

广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月二十六日

§ 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。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 月 23 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 11 月 30 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 17 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告 | 52 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 52 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 52 |
| 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..... | 54 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 56 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 58 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 59 |

| | |
|---|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注 | 59 |
| §8 基金份额持有人信息 | 59 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 59 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 60 |
| 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 | 60 |
| §9 开放式基金份额变动 | 61 |
| §10 重大事件揭示 | 61 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 61 |
| 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 | 61 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 61 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 62 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 62 |
| 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 | 62 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 62 |
| 10.8 其他重大事件 | 62 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| 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 | 63 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| §12 备查文件目录 | 63 |
| 12.1 备查文件目录 | 63 |
| 12.2 存放地点 | 64 |
| 12.3 查阅方式 | 64 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| 基金名称 | 广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 | |
| 基金简称 | 广发资管平衡精选一年持有混合 | |
| 基金主代码 | 872018 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 11 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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 950,808,981.69 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。3 年后，按照中国证监会有关规定执行。 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 广发资管平衡精选一年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 870009 | 872019 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 823,165,761.07 份 | 127,643,220.62 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，力争实现集合计划资产长期、持续、稳定的超额收益。 |
| 投资策略 | 本集合计划通过对宏观经济趋势、市场环境、财政政策、货币政策、行业周期阶段等的评估分析，研判国内经济发展形势，在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中各类资产的配置比例，从而实现本集合计划追求稳定收益与长期资本增值的目标。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×10%+恒生中国企业指数收益率×15%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本集合计划为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、债券型集合计划和货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合计划，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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 孔维成 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-66336029 | 010-66105799 |

| | | | |
|--------|------|---------------------------------|---------------------|
| 负责人 | 电子邮箱 | xuyz@gf.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95575 | 95588 |
| 传真 | | 020-87553363 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-285 | 北京市西城区复兴门内大街55 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 | 北京市西城区复兴门内大街55 号 |
| 邮政编码 | | 510075 | 100140 |
| 法定代表人 | | 秦力 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.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（2022年1月1日至2022年6月30日） | |
|---------------|---------------------------|------------------|
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 广发资管平衡精选一年持有混合 C |
| 本期已实现收益 | -69,143,732.37 | -11,425,217.63 |
| 本期利润 | -67,709,995.74 | -11,313,540.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0697 | -0.0736 |
| 本期加权平均净值利润率 | -6.23% | -6.63% |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.07% | -4.35% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| | 广发资管平衡精选一年持 | 广发资管平衡精选一年持有 |

| | 有混合 A | 混合 C |
|---------------------|------------------------------|------------------|
| 期末可供分配利润 | -59,690,543.75 | -10,631,842.94 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0725 | -0.0833 |
| 期末基金资产净值 | 972,995,756.82 | 149,504,060.85 |
| 期末基金份额净值 | 1.1820 | 1.1713 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | |
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 广发资管平衡精选一年持有混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 15.75% | 14.70% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润，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

广发资管平衡精选一年持有混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 6.26% | 0.95% | 7.21% | 1.01% | -0.95% | -0.06% |
| 过去三个月 | 12.75% | 1.55% | 4.87% | 1.26% | 7.88% | 0.29% |
| 过去六个月 | -4.07% | 1.73% | -7.02% | 1.33% | 2.95% | 0.40% |
| 过去一年 | -5.09% | 1.55% | -13.52% | 1.12% | 8.43% | 0.43% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.75% | 1.39% | -10.23% | 1.08% | 25.98% | 0.31% |

广发资管平衡精选一年持有混合 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 6.21% | 0.95% | 7.21% | 1.01% | -1.00% | -0.06% |
| 过去三个月 | 12.59% | 1.55% | 4.87% | 1.26% | 7.72% | 0.29% |
| 过去六个月 | -4.35% | 1.73% | -7.02% | 1.33% | 2.67% | 0.40% |
| 过去一年 | -5.65% | 1.55% | -13.52% | 1.12% | 7.87% | 0.43% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.70% | 1.39% | -10.23% | 1.08% | 24.93% | 0.31% |

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

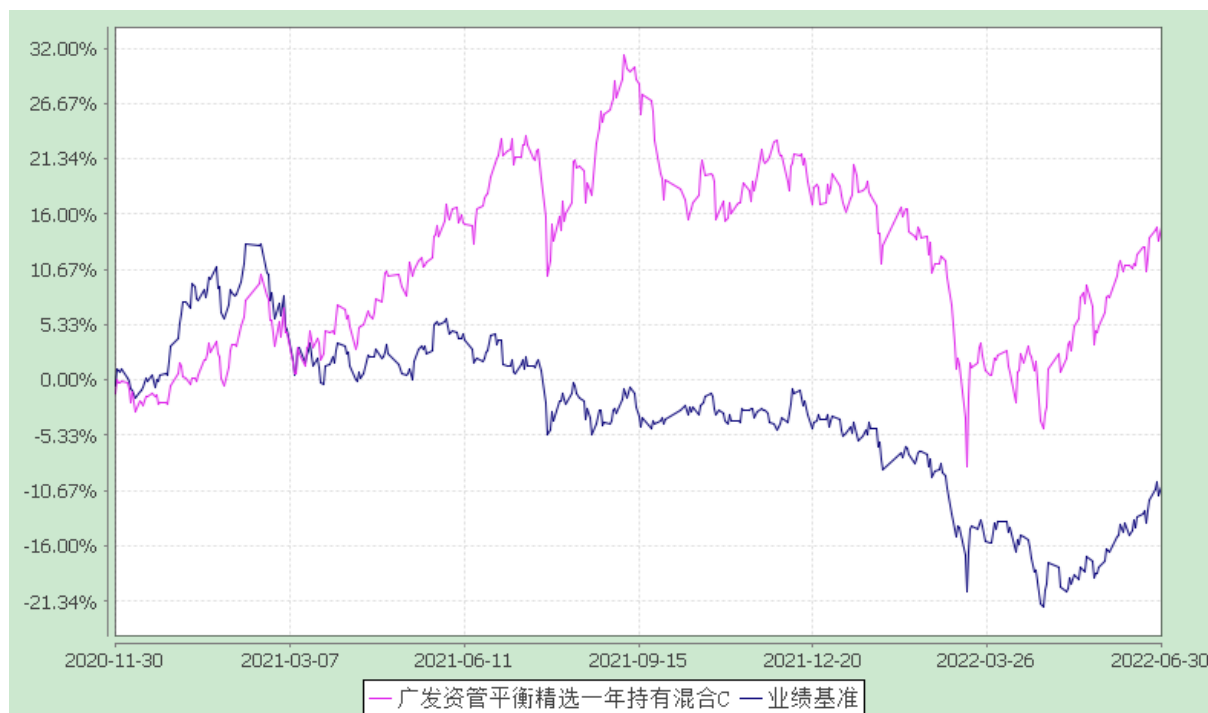
广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 11 月 30 日至 2022 年 6 月 30 日)

广发资管平衡精选一年持有混合 A



广发资管平衡精选一年持有混合 C



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会《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2022年6月30日,公司资产管理总规模为3,628.76亿元,其中主动管理资产规模为3,520.12

亿元。根据中国证券投资基金业协会的统计数据，2022 年第一季度，公司私募资产管理月均规模为 4,293.86 亿元，行业排名第四；2022 年第二季度，公司私募资产管理月均规模为 3,949.45 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 2022 年 6 月 30 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 | | |
| 刘淑生 | 投资经理 | 2020-11-30 | - | 8 年 | 硕士研究生，曾先后任职于元大宝来证券投资信托股份有限公司、国金证券股份有限公司等；2014 年加入兴业证券股份有限公司担任高级研究员；2015 年 8 月加入汇丰晋信基金管理有限公司，先后担任高级研究员、研究副总监、基金经理。2020 年 7 月加入广发证券资产管理（广东）有限公司权益产品部，现任广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划投资经理。 |

