至2020年12月31日
审计费用	74,000.00	45,712.74
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,123.26	1,942.82
合计	197,123.26	47,655.56

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发证券资产管理（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。

#### 7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日） 至2020年12月31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	8,795,933,588.12	100.00%	5,532,167,170.20	100.00%

##### 7.4.10.1.2 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。

### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日） 至2020年12月31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%	-	-

### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	-	-	352,400,000.00	100.00%

### 7.4.10.1.5 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12月31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	6,076,288.22	100.00%	330,792.45	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12月31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	3,877,380.25	100.00%	427,906.31	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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,357,066.82	9,049,697.31
其中：支付销售机构的客户维护费	6,476,478.29	3,802,673.93

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,003,560.03	1,357,454.61

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本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。

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

本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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年5月7日(基金合同生 效日)至2020年12月31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	-	36,567,000.14
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	36,567,000.14
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	6.19%	4.13%

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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	0.84%	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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月7日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	84,446,213.43	1,256,606.38	189,099,708.40	1,127,662.50

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未发生利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	90.00	1,487.70	1,487.70	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-04	新股流通受限	4.57	21.08	185.00	845.45	3,899.80	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-12	新股流通受限	8.40	23.88	165.00	1,386.00	3,940.20	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股流通受限	9.96	27.29	83.00	826.68	2,265.07	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-12	新股流通	11.90	45.45	173.00	2,058.70	7,862.85	20

				受限						2 1- 1 0- 1 8 除 权 除 息 , 派 息 比 例 0. 3 6 0 0 ( 含 税 )
301017	漱玉 平民	2021-06-23	2022-01-05	新 股 流 通 受 限	8.86	23.80	366.00	3,242.76	8,710.80	2 0 2 1- 0 8- 1 6 除 权 除 息 , 派 息 比 例 0. 11 0 0

										(含 税)
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股 流通 受限	10.64	30.44	148.00	1,574.72	4,505.12	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股 流通 受限	9.46	41.43	126.00	1,191.96	5,220.18	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-19	新股 流通 受限	1.55	20.88	127.00	196.85	2,651.76	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-16	新股 流通 受限	18.03	62.73	87.00	1,568.61	5,457.51	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-15	新股 流通 受限	11.45	16.65	135.00	1,545.75	2,247.75	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股 流通 受限	5.31	13.50	390.00	2,070.90	5,265.00	2 0 2 1- 0 9- 3 0 除 权 除 息 , 派 息 比 例 0. 1 6 0 0 ( 含 税)



301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-23	新股 流通 受限	14.14	89.87	194.00	2,743.16	17,434.78	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-22	新股 流通 受限	6.10	31.52	116.00	707.60	3,656.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-22	新股 流通 受限	4.97	12.51	214.00	1,063.58	2,677.14	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股 流通 受限	15.14	59.97	55.00	832.70	3,298.35	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股 流通 受限	22.04	56.28	441.00	9,719.64	24,819.48	2021-09-23 除权除息，派息比例0.5400（含税）
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-01-29	新股 流通 受限	23.38	29.93	92.00	2,150.96	2,753.56	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-01-30	新股 流通 受限	14.82	24.26	73.00	1,081.86	1,770.98	-
301038	深水	2021-07-22	2022-02-04	新股	6.68	20.23	126.00	841.68	2,548.98	-

	规院			流通受限						
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-08	新股流通受限	6.96	12.51	1,373.00	9,556.08	17,176.23	2021-11-09 除权除息，派息比例 0.3000（含税）
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-03	新股流通受限	13.57	38.51	88.00	1,194.16	3,388.88	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	95.00	694.45	2,679.95	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-13	新股流通受限	15.81	28.37	200.00	3,162.00	5,674.00	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	48.99	141.00	1,175.94	6,907.59	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-18	新股流通受限	4.13	12.96	391.00	1,614.83	5,067.36	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	92.00	1,779.28	3,028.64	-

