

# 广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

### 2023 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：二〇二三年八月二十五日

## § 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 2023 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划于 2020 年 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	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
<b>§5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	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
<b>§7 投资组合报告</b>	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56

7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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 .....	58
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## §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	535,547,419.30 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	468,726,680.09 份	66,820,739.21 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		珠海横琴新区荣珠道191号写字楼2005房	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	北京市西城区锦什坊街 26 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（2023年1月1日至2023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	-73,613,311.96	-10,580,463.19
本期利润	-84,986,123.33	-12,055,076.55
加权平均基金份额本期利润	-0.1649	-0.1636
本期加权平均净值利润率	-15.35%	-15.44%
本期基金份额净值增长率	-14.50%	-14.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023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	-125,618,800.74	-18,901,144.02
期末可供分配基金份额利润	-0.2680	-0.2829
期末基金资产净值	462,411,917.38	64,929,471.84
期末基金份额净值	0.9865	0.9717
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	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	-3.39%	-4.84%

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	0.03%	1.73%	1.52%	0.82%	-1.49%	0.91%
过去三个月	-8.50%	1.38%	-4.56%	0.74%	-3.94%	0.64%
过去六个月	-14.50%	1.27%	-0.75%	0.76%	-13.75%	0.51%
过去一年	-16.54%	1.29%	-11.81%	0.92%	-4.73%	0.37%
自基金合同生效起至今	-3.39%	1.35%	-20.83%	1.02%	17.44%	0.33%

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	-0.02%	1.73%	1.52%	0.82%	-1.54%	0.91%
过去三个月	-8.64%	1.38%	-4.56%	0.74%	-4.08%	0.64%
过去六个月	-14.75%	1.28%	-0.75%	0.76%	-14.00%	0.52%
过去一年	-17.04%	1.29%	-11.81%	0.92%	-5.23%	0.37%
自基金合同生效起至今	-4.84%	1.35%	-20.83%	1.02%	15.99%	0.33%

### 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 2023 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2023年6月30日,公司资产管理总规模为2161.15亿元。根据中国证券投资基金业协会

的统计数据，2023 年第一季度，公司私募资产管理月均规模为 2247.49 亿元，行业排名第八；2023 年第二季度，公司私募资产管理月均规模为 1941.74 亿元，行业排名第八。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 2023 年 6 月 30 日，广发资管已有 12 只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		
林浩然	投资经理	2022-11-17	-	11 年	本科毕业于南开大学数学与应用数学专业，研究生毕业于南开大学金融工程专业。2012 年 6 月至 2014 年 6 月，在平安证券股份有限公司任商贸零售行业研究员；2014 年 6 月至 2016 年 12 月在国泰君安证券股份有限公司任商贸零售行业高级研究员；2016 年 12 月至 2022 年 3 月，在鹏华基金管理有限公司历任基金经理助理、投资经理；2022 年 3 月至 2022 年 9 月，在浙商证券股份有限公司任消费首席策略兼消费组长；2022 年 9 月至今，在广发证券资产管理(广东)有限公司权益投资部担任投资经理。2022 年 11 月起任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经理。

注：1、任职日期为本集合计划合同生效日或本集合计划管理人对外披露的任职日期，离任日期为本集合计划管理人对外披露的离任日期；

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 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。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 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

我们坚持“发掘相关行业、消费中做成长”的长期思路，坚信消费崛起将伴随品牌的繁荣成长，通过对产业链深入浅出，捕捉最具成长性的发展阶段和环节。我们认为，疫后随着经济发展模式转变，以消费为代表的“内循环”将在未来经济增长中扮演更加重要的角色，这一趋势在中长期将持续演绎。今年上半年，受益于疫后各场景的逐渐恢复，服务类消费呈现快速增长，但商品零售恢复动能尚不扎实。一方面是由于疫情的“疤痕效应”，无论是消费习惯还是消费意愿须一定时间调整，另一方面，海外加息周期对需求的遏制，加上国内新周期刚刚开启，使得短期经济复苏力度低于预期，进而对短期消费倾向产生负面影响。

下半年经济下行速度环比将减缓，海外需求+消费恢复动能均有望环比改善。对经济基本面不过分悲观，一旦地产、城投担忧解决，经济基本面预期有望提前见底。此外，在 AI 为代表的新科技浪

潮下，互联网等科技类公司有望买入新扩张周期。

我们看好几条主线：

一， AI 产业趋势确认且迅速迭代，行业标准和应用的落地可能加快，期待对各行业效率及效率提升；

二， 对消费而言，部分领域如白电、服饰、小家电等低库存行业率先恢复增长，行业估值已回落到合理中枢。下半年随着基本面好转趋势更加确定，回报性价比将更加突出。

中期来看，随着社会无风险利率持续下降，和资本市场隐含回报率提升，我们预计股票在资产配置中的吸引力将继续提升。

#### 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

上半年随着场景恢复各行业呈现恢复性增长，同时由于疫情带来的疤痕效应企业扩张意愿不足，此前已处于低谷的房地产等行业依然面临需求不足、新开工意愿下降的局面。海外由于大幅加息应对通胀，从而导致需求端逐渐萎缩，进一步增加了出口端压力。社会经济在恢复性增长中也面临一定挑战，国内消费复苏进度略低于市场预期。

