

广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）
集合资产管理计划
2022 年第 3 季度报告
2022 年 9 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十五日

§ 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

集合计划托管人招商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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 2022 年 4 月 11 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发资管智荟广易六个月持有期混合（FOF）
基金主代码	872029
基金运作方式	其他开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 11 日
报告期末基金份额总额	165,734,772.12 份
投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，

	<p>精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。本集合计划将主要投资于证券投资基金，构建本集合计划的核心组合。基金投资具体策略如下：首先，根据晨星等第三方评级机构对基金的评级、风险调整后的收益（IR,Sharpe）、规模和流动性等一系列量化指标对基金进行初步筛选。然后，本集合计划将从定量和定性的角度对基金进行二次筛选，确定投资组合。</p>	
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×5%+中债总指数收益率×75%</p>	
风险收益特征	<p>本集合计划为混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金，属于中风险产品。</p> <p>本集合计划除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>	
基金管理人	<p>广发证券资产管理（广东）有限公司</p>	
基金托管人	<p>招商银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>广发资管智荟广易六个月持有期混合 A</p>	<p>广发资管智荟广易六个月持有期混合 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>870004</p>	<p>872030</p>
报告期末下属分级基金	<p>156,601,592.53 份</p>	<p>9,133,179.59 份</p>

的份额总额		
-------	--	--

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)	
	广发资管智荟广易六 个月持有期混合 A	广发资管智荟广易六 个月持有期混合 C
1.本期已实现收益	-256,475.57	-4,127.19
2.本期利润	-2,543,223.96	-193,260.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0206	-0.0567
4.期末基金资产净值	157,548,016.92	9,175,359.84
5.期末基金份额净值	1.0060	1.0046

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

广发资管智荟广易六个月持有期混合 A

阶段	净值增长率①	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	-1.30%	0.32%	-2.94%	0.23%	1.64%	0.09%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.27%	-0.99%	0.29%	1.59%	-0.02%

广发资管智荟广易六个月持有期混合 C

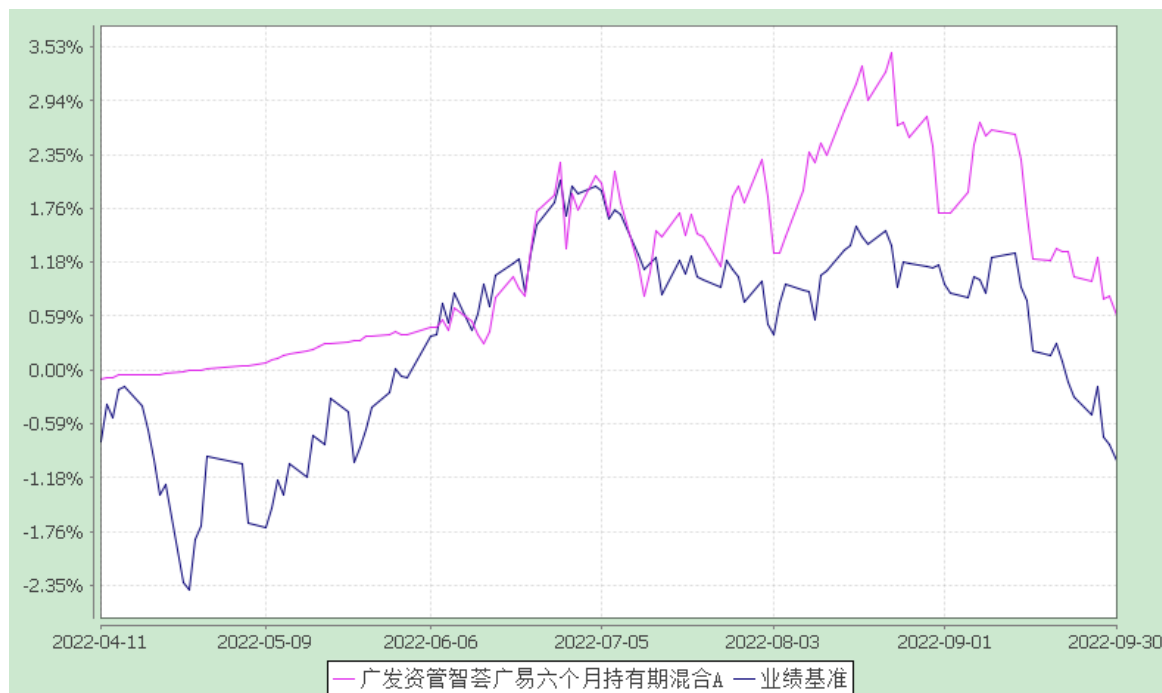
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.39%	0.32%	-2.94%	0.23%	1.55%	0.09%
自基金合同生效起至今	0.46%	0.27%	-0.99%	0.29%	1.45%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