301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股 流通 受限	60.64	234.7 4	145.00	8,792.80	34,037.30	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股 流通 受限	11.87	28.78	95.00	1,127.65	2,734.10	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-06	新股 流通 受限	6.90	21.78	156.00	1,076.40	3,397.68	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股 流通 受限	3.93	11.09	245.00	962.85	2,717.05	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-13	新股 流通 受限	8.09	19.30	118.00	954.62	2,277.40	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-13	新股 流通 受限	4.17	30.94	151.00	629.67	4,671.94	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股 流通 受限	3.31	17.01	224.00	741.44	3,810.24	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股 流通 受限	17.40	36.11	75.00	1,305.00	2,708.25	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股 流通 受限	13.98	28.38	63.00	880.74	1,787.94	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-27	新股 流通 受限	5.17	44.21	249.00	1,287.33	11,008.29	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股 流通 受限	7.46	33.41	95.00	708.70	3,173.95	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股 流通 受限	12.24	32.00	72.00	881.28	2,304.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股 流通 受限	5.77	12.14	344.00	1,984.88	4,176.16	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股 流通 受限	11.92	24.82	63.00	750.96	1,563.66	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股 流通	15.48	21.53	348.00	5,387.04	7,492.44	-

				受限						
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	新股 流通 受限	93.09	75.34	321.00	29,881.89	24,184.14	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股 流通 受限	33.16	24.67	380.00	12,600.80	9,374.60	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股 流通 受限	19.11	67.93	97.00	1,853.67	6,589.21	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股 流通 受限	10.45	11.22	1,625.00	16,981.25	18,232.50	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股 流通 受限	36.50	31.31	294.00	10,731.00	9,205.14	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-02	新股 流通 受限	36.31	35.52	178.00	6,463.18	6,322.56	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-01	新股 流通 受限	58.08	49.85	220.00	12,777.60	10,967.00	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股 流通 受限	79.60	78.53	204.00	16,238.40	16,020.12	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股 流通 受限	12.36	22.17	193.00	2,385.48	4,278.81	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	新股 流通 受限	27.81	31.14	304.00	8,454.24	9,466.56	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	新股 流通 受限	26.91	43.36	154.00	4,144.14	6,677.44	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-03	新股 流通 受限	57.27	53.71	163.00	9,335.01	8,754.73	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股 流通 受限	10.48	36.68	134.00	1,404.32	4,915.12	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股 流通 受限	12.03	17.12	851.00	10,237.53	14,569.12	-
301133	金钟	2021-11-19	2022-05-26	新股	14.33	26.95	147.00	2,106.51	3,961.65	-

	股份			流通受限						
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	10.52	10.52	2,637.00	27,741.24	27,741.24	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	124.00	3,245.08	5,562.64	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股流通受限	10.07	16.76	381.00	3,836.67	6,385.56	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	86.06	94.50	135.00	11,618.10	12,757.50	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	180.00	7,034.40	9,383.40	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	298.00	34,830.24	34,591.84	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	189.00	8,314.11	9,595.53	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	99.00	2,684.88	3,027.42	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股流通受限	13.00	20.48	237.00	3,081.00	4,853.76	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	228.00	15,089.04	12,909.36	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	343.00	9,552.55	9,418.78	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	153.00	4,701.69	4,458.42	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	96.00	2,088.96	2,803.20	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	195.00	5,709.60	6,240.00	-

301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股 流通 受限	25.80	33.65	459.00	11,842.20	15,445.35	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	新股 流通 受限	69.89	88.72	159.00	11,112.51	14,106.48	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股 流通 受限	41.98	41.98	5,297.00	222,368.06	222,368.06	-

注：截至本报告期末，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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本集合计划无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本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。

##### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对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行交通银行，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。

##### **7.4.13.2.1 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。

##### **7.4.13.2.2 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。

##### **7.4.13.2.3 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。

##### **7.4.13.2.4 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。

##### **7.4.13.2.5 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。

##### **7.4.13.2.6 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。

#### **7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划管理人通过设置久期、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、结算备付金和存出保证金等，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	84,446,213.43	-	-	-	84,446,213.43
结算备付金	1,925,158.05	-	-	-	1,925,158.05
存出保证金	644,682.70	-	-	-	644,682.70
交易性金融资产	-	-	-	868,198,163.70	868,198,163.70
应收证券清算款	-	-	-	10,737,477.89	10,737,477.89
应收利息	-	-	-	17,016.24	17,016.24



