

广发锐意进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金
(FOF)

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§ 1 重要提示

基金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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）
基金主代码	007904
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 27 日
报告期末基金份额总额	99,265,180.09 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过定量与定性相结合的方法精选不同资产类别中的优质基金，结合基金的风险收益特征和市场环境合理配置权重，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不

	同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券、基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。	
业绩比较基准	中证股票型基金指数收益率×75%+中证债券型基金指数收益率×20%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	<p>本基金为基金中基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。</p> <p>本基金为目标风险基金中的成长型 FOF，其预期收益及风险水平高于目标风险基金中的稳健型 FOF 和保守型 FOF。</p>	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）A	广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	007904	009322
报告期末下属分级基金的份额总额	65,354,273.43 份	33,910,906.66 份

§ 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)	
	广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）A	广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）C

1.本期已实现收益	-1,224,435.59	-251,372.85
2.本期利润	-4,979,819.60	-1,220,748.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1352	-0.2010
4.期末基金资产净值	86,017,070.39	44,344,855.83
5.期末基金份额净值	1.3162	1.3077

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

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

3.2 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

1、广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）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	-8.06%	0.82%	-10.16%	0.71%	2.10%	0.11%
过去六个月	-2.29%	1.14%	-3.93%	0.97%	1.64%	0.17%
过去一年	-13.74%	1.10%	-14.50%	0.94%	0.76%	0.16%
自基金合同生效起至今	31.62%	1.15%	22.96%	1.01%	8.66%	0.14%

2、广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）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	-8.15%	0.82%	-10.16%	0.71%	2.01%	0.11%
过去六个	-2.42%	1.14%	-3.93%	0.97%	1.51%	0.17%

月						
过去一年	-13.89%	1.10%	-14.50%	0.94%	0.61%	0.16%
自基金合同生效起至今	33.30%	1.13%	17.19%	0.98%	16.11%	0.15%

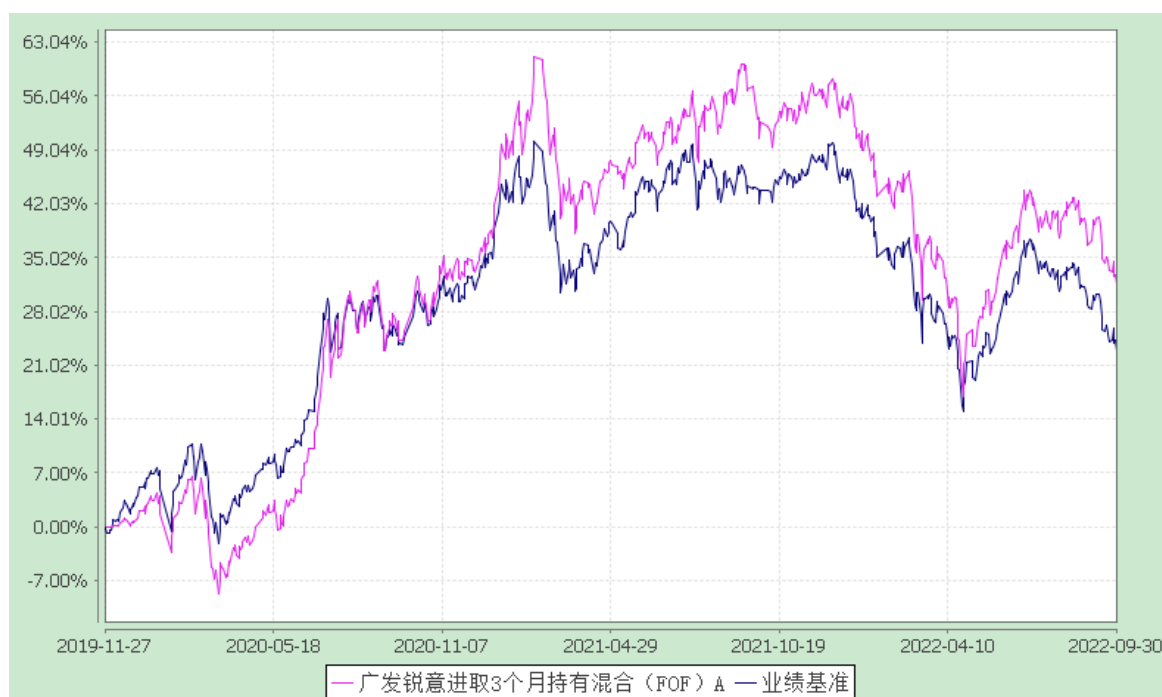
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发锐意进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