另一方面，俄乌冲突延续并有进一步升级风险，对恢复中的全球经济增加了不确定性。同时，大国地缘博弈也使得原有国际供应链体系有重塑风险，后疫情时代的全球化合作及供应链稳定遭遇挑战。

A 股板块中，涨幅居前的是通信、传媒和计算机等科技板块，由于 ChatGPT 技术突破引领生成式 AI 浪潮蔓延，无论是美股相关核心企业，还是 A 股科技板块，行情演绎体现得淋漓尽致。随着华为、阿里等企业纷纷推出大模型并构建生态，预计将持续催化相关应用端落地，并产生新的行业机会；跌幅领先的是社会服务、地产链、食品饮料、医药等与经济相关度较高板块。市场整体体现为主题交替强势，指数缓慢下行、行业宽幅震荡特征。

展望下半年，我们对市场并不悲观，在政策加持下国内经济动能有望逐渐恢复，海外加息周期接近完成也使得汇率及出口压力将获缓解。经历连续调整后，A 股及 H 股资产已具备较大吸引力。在长期无风险收益率下行的环境下，国内社会保障体系继续完善，社保、养老、保险、银行理财等长线资金加大配置权益资产是趋势性的。

对于消费而言，中长期来看对经济增长贡献占比不断提升。短期消费复苏低于预期主要受海外

紧缩周期拉长和国内疫后“疤痕效应”影响。展望下半年随着海外通胀压力缓解，及国内经济逐渐企稳，我们认为消费增速将稳步恢复，看好国产品牌在新兴消费及品牌消费升级趋势中的长期机会。

#### 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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	146,366,615.70	125,919,222.00
结算备付金		1,450,956.38	46,591,178.05
存出保证金		314,332.78	197,180.22
交易性金融资产	6.4.7.2	388,927,649.73	725,868,272.05
其中：股票投资		388,927,649.73	725,868,272.05
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,854.30	235,562.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		537,062,408.89	898,811,415.07
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,915,617.56	93,770,344.75
应付赎回款		870,348.98	2,795,801.96
应付管理人报酬		270,805.27	416,112.10
应付托管费		81,241.56	124,763.71
应付销售服务费		33,322.96	52,116.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	549,683.34	1,097,423.37
负债合计		9,721,019.67	98,256,562.02
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	671,861,333.98	871,804,656.05
未分配利润	6.4.7.8	-144,519,944.76	-71,249,803.00
净资产合计		527,341,389.22	800,554,853.05
负债和净资产总计		537,062,408.89	898,811,415.07

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，本集合计划份额总额 535,547,419.30 份。其中 A 类份额净值（暂估业绩报酬前）人民币 0.9865 元，份额总额 468,726,680.09 份，资产净值（暂估业绩报酬前）人民币 462,411,917.38 元，相关暂估业绩报酬人民币 77.46 元，资产净值（暂估业绩报酬后）人民币 462,411,839.92 元；C 类份额净值（暂估业绩报酬前）人民币 0.9717 元，份额总额 66,820,739.21 份，资产净值（暂估业绩报酬前）人民币 64,929,471.84 元，相关暂估业绩报酬人民币 18.00 元，资产净值（暂估业绩报酬后）人民币 64,929,453.84 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。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-94,180,219.16	-73,504,129.38
1.利息收入		256,591.63	175,890.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	256,591.63	175,890.42
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-81,589,386.06	-75,225,433.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-86,546,903.55	-97,269,364.49
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	4,957,517.49	22,043,931.02
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	-12,847,424.73	1,545,413.67
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		2,860,980.72	5,519,406.95
1. 管理人报酬		1,945,375.25	3,767,870.19
2. 托管费		568,184.87	1,130,361.13
3. 销售服务费		234,162.74	511,043.32
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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		22,581.48	-
8. 其他费用	6.4.7.17	90,676.38	110,132.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-97,041,199.88</b>	<b>-79,023,536.33</b>
减：所得税费用		-	-



四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-97,041,199.88	-79,023,536.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-97,041,199.88	-79,023,536.33

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	871,804,656.05	-71,249,803.00	800,554,853.05
二、本期期初净资产（基金净值）	871,804,656.05	-71,249,803.00	800,554,853.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-199,943,322.07	-73,270,141.76	-273,213,463.83
（一）、综合收益总额	-	-97,041,199.88	-97,041,199.88
（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）	-199,943,322.07	23,771,058.12	-176,172,263.95
其中：1.基金申购款	2,101,674.37	-251,173.89	1,850,500.48
2.基金赎回款	-202,044,996.44	24,022,232.01	-178,022,764.43
（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）	671,861,333.98	-144,519,944.76	527,341,389.22
项目	上年度可比期间 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

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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》、《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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 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

本集合计划本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

##### （1）增值税

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》、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》、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》、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》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》的规定及其他相关法规：