注：1、任职日期是指本集合计划合同变更生效的日期；

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

报告期末，本集合计划的投资经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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

本基金一直恪守——“聚焦泛消费，价值守正，变中出奇”的投资策略：具体而言，从行业分布上本基金以基金经理能力圈内的“泛消费”能力圈为主（投资经理从事“泛消费”领域研究投资十三年，经验覆盖买方、卖方，港股、A 股），通过深度研究、长期跟踪、独立研判，挖掘被市场低估的价值投资机会。我们试图运用我们长期研究积累的经验和资源，去提升我们对这些行业和公司出现“关键变化”的嗅觉，以及去定性、定量评估这种“变化”的能力，希望能够出奇制胜，持续为投资人创造超额回报。与此同时，我们将持续致力于提升我们的执行力。

整个上半年，A 股面临多重风险冲击（海外流动性收缩、俄乌战争、全球通胀、国内疫情复发），但总体而言，在国内流动性充裕的背景下，A 股仍然表现的相对独立、可圈可点。尤其是对于部分长期空间大、短期增速高（受疫情影响较小）、中国在全球有产业竞争优势的行业，虽然波动较大，但是优质公司股价展现强势。而另一端，传统行业，尤其是地产及相关产业，在国内地产去杠杆的大背景下（另一方面，中国地产行业发展黄金时期已过），部分民企陆续出现违约风险，股市表现

更是惨淡。而我们重仓的“泛消费”赛道，受制于疫情复发，股市表现较弱。

虽然整个上半年大部分时候消费都被疫情压制，但随着 6 月份市场开始交易“后疫情时代的报复性消费”，消费行业的反弹给予我们机会减少对于“疫情”敏感的消费行业，增加配置部分疫情免疫甚至刺激的“泛消费”行业（主要是户外消费相关公司）。同时，基于对海外流动性收紧的担心，我们也借机减少港股配置比例。另外，我们还增加了互联网行业配置比例，我们认为相关公司从长期而言，估值吸引力显著；短期而言，压制行业估值的政策管制也告一段落；同时，在整个经济大环境疲软的背景下，互联网公司的暂时的战线收缩将带来利润短期的释放。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，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

就宏观经济而言，我们认为：复苏之路不会平坦，三季度仍有压力。短期看，当前中国经济在疫情“砸坑”后迎来“反弹”修复，当前经济恢复仍有空间，“反弹”态势仍将延续；但是，私人部门的信心修复仍需要较长时间。我们认为，三季度国内“动态清零”的防疫政策仍不会有根本性变化，但是病毒的变化（尤其是 BA.5 分支的强传染性）将带来国内局部点状持续面临“封锁”风险，尤其是在人员流动活跃的经济大省。市场对疫情的交易态度可能随着疫情的动态变化来回摆动，但是疫情对服务乃至整个消费行业的影响三季度仍将客观存在。

政府主导的需求刺激在短期和长期都有看点。短期看，前期一揽子政策效果或将逐渐显现，下半年财政、货币政策仍有继续发力的空间；长期看，在动荡的全球格局中，中国经济进入高质量发展新“新常态”，未来几年“安全保障”、“内循环”、“东西并重”等关键字可能是新“新常态”下的宏观主线。

就三季度的证券市场而言，我们认为市场波动可能收窄，但是仍难言“趋势性”行情。波动收窄主要是由于海内外风险在一二季度都有充分释放，同时流动性仍将维持相对宽松；但受制于整个经济基本面，“趋势性行情”不具备条件。同时，需要关注，三季度开始国内的通胀压力，是否会对货币政策带来一定制约。

就消费行业而言，我们认为疫情的影响仍将持续，我们仍将聚焦于：长期而言仍有较大成长空间，同时，公司竞争力凸显，短期估值又有显著吸引力的公司。就细分行业而言，我们看好“国潮”相关公司的表现，尤其是在服装行业，经历了十余年的激烈竞争，叠加疫情的重磅冲击，部分细分

行业“供给侧改革”非常充分，一旦疫情解除，基本面有望强势反转，并且持续性较强。另外，我们看好“户外运动”这个细分赛道，这在中国仍是一个新兴的高成长赛道，长期而言渗透率提升空间巨大；短期而言，行业对疫情免疫，甚至受益于“长途旅游受限”带来的短途游刺激。

最后，我们相信疫情终将褪去，外围环境越复杂，中国经济越需依仗“内循环”。市场永远是风险与机会并存，高成长的时候担心高估值的风险，低估值的时候担心下滑的风险，做投资永远是在风险与机会中权衡，在潜在回报（目标价-市价）对风险有足够补偿的时候介入，随后，等待时间的玫瑰绽放。

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。

4.8 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，本集合计划托管人在对广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和集合计划合同的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划的管理人——广发证券资产管理（广东）有限公司在广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划份额申购赎回价格计算、集合计划费用开支等问题上，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发证券资产管理（广东）有限公司编制和披露的广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 54,443,702.54 | 125,192,853.04 |
| 结算备付金 | | 333,449.06 | 5,432,101.13 |
| 存出保证金 | | 385,594.61 | 666,604.16 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,060,854,645.96 | 1,838,970,190.72 |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其中：股票投资 | | 1,060,854,645.96 | 1,838,970,190.72 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | 19,387,741.17 | 1,565,466.94 |
| 应收股利 | | 592,463.29 | 78,535.54 |
| 应收申购款 | | 146,713.46 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 17,316.74 |
| 资产总计 | | 1,136,144,310.09 | 1,971,923,068.27 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 70.05 | 9,000,885.60 |
| 应付赎回款 | | 10,665,960.91 | - |
| 应付管理人报酬 | | 608,002.91 | 1,030,972.59 |
| 应付托管费 | | 170,135.20 | 309,291.79 |
| 应付销售服务费 | | 1,819,412.66 | 1,309,331.28 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 1,831,994.42 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 380,910.69 | 878,379.54 |
| 负债合计 | | 13,644,492.42 | 14,360,855.22 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,192,822,204.36 | 1,994,795,421.79 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -70,322,386.69 | -37,233,208.74 |
| 净资产合计 | | 1,122,499,817.67 | 1,957,562,213.05 |
| 负债和净资产总计 | | 1,136,144,310.09 | 1,971,923,068.27 |

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，本集合计划份额总额 950,808,981.69 份。其中 A 类份额净值（暂估业绩报酬前）人民币 1.1820 元，份额总额 823,165,761.07 份，资产净值（暂估业绩报酬前）人民币 972,995,756.82 元，相关暂估业绩报酬人民币 2,501,469.29 元，资产净值（暂估业绩报酬后）人民币 970,494,287.53 元；C 类份额净值（暂估业绩报酬前）人民币 1.1713 元，份额总额

127,643,220.62 份，资产净值（暂估业绩报酬前）人民币 149,504,060.85 元，相关暂估业绩报酬人民币 403,907.01 元，资产净值（暂估业绩报酬后）人民币 149,100,153.84 元。实际计提时的业绩报酬可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。

(2) 以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -73,504,129.38 | 270,010,061.26 |
| 1.利息收入 | | 175,890.42 | 323,858.99 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 175,890.42 | 259,919.60 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 63,939.39 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -75,225,433.47 | 123,392,515.66 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -97,269,364.49 | 111,391,625.47 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.13 | 22,043,931.02 | 12,000,890.19 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14 | 1,545,413.67 | 146,290,581.76 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | - | 3,104.85 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 减：二、营业总支出 | | 5,519,406.95 | 11,125,514.35 |
| 1. 管理人报酬 | | 3,767,870.19 | 3,531,177.77 |
| 2. 托管费 | | 1,130,361.13 | 1,059,353.29 |
| 3. 销售服务费 | | 511,043.32 | 502,078.03 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 401,240.02 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.16 | 110,132.31 | 5,631,665.24 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -79,023,536.33 | 258,884,546.91 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -79,023,536.33 | 258,884,546.91 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -79,023,536.33 | 258,884,546.91 |