应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	87,016,054.18	-	-	878,952,657.83	965,968,712.01
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	5,569,369.34	5,569,369.34
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	991,359.01	991,359.01
应付托管费	-	-	-	148,703.86	148,703.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	330,792.45	330,792.45
应交税费	-	-	-	856,173.60	856,173.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	194,000.00	194,000.00
负债总计	-	-	-	8,090,398.26	8,090,398.26
利率敏感度缺口	87,016,054.18	-	-	870,862,259.57	957,878,313.75
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
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

					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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划于 2021 年 12 月 31 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、结算备付金和存出保证金等，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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	-	-	-
交易性金融资产	-	56,271,392.00	56,271,392.00
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	-	-	-

资产合计	-	56,271,392.00	56,271,392.00
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
其他负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	56,271,392.00	56,271,392.00
项目	上年度末		
	2020年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	-	-	-
交易性金融资产	-	248,331,610.00	248,331,610.00
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	-	-	-
资产合计	-	248,331,610.00	248,331,610.00
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
其他负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	248,331,610.00	248,331,610.00

## 7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

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 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	2,813,569.60	12,416,580.50
	所有外币相对人民币贬值 5%	-2,813,569.60	-12,416,580.50

## 7.4.13.4.3 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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	868,198,163.70	90.64	1,247,794,592.91	91.20
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	-	-	-	-
合计	868,198,163.70	90.64	1,247,794,592.91	91.20

## 7.4.13.4.3.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	各板块市场指数上涨 5%	58,804,615.96	67,449,910.99
	各板块市场指数下跌 5%	-58,804,615.96	-67,449,910.99

#### 7.4.14 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) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 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次的余额为人民币 867,398,740.08 元，属于第二层次的余额为人民币 799,423.62 元，无属于第三层次的余额。

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

###### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	868,198,163.70	89.88
	其中：股票	868,198,163.70	89.88
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	86,371,371.48	8.94
8	其他各项资产	11,399,176.83	1.18
9	合计	965,968,712.01	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 56,271,392.00 元，占集合计划资产净值的比例为 5.87%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	698,601,548.95	72.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,356.81	0.00
F	批发和零售业	410,339.46	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,304.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,051,195.61	2.93
J	金融业	20,523.44	0.00

K	房地产业	21,699,349.76	2.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	62,940,648.60	6.57
N	水利、环境和公共设施管理业	178,143.81	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,671.94	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,689.32	0.00
S	综合	-	-
	合计	811,926,771.70	84.76

### 8.2.2 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	56,271,392.00	5.87
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
通信服务	-	-
信息技术	-	-
合计	56,271,392.00	5.87

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	530,241.00	62,875,977.78	6.56
2	300750	宁德时代	105,500.00	62,034,000.00	6.48
3	601012	隆基股份	711,120.00	61,298,544.00	6.40
4	002812	恩捷股份	229,227.00	57,398,440.80	5.99
5	688599	天合光能	691,773.00	54,580,889.70	5.70