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，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(3) 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	146,366,615.70
等于：本金	146,356,341.80
加：应计利息	10,273.90
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	146,366,615.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	388,329,704.45	-	388,927,649.73	597,945.28
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		388,329,704.45	-	388,927,649.73	597,945.28

#### 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 2023 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	463,892.96
其中：交易所市场	463,892.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,790.38
合计	549,683.34

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	606,767,355.12	761,207,455.78
本期申购	1,208,849.50	1,516,541.86
本期赎回（以“-”号填列）	-139,249,524.53	-174,693,279.52
本期末	468,726,680.09	588,030,718.12

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,156,068.46	110,597,200.27
本期申购	466,403.84	585,132.51
本期赎回（以“-”号填列）	-21,801,733.09	-27,351,716.92
本期末	66,820,739.21	83,830,615.86

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	26,016,888.05	-87,151,741.35	-61,134,853.30
本期利润	-73,613,311.96	-11,372,811.37	-84,986,123.33
本期基金份额交易产生的变动数	-1,671,651.25	22,173,827.14	20,502,175.89
其中：基金申购款	17,924.44	-193,329.04	-175,404.60
基金赎回款	-1,689,575.69	22,367,156.18	20,677,580.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-49,268,075.16	-76,350,725.58	-125,618,800.74

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	2,561,848.90	-12,676,798.60	-10,114,949.70
本期利润	-10,580,463.19	-1,474,613.36	-12,055,076.55
本期基金份额交易产生的变动数	-2,700.12	3,271,582.35	3,268,882.23

其中：基金申购款	2,845.17	-78,614.46	-75,769.29
基金赎回款	-5,545.29	3,350,196.81	3,344,651.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,021,314.41	-10,879,829.61	-18,901,144.02

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	193,395.88	
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	60,366.12	
其他	2,829.63	
合计	256,591.63	

#### 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	1,800,785,803.10	
减：卖出股票成本总额	1,882,312,128.21	
减：交易费用	5,020,578.44	
买卖股票差价收入	-86,546,903.55	

#### 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
股票投资产生的股利收益	4,957,517.49	
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	4,957,517.49	

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
1.交易性金融资产	-12,847,424.73	

——股票投资	-12,847,424.73
——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	-
合计	-12,847,424.73

#### 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 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	26,283.01
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	386.00
账户管理费	4,500.00
合计	90,676.38

#### 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”	本集合计划管理人、销售机构



资管”)	
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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	3,360,958,709.54	100.00%	2,653,202,162.39	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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	2,257,561.38	100.00%	463,892.96	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	1,945,375.25	3,767,870.19
其中：支付销售机构的客户维护费	942,243.96	1,992,246.99

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。

（3）于本报告期，本集合计划管理人收取的以上业绩报酬为人民币 51,425.64 元。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	568,184.87	1,130,361.13

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 2023年1月1日至2023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	-	149,306.65	149,306.65
合计	-	149,306.65	149,306.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：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。

### 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固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固有资金投资本集合计划的情况。

##### 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

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

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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	146,366,615.70	193,395.88	54,443,702.54	147,594.50

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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 广发资管平衡精选一年持有混合 A

本报告期内未进行利润分配。

##### 广发资管平衡精选一年持有混合 C

本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	66.00	1,843.38	2,179.98	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	2,137.00	20,515.20	20,109.17	2023-06-16 除权除息，派息比例 0.3500（含税）
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	465.00	5,524.20	9,774.30	2023-06-01 除权除息，派息比例 0.1420（含税）
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	73.00	1,378.24	1,430.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	111.00	2,295.48	2,829.39	2023-06-28 除权除息，派息比例 0.6000（含税）
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	122.00	1,876.36	1,814.14	-
00136	海森	2023-0	6个月	新股	44.48	39.48	40.00	1,779.	1,579.	-

7	药业	3-30		流通受限				20	20	
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	86.00	2,480.24	2,647.08	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	134.00	5,688.30	4,417.98	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	172.00	7,086.40	7,342.68	2023-06-13 除权除息, 派息比例 0.2000 (含税)
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	103.00	5,819.50	5,451.79	2023-05-31 除权除息, 派息比例 0.2000 (含税)
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	199.00	6,766.00	6,951.07	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内	新股流通受限	25.82	25.82	2,302.00	59,437.64	59,437.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	256.00	6,609.92	6,609.92	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	135.00	6,227.55	4,644.00	2023-06-02 除权除息, 派息比例 1.5000 (含税)
30121	金杨	2023-0	6 个月	新股	57.88	49.17	127.00	7,350.	6,244.	-

0	股份	6-21		流通受限				76	59	
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	35.66	33.26	198.00	7,060.68	6,585.48	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	127.00	9,207.50	7,419.34	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	664.00	33,200.00	20,391.44	2023-06-06 除权除息, 派息比例 0.1000 (含税)
301260	格力博	2023-01-20	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,352.00	41,709.20	31,947.76	2023-06-07 除权除息, 派息比例 0.0617 (含税)
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内	新股流通受限	36.90	36.90	1,575.00	58,117.50	58,117.50	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	30.22	25.50	532.00	16,077.04	13,566.00	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	219.00	6,892.08	5,496.90	2023-05-26 除权除息, 派息比例 0.4000 (含税), 送转比例 0.4000
30129	明阳	2023-0	6 个月	新股	38.13	31.03	727.00	27,720	22,558	-