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|-------------------------------------|---------------------------------|----------------|------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 1,994,795,421.79 | -37,233,208.74 | 1,957,562,213.05 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 1,994,795,421.79 | -37,233,208.74 | 1,957,562,213.05 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -801,973,217.43 | -33,089,177.95 | -835,062,395.38 |
| （一）、综合收益总额 | - | -79,023,536.33 | -79,023,536.33 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -801,973,217.43 | 45,934,358.38 | -756,038,859.05 |
| 其中：1.基金申购款 | 18,836,375.81 | -1,563,847.18 | 17,272,528.63 |
| 2.基金赎回款 | -820,809,593.24 | 47,498,205.56 | -773,311,387.68 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值 | - | - | - |

| | | | |
|--|---------------------------------|-----------------|------------------|
| 减少以“-”号填列) | | | |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 1,192,822,204.36 | -70,322,386.69 | 1,122,499,817.67 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 444,728,769.36 | -84,513,579.40 | 360,215,189.96 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 444,728,769.36 | -84,513,579.40 | 360,215,189.96 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,148,391,106.35 | 72,165,539.66 | 1,220,556,646.01 |
| （一）、综合收益总额 | - | 258,884,546.91 | 258,884,546.91 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 1,148,391,106.35 | -186,719,007.25 | 961,672,099.10 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,155,896,601.24 | -187,668,310.87 | 968,228,290.37 |
| 2.基金赎回款 | -7,505,494.89 | 949,303.62 | -6,556,191.27 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 1,593,119,875.71 | -12,348,039.74 | 1,580,771,835.97 |

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：秦力，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

广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为广发金管家法宝量化多策略集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于 2013 年 5 月 24 日成立，2013 年 6 月 5 日取得《关于广发证券股份有限公司发起设立广发金管家法宝量化多策略集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕584 号）。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币 107,491,035.40 元（含利息转份额），折合 107,491,035.40 份集合计划份额，上述资金经天健会计师事务所（特殊普通合伙）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，托管人为中国工商银行股份有限公司。

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，中国证监会于 2020 年 11 月 6 日签发《关于准予广发金管家法宝量化多策略集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2020〕2985 号），准予本集合计划进行合同变更。

自 2020 年 11 月 30 日起，《广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》

生效，原《广发金管家法宝量化多策略集合资产管理计划资产管理合同》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、公开发行的次级债）、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（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本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于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和集合计划净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本集合计划报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量

特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行计量，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。衍生工具公允价值变动产生的利得或损失直接计入当期损益。

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的

变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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并确认产生的资产和负债；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；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除

适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(7) 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。

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本集合计划自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本集合计划的影响不重大。

本集合计划将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本集合计划计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本集合计划将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 125,192,853.04 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 14,478.17 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 125,207,331.21 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,432,101.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,538.67 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,434,639.80 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 666,604.16 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 299.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 666,904.06 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 17,316.74 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 14,478.17 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,538.67 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 299.90 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本集合计划金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本集合计划本期期初未分配利润的变化。

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：

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本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。

(3) 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

本集合计划从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

本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。

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 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 54,443,702.54 |
| 等于：本金 | 54,437,758.72 |
| 加：应计利息 | 5,943.82 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |

| | |
|--------|---------------|
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 54,443,702.54 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|--------|------------------------|------|------------------|---------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,007,063,957.25 | - | 1,060,854,645.96 | 53,790,688.71 |
| 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 | | 1,007,063,957.25 | - | 1,060,854,645.96 | 53,790,688.71 |

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | |
|-------------|------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 280,207.38 |
| 其中：交易所市场 | 280,207.38 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 100,703.31 |
| 合计 | 380,910.69 |

6.4.7.7 实收基金

广发资管平衡精选一年持有混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,372,023,235.27 | 1,721,245,481.44 |
| 本期申购 | 12,416,253.03 | 15,576,457.71 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -561,273,727.23 | -704,135,638.58 |
| 本期末 | 823,165,761.07 | 1,032,686,300.57 |

广发资管平衡精选一年持有混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 218,044,446.46 | 273,549,940.35 |
| 本期申购 | 2,598,444.98 | 3,259,918.10 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -92,999,670.82 | -116,673,954.66 |
| 本期末 | 127,643,220.62 | 160,135,903.79 |

6.4.7.8 未分配利润

广发资管平衡精选一年持有混合 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末 | 141,703,250.92 | -172,404,153.85 | -30,700,902.93 |
| 本期利润 | -69,143,732.37 | 1,433,736.63 | -67,709,995.74 |

| | | | |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -43,247,491.29 | 81,967,846.21 | 38,720,354.92 |
| 其中：基金申购款 | 906,785.28 | -2,159,234.32 | -1,252,449.04 |
| 基金赎回款 | -44,154,276.57 | 84,127,080.53 | 39,972,803.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 29,312,027.26 | -89,002,571.01 | -59,690,543.75 |

广发资管平衡精选一年持有混合 C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 20,867,731.59 | -27,400,037.40 | -6,532,305.81 |
| 本期利润 | -11,425,217.63 | 111,677.04 | -11,313,540.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,226,269.02 | 13,440,272.48 | 7,214,003.46 |
| 其中：基金申购款 | 137,029.82 | -448,427.96 | -311,398.14 |
| 基金赎回款 | -6,363,298.84 | 13,888,700.44 | 7,525,401.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,216,244.94 | -13,848,087.88 | -10,631,842.94 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 147,594.50 |
| 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 | 22,906.28 |
| 其他 | 5,389.64 |
| 合计 | 175,890.42 |

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 1,659,410,253.14 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,752,682,002.62 |
| 减：交易费用 | 3,997,615.01 |
| 买卖股票差价收入 | -97,269,364.49 |

6.4.7.11 债券投资收益

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 22,043,931.02 |
| 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 | 22,043,931.02 |

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -21,944.52 |
| ——股票投资 | -21,944.52 |
| ——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 | -1,567,358.19 |
| 合计 | 1,545,413.67 |

6.4.7.15 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022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 | 429.00 |
| 账户管理费 | 13,500.00 |
| 合计 | 110,132.31 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本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 |
| 中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”） | 本集合计划托管人 |
| 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 |

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 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 | 2,653,202,162.39 | 100.00% | 4,179,861,360.85 | 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无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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 | - | - | 597,700,000.00 | 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 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|------------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 广发证券 | 1,819,301.77 | 100.00% | 280,207.38 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 2,848,538.42 | 100.00% | 535,801.20 | 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 2022年1月1日至2022年6月 30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,767,870.19 | 3,531,177.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,992,246.99 | 1,767,919.74 |

注：（1）本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div 365$$

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，托管人按照与管理人协商一致的方式，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。

（2）业绩报酬计提基准日为本集合计划的份额持有人赎回申请日和计划终止退出日。计划终止退出日即集合合同规定的集合合同终止事由出现后，集合计划财产清算完毕，管理人为投资者办理退出的日期。业绩报酬计提日为本集合计划份额持有人赎回确认日或计划终止退出确认日。在本集合计划份额业绩报酬计提日，管理人将根据投资者的期间年化收益率（R），对份额期间年化收益率超过 6% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。