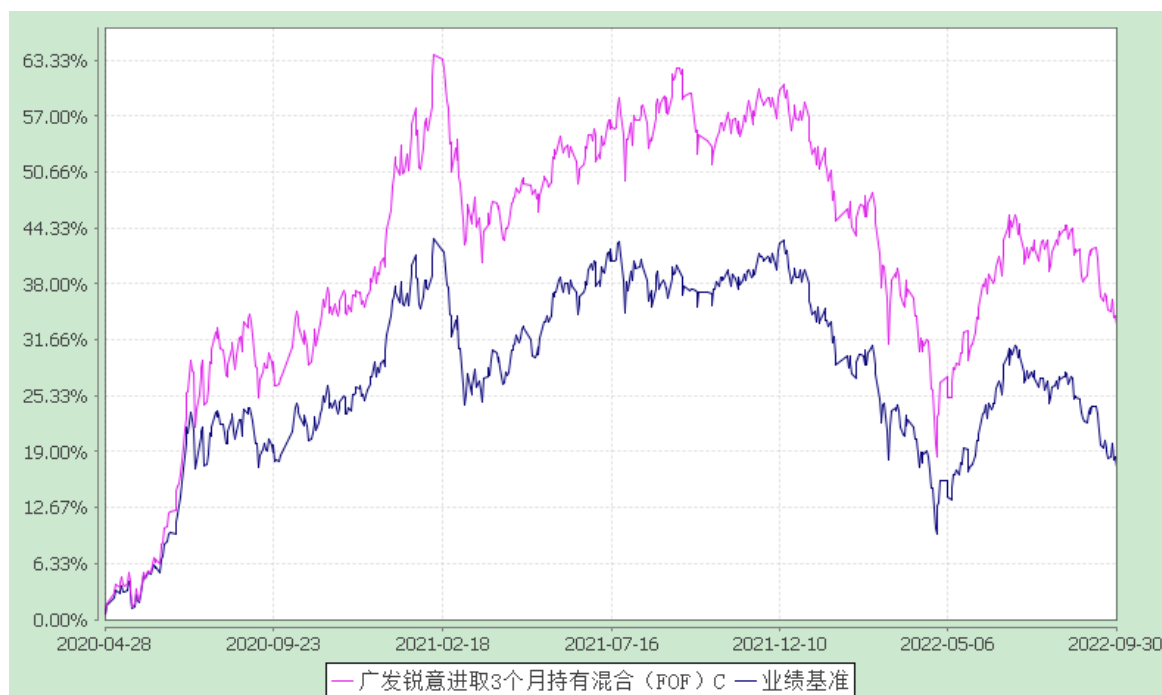
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2019 年 11 月 27 日至 2022 年 9 月 30 日）

1、广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）A：



2、广发锐意进取 3 个月持有混合（FOF）C：



§ 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		
曹建文	本基金的基金经理；广发安泰稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)的基金经理；广发养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理	2021-11-29	-	10年	曹建文，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任浦银安盛基金管理有限公司金融分析师、投资经理，平安养老保险股份有限公司投资经理。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年三季度，权益市场在反弹后重归弱势，美元利率上行、海外经济衰退风险有所增加，市场开始担忧出口的潜在下滑，新能源和半导体等成长板块出现明显调整。由于疫情的反复，消费板块表现较弱。受金融降费的影响，金融板块也出现较大跌幅。受益于能源价格的坚挺，煤炭和石化等上游板块表现相对较好。债券市场方面，在疫情冲击和外需下行风险加大的背景下，托底经济的压力较大，资金面上维持偏宽松状态，流动性合理充裕，十年国债利率先下后上，中枢下移至2.7%。