1	电气	6-21		流通受限				.51	.81	
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内	新股流通受限	19.99	19.99	3,750.00	74,962.50	74,962.50	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	262.00	7,755.20	18,712.04	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	37.40	36.07	128.00	4,787.20	4,616.96	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	891.00	23,878.80	19,887.12	2023-06-07 除权除息, 派息比例 0.2200 (含税)
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	702.00	17,725.50	13,822.38	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	177.00	5,715.33	9,048.24	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	333.00	4,348.98	6,866.46	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	321.00	28,057.54	17,090.04	2023-05-25 除权除息, 派息比例 0.9000 (含税), 送转比例 0.5000
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	193.00	7,538.58	7,596.48	-
30132	曼恩	2023-0	6 个月	新股	76.80	107.95	310.00	23,808	33,464	-

5	斯特	5-04		流通受限				.00	.50	
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,066.00	15,787.46	14,636.18	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	158.00	5,150.80	4,798.46	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	234.00	17,187.30	10,913.76	2023-06-16 除权除息, 派息比例 1.5000 (含税)
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	416.00	7,300.80	6,968.00	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	951.00	22,605.27	40,788.39	2023-05-19 除权除息, 派息比例 0.3980 (含税)
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	89.00	6,397.32	8,241.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	196.00	6,611.08	6,242.60	2023-05-17 除权除息, 派息比例 0.3000 (含税)
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	292.00	6,949.60	9,589.28	-
30138	天键	2023-0	6 个月	新股	46.16	35.72	303.00	13,986	10,823	-

3	股份	5-31		流通受限				.48	.16	
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	255.00	7,647.45	6,066.45	2023-05-24 除权除息, 派息比例 0.4000 (含税)
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	58.32	45.36	167.00	9,739.44	7,575.12	2023-06-19 除权除息, 派息比例 0.3500 (含税)
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内	新股流通受限	26.68	26.68	3,066.00	81,800.88	81,800.88	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.68	26.68	341.00	9,097.88	9,097.88	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	249.00	13,264.23	10,009.80	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	225.00	9,897.75	11,603.25	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	579.00	9,402.96	9,814.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	141.00	3,496.80	6,182.85	2023-06-01 除权除息, 派息比例 0.5000 (含税)
30142	世纪	2023-0	6 个月	新股	26.35	30.60	152.00	4,005.	4,651.	-

8	恒通	5-10		流通受限				20	20	
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	28.75	21.02	246.00	7,072.50	5,170.92	2023-06-01 除权除息，派息比例 0.2540（含税）
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	949.00	18,970.51	16,038.10	2023-06-16 除权除息，派息比例 0.1500（含税）
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内	新股流通受限	57.66	57.66	3,219.00	185,607.54	185,607.54	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内	新股流通受限	39.78	39.78	1,741.00	69,256.98	69,256.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	194.00	7,717.32	7,717.32	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,790.00	11,778.20	13,568.20	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	702.00	7,272.72	8,311.68	2023-06-19 除权除息，派息比例 0.0780（含税）
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	663.00	7,730.58	8,128.38	2023-06-08 除权除息，

										派息比例 0.1450 (含税)
60313 5	中重 科技	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	539.00	9,594. 20	9,642. 71	-
60313 7	恒尚 节能	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	15.90	17.09	67.00	1,065. 30	1,145. 03	-
60317 2	万丰 股份	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	14.58	16.13	60.00	874.80	967.80	-
68814 6	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	547.00	19,774 .05	20,857 .11	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	1,811. 00	35,966 .46	32,706 .66	-
68833 4	西高 院	2023-0 6-09	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	656.00	9,288. 96	10,633 .76	-
68835 2	顾中 科技	2023-0 4-11	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	1,551. 00	18,767 .10	18,720 .57	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	514.00	12,130 .40	33,240 .38	-
68842 9	时创 能源	2023-0 6-20	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	289.00	5,548. 80	7,378. 17	-
68843 3	华曙 高科	2023-0 4-07	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	360.00	9,597. 60	11,340 .00	-
68845 8	美芯 晟	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	75.00	90.76	212.00	15,900 .00	19,241 .12	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	6,533. 00	37,172 .77	35,343 .53	-
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	2,061. 00	22,877 .10	35,119 .44	-

688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	303.00	10,298.97	8,935.47	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	155.00	25,783.80	18,927.05	2023-06-20 除权除息, 派息比例 0.1500 (含税), 送转比例 0.4800
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	655.00	13,702.60	12,549.80	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	382.00	8,350.52	9,110.70	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	192.00	29,256.96	26,106.24	2023-06-15 除权除息, 派息比例 0.3000 (含税)
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	108.00	3,780.00	5,532.84	-
688539	高华科技	2023-04-11	6 个月	新股流通受限	38.22	43.49	4,918.00	187,965.96	213,883.82	2023-06-20 除权除息, 派息比例 0.3000 (含税)
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	409.00	17,861.03	21,697.45	-

