

# 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

## 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：招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。

集合计划托管人招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 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 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	6
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	12
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	13
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	13
<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	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39

7.12 本报告期投资基金情况 .....	39
7.13 投资组合报告附注 .....	43
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>47</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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	148,576,447.52 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。	
下属分级基金的基金简称	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
下属分级基金的交易代码	870004	872030
报告期末下属分级基金的份额总额	141,174,760.91 份	7,401,686.61 份

### 2.2 基金产品说明

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，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。本集合计划对内地股票及港股通标的股票主要通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。
业绩比较基准	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%。
风险收益特征	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。 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。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孔维成	张姗
	联系电话	020-66336029	0755-83077987
	电子邮箱	xuyz@gf.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95575	95555
传真		020-87553363	0755-83195201
注册地址		珠海横琴新区荣珠道191号写字楼2005房	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510075	518040
法定代表人		秦力	缪建民

## 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	广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

3.1.4 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
本期已实现收益	613,423.08	23,364.17
本期利润	1,274,662.97	62,437.95
加权平均基金份额本期利润	0.0086	0.0075
本期加权平均净值利润率	0.85%	0.75%
本期基金份额净值增长率	0.83%	0.62%
<b>3.1.5 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	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
期末可供分配利润	57,833,654.84	-82,049.15
期末可供分配基金份额利润	0.4097	-0.0111
期末基金资产净值	141,946,039.53	7,409,388.38
期末基金份额净值	1.0055	1.0010
<b>3.1.6 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	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
基金份额累计净值增长率	0.55%	0.10%

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

广发资管智荟广易六个月持有期混合 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	0.53%	0.23%	0.93%	0.21%	-0.40%	0.02%
过去三个月	-0.93%	0.22%	0.26%	0.21%	-1.19%	0.01%
过去六个月	0.83%	0.26%	1.80%	0.21%	-0.97%	0.05%
过去一年	-1.35%	0.27%	0.11%	0.25%	-1.46%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.55%	0.26%	2.12%	0.27%	-1.57%	-0.01%

广发资管智荟广易六个月持有期混合 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	0.49%	0.23%	0.93%	0.21%	-0.44%	0.02%
过去三个月	-1.04%	0.22%	0.26%	0.21%	-1.30%	0.01%
过去六个月	0.62%	0.26%	1.80%	0.21%	-1.18%	0.05%
过去一年	-1.75%	0.27%	0.11%	0.25%	-1.86%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.26%	2.12%	0.27%	-2.02%	-0.01%

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  
 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

（2022 年 4 月 11 日至 2023 年 6 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：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符合合同（第十二部分）的有关约定。

## §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		
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	-	16 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	-	3 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：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。

#### 4.2 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

上半年宏观主要有两条重要线索：第一条线，中国的经济复苏乏力；第二条线，美国的经济韧性十足。具体来看，疫情放开以后，上半年的中国经济经历了强预期和弱现实的对冲，甚至当前市场开始担忧核心 CPI 持续低位的情况；反观美国，美联储加息速度为过去四十年最快，但上半年的经济没有出现衰退，且韧性十足，以至于当前的市场对美国经济后续“软着陆”还抱有很大的期望。

2023 年上半年 A 股冲高回落，指数区间震荡。从结构上来讲，板块极端分化，涨幅靠前的板块主要是人工智能和中特估：受益于 AI 产业的催化，人工智能相关个股出现大幅度上涨，通信、传媒、计算机都出现明显上涨；中特估受益于政策催化表现同样突出，建筑装饰、石油石化收益上涨。跌幅较大的板块集中在地产链、消费和电新，其中房地产、食品饮料、电力设备出现明显下跌。

操作上，我们上半年做好的方面是捕捉到一部分 AI 主题的行市；做的不好的方面是医药以及互联网持仓收益对组合有所拖累。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划的净值数据和同期业绩比较基准数据详见本报告“3 主要财务指标和基金净值表现”的披露内容。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管当前经济仍疲软，但我们对后市并不悲观，认为下半年没有太大风险：政策方面，7 月的政治局会议给大家比较强的信心，市场政策面可能见底，预计未来会有更多政策逐步出台；流动性方面，二季度经济数据低于市场预期，市场流动性大概率继续保持宽松。