6	600529	山东药玻	1,142,000.00	50,133,800.00	5.23
7	002049	紫光国微	215,600.00	48,510,000.00	5.06
8	002179	中航光电	473,300.00	47,595,048.00	4.97
9	300014	亿纬锂能	381,300.00	45,062,034.00	4.70
10	300763	锦浪科技	190,500.00	44,110,275.00	4.60
11	603806	福斯特	327,000.00	42,689,850.00	4.46
12	603267	鸿远电子	225,500.00	40,463,720.00	4.22
13	002985	北摩高科	307,900.00	37,089,634.00	3.87
14	06049	保利物业	651,600.00	32,658,192.00	3.41
15	002459	晶澳科技	351,400.00	32,574,780.00	3.40
16	688508	芯朋微	239,989.00	27,805,125.54	2.90
17	002389	航天彩虹	861,400.00	23,946,920.00	2.50
18	01995	旭辉永升服务	2,390,000.00	23,613,200.00	2.47
19	300363	博腾股份	252,431.00	22,579,952.95	2.36
20	000069	华侨城 A	3,082,294.00	21,699,349.76	2.27
21	300233	金城医药	647,400.00	18,832,866.00	1.97
22	600600	青岛啤酒	93,400.00	9,246,600.00	0.97
23	301177	迪阿股份	2,975.00	375,320.40	0.04
24	688262	国芯科技	5,297.00	222,368.06	0.02
25	301127	天源环保	8,505.00	168,950.30	0.02
26	688236	春立医疗	2,109.00	57,765.51	0.01
27	301050	雷电微力	145.00	34,037.30	0.00
28	301136	招标股份	2,637.00	27,741.24	0.00
29	301035	润丰股份	441.00	24,819.48	0.00
30	301087	可孚医疗	321.00	24,184.14	0.00
31	600927	永安期货	547.00	20,523.44	0.00
32	301090	华润材料	1,625.00	18,232.50	0.00
33	301029	怡合达	194.00	17,434.78	0.00
34	301039	中集车辆	1,373.00	17,176.23	0.00
35	301096	百诚医药	204.00	16,020.12	0.00
36	301211	亨迪药业	459.00	15,445.35	0.00
37	301221	光庭信息	159.00	14,106.48	0.00
38	301189	奥尼电子	228.00	12,909.36	0.00
39	301166	优宁维	135.00	12,757.50	0.00
40	301069	凯盛新材	249.00	11,008.29	0.00
41	301093	华兰股份	220.00	10,967.00	0.00
42	603230	内蒙新华	388.00	10,037.56	0.00
43	300997	欢乐家	556.00	9,635.48	0.00
44	301179	泽宇智能	189.00	9,595.53	0.00
45	301100	风光股份	304.00	9,466.56	0.00
46	301190	善水科技	343.00	9,418.78	0.00
47	301168	通灵股份	180.00	9,383.40	0.00
48	301088	戎美股份	380.00	9,374.60	0.00
49	301091	深城交	294.00	9,205.14	0.00



50	301108	洁雅股份	163.00	8,754.73	0.00
51	301017	漱玉平民	366.00	8,710.80	0.00
52	300994	久祺股份	173.00	7,862.85	0.00
53	301082	久盛电气	348.00	7,492.44	0.00
54	301046	能辉科技	141.00	6,907.59	0.00
55	301101	明月镜片	154.00	6,677.44	0.00
56	301089	拓新药业	97.00	6,589.21	0.00
57	301149	隆华新材	381.00	6,385.56	0.00
58	301092	争光股份	178.00	6,322.56	0.00
59	301199	迈赫股份	195.00	6,240.00	0.00
60	301045	天禄科技	200.00	5,674.00	0.00
61	301138	华研精机	124.00	5,562.64	0.00
62	301026	浩通科技	87.00	5,457.51	0.00
63	301028	东亚机械	390.00	5,265.00	0.00
64	301021	英诺激光	126.00	5,220.18	0.00
65	301048	金鹰重工	391.00	5,067.36	0.00
66	001296	长江材料	83.00	4,920.24	0.00
67	301111	粤万年青	134.00	4,915.12	0.00
68	301188	力诺特玻	237.00	4,853.76	0.00
69	301060	兰卫医学	151.00	4,671.94	0.00
70	301020	密封科技	148.00	4,505.12	0.00
71	301193	家联科技	153.00	4,458.42	0.00
72	301098	金埔园林	193.00	4,278.81	0.00
73	301078	孩子王	344.00	4,176.16	0.00
74	301133	金钟股份	147.00	3,961.65	0.00
75	300814	中富电路	165.00	3,940.20	0.00
76	300774	倍杰特	185.00	3,899.80	0.00
77	301062	上海艾录	224.00	3,810.24	0.00
78	301030	仕净科技	116.00	3,656.32	0.00
79	301055	张小泉	156.00	3,397.68	0.00
80	301040	中环海陆	88.00	3,388.88	0.00
81	301033	迈普医学	55.00	3,298.35	0.00
82	301072	中捷精工	95.00	3,173.95	0.00
83	301049	超越科技	92.00	3,028.64	0.00
84	301182	凯旺科技	99.00	3,027.42	0.00
85	301198	喜悦智行	96.00	2,803.20	0.00
86	301036	双乐股份	92.00	2,753.56	0.00
87	301053	远信工业	95.00	2,734.10	0.00
88	301056	森赫股份	245.00	2,717.05	0.00
89	301063	海锅股份	75.00	2,708.25	0.00
90	301041	金百泽	95.00	2,679.95	0.00
91	301032	新柴股份	214.00	2,677.14	0.00
92	301025	读客文化	127.00	2,651.76	0.00
93	301038	深水规院	126.00	2,548.98	0.00