688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	769.00	16,279.73	18,071.50	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	609.00	7,722.12	13,586.79	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	612.00	18,519.12	15,501.96	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	200.00	27,160.00	24,082.00	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	149.00	18,744.20	17,586.47	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	588.00	15,723.12	23,919.84	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内	新股流通受限	55.00	55.00	877.00	48,235.00	48,235.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	689.00	7,358.52	8,502.26	-
688623	二元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	137.00	17,245.56	11,890.23	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	482.00	4,463.32	8,960.38	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	328.00	8,291.84	9,797.36	-

注：截至本报告期末 2023 年 6 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 2023 年 6 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 2023 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 2023 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 2023 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、存出保证金和买入返售金融资产等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本集合计划的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，受市场利率变动影响较小。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	146,356,341.80	-	-	10,273.90	146,366,615.70
结算备付金	1,450,306.98	-	-	649.40	1,450,956.38
存出保证金	314,191.38	-	-	141.40	314,332.78
交易性金融资产	-	-	-	388,927,649.73	388,927,649.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,854.30	2,854.30
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	148,120,840.16	-	-	388,941,568.73	537,062,408.89
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	-	-	-	7,915,617.56	7,915,617.56
应付赎回款	-	-	-	870,348.98	870,348.98
应付管理人报酬	-	-	-	270,805.27	270,805.27

应付托管费	-	-	-	81,241.56	81,241.56
应付销售服务费	-	-	-	33,322.96	33,322.96
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	549,683.34	549,683.34
负债总计	-	-	-	9,721,019.67	9,721,019.67
利率敏感度缺口	148,120,840.16	-	-	379,220,549.06	527,341,389.22
<b>上年度末 2022 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	125,909,247.76	-	-	9,974.24	125,919,222.00
结算备付金	46,588,728.42	-	-	2,449.63	46,591,178.05
存出保证金	197,091.52	-	-	88.70	197,180.22
交易性金融资产	-	-	-	725,868,272.05	725,868,272.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	235,562.75	235,562.75
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	172,695,067.70	-	-	726,116,347.37	898,811,415.07
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	93,770,344.75	93,770,344.75
应付赎回款	-	-	-	2,795,801.96	2,795,801.96

应付管理人报酬	-	-	-	416,112.10	416,112.10
应付托管费	-	-	-	124,763.71	124,763.71
应付销售服务费	-	-	-	52,116.13	52,116.13
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,097,423.37	1,097,423.37
负债总计	-	-	-	98,256,562.02	98,256,562.02
利率敏感度缺口	172,695,067.70	-	-	627,859,785.35	800,554,853.05

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

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

注：本集合计划于 2023 年 6 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 2023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	-	-	-
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	92,559,195.81	92,559,195.81
衍生金融资产	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-
应收清算款	-	-	-
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>-</b>	<b>92,559,195.81</b>	<b>92,559,195.81</b>
<b>以外币计价的负债</b>			
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	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-
应付托管费	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-
应交税费	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	-	-
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>-</b>	<b>92,559,195.81</b>	<b>92,559,195.81</b>
<b>项目</b>	<b>上年度末</b>		
	<b>2022年12月31日</b>		
	<b>美元</b>	<b>港币</b>	<b>合计</b>
	<b>折合人民币</b>	<b>折合人民币</b>	
<b>以外币计价的资产</b>			
银行存款	-	-	-
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	340,323,716.61	340,323,716.61
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-
应收清算款	-	-	-
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
<b>资产合计</b>	-	<b>340,323,716.61</b>	<b>340,323,716.61</b>
<b>以外币计价的负债</b>			
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	-	-	-
应付清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-
应付托管费	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-
应交税费	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	-	-
<b>负债合计</b>	-	-	-
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	-	<b>340,323,716.61</b>	<b>340,323,716.61</b>

#### 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
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	4,627,959.79	17,016,185.83
	所有外币相对人民币贬值 5%	-4,627,959.79	-17,016,185.83

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	388,927,649.73	73.75	725,868,272.05	90.67
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	388,927,649.73	73.75	725,868,272.05	90.67

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	各板块市场指数上涨 5%	22,443,828.98	53,174,971.24
各板块市场指数下跌 5%	-22,443,828.98	-53,174,971.24	

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
---------------	-----

	2023 年 6 月 30 日
第一层次	387,085,220.78
第二层次	600,843.16
第三层次	1,241,585.79
合计	388,927,649.73

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，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投资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，确定相关投资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	388,927,649.73	72.42
	其中：股票	388,927,649.73	72.42
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	147,817,572.08	27.52
8	其他各项资产	317,187.08	0.06
9	合计	537,062,408.89	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 92,559,195.81 元，占集合计划资产净值比例 17.55%。