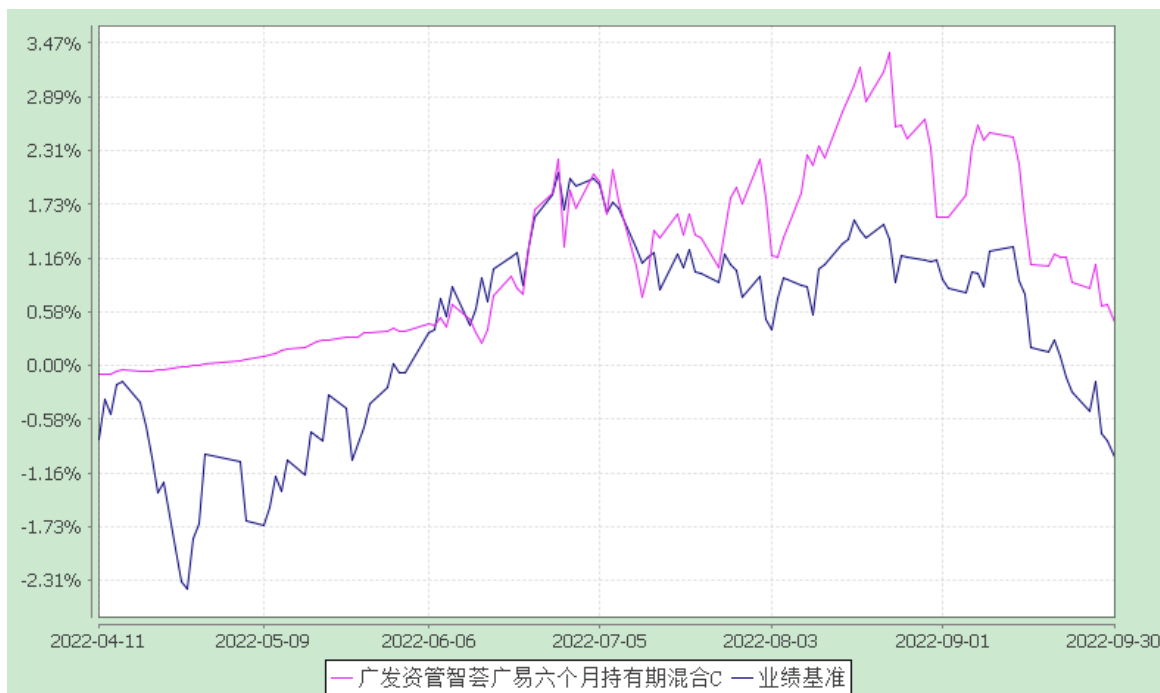
广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2022 年 4 月 11 日至 2022 年 9 月 30 日）

广发资管智荟广易六个月持有期混合 A



广发资管智荟广易六个月持有期混合 C



注：1.本集合计划的合同生效日为 2022 年 4 月 11 日，至披露时点本集合计划合同生效未满 1 年；

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王楠	广发资管资产配置部副总经理兼公募配置部负责人、本集合计划投资经理	2022-04-11	-	15 年	王楠,男,硕士研究生学历,本科毕业于北京大学金融数学专业,研究生毕业于清华大学工商管理专业,过往曾就职于中金公司、北京高华证券、中信证券,现就职于广发资管资产配置部,任部门副总经理兼公募配置部负责人。2022 年 4 月起任广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基

					金(FOF)集合资产管理计划基金经理。
吕琪	本集合计划投资经理助理	2022-07-08	-	2 年	中国人民大学汉青研究院量化金融硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司研究所高级分析师。现任本集合计划投资经理助理。

注：注：1、任职日期是指公司决定聘任投资经理/投资助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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，为本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，不存在损害计划持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1. 宏观及市场回顾

首先，全球角度：目前来看，判断美联储转向或加息周期已临近结束仍为时尚早，资产定价预期仍将处于频繁折返特征之下。原因是海外经济数据依旧没有明确的经济衰退的信号。10月3日公布的9月美国的ISM制造业PMI数据偏低，引发政策转向预期，全球风险资产大涨；10月7日公布的非农就业数据高于预期，加息预期强化，美股显著调整，港股10月7日亦下跌1.5%。