本集合计划的业绩报酬计提原则：

A. 同一投资者不同时间多次申购产品份额的，对投资者每笔份额（或红利再投份额）分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

B. 在投资者赎回确认日和集合计划终止退出确认日对符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬；

C. 在投资者赎回或集合计划终止退出时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算款中扣除；

D. 投资者申请赎回时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序赎回的方式确定赎回份额，计算、提取赎回份额对应的业绩报酬。

业绩报酬计提方法：

本集合计划在 TA 端计提业绩报酬。业绩报酬计提基准日为本集合计划赎回申请日和集合计划终止退出日。业绩报酬计提日为本集合计划份额持有人赎回确认日或计划终止退出确认日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬基准日”，下同）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。份额持有人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔份额应收的管理人业绩报酬。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = [(A - B) \div C] \times 365 \div D \times 100\%$$

A 为投资者本次业绩报酬计提基准日的该类份额的份额累计净值；

B 为投资者上一个业绩报酬计提基准日（若无，则取申购申请日）的该类份额的份额累计净值；

C 为投资者上一个业绩报酬计提基准日（若无，则取申购申请日）的该类份额的份额净值；

D 为投资者上一个业绩报酬计提日（含）（若无，则取申购确认日）到本次业绩报酬计提日（不含）的间隔天数；

R 为期间年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

期间年化收益率 $R < 6\%$ ，计提比例 0%，业绩报酬 $Y = 0$

期间年化收益率 $R \geq 6\%$ ，计提比例 20%，业绩报酬 $Y = F \times (R - 6\%) \times 20\% \times D / 365$

Y 为业绩报酬；

F 为每笔份额在上一个业绩报酬计提基准日的资产市值。

业绩报酬支付：

投资者赎回或者本集合计划终止清算时，托管人根据管理人的指令将赎回资金或清算款（含业绩报酬）划拨给集合计划备付金账户，在中登资金交收系统中将业绩报酬支付给管理人，并将扣除

业绩报酬的赎回资金或清算款转入投资者的交易账户。因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划管理人收取的以上业绩报酬为人民币 8,580,964.97 元；于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日，本集合计划管理人收取的以上业绩报酬为人民币 0.00 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,130,361.13 | 1,059,353.29 |

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，托管人按照与管理人协商一致的方式，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------|------------------|------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 广发资管平衡精选一年持有混合 C | 合计 |
| 广发证券 | - | 392,026.12 | 392,026.12 |
| 广发资管 | - | 5,302.36 | 5,302.36 |
| 合计 | - | 397,328.48 | 397,328.48 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 广发资管平衡精选一年持有混合 C | 合计 |
| 广发证券 | - | 501,684.87 | 501,684.87 |
| 合计 | - | 501,684.87 | 501,684.87 |

注：（1）本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.6%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.6% 的年费率计提，销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div 365$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，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，托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内从集合计划财产一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 本表所列销售服务费中，本报告期及上年度可比期间数据以实际销售服务机构列示；2021 年中期报告的数据以管理人归口数据列示。

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。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间集合计划管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发资管平衡精选一年持有混合 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|--------------------------------|-------------------|--------------------------|---------------------|----------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额占 基金总份额的比例 |
| 广发资管领钧 2 号 FOF 集合资产管理 计划 | 4,414,231.48 | 0.46% | 4,414,231.48 | 0.28% |

| | | | | |
|-------------------------|--------------|-------|--------------|-------|
| 广发资管领钧 1 号 FOF 集合资产管理计划 | 4,617,231.51 | 0.49% | 4,617,231.51 | 0.29% |
|-------------------------|--------------|-------|--------------|-------|

注：1、本集合计划除管理人之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。

2、本表中占基金总份额比例的计算中，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

广发资管平衡精选一年持有混合 C

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|-------------------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 广发资管领钧 3 号 FOF 集合资产管理计划 | 1,609,398.89 | 0.17% | 1,609,398.89 | 0.10% |

注：1、本集合计划除管理人之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。

2、本表中占基金总份额比例的计算中，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

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 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 |
| 工商银行 | 54,443,702.54 | 147,594.50 | 95,510,834.10 | 218,228.54 |

注：本集合计划的上述银行存款由托管人工商银行保管，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内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| |
|----------------------|
| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |
|----------------------|