## 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	-	-
C	制造业	113,217,997.51	21.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,109.17	0.00
E	建筑业	9,273.41	0.00
F	批发和零售业	33,156.55	0.01
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	151,146,493.71	28.66
J	金融业	25,242,215.00	4.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,640,389.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	21,641.15	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	18,466.38	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,712.04	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	296,368,453.92	56.20

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
非日常生活消费品	33,249,423.06	6.31
日常消费品	13,177,168.00	2.50
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
通信服务	46,132,604.75	8.75
信息技术	-	-
合计	92,559,195.81	17.55

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	002230	科大讯飞	525,221.00	35,694,019.16	6.77
2	002555	三七互娱	818,100.00	28,535,328.00	5.41
3	00700	腾讯控股	83,975.00	25,673,676.75	4.87
4	03690	美团-W	183,000.00	20,635,080.00	3.91
5	01024	快手-W	414,400.00	20,458,928.00	3.88
6	600519	贵州茅台	10,600.00	17,924,600.00	3.40
7	600612	老凤祥	227,800.00	15,918,664.00	3.02
8	002841	视源股份	229,500.00	15,339,780.00	2.91
9	603345	安井食品	103,300.00	15,164,440.00	2.88
10	600276	恒瑞医药	311,800.00	14,935,220.00	2.83
11	300803	指南针	286,100.00	13,901,599.00	2.64
12	09992	泡泡玛特	785,451.00	12,614,343.06	2.39
13	603444	吉比特	25,600.00	12,572,416.00	2.38
14	300002	神州泰岳	887,600.00	12,426,400.00	2.36
15	002624	完美世界	700,800.00	11,836,512.00	2.24
16	300033	同花顺	64,700.00	11,340,616.00	2.15
17	00291	华润啤酒	224,000.00	10,655,680.00	2.02
18	600446	金证股份	644,800.00	9,375,392.00	1.78
19	600326	西藏天路	1,181,500.0	7,951,495.00	1.51

			0		
20	002517	恺英网络	474,200.00	7,463,908.00	1.42
21	300058	蓝色光标	686,700.00	6,640,389.00	1.26
22	600570	恒生电子	123,400.00	5,465,386.00	1.04
23	600398	海澜之家	775,100.00	5,332,688.00	1.01
24	300308	中际旭创	35,900.00	5,293,455.00	1.00
25	300496	中科创达	53,600.00	5,164,360.00	0.98
26	300634	彩讯股份	192,037.00	5,069,776.80	0.96
27	300042	朗科科技	132,300.00	5,064,444.00	0.96
28	688088	虹软科技	116,236.00	4,969,089.00	0.94
29	688369	致远互联	88,843.00	4,913,017.90	0.93
30	300459	汤姆猫	752,100.00	4,881,129.00	0.93
31	688036	传音控股	21,466.00	3,155,502.00	0.60
32	003029	吉大正元	82,800.00	2,686,860.00	0.51
33	000999	华润三九	43,400.00	2,632,644.00	0.50
34	02367	巨子生物	78,600.00	2,521,488.00	0.48
35	000977	浪潮信息	46,400.00	2,250,400.00	0.43
36	688582	芯动联科	5,875.00	271,615.79	0.05
37	301291	明阳电气	7,268.00	235,795.41	0.04
38	688539	高华科技	4,918.00	213,883.82	0.04
39	301486	致尚科技	3,219.00	185,607.54	0.04
40	301395	仁信新材	3,407.00	90,898.76	0.02
41	688429	时创能源	2,881.00	82,416.57	0.02
42	301488	豪恩汽电	1,935.00	76,974.30	0.01
43	301292	海科新源	3,750.00	74,962.50	0.01
44	301202	朗威股份	2,558.00	66,047.56	0.01
45	301210	金杨股份	1,264.00	64,606.80	0.01
46	301261	恒工精密	1,575.00	58,117.50	0.01
47	688603	天承科技	877.00	48,235.00	0.01
48	301358	湖南裕能	951.00	40,788.39	0.01
49	688469	中芯集成-U	6,533.00	35,343.53	0.01
50	688472	阿特斯	2,061.00	35,119.44	0.01
51	301325	曼恩斯特	310.00	33,464.50	0.01
52	688361	中科飞测-U	514.00	33,240.38	0.01
53	688249	晶合集成	1,811.00	32,706.66	0.01
54	301260	格力博	1,352.00	31,947.76	0.01
55	688531	日联科技	192.00	26,106.24	0.00
56	688576	西山科技	200.00	24,082.00	0.00
57	688543	国科军工	409.00	21,697.45	0.00
58	301301	川宁生物	2,361.00	21,154.56	0.00
59	688146	中船特气	547.00	20,857.11	0.00
60	301246	宏源药业	664.00	20,391.44	0.00
61	001286	陕西能源	2,137.00	20,109.17	0.00
62	301303	真兰仪表	891.00	19,887.12	0.00