俄乌战争的影响依然持续，不确定性随时发生着变化。同时在10月5日，OPEC+决定11月起日均减产200万桶。国庆假期期间WTI原油期货结算价较节前上涨16.5%，回到90美元/桶以上。由于能源版图的重构，全球能源供应将经历相当长的调整期，以达成新的供应平衡，或者说供应安全，这势必造成更多的冗余和浪费，加重全球的通胀。回到短期，通胀压力的高点应该是过去了。最近几个月各种大宗商品的价格是下跌的，在制造端传导2个季度左右，它将会在终端逐渐体现。

其次，国内角度：经济恢复的不确定性依然很大，最重要因素还是疫情的反复，房地产的复苏的节奏。具体来看，好的方面包括：9月行业开工率多数回升，全国247家钢铁高炉开工率显著回暖，焦化企业开工率延续反弹。PTA江浙织机负荷率环比走升。基建链数据偏强，全国水泥库容比有所回升。9月地产销售低位企稳，一线城市环比自去年8月以来首度转正。国内稳增长政策升温，地产相关政策密集出台。

存在变数的方面包括：9月外贸高频不及前期强劲，且波动较大；9月汽车销售增速较前值放缓，但仍属较景气的状态；9月猪肉价格再度呈上行趋势，农业部猪肉平均批发价9月、国庆期间环比分别回升7.2%、2.5%，或带来通胀压力。

总体上，回到今年的三个重要因素：通胀、疫情、地产。地产政策已经开始加力，市场总体情况应该会比过去两个月要好一些。随着全球疫情影响的消散，国内情况正常化应该会逐渐开启，市场有望逐渐走出阴霾。

2. 权益市场配置

近期A股市场表现偏弱，成交量明显收缩，市场氛围较为悲观，一方面在于投资者经济预期调整，风险偏好下降，另一方面在于大国博弈与地缘政治波动下风险预期高度不稳定。

在具体的投资策略上，我们依然坚持两个原则，第一，一切皆有周期；第二，在

保证确定性的前提下寻找高回报率的投资机会。在目前的外部环境和经济形势下，我们的投资重点转向以下两个方向：（1）低估值防御板块，比如基建、银行以及地产等“稳增长”板块，在风险偏好较弱以及市场弱势震荡的情况下，短期有望有相对表现；（2）在大国博弈升级、国际地缘风险加剧的背景下，关注具有自主可控和国产替代逻辑的国防军工、计算机、半导体等细分行业，以及受益于国际供需矛盾的煤炭、油运等。

对于具体行业来看：

地产：房地产销售的改善有周期性因素，类似今年 6 月份；苏州因为政策放松，销售环比提升 116%；成都因为疫情结束，都有比较明显的改善，一线城市推盘也比较积极。目前市场销售的复苏仍然不足，大部分城市去化率不高，目前房企参与拿地的热情更加低迷，北京、上海这两个核心城市第三批土拍的托底数量相比第二批更多。因此即使地产行业的基本面迎来反转，但地产行业的股价未必会迎来长周期的反转，更加需要关注的是在行业出清过程中由政策加码、销售数据回暖等带来的阶段性投资机会。

基建基本面角度，8 月基建继续高增，基建投资同比增长 15.31%，本月国务院例会也再次强调对于基建的支持，近期螺纹钢和石油沥青装置开工率等高频数据亦持续回升，预计随着天气降温、限产限电缓解，叠加国务院督导行动的落实，基建三季度实物量有望继续加速落地；交易面维度，由于 5 月后相关股票上涨乏力，当前估值亦具吸引力。

煤炭：目前煤矿及铁路运力优先保长协，市场煤资源依旧偏紧，而冶金化工等采购积极，中小煤矿供不应求，价格持续上涨，发运户采购困难且发运成本增加，北方港现货资源紧缺短期难以缓解，而下游非电行业刚性备货，冬储也陆续启动，外加前期中间环节库存得到一定去化（8 月高温所致），同时今年水电出力不足导致火电需求增加，以及煤矿安全事故影响等等。预计 11 月供暖季开始前（这个时间点和大秦线检修结束的时间相差不远），煤价大概率会保持偏强运行。

银行：当前板块估值处于极低位置，进可攻退可守。关注经济好转所带动的板块景气度提升。未来重点关注两条主线：1、优质区域城商行；2、经济提振政策落地见效所利好的超跌优质股份行。