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|---|
| 300834 | 星辉环材 | 2022-01-06 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.57 | 30.03 | 527.00 | 29,285.39 | 15,825.81 | 2022-04-08 除权除息, 派息比例 2.2000 (含税) |
| 301097 | 天益医疗 | 2022-03-25 | 6个月 | 新股流通受限 | 52.37 | 47.83 | 115.00 | 6,022.55 | 5,500.45 | 2022-06-07 除权除息, 派息比例 0.2500 (含税) |
| 301102 | 兆讯传媒 | 2022-03-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.88 | 31.09 | 362.00 | 14,436.56 | 11,254.58 | - |
| 301103 | 何氏眼科 | 2022-03-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.75 | 32.02 | 183.00 | 5,992.50 | 5,859.66 | 2022-06-01 除权除息, 派息比例 0.6000 (含税), 送转比例 0.3000 |
| 301109 | 军信股份 | 2022-04-06 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.20 | 16.14 | 1,082.00 | 25,098.01 | 17,463.48 | 2022-06-17 除权除息, 派息比例 0.3800 (含 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|------|----------------|-------|-------|--------|--------------|--------------|---|
| | | | | | | | | | | 税), 送转 比例 0.5000 |
| 301110 | 青木 股份 | 2022-0 3-04 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 63.10 | 39.85 | 91.00 | 5,742. 10 | 3,626. 35 | 2022-0 5-31 除权 除息, 派息 比例 0.6000 (含 税) |
| 301112 | 信邦 智能 | 2022-0 6-20 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 27.53 | 45.04 | 182.00 | 5,010. 46 | 8,197. 28 | - |
| 301116 | 益客 食品 | 2022-0 1-10 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 11.40 | 20.46 | 286.00 | 3,260. 40 | 5,851. 56 | 2022-0 6-02 除权 除息, 派息 比例 0.0522 (含 税) |
| 30112 0 | 新特 电气 | 2022-0 4-11 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 13.73 | 15.49 | 261.00 | 3,583. 53 | 4,042. 89 | 2022-0 5-31 除权 除息, 派息 比例 0.2000 (含 税) |
| 30112 5 | 腾亚 精工 | 2022-0 5-27 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 22.49 | 27.42 | 101.00 | 2,271. 49 | 2,769. 42 | - |
| 30113 0 | 西点 药业 | 2022-0 2-16 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 22.55 | 37.70 | 87.00 | 1,961. 85 | 3,279. 90 | 2022-0 6-30 除权 除息, 派息 比例 0.1300 (含 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|-----------|----------------|--------|-------|--------------|---------------|---------------|--|
| | | | | | | | | | | 税) |
| 30113 5 | 瑞德 智能 | 2022-0 4-01 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 31.98 | 26.26 | 119.00 | 3,805. 62 | 3,124. 94 | 2022-0 6-15 除权 除息, 派息 比例 0.3000 (含 税) |
| 30113 7 | 哈焊 华通 | 2022-0 3-14 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 15.37 | 15.99 | 210.00 | 3,227. 70 | 3,357. 90 | 2022-0 6-23 除权 除息, 派息 比例 0.0850 (含 税) |
| 30113 9 | 元道 通信 | 2022-0 6-30 | 1 个月 内 | 新股 流通 受限 | 38.46 | 38.46 | 2,088. 00 | 80,304 .48 | 80,304 .48 | - |
| 30114 8 | 嘉戎 技术 | 2022-0 4-14 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 38.39 | 23.90 | 171.00 | 6,564. 69 | 4,086. 90 | 2022-0 6-21 除权 除息, 派息 比例 0.5200 (含 税) |
| 30115 0 | 中一 科技 | 2022-0 4-14 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 108.84 | 82.76 | 278.00 | 30,258 .60 | 23,007 .28 | 2022-0 6-10 除权 除息, 派息 比例 2.0000 (含 税), 送转 比例 0.5000 |
| 30115 1 | 冠龙 节能 | 2022-0 3-30 | 6 个月 | 新股 流通 | 30.82 | 21.46 | 330.00 | 10,170 .60 | 7,081. 80 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------|--------|-------|-------|-----------|------------|------------|-----------------------------------|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 301153 | 中科江南 | 2022-05-10 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.68 | 43.98 | 161.00 | 5,422.48 | 7,080.78 | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022-01-07 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.64 | 20.38 | 166.00 | 2,596.24 | 3,383.08 | 2022-05-27 除权除息, 派息比例 0.1200 (含税) |
| 301162 | 国能日新 | 2022-04-19 | 6 个月 | 新股流通受限 | 45.13 | 54.11 | 185.00 | 8,349.05 | 10,010.35 | 2022-06-14 除权除息, 派息比例 0.4500 (含税) |
| 301163 | 宏德股份 | 2022-04-11 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.27 | 32.33 | 99.00 | 2,600.73 | 3,200.67 | - |
| 301175 | 中科环保 | 2022-06-30 | 1 个月内 | 新股流通受限 | 3.82 | 3.82 | 42,838.00 | 163,641.16 | 163,641.16 | - |
| 301187 | 欧圣电气 | 2022-04-13 | 6 个月 | 新股流通受限 | 21.33 | 22.54 | 289.00 | 6,164.37 | 6,514.06 | 2022-06-07 除权除息, 派息比例 0.5000 (含税) |
| 301196 | 唯科科技 | 2022-01-04 | 6 个月 | 新股流通受限 | 64.08 | 37.52 | 231.00 | 14,802.48 | 8,667.12 | 2022-06-15 除权除息, 派息比例 0.6000 (含 |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|--------|-------|-------|--------|-----------|-----------|---|
| | | | | | | | | | | 税) |
| 301200 | 大族数控 | 2022-02-18 | 6 个月 | 新股流通受限 | 76.56 | 51.92 | 835.00 | 63,927.60 | 43,353.20 | 2022-04-29 除权除息, 派息比例 0.4000 (含税) |
| 301201 | 诚达药业 | 2022-01-12 | 6 个月 | 新股流通受限 | 72.69 | 71.54 | 228.00 | 16,573.32 | 16,311.12 | 2022-05-27 除权除息, 派息比例 0.4500 (含税) |
| 301206 | 三元生物 | 2022-01-26 | 6 个月 | 新股流通受限 | 72.83 | 45.69 | 875.00 | 63,721.90 | 39,978.75 | 2022-06-17 除权除息, 派息比例 1.0000 (含税), 送转比例 0.5000 |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022-02-10 | 6 个月 | 新股流通受限 | 56.88 | 56.42 | 476.00 | 27,074.88 | 26,855.92 | 2022-06-16 除权除息, 派息比例 0.2000 (含税) |
| 301212 | 联盛化学 | 2022-04-07 | 6 个月 | 新股流通受限 | 29.67 | 33.28 | 180.00 | 5,340.60 | 5,990.40 | 2022-06-29 除权除息, 派息 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|------|----------------|-------|-------|--------------|---------------|---------------|--|
| | | | | | | | | | | 比例 0.2050 (含 税) |
| 30121 5 | 中汽 股份 | 2022-0 2-28 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 3.80 | 6.39 | 2,188. 00 | 8,314. 40 | 13,981 .32 | 2022-0 5-26 除权 除息, 派息 比例 0.0230 (含 税) |
| 30121 6 | 万凯 新材 | 2022-0 3-21 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 35.68 | 29.84 | 838.00 | 29,899 .84 | 25,005 .92 | 2022-0 6-23 除权 除息, 派息 比例 0.2000 (含 税) |
| 30121 7 | 铜冠 铜箔 | 2022-0 1-20 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 17.27 | 14.83 | 4,275. 00 | 73,829 .25 | 63,398 .25 | 2022-0 6-10 除权 除息, 派息 比例 0.1500 (含 税) |
| 30121 9 | 腾远 钴业 | 2022-0 3-10 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 96.60 | 87.82 | 344.00 | 33,230 .18 | 30,210 .08 | 2022-0 5-24 除权 除息, 派息 比例 3.9900 (含 税), 送转 比例 0.8000 |
| 30122 2 | 浙江 恒威 | 2022-0 3-02 | 6 个月 | 新股 流通 | 33.98 | 28.96 | 128.00 | 4,349. 44 | 3,706. 88 | 2022-0 6-10 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|-----------|----------------|-------|-------|--------------|---------------|---------------|--|
| | | | | 受限 | | | | | | 除权 除息, 派息 比例 0.6000 (含 税) |
| 30122 8 | 实朴 检测 | 2022-0 1-21 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 20.08 | 20.34 | 210.00 | 4,216. 80 | 4,271. 40 | 2022-0 6-16 除权 除息, 派息 比例 0.2000 (含 税) |
| 30123 3 | 盛帮 股份 | 2022-0 6-24 | 1 个月 内 | 新股 流通 受限 | 41.52 | 41.52 | 572.00 | 23,749 .44 | 23,749 .44 | - |
| 30123 3 | 盛帮 股份 | 2022-0 6-24 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 41.52 | 41.52 | 64.00 | 2,657. 28 | 2,657. 28 | - |
| 30123 5 | 华康 医疗 | 2022-0 1-21 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 39.30 | 37.93 | 185.00 | 7,270. 50 | 7,017. 05 | 2022-0 5-18 除权 除息, 派息 比例 0.1000 (含 税) |
| 30123 6 | 软通 动力 | 2022-0 3-08 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 48.57 | 31.38 | 1,463. 00 | 71,058 .00 | 45,908 .94 | 2022-0 6-09 除权 除息, 派息 比例 0.0000 (含 税), 送转 比例 0.5000 |
| 30123 7 | 和顺 科技 | 2022-0 3-16 | 6 个月 | 新股 流通 | 56.69 | 41.86 | 110.00 | 6,235. 90 | 4,604. 60 | 2022-0 5-24 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|-----------|----------------|-------|-------|--------------|---------------|----------------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | 除权 除息, 派息 比例 0.7000 (含 税) |
| 30123 8 | 瑞泰 新材 | 2022-0 6-10 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 19.18 | 32.07 | 3,496. 00 | 67,053 .28 | 112,11 6.72 | - |
| 30123 9 | 普瑞 眼科 | 2022-0 6-22 | 1 个月 内 | 新股 流通 受限 | 33.65 | 33.65 | 2,629. 00 | 88,465 .85 | 88,465 .85 | - |
| 30123 9 | 普瑞 眼科 | 2022-0 6-22 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 33.65 | 33.65 | 293.00 | 9,859. 45 | 9,859. 45 | - |
| 30124 8 | 杰创 智能 | 2022-0 4-13 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 39.07 | 29.87 | 163.00 | 6,368. 41 | 4,868. 81 | 2022-0 6-17 除权 除息, 派息 比例 0.2000 (含 税) |
| 30125 6 | 华融 化学 | 2022-0 3-14 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 8.05 | 10.08 | 867.00 | 6,979. 35 | 8,739. 36 | - |
| 30125 8 | 富士 莱 | 2022-0 3-21 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 48.30 | 41.68 | 126.00 | 6,085. 80 | 5,251. 68 | 2022-0 6-08 除权 除息, 派息 比例 0.4000 (含 税) |
| 30125 9 | 艾布 鲁 | 2022-0 4-18 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 18.39 | 24.94 | 150.00 | 2,758. 50 | 3,741. 00 | - |
| 30126 6 | 宇邦 新材 | 2022-0 5-30 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 26.86 | 47.07 | 204.00 | 5,479. 44 | 9,602. 28 | - |
| 30126 8 | 铭利 达 | 2022-0 3-29 | 6 个月 | 新股 流通 | 28.50 | 34.87 | 295.00 | 8,407. 50 | 10,286 .65 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|---------|------------|-------|--------|-------|-------|----------|------------|------------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 301279 | 金道科技 | 2022-04-06 | 6 个月 | 新股流通受限 | 31.20 | 22.81 | 144.00 | 4,492.80 | 3,284.64 | - |
| 301286 | 侨源股份 | 2022-06-06 | 6 个月 | 新股流通受限 | 16.91 | 19.79 | 288.00 | 4,870.08 | 5,699.52 | - |
| 301288 | 清研环境 | 2022-04-14 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.09 | 19.98 | 135.00 | 2,577.15 | 2,697.30 | - |
| 301298 | 东利机械 | 2022-05-27 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.68 | 20.83 | 206.00 | 2,612.08 | 4,290.98 | - |
| 301302 | 华如科技 | 2022-06-16 | 6 个月 | 新股流通受限 | 52.03 | 56.42 | 285.00 | 14,828.55 | 16,079.70 | - |
| 688237 | 超卓航科 | 2022-06-24 | 1 个月内 | 新股流通受限 | 41.27 | 41.27 | 1,248.00 | 51,504.96 | 51,504.96 | - |
| 688322 | 奥比中光-UW | 2022-06-30 | 1 个月内 | 新股流通受限 | 30.99 | 30.99 | 5,165.00 | 160,063.35 | 160,063.35 | - |
| 688400 | 凌云光 | 2022-06-27 | 1 个月内 | 新股流通受限 | 21.93 | 21.93 | 7,358.00 | 161,360.94 | 161,360.94 | - |