63	688458	美芯晟	212.00	19,241.12	0.00
64	688507	索辰科技	155.00	18,927.05	0.00
65	688352	颀中科技	1,551.00	18,720.57	0.00
66	301293	三博脑科	262.00	18,712.04	0.00
67	688552	航天南湖	769.00	18,071.50	0.00
68	688581	安杰思	149.00	17,586.47	0.00
69	301322	绿通科技	321.00	17,090.04	0.00
70	301439	泓淋电力	949.00	16,038.10	0.00
71	688570	天玛智控	612.00	15,501.96	0.00
72	301332	德尔玛	1,066.00	14,636.18	0.00
73	301305	朗坤环境	702.00	13,822.38	0.00
74	688562	航天软件	609.00	13,586.79	0.00
75	601061	中信金属	1,790.00	13,568.20	0.00
76	301262	海看股份	532.00	13,566.00	0.00
77	688512	慧智微-U	655.00	12,549.80	0.00
78	688623	双元科技	137.00	11,890.23	0.00
79	301399	英特科技	225.00	11,603.25	0.00
80	688433	华曙高科	360.00	11,340.00	0.00
81	301297	富乐德	489.00	11,007.39	0.00
82	301345	涛涛车业	234.00	10,913.76	0.00
83	301383	天键股份	303.00	10,823.16	0.00
84	688334	西高院	656.00	10,633.76	0.00
85	301397	溯联股份	249.00	10,009.80	0.00
86	301408	华人健康	579.00	9,814.05	0.00
87	688631	莱斯信息	328.00	9,797.36	0.00
88	001287	中电港	465.00	9,774.30	0.00
89	603135	中重科技	539.00	9,642.71	0.00
90	301382	蜂助手	292.00	9,589.28	0.00
91	688523	航天环宇	382.00	9,110.70	0.00
92	301315	威士顿	177.00	9,048.24	0.00
93	688629	华丰科技	482.00	8,960.38	0.00
94	688479	友车科技	303.00	8,935.47	0.00
95	688620	安凯微	689.00	8,502.26	0.00
96	601065	江盐集团	702.00	8,311.68	0.00
97	301360	荣旗科技	89.00	8,241.40	0.00
98	601133	柏诚股份	663.00	8,128.38	0.00
99	301323	新莱福	193.00	7,596.48	0.00
100	301387	光大同创	167.00	7,575.12	0.00
101	301232	飞沃科技	127.00	7,419.34	0.00
102	301141	中科磁业	172.00	7,342.68	0.00
103	301355	南王科技	416.00	6,968.00	0.00
104	301170	锡南科技	199.00	6,951.07	0.00
105	301320	豪江智能	333.00	6,866.46	0.00
106	301225	恒勃股份	198.00	6,585.48	0.00

107	301373	凌玮科技	196.00	6,242.60	0.00
108	301419	阿莱德	141.00	6,182.85	0.00
109	301386	未来电器	255.00	6,066.45	0.00
110	688535	华海诚科	108.00	5,532.84	0.00
111	301281	科源制药	219.00	5,496.90	0.00
112	301157	华塑科技	103.00	5,451.79	0.00
113	301429	森泰股份	246.00	5,170.92	0.00
114	301337	亚华电子	158.00	4,798.46	0.00
115	301428	世纪恒通	152.00	4,651.20	0.00
116	301203	国泰环保	135.00	4,644.00	0.00
117	301295	美硕科技	128.00	4,616.96	0.00
118	300804	广康生化	134.00	4,417.98	0.00
119	001328	登康口腔	111.00	2,829.39	0.00
120	001380	华纬科技	86.00	2,647.08	0.00
121	001282	三联锻造	66.00	2,179.98	0.00
122	001360	南矿集团	122.00	1,814.14	0.00
123	001367	海森药业	40.00	1,579.20	0.00
124	001324	长青科技	73.00	1,430.80	0.00
125	603137	恒尚节能	67.00	1,145.03	0.00
126	603172	万丰股份	60.00	967.80	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	01024	快手-W	53,295,515.90	6.66
2	00700	腾讯控股	48,425,034.21	6.05
3	03690	美团-W	46,427,657.52	5.80
4	002624	完美世界	45,315,418.55	5.66
5	06098	碧桂园服务	42,872,207.81	5.36
6	002230	科大讯飞	36,509,564.22	4.56
7	600570	恒生电子	29,597,230.56	3.70
8	00291	华润啤酒	28,530,602.05	3.56
9	09992	泡泡玛特	27,945,840.53	3.49
10	300896	爱美客	27,522,568.60	3.44
11	600276	恒瑞医药	25,256,294.37	3.15
12	02269	药明生物	24,785,530.25	3.10
13	300418	昆仑万维	24,203,680.24	3.02
14	002304	洋河股份	23,994,891.00	3.00