94	301073	君亭酒店	72.00	2,304.00	0.00
95	301059	金三江	118.00	2,277.40	0.00
96	300854	中兰环保	83.00	2,265.07	0.00
97	301027	华蓝集团	135.00	2,247.75	0.00
98	301068	大地海洋	63.00	1,787.94	0.00
99	301037	保立佳	73.00	1,770.98	0.00
100	301079	邵阳液压	63.00	1,563.66	0.00
101	001234	泰慕士	90.00	1,487.70	0.00
102	603176	汇通集团	440.00	1,078.00	0.00
103	300918	南山智尚	46.00	470.58	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603659	璞泰来	130,662,009.70	9.55
2	00168	青岛啤酒股份	65,692,154.51	4.80
2	600600	青岛啤酒	61,777,368.04	4.52
3	300750	宁德时代	115,265,449.00	8.42
4	300601	康泰生物	111,704,378.87	8.16
5	603259	药明康德	110,679,518.69	8.09
6	300363	博腾股份	98,641,239.90	7.21
7	000858	五粮液	89,994,536.00	6.58
8	601012	隆基股份	88,552,684.52	6.47
9	002511	中顺洁柔	85,704,294.43	6.26
10	300763	锦浪科技	82,127,807.90	6.00
11	002460	赣锋锂业	78,929,588.06	5.77
12	002709	天赐材料	76,294,474.46	5.58
13	601689	拓普集团	76,115,057.88	5.56
14	600760	中航沈飞	73,664,251.96	5.38
15	300122	智飞生物	67,102,059.40	4.90
16	01999	敏华控股	66,891,034.65	4.89
17	002049	紫光国微	64,529,907.00	4.72
18	600519	贵州茅台	61,389,695.24	4.49
19	002850	科达利	60,334,502.00	4.41
20	002078	太阳纸业	59,750,010.39	4.37
21	002027	分众传媒	58,613,958.08	4.28
22	002812	恩捷股份	58,345,385.76	4.26
23	605369	拱东医疗	57,056,927.80	4.17
24	002179	中航光电	55,496,197.37	4.06