在制造业方面，新能源板块本月继续受到外部利空消息的冲击，如《关于禁止欧

盟市场强迫劳动产品法规提案》的发布、IRA 法案重提、欧委会紧急干预市场以降低能源价格的提案的公布等，但随着前期泛新能源板块的深跌，种种利空对于新能源股价的冲击正在减弱。我们认为内短期新能源虽不一定会再度成为领涨行业，但前期深跌再现的可能性较低，中长期维度则继续战略性看好新能源，内部板块排序为风>光~储>车。

风电设备：8 月风电装机 1.21GW，环比下降 39.2%，部分投资者对于风电景气度出现担忧。回顾历史数据，仅 2021 年出现正增长，主要还是由于风电抢装影响。我们认为数据出现环比下降原因是风机吊装后要获得并网许可证方可并网，大约有 1-3 个月的时间延迟，因此 8 月风电并网数据反映的是 5-7 月的吊装情况，维持高景气判断；景气度 8-9 月环比改善已较为明显，9 月叶片生产端环比增长 70%-80%。外资厂开始谈明年的主轴承提价，纯进口部分可能提涨 20%，明年仍在一个国产化替代和新疆联的 α 周期内。风电重点公司目前估值处于整体合理中枢。

光伏设备：硅料价格见顶，博弈进入关键期。硅料价格拐点临近，电池片供需偏紧。根据 PVInfolink 的统计，9 月硅料整体供应量环比提升，有效增量主要集中在下旬。在 10 月硅料有效供应量显著提升预期下，抢购或囤货现象陆续消退，硅料价格下行拐点有望出现。硅料价格见顶，博弈进入关键期，海外需求依然旺盛，国内市场待硅料降价逐步启动；行业降本提效是主旋律，全球光伏平价背景下硅片、电池片到组件环节扩产规模有望超预期，对于平台化布局的硅片\组件设备龙头企业将更加受益；电池片环节，金属化方面，激光转印技术下半年有望放量。

半导体行业：短期虽有海外利空政策压制，但超跌叠加国内政策加码预期或带来交易机会，，长期国产化趋势向好。一方面，全球半导体的低景气度状态或许还将持续一年左右的时间，也可能会更长，这些跟随全球景气变化的低端芯片公司，在财务上的表现可能会低于预期。另一方面，对于国产化需求推动的企业来说，国内产业政策支持正在逐步落地，包括各种扩产计划也在推进。其实，对于上游的设备材料和一些高端芯片子行业来说，是会有持续刺激产生的。后续关注方向：1、半导体设备和材料，目前国产化率较低，在相当一段时间内都可以看到产业向好的方向发展，相应的，龙头公司财务质量改善也较明显。2、需求场景较确定的芯片设计环节，主要是军工的集成电路企业。3、国产化难度较高的高端芯片，以车载集成电路为代表。

通信行业：关注汽车连接器，海缆、光缆，智能控制器。海缆、光缆：短期江苏

项目受损于东部战区的审核整改，广东项目在海上交通事故后仍正常推进。行业发展趋势未出现改变，标的估值仍然较低。

汽车连接器：高压、高速连接器分别代表着电动化、智能化 beta，单车价值量高，高速壁垒强于高压。

消费行业：白酒基本面角度实际动销基本面比较差，整体上高端>强势地产酒>次高端~其他地产酒。三季度能够环比二季度改善，但是同比还能加速的概率较低。短期行业承压，关注中长期白酒行业，尤其高端、次高端的增长。交易面角度有超跌反弹的空间。养殖板块方面，猪肉价格小幅震荡。短期来看，虽然农业部能繁母猪数据质量较差，但考虑到其已经连续三个月转正，去化逻辑已弱。此外国庆带来猪肉短期消费的上行，但总体来说由于猪肉需求偏刚性，因此投资维度更建议关注供给维度的变化。

3. 债券市场配置

展望 2022 年四季度，国内基本面修复节奏和流动性的边际变化将成为影响债市的主要因素。经济在地产风险平息后有望缓慢修复，但疫情扰动下消费疲弱、海外经济衰退导致出口回落仍是潜在风险。考虑服务价格低位运行，将部分对冲猪价上涨，叠加 PPI 受基数影响延续走低，国内通胀压力整体可控。政策方面，新增专项债限额发行接近尾声后，四季度财政或仍将扩容，政策性金融工具来托底基建，货币政策更注重宽信用发力，流动性预计保持合理充裕。对于债券市场，我们认为四季度或呈现震荡偏强的态势。