注：截至本报告期末 2022 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 2022 年 06 月 30 日止，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 2022 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 2022 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 2022 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。本集合计划在严格控制风险的前提下，力争实现集合计划资产长期、持续、稳定的超额收益。

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工商银行，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022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 | 54,443,702.54 | - | - | - | 54,443,702.54 |
| 结算备付金 | 333,449.06 | - | - | - | 333,449.06 |
| 存出保证金 | 385,594.61 | - | - | - | 385,594.61 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,060,854,645.96 | 1,060,854,645.96 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 19,387,741.17 | 19,387,741.17 |
| 应收股利 | - | - | - | 592,463.29 | 592,463.29 |
| 应收申购款 | - | - | - | 146,713.46 | 146,713.46 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 55,162,746.21 | - | - | 1,080,981,563.88 | 1,136,144,310.09 |
| 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 | - | - | - | 70.05 | 70.05 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 10,665,960.91 | 10,665,960.91 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 608,002.91 | 608,002.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | 170,135.20 | 170,135.20 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,819,412.66 | 1,819,412.66 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 380,910.69 | 380,910.69 |
| 负债总计 | - | - | - | 13,644,492.42 | 13,644,492.42 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|----------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 利率敏感度缺口 | 55,162,746.21 | - | - | 1,067,337,071.46 | 1,122,499,817.67 |
| 上年度末 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 | 125,192,853.04 | - | - | - | 125,192,853.04 |
| 结算备付金 | 5,432,101.13 | - | - | - | 5,432,101.13 |
| 存出保证金 | 666,604.16 | - | - | - | 666,604.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,838,970,190.72 | 1,838,970,190.72 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,565,466.94 | 1,565,466.94 |
| 应收股利 | - | - | - | 78,535.54 | 78,535.54 |
| 其他资产 | - | - | - | 17,316.74 | 17,316.74 |
| 资产总计 | 131,291,558.33 | - | - | 1,840,631,509.94 | 1,971,923,068.27 |
| 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 | - | - | - | 9,000,885.60 | 9,000,885.60 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,030,972.59 | 1,030,972.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | 309,291.79 | 309,291.79 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,309,331.28 | 1,309,331.28 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,831,994.42 | 1,831,994.42 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 878,379.54 | 878,379.54 |
| 负债总计 | - | - | - | 14,360,855.22 | 14,360,855.22 |
| 利率敏感度缺口 | 131,291,558.33 | - | - | 1,826,270,654.72 | 1,957,562,213.05 |

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 2022 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30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 | - | 316,082,779.00 | 316,082,779.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - |
| 资产合计 | - | 316,082,779.00 | 316,082,779.00 |
| 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 | - | 316,082,779.00 | 316,082,779.00 |
| 项目 | 上年度末 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 | - | 409,440,438.00 | 409,440,438.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - |

| | | | |
|----------------------|---|-----------------------|-----------------------|
| 应收利息 | - | - | - |
| 资产合计 | - | 409,440,438.00 | 409,440,438.00 |
| 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 | - | 409,440,438.00 | 409,440,438.00 |

6.4.13.4.2.2 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 |
| | | 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
| | 所有外币相对人民币升值 5% | 15,804,138.95 | 20,472,021.90 |
| | 所有外币相对人民币贬值 5% | -15,804,138.95 | -20,472,021.90 |

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 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2021 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 | 1,060,854,645.96 | 94.51 | 1,838,970,190.72 | 93.94 |

| | | | | |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 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 | 1,060,854,645.96 | 94.51 | 1,838,970,190.72 | 93.94 |

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 |
| | | 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
| | 各板块市场指数上涨 5% | 59,936,536.70 | 98,954,568.76 |
| | 各板块市场指数下跌 5% | -59,936,536.70 | -98,954,568.76 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次 | 1,059,432,600.32 |
| 第二层次 | 741,606.91 |
| 第三层次 | 680,438.73 |
| 合计 | 1,060,854,645.96 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | 1,060,854,645.96 | 93.37 |
| | 其中：股票 | 1,060,854,645.96 | 93.37 |
| 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 | 54,777,151.60 | 4.82 |
| 8 | 其他各项资产 | 20,512,512.53 | 1.81 |
| 9 | 合计 | 1,136,144,310.09 | 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 316,082,779.00 元，占集合计划资产净值比例 28.16%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 |
|----|------|----------|-----------|
|----|------|----------|-----------|

| | | | (%) |
|---|------------------|----------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 12,210,913.98 | 1.09 |
| C | 制造业 | 625,983,915.36 | 55.77 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 14,287,924.00 | 1.27 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 167,879.41 | 0.01 |
| J | 金融业 | 33,937,240.00 | 3.02 |
| K | 房地产业 | 50,639,767.50 | 4.51 |
| L | 租赁和商务服务业 | 11,254.58 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 49,393.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 198,404.17 | 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 | 7,285,174.96 | 0.65 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 744,771,866.96 | 66.35 |

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 | 31,119,736.00 | 2.77 |
| 非日常生活消费品 | 107,174,399.00 | 9.55 |
| 日常消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 72,284,040.00 | 6.44 |
| 医疗保健 | 8,920,000.00 | 0.79 |
| 工业 | 9,942,900.00 | 0.89 |
| 通信服务 | 76,921,704.00 | 6.85 |
| 信息技术 | 9,720,000.00 | 0.87 |
| 合计 | 316,082,779.00 | 28.16 |