25	300233	金城医药	55,304,624.00	4.04
26	600660	福耀玻璃	54,796,498.78	4.01
27	300274	阳光电源	53,999,178.36	3.95
28	300073	当升科技	53,013,965.98	3.87
29	02020	安踏体育	52,946,102.96	3.87
30	603806	福斯特	52,889,428.47	3.87
31	603456	九洲药业	52,720,810.94	3.85
32	603267	鸿远电子	52,549,606.00	3.84
33	000568	泸州老窖	52,466,709.95	3.83
34	002985	北摩高科	48,160,974.20	3.52
35	300919	中伟股份	47,890,987.19	3.50
36	02313	申洲国际	47,734,670.64	3.49
37	601799	星宇股份	45,982,056.42	3.36
38	300014	亿纬锂能	44,550,219.69	3.26
39	603799	华友钴业	43,281,365.00	3.16
40	600529	山东药玻	43,101,713.20	3.15
41	00175	吉利汽车	42,877,428.48	3.13
42	688002	睿创微纳	42,780,978.03	3.13
43	06049	保利物业	41,702,078.56	3.05
44	300630	普利制药	40,608,260.72	2.97
45	603290	斯达半导	37,078,786.00	2.71
46	688122	西部超导	36,592,409.09	2.67
47	688599	天合光能	35,854,140.58	2.62
48	300759	康龙化成	34,913,350.17	2.55
49	603712	七一二	34,628,541.40	2.53
50	002311	海大集团	34,596,874.64	2.53
51	600702	舍得酒业	34,576,654.20	2.53
52	603520	司太立	34,151,989.00	2.50
53	300482	万孚生物	33,438,717.88	2.44
54	00939	建设银行	32,850,011.56	2.40
55	603288	海天味业	32,769,752.00	2.40
56	00700	腾讯控股	32,438,011.02	2.37
57	002459	晶澳科技	31,655,996.00	2.31
58	600196	复星医药	31,501,483.60	2.30
59	02331	李宁	31,354,410.60	2.29
60	600585	海螺水泥	30,434,148.00	2.22
61	300357	我武生物	30,370,347.11	2.22
62	002597	金禾实业	30,254,872.52	2.21
63	688508	芯朋微	30,162,572.94	2.20
64	002607	中公教育	28,712,079.54	2.10
65	01995	永升生活服务	28,557,920.12	2.09
66	603233	大参林	28,019,409.01	2.05
67	601877	正泰电器	27,451,357.30	2.01
68	06862	海底捞	27,371,530.93	2.00

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603659	璞泰来	161,280,462.28	11.79
2	002511	中顺洁柔	146,961,291.99	10.74
3	02020	安踏体育	127,993,815.32	9.36
4	002027	分众传媒	119,177,247.15	8.71
5	300601	康泰生物	114,682,989.17	8.38
6	00168	青岛啤酒股份	59,614,431.64	4.36
6	600600	青岛啤酒	54,412,138.00	3.98
7	000333	美的集团	103,593,051.73	7.57
8	601012	隆基股份	102,701,020.43	7.51
9	00175	吉利汽车	93,620,972.48	6.84
10	000858	五粮液	93,600,301.20	6.84
11	300363	博腾股份	92,560,778.30	6.77
12	600690	海尔智家	87,425,986.79	6.39
13	002709	天赐材料	85,447,977.27	6.25
14	002850	科达利	81,284,596.00	5.94
15	300763	锦浪科技	79,523,270.49	5.81
16	601318	中国平安	79,084,301.62	5.78
17	600760	中航沈飞	79,007,064.14	5.77
18	600438	通威股份	77,811,312.78	5.69
19	601689	拓普集团	75,501,060.32	5.52
20	002460	赣锋锂业	72,919,503.00	5.33
21	605369	拱东医疗	71,937,104.40	5.26
22	600660	福耀玻璃	51,679,175.65	3.78
22	03606	福耀玻璃	15,944,415.73	1.17
23	300122	智飞生物	65,132,605.48	4.76
24	300750	宁德时代	63,166,605.00	4.62
25	300073	当升科技	61,416,745.86	4.49
26	600519	贵州茅台	60,020,604.00	4.39
27	09922	九毛九	58,533,474.35	4.28
28	603658	安图生物	56,995,754.63	4.17