因此在债券基金的配置上，我们将坚持三个方向：把握交易性行情、合理利用杠杆、严控信用风险。

第一，把握交易性行情：站在目前时点来看，利率处于历史偏低位置，中短端债券利率相对宽松的资金面并未明显超涨，且曲线较为陡峭，经济内生动能偏弱也限制收益率上行的幅度。展望中期，考虑出口对经济的贡献下降，如果地产风险进一步蔓延、宽信用传导不畅，宽松预期或再度发酵，债市仍有交易性行情。

其次，合理利用杠杆：展望四季度，国内散点疫情扰动下，中小企业和服务业经营受挫，后续经济复苏的斜率和空间存在不确定性，流动性显著收紧的概率偏低。考虑债券收益率曲线较陡，目前杠杆套息空间仍在，保持组合流动性的前提下合理利用

杠杆。

第三，严控信用风险：展望四季度，疫情防控和地产下滑对宏观经济的抑制仍不可忽视，多数产业均受到了不同程度的负面影响，部分行业如地产、交运、传媒等仍在筑底阶段，而城投在地方经济不景气、土地财政下滑和防疫开支增长的逻辑下尾部风险无法消除，因此下阶段信用风险控制仍是第一要务。

4.5 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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	152,745,140.10	91.41
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	12,434,325.00	7.44

8	其他资产	1,910,425.85	1.14
9	合计	167,089,890.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2022 年 3 月，中泰证券(上海)资产管理有限公司因个别资产管理计划估值方法不合理以及关联交易制度不完善等原因，被上海证监局采取责令改正的行政监管措施。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序和流程均符合公司投资管理制度的相关规定和程序。

除此之外，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内受到监管部门公开谴责或处罚的情况。

5.11.2 报告期内，本集合计划未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,909,209.40
3	应收股利	716.45
4	应收利息	-
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,910,425.85

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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未持有股票。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理
----	------	------	------	---------	---------	--------------	--------------

							人关联方所管理的基金
1	006989	建信中短债纯债债券 A	契约型开放式	13,275,468.69	13,819,762.91	8.29	否
2	000403	工银纯债债券 B	契约型开放式	9,262,130.20	10,701,465.23	6.42	否
3	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型开放式	8,759,735.19	10,112,238.30	6.07	否
4	270049	广发纯债债券 C	契约型开放式	6,827,730.23	8,379,673.31	5.03	是
5	012449	广发睿毅领先混合 C	契约型开放式	2,982,864.58	7,991,094.21	4.79	是
6	012940	中泰星元灵活配置混合 C	契约型开放式	3,363,210.60	7,730,339.56	4.64	否
7	519782	交银裕隆纯债债券 A	契约型开放式	5,861,658.80	7,616,639.44	4.57	否
8	004042	华夏鼎茂债券 A	契约型开放式	5,643,444.61	6,966,268.03	4.18	否
9	006320	易方达安瑞短债债券 C	契约型开放式	6,707,820.16	6,747,396.30	4.05	是
10	110053	易方达安源中短债债券 A	契约型开放式	5,351,253.22	5,881,027.29	3.53	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	9,649.51	2,899.73
当期交易基金产生的	22,458.54	20,147.40

赎回费（元）		
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	40,464.82	19,364.32
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	176,918.57	85,813.09
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	38,307.33	18,062.56
当期交易基金产生的交易费（元）	16,510.05	-
当期交易基金产生的转换费（元）	11,195.78	11,195.78

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本集合计划对被投资基金的持仓根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本集合计划合同的约定，集合计划管理人不得对集合计划财产中持有的自身管理的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金的部分收取管理费，集合计划托管人不得对集合计划财产中持有的自身托管的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金的部分收取托管费。集合计划管理人运用集合计划财产申购自身管理的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、招募说明书约定应当收取并计入集合计划财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本集合计划管理人从被投资基金收取后返还至本集合计划资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内持有的基金除其已披露信息外，持有的基金未发生其他重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发资管智荟广易	广发资管智荟广易
----	----------	----------

	六个月持有期混合A	六个月持有期混合C
报告期期初基金份额总额	104,023,731.13	1,099.90
报告期期间基金总申购份额	54,420,173.29	9,132,079.69
减：报告期期间基金总赎回份额	1,842,311.89	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	156,601,592.53	9,133,179.59

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。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本集合计划份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，管理人不存在运用固有资金申购、赎回或买卖本集合计划的情况。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《关于准予广发增强型基金优选集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2021】3261号）；
- 2、广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划

招募说明书；

4、广发资智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同；

5、广发资智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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。

10.2 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。

10.3 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

二〇二二年十月二十五日