报告期内，本基金持续跟踪宏观经济、政策、市场风格等的变化，降低了权益仓位，采用定量和定性相结合的方式优选基金品种，并通过风格配置和结构调整获取较稳定的超额收益。在市场分化较大的背景下，本基金增加了价值型和稳健型风格基金的配置，减少了新能源和科技等主题基金的配置，本基金整体风格偏价值，力争通过优选权益基金以及把握板块和风格的结构化机会，以期取得超越权益市场平均水平的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为-8.06%，C类基金份额净值增长率为-8.15%，同期业绩比较基准收益率为-10.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金且截至本报告期末，合同生效不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的披露规定。

§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：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	95,874,649.70	70.72

3	固定收益投资	6,413,982.63	4.73
	其中：债券	6,413,982.63	4.73
	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	501,608.19	0.37
8	其他资产	32,774,271.40	24.18
9	合计	135,564,511.92	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 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

本基金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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,394,980.96	4.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	19,001.67	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,413,982.63	4.92

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	56,000	5,691,372.06	4.37
2	019679	22 国债 14	6,000	602,650.52	0.46
3	019638	20 国债 09	1,000	100,958.38	0.08
4	118020	芳源转债	190	19,001.67	0.01

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

本基金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

本基金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

本基金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) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金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) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,957.12
2	应收证券清算款	3,201,112.74
3	应收股利	141,948.43
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,427,826.62
6	其他应收款	426.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,774,271.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金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	002340	富国价值优势混合	契约型开放式	1,029,846.67	3,432,067.01	2.63	否
2	519133	海富通改革驱动混合	契约型开放式	1,298,479.90	3,239,187.96	2.48	否
3	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式	801,000.00	3,098,268.00	2.38	否
4	002670	万家沪深300指数增强A	契约型开放式	1,676,830.36	2,249,970.98	1.73	否
5	519702	交银趋势优先混合A	契约型开放式	491,874.03	2,072,314.48	1.59	否
6	001286	易方达新鑫混合E	契约型开放式	1,470,588.24	1,994,117.65	1.53	否
7	008099	广发价值领先混合A	契约型开放式	1,150,800.39	1,857,967.23	1.43	是
8	519756	交银国企改革灵活配置混合	契约型开放式	943,527.59	1,777,605.98	1.36	否
9	013430	交银趋势优先混合C	契约型开放式	420,549.53	1,760,546.50	1.35	否
10	159967	华夏成长ETF	交易型开放式	3,020,500.00	1,733,767.00	1.33	否

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）	20,099.97	-
当期交易基金产生的	35,394.89	4,016.91

赎回费（元）		
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	7,915.27	1,279.73
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	159,736.88	29,145.85
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	27,924.16	5,139.29
当期交易基金产生的交易费（元）	1,269.29	314.71

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基金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基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、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，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发锐意进取3个月持有混合（FOF）A	广发锐意进取3个月持有混合（FOF）C
报告期期初基金份额总额	33,015,620.89	3,901,941.62

报告期期间基金总申购份额	33,954,444.33	30,225,676.44
减：报告期期间基金总赎回份额	1,615,791.79	216,711.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	65,354,273.43	33,910,906.66

§8 基金管理人运用自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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.08
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.08
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	10.07

8.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用自有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	10,000,800.08	10.07%	10,000,800.08	10.07%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等	-	-	-	-	-

人员					
基金管理人	-	-	-	-	-
股东					
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	10.07%	10,000,800.08	10.07%	三年

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220701-20220918	10,000,800.08	-	-	10,000,800.08	10.07%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- （一）中国证监会注册广发锐意进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集的文件

- （二）《广发锐意进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- （三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （四）《广发锐意进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》
- （五）法律意见书

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司
二〇二二年十月二十六日