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 | 603908 | 牧高笛 | 1,164,800.00 | 110,830,720.00 | 9.87 |
| 2 | 603339 | 四方科技 | 9,435,829.00 | 107,945,883.76 | 9.62 |
| 3 | 002154 | 报喜鸟 | 23,481,863.00 | 101,441,648.16 | 9.04 |
| 4 | 03690 | 美团-W | 506,900.00 | 84,185,952.00 | 7.50 |
| 5 | 605080 | 浙江自然 | 1,227,774.00 | 78,442,480.86 | 6.99 |
| 6 | 00700 | 腾讯控股 | 253,800.00 | 76,921,704.00 | 6.85 |
| 7 | 601882 | 海天精工 | 3,317,694.00 | 68,377,673.34 | 6.09 |
| 8 | 01658 | 邮储银行 | 10,428,000.00 | 55,581,240.00 | 4.95 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 804,200.00 | 33,937,240.00 | 3.02 |
| 9 | 03968 | 招商银行 | 372,000.00 | 16,702,800.00 | 1.49 |
| 10 | 601339 | 百隆东方 | 9,503,013.00 | 48,275,306.04 | 4.30 |
| 11 | 000002 | 万科A | 1,794,999.00 | 36,797,479.50 | 3.28 |
| 12 | 06049 | 保利物业 | 720,400.00 | 30,804,304.00 | 2.74 |
| 13 | 600557 | 康缘药业 | 1,844,000.00 | 27,088,360.00 | 2.41 |
| 14 | 601668 | 中国建筑 | 2,685,700.00 | 14,287,924.00 | 1.27 |
| 15 | 600048 | 保利发展 | 792,800.00 | 13,842,288.00 | 1.23 |
| 16 | 01999 | 敏华控股 | 1,806,000.00 | 13,093,500.00 | 1.17 |
| 17 | 601666 | 平煤股份 | 898,522.00 | 12,210,913.98 | 1.09 |
| 18 | 002415 | 海康威视 | 315,100.00 | 11,406,620.00 | 1.02 |
| 19 | 688596 | 正帆科技 | 573,962.00 | 11,375,926.84 | 1.01 |
| 20 | 600195 | 中牧股份 | 906,900.00 | 11,118,594.00 | 0.99 |
| 21 | 300866 | 安克创新 | 166,300.00 | 11,029,016.00 | 0.98 |
| 22 | 01800 | 中国交通建设 | 2,882,000.00 | 9,942,900.00 | 0.89 |

| | | | | | |
|----|--------|----------|--------------|--------------|------|
| 23 | 03800 | 协鑫科技 | 3,000,000.00 | 9,720,000.00 | 0.87 |
| 24 | 06078 | 海吉亚医疗 | 200,000.00 | 8,920,000.00 | 0.79 |
| 25 | 06690 | 海尔智家 | 300,000.00 | 7,452,000.00 | 0.66 |
| 26 | 300244 | 迪安诊断 | 230,900.00 | 7,180,990.00 | 0.64 |
| 27 | 688599 | 天合光能 | 101,032.00 | 6,592,338.00 | 0.59 |
| 28 | 002831 | 裕同科技 | 220,000.00 | 6,501,000.00 | 0.58 |
| 29 | 601126 | 四方股份 | 396,600.00 | 6,428,886.00 | 0.57 |
| 30 | 000830 | 鲁西化工 | 333,700.00 | 5,769,673.00 | 0.51 |
| 31 | 002937 | 兴瑞科技 | 299,100.00 | 5,530,359.00 | 0.49 |
| 32 | 688696 | 极米科技 | 15,614.00 | 4,807,082.18 | 0.43 |
| 33 | 09618 | 京东集团-S W | 11,300.00 | 2,442,947.00 | 0.22 |
| 34 | 688297 | 中无人机 | 24,681.00 | 1,312,535.58 | 0.12 |
| 35 | 002567 | 唐人神 | 80,000.00 | 680,800.00 | 0.06 |
| 36 | 00884 | 旭辉控股集团 | 93,600.00 | 315,432.00 | 0.03 |
| 37 | 301175 | 中科环保 | 42,838.00 | 163,641.16 | 0.01 |
| 38 | 688400 | 凌云光 | 7,358.00 | 161,360.94 | 0.01 |
| 39 | 688322 | 奥比中光-UW | 5,165.00 | 160,063.35 | 0.01 |
| 40 | 301238 | 瑞泰新材 | 3,496.00 | 112,116.72 | 0.01 |
| 41 | 301239 | 普瑞眼科 | 2,922.00 | 98,325.30 | 0.01 |
| 42 | 301112 | 信邦智能 | 1,820.00 | 97,435.52 | 0.01 |
| 43 | 301139 | 元道通信 | 2,088.00 | 80,304.48 | 0.01 |
| 44 | 301217 | 铜冠铜箔 | 4,275.00 | 63,398.25 | 0.01 |
| 45 | 688237 | 超卓航科 | 1,248.00 | 51,504.96 | 0.00 |
| 46 | 301236 | 软通动力 | 1,463.00 | 45,908.94 | 0.00 |
| 47 | 301200 | 大族数控 | 835.00 | 43,353.20 | 0.00 |
| 48 | 301206 | 三元生物 | 875.00 | 39,978.75 | 0.00 |
| 49 | 301219 | 腾远钴业 | 344.00 | 30,210.08 | 0.00 |
| 50 | 301207 | 华兰疫苗 | 476.00 | 26,855.92 | 0.00 |
| 51 | 301233 | 盛帮股份 | 636.00 | 26,406.72 | 0.00 |
| 52 | 301216 | 万凯新材 | 838.00 | 25,005.92 | 0.00 |
| 53 | 301150 | 中一科技 | 278.00 | 23,007.28 | 0.00 |
| 54 | 301109 | 军信股份 | 1,082.00 | 17,463.48 | 0.00 |
| 55 | 301201 | 诚达药业 | 228.00 | 16,311.12 | 0.00 |
| 56 | 301096 | 百诚医药 | 204.00 | 16,116.00 | 0.00 |
| 57 | 301302 | 华如科技 | 285.00 | 16,079.70 | 0.00 |
| 58 | 300834 | 星辉环材 | 527.00 | 15,825.81 | 0.00 |
| 59 | 301215 | 中汽股份 | 2,188.00 | 13,981.32 | 0.00 |
| 60 | 301102 | 兆讯传媒 | 362.00 | 11,254.58 | 0.00 |
| 61 | 301268 | 铭利达 | 295.00 | 10,286.65 | 0.00 |
| 62 | 301162 | 国能日新 | 185.00 | 10,010.35 | 0.00 |
| 63 | 301266 | 宇邦新材 | 204.00 | 9,602.28 | 0.00 |
| 64 | 301127 | 天源环保 | 851.00 | 9,471.63 | 0.00 |
| 65 | 301256 | 华融化学 | 867.00 | 8,739.36 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|----------|------|
| 66 | 301196 | 唯科科技 | 231.00 | 8,667.12 | 0.00 |
| 67 | 601089 | 福元医药 | 382.00 | 8,041.10 | 0.00 |
| 68 | 603259 | 药明康德 | 77.00 | 8,007.23 | 0.00 |
| 69 | 301151 | 冠龙节能 | 330.00 | 7,081.80 | 0.00 |
| 70 | 301153 | 中科江南 | 161.00 | 7,080.78 | 0.00 |
| 71 | 301235 | 华康医疗 | 185.00 | 7,017.05 | 0.00 |
| 72 | 301187 | 欧圣电气 | 289.00 | 6,514.06 | 0.00 |
| 73 | 301212 | 联盛化学 | 180.00 | 5,990.40 | 0.00 |
| 74 | 301103 | 何氏眼科 | 183.00 | 5,859.66 | 0.00 |
| 75 | 301116 | 益客食品 | 286.00 | 5,851.56 | 0.00 |
| 76 | 301286 | 侨源股份 | 288.00 | 5,699.52 | 0.00 |
| 77 | 301097 | 天益医疗 | 115.00 | 5,500.45 | 0.00 |
| 78 | 301258 | 富士莱 | 126.00 | 5,251.68 | 0.00 |
| 79 | 301248 | 杰创智能 | 163.00 | 4,868.81 | 0.00 |
| 80 | 301237 | 和顺科技 | 110.00 | 4,604.60 | 0.00 |
| 81 | 001268 | 联合精密 | 160.00 | 4,435.20 | 0.00 |
| 82 | 301298 | 东利机械 | 206.00 | 4,290.98 | 0.00 |
| 83 | 301228 | 实朴检测 | 210.00 | 4,271.40 | 0.00 |
| 84 | 301148 | 嘉戎技术 | 171.00 | 4,086.90 | 0.00 |
| 85 | 301120 | 新特电气 | 261.00 | 4,042.89 | 0.00 |
| 86 | 301259 | 艾布鲁 | 150.00 | 3,741.00 | 0.00 |
| 87 | 301222 | 浙江恒威 | 128.00 | 3,706.88 | 0.00 |
| 88 | 301110 | 青木股份 | 91.00 | 3,626.35 | 0.00 |
| 89 | 301158 | 德石股份 | 166.00 | 3,383.08 | 0.00 |
| 90 | 301137 | 哈焊华通 | 210.00 | 3,357.90 | 0.00 |
| 91 | 301279 | 金道科技 | 144.00 | 3,284.64 | 0.00 |
| 92 | 301130 | 西点药业 | 87.00 | 3,279.90 | 0.00 |
| 93 | 301163 | 宏德股份 | 99.00 | 3,200.67 | 0.00 |
| 94 | 301135 | 瑞德智能 | 119.00 | 3,124.94 | 0.00 |
| 95 | 301055 | 张小泉 | 156.00 | 2,773.68 | 0.00 |
| 96 | 301125 | 腾亚精工 | 101.00 | 2,769.42 | 0.00 |
| 97 | 301288 | 清研环境 | 135.00 | 2,697.30 | 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 | 600519 | 贵州茅台 | 106,821,509.26 | 5.46 |
| 2 | 605080 | 浙江自然 | 98,140,949.98 | 5.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 3 | 03690 | 美团-W | 78,996,845.21 | 4.04 |
| 4 | 601001 | 晋控煤业 | 50,339,512.13 | 2.57 |
| 5 | 000002 | 万科A | 37,953,351.72 | 1.94 |
| 6 | 000961 | 中南建设 | 36,776,503.00 | 1.88 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 34,060,786.00 | 1.74 |
| 8 | 601816 | 京沪高铁 | 32,547,021.00 | 1.66 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 28,419,814.00 | 1.45 |
| 10 | 600557 | 康缘药业 | 27,840,095.84 | 1.42 |
| 11 | 002154 | 报喜鸟 | 25,506,667.10 | 1.30 |
| 12 | 601882 | 海天精工 | 24,331,236.03 | 1.24 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能 | 23,663,905.00 | 1.21 |
| 14 | 002415 | 海康威视 | 22,474,133.00 | 1.15 |
| 15 | 688596 | 正帆科技 | 20,861,283.47 | 1.07 |
| 16 | 002985 | 北摩高科 | 20,459,538.80 | 1.05 |
| 17 | 600266 | 城建发展 | 17,718,921.54 | 0.91 |
| 18 | 601668 | 中国建筑 | 15,551,685.00 | 0.79 |
| 19 | 601666 | 平煤股份 | 14,612,599.80 | 0.75 |
| 20 | 600346 | 恒力石化 | 13,334,816.00 | 0.68 |