29	01999	敏华控股	56,559,944.19	4.13
30	300630	普利制药	54,822,876.43	4.01
31	300274	阳光电源	53,571,872.08	3.92
32	603456	九洲药业	52,261,874.00	3.82
33	00700	腾讯控股	51,415,521.50	3.76
34	002078	太阳纸业	51,333,432.08	3.75
35	603712	七一二	49,752,161.57	3.64
36	600176	中国巨石	49,460,496.81	3.62
37	06862	海底捞	48,795,202.50	3.57
38	02313	申洲国际	47,806,165.71	3.49
39	300919	中伟股份	46,547,940.02	3.40
40	601799	星宇股份	46,533,725.80	3.40
41	002241	歌尔股份	46,091,138.00	3.37
42	000568	泸州老窖	45,316,428.18	3.31
43	603799	华友钴业	44,101,234.64	3.22
44	688063	派能科技	40,637,644.95	2.97
45	300715	凯伦股份	39,518,186.06	2.89
46	600036	招商银行	37,288,751.00	2.73
47	300450	先导智能	37,214,617.48	2.72
48	603288	海天味业	36,299,535.50	2.65
49	603290	斯达半导	36,261,660.34	2.65
50	603520	司太立	36,251,275.30	2.65
51	002142	宁波银行	36,160,095.90	2.64
52	000001	平安银行	36,119,997.00	2.64
53	603259	药明康德	35,195,820.48	2.57
54	688002	睿创微纳	35,100,364.86	2.57
55	002597	金禾实业	34,759,767.60	2.54
56	688122	西部超导	34,177,821.25	2.50
57	300233	金城医药	33,450,053.00	2.44
58	300357	我武生物	32,609,913.00	2.38
59	002311	海大集团	32,358,489.36	2.37
60	02331	李宁	32,219,206.51	2.35
61	300759	康龙化成	31,722,507.24	2.32
62	603816	顾家家居	31,702,442.00	2.32
63	00939	建设银行	30,897,478.41	2.26
64	002607	中公教育	30,410,949.13	2.22
65	600702	舍得酒业	29,516,583.57	2.16
66	600585	海螺水泥	29,133,294.00	2.13
67	300482	万孚生物	28,752,216.12	2.10
68	601877	正泰电器	27,850,529.80	2.04

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,158,493,405.66
卖出股票收入（成交）总额	4,633,746,840.64

#### 8.5 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。

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	644,682.70
2	应收证券清算款	10,737,477.89
3	应收股利	-
4	应收利息	17,016.24

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,399,176.83

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
9,178	64,321.57	49,127,265.07	8.32%	541,216,059.00	91.68%

#### 9.2 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	1,420,241.29	0.24%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产 品份额总量的数量区间（万 份）
--------	------	--------------------------------

刘宁	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	50~100
	合计	>100

注：直系亲属包括配偶、父母和子女。

## § 10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	142,296,212.34
减：本报告期基金总赎回份额	438,174,221.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	590,343,324.07

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划本报告期内未召开集合计划份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人于 2021 年 7 月 7 日发布公告,叶秋彬先生因内部退休，自 2021 年 7 月 6 日起离任公司副总经理、首席信息官职务，公司聘请柯学先生自 2021 年 7 月 6 日起担任公司首席信息官；于 2021 年 7 月 24 日发布公告，孔维成先生因工作安排自 2021 年 7 月 22 日离任公司总经理职务，由公司董事长杨龙先生代为履行总经理职务；于 2021 年 11 月 26 日发布公告，钟沁昇先生因个人原因自 2021 年 11 月 25 日离任公司副总经理职务；于 2021 年 12 月 31 日发布公告，杨龙先生因工作安排自 2021 年 12 月 30 日离任公司董事长、总经理职务，公司聘请秦力先生自 2021 年 12 月 30 日起担任公司董事长、总经理职务。除此之外，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本集合计划托管人的托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。除此之外，本集合计划托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。



#### 11.4 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。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划自合同变更生效以来聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为 74,000.00 元，已提供审计服务年限为 2 年。

#### 11.6 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、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
广发证券	2	8,795,933,588.12	100.00%	6,076,288.22	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。

##### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
广发证券	1,969,951.26	100.00%	-	-	-	-

#### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发证券资产管理（广东）有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-12-31
2	关于旗下部分集合资产管理计划 2022 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	2021-12-28

3	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-11-26
4	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 3 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-26
5	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年第三季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-10-26
6	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(年度更新)	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-15
7	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划更新(图数据更新)基金产品资料概要 2021-10-15	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-15
8	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年中期报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-08-27
9	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年中期报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-08-27
10	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-24
11	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 2 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-20
12	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年第二季度报告提示性公告	指定报刊及管理人网站	2021-07-20
13	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划关于增加陆金所为销售机构的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-10
14	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2021-07-07
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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

## § 12影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

### 12.2 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。

## § 13备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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](http://www.gfam.com.cn)。

广发证券资产管理（广东）有限公司

二〇二二年三月二十九日