15	002311	海大集团	23,954,078.00	2.99
16	300059	东方财富	23,756,010.03	2.97
17	002236	大华股份	23,197,448.43	2.90
18	603444	吉比特	22,796,908.00	2.85
19	002555	三七互娱	22,377,222.00	2.80
20	01951	锦欣生殖	21,583,698.51	2.70
21	300957	贝泰妮	20,444,454.24	2.55
22	600809	山西汾酒	19,606,281.00	2.45
23	300033	同花顺	19,059,924.00	2.38
24	603108	润达医疗	18,388,484.40	2.30
25	300474	景嘉微	18,335,147.00	2.29
26	300724	捷佳伟创	18,071,062.67	2.26
27	300803	指南针	17,284,804.00	2.16
28	002463	沪电股份	17,032,002.76	2.13
29	000333	美的集团	16,880,128.00	2.11
30	002841	视源股份	16,876,823.00	2.11
31	600612	老凤祥	16,855,868.00	2.11
32	601360	三六零	16,453,316.29	2.06
33	688041	海光信息	16,295,837.07	2.04

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	03690	美团-W	76,249,968.69	9.52
2	00700	腾讯控股	68,617,609.99	8.57
3	06098	碧桂园服务	66,827,925.56	8.35
4	00291	华润啤酒	56,645,753.18	7.08
5	000568	泸州老窖	53,208,363.00	6.65
6	09922	九毛九	47,885,431.21	5.98
7	002271	东方雨虹	46,265,012.56	5.78
8	09992	泡泡玛特	38,271,360.52	4.78
9	600519	贵州茅台	35,758,122.00	4.47
10	601636	旗滨集团	34,881,083.18	4.36
11	01024	快手-W	33,316,203.37	4.16
12	600036	招商银行	31,960,021.00	3.99
13	002624	完美世界	31,387,921.69	3.92

14	600809	山西汾酒	30,716,915.71	3.84
15	000002	万科 A	30,401,773.00	3.80
16	600859	王府井	29,426,216.00	3.68
17	603345	安井食品	27,897,132.00	3.48
18	000001	平安银行	23,863,326.04	2.98
19	603899	晨光股份	23,109,104.00	2.89
20	300418	昆仑万维	23,026,815.84	2.88
21	300896	爱美客	22,651,671.00	2.83
22	002304	洋河股份	21,534,165.92	2.69
23	002311	海大集团	21,265,252.35	2.66
24	02269	药明生物	20,412,649.87	2.55
25	600570	恒生电子	20,393,883.90	2.55
26	300059	东方财富	20,377,655.29	2.55
27	002236	大华股份	19,429,289.00	2.43
28	002463	沪电股份	17,951,326.79	2.24
29	300957	贝泰妮	17,483,398.44	2.18
30	000333	美的集团	17,296,831.00	2.16
31	300724	捷佳伟创	17,175,429.00	2.15
32	002791	坚朗五金	17,149,859.73	2.14
33	688111	金山办公	17,067,176.17	2.13
34	01951	锦欣生殖	16,729,515.72	2.09
35	601360	三六零	16,098,827.00	2.01

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,558,030,751.64
卖出股票收入（成交）总额	1,800,785,803.10

#### 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中，三七互娱实际控制人李卫伟先生和公司副董事长曾开天 2023 年 6 月 27 日收到中国证监会下发《立案告知书》：因涉嫌信息披露违法违规，证监会决定对公司、李卫伟和曾开天立案。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。

除上述前十名证券发行主体公告信息之外，本集合计划的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 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	314,332.78
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-



5	应收申购款	2,854.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	317,187.08

#### 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	11,790	39,756.29	1,128,583.46	0.24%	467,598,096.63	99.76%
广发资管平衡精选一年持有混合 C	2,770	24,123.01	88,129.02	0.13%	66,732,610.19	99.87%
合计	14,435	37,100.62	1,216,712.48	0.23%	534,330,706.82	99.77%

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	614,963.23	0.13%
	广发资管平衡精选一年持有混合 C	639,009.37	0.96%
	合计	1,253,972.60	0.23%

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	0~10
	广发资管平衡精选一年持有混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发资管平衡精选一年持有混合 A	10~50
	广发资管平衡精选一年持有混合 C	50~100
	合计	>100

### §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
基金合同生效日（2020 年 11 月 30 日）基金份额总额	41,624,414.07	-
本报告期期初基金份额总额	606,767,355.12	88,156,068.46
本报告期基金总申购份额	1,208,849.50	466,403.84
减：本报告期基金总赎回份额	139,249,524.53	21,801,733.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	468,726,680.09	66,820,739.21

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，本集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期内未发生改聘会计师事务所的情形。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.6.2 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	3,360,958,709.54	100.00%	2,257,561.38	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	关于旗下部分集合资产管理计划 2023 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	2023-01-04
2	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 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20
3	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2022 年第四季度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-01-20
4	广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-03-29
5	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2022 年年度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-03-29
6	关于调整旗下部分集合资产管理计划 2023 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	基金电子披露网站及管理人网站	2023-04-12
7	广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-04-21
8	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2023 年第一季度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-04-21
9	关于调整旗下部分集合资产管理计划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、管理人网站	2023-07-18
10	广发资管平衡精选一年持有混合型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-07-20
11	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2023 年第二季度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-07-20

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，除已公告信息外，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《关于准予广发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](http://www.gfam.com.cn)。

广发证券资产管理（广东）有限公司

二〇二三年八月二十五日