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 | 300750 | 宁德时代 | 188,564,323.78 | 9.63 |
| 2 | 02331 | 李宁 | 152,442,057.62 | 7.79 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 109,799,917.00 | 5.61 |
| 4 | 601339 | 百隆东方 | 70,418,606.90 | 3.60 |
| 5 | 603518 | 锦泓集团 | 68,490,715.31 | 3.50 |
| 6 | 002154 | 报喜鸟 | 62,325,683.00 | 3.18 |
| 7 | 601001 | 晋控煤业 | 50,142,223.68 | 2.56 |
| 8 | 002180 | 纳思达 | 48,518,480.00 | 2.48 |
| 9 | 300014 | 亿纬锂能 | 48,324,854.47 | 2.47 |
| 10 | 300763 | 锦浪科技 | 44,359,456.00 | 2.27 |
| 11 | 300059 | 东方财富 | 43,274,137.16 | 2.21 |
| 12 | 000733 | 振华科技 | 39,461,304.00 | 2.02 |
| 13 | 600048 | 保利发展 | 38,402,172.00 | 1.96 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 37,044,430.00 | 1.89 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 603568 | 伟明环保 | 37,030,142.80 | 1.89 |
| 16 | 000961 | 中南建设 | 34,531,803.00 | 1.76 |
| 17 | 601816 | 京沪高铁 | 31,771,738.00 | 1.62 |
| 18 | 601882 | 海天精工 | 25,398,391.14 | 1.30 |
| 19 | 600496 | 精工钢构 | 24,896,072.00 | 1.27 |
| 20 | 605080 | 浙江自然 | 22,779,588.00 | 1.16 |

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 | 974,588,402.38 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,659,410,253.14 |

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 本基金投资股指期货的投资政策

- (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 本报告期内，本集合计划投资前十名证券的发行主体在本报告期内未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，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。

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 | 385,594.61 |
| 2 | 应收清算款 | 19,387,741.17 |
| 3 | 应收股利 | 592,463.29 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 146,713.46 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,512,512.53 |

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

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------------|----------|-----------|---------------|--------|----------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 17,126 | 48,065.27 | 22,839,566.25 | 2.77% | 800,326,194.82 | 97.23% |
| 广发资管平衡精选一年持有混合 C | 3,828 | 33,344.62 | 1,991,443.85 | 1.56% | 125,651,776.77 | 98.44% |
| 合计 | 20,734 | 45,857.48 | 24,831,010.10 | 2.61% | 925,977,971.59 | 97.39% |

注：本表中，分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分份额基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下述分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）；户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总数/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 2,109,558.72 | 0.26% |
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 C | 26,006.47 | 0.02% |
| | 合计 | 2,135,565.19 | 0.22% |

注：本表中，从业人员持有份额占基金总份额比例的计算中，对分份额基金，分母“基金总份额”采用各自级别的份额；对合计数，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | >100 |
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开 | 广发资管平衡精选一年 | 0 |

| | | |
|------|------------------|---|
| 放式基金 | 持有混合 A | |
| | 广发资管平衡精选一年持有混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 广发资管平衡精选一年持有混合 A | 广发资管平衡精选一年持有混合 C |
|---------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,372,023,235.27 | 218,044,446.46 |
| 本报告期基金总申购份额 | 12,416,253.03 | 2,598,444.98 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 561,273,727.23 | 92,999,670.82 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 823,165,761.07 | 127,643,220.62 |

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。

§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，本集合计划管理人发生如下重大人事变动：2022 年 1 月，本集合计划管理人的副总经理叶鹏先生个人提出辞职申请，不再担任公司副总经理职务；2022 年 2 月，因工作安排，本集合计划管理人的首席风险官由吴顺虎先生变更为孔维成先生；2022 年 4 月，因工作安排，本集合计划管理人的合规负责人由吴顺虎先生变更为孔维成先生。2022 年 7 月，本集合计划管理人的首席信息官柯学先生因个人原因离任，公司聘任了蒋荣（Jiang Ron）先生担任公司副总经理、首席信息官。

本报告期内，本集合计划托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

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 | 2,653,202,162.39 | 100.00% | 1,819,301.77 | 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

本集合计划本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|---------------------|------------|
| 1 | 广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2021 年第 4 季度报告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2022-01-20 |
| 2 | 关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年第四季度报告提示性公告 | 指定报刊、管理人网站 | 2022-01-20 |
| 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 | 2022-01-28 |

| | | | |
|---|--|---------------------|------------|
| 4 | 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 | 2022-02-25 |
| 5 | 广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2021 年年度报告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2022-03-29 |
| 6 | 关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2021 年年度报告提示性公告 | 指定报刊、管理人网站 | 2022-03-29 |
| 7 | 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 | 2022-04-09 |
| 8 | 广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2022 年第一季度报告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2022-04-19 |
| 9 | 关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2022 年第一季度报告提示性公告 | 指定报刊、管理人网站 | 2022-04-19 |

§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、《关于准予广发金管家法宝量化多策略集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2020】2985号）；
- 2、广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 5、广发资管平衡精选一年持有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

二〇二二年八月二十六日