市场结构方面，我们认为 2023 年下半年存在机会的方向如下：

首先是顺周期方向，看好有色行业，原因是工业金属供给端还是有约束的，库存也比较低，产能很难扩出来。看好大金融，大金融整体性价比较高，估值处于历史较低位置。证券行业估值不贵，政策对增加资本市场的活跃性也会有所支持。银行基本面最差的时候过去了，未来有望受益于稳增长政策。

其次是科技成长方向，看好电子行业，半导体有库存触底的逻辑。看好计算机行业 To B 和 To G 的方向。从年初至今来看，计算机里面表现比较好的基本是 To C 的方向，因为这个方向与 AI 的结合更快，也给市场带来更多的想象力。但是展望下半年或明年，To B 和 To G 方向可能会有更好的表现，To B 的方向我们主要关注工业软件，To G 的方向我们会更多关注泛信创相关的领域。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,737,684.99	12,103,618.92
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	132,301,028.93	151,208,938.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		132,301,028.93	151,208,938.00
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		4,000,000.00	-
应收股利		-	4,612.65
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		150,038,713.92	163,317,169.57
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付赎回款		494,914.94	80,291.47
应付管理人报酬		98,885.33	111,225.74
应付托管费		10,654.14	12,138.77
应付销售服务费		2,464.08	3,094.70
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	76,367.52	34,000.00
负债合计		683,286.01	240,750.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	91,514,071.30	101,135,764.93
未分配利润	6.4.7.8	57,841,356.61	61,940,653.96
净资产合计		149,355,427.91	163,076,418.89
负债和净资产总计		150,038,713.92	163,317,169.57

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，本集合计划 A 类份额净值人民币 1.0055 元，份额总额 141,174,760.91 份；C 类份额净值人民币 1.0010 元，份额总额 7,401,686.61 份；集合计划份额总额 148,576,447.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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 4 月 11 日（基 金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,131,565.39	2,249,615.16
1.利息收入		47,380.21	24,181.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	47,380.21	24,181.35
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）		1,383,871.51	316,843.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	384,335.62	15,819.61
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	999,535.89	301,023.40
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	700,313.67	1,908,590.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		794,464.47	219,039.52
1. 管理人报酬		627,499.12	186,970.33
2. 托管费		67,832.68	18,937.54
3. 销售服务费		16,612.86	0.56
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		4,626.53	1,602.95
8. 其他费用	6.4.7.19	77,893.28	11,528.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,337,100.92</b>	<b>2,030,575.64</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,337,100.92</b>	<b>2,030,575.64</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,337,100.92	2,030,575.64

注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 4 月 11 日，上年度可比期间不完整。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	101,135,764.93	61,940,653.96	163,076,418.89
二、本期期初净资产（基金净值）	101,135,764.93	61,940,653.96	163,076,418.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,621,693.63	-4,099,297.35	-13,720,990.98
（一）、综合收益总额	-	1,337,100.92	1,337,100.92
（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）	-9,621,693.63	-5,436,398.27	-15,058,091.90
其中：1.基金申购款	1,259.94	863.01	2,122.95
2.基金赎回款	-9,622,953.57	-5,437,261.28	-15,060,214.85
（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）	91,514,071.30	57,841,356.61	149,355,427.91
项目	上年度可比期间 2022 年 4 月 11 日（基金合同生效日）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）	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	62,796,337.41	42,591,395.41	105,387,732.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-817,275.71	1,466,903.70	649,627.99
（一）、综合收益总额	-	2,030,575.64	2,030,575.64
（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）	-817,275.71	-563,671.94	-1,380,947.65
其中：1.基金申购款	60,565.20	40,727.79	101,292.99
2.基金赎回款	-877,840.91	-604,399.73	-1,482,240.64
（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）	61,979,061.70	44,058,299.11	106,037,360.81

注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 4 月 11 日，上年度可比期间不完整。

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（以下简称“本集合计划”）原为广发增强型基金优选集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于 2007 年 2 月 9 日正式成立。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币 2,971,867,559.30 元（含利息转份额），折合 2,971,867,559.30 份集合计划份额，上述资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司审验。原集合计划原管理人为广发证券股份有限公司，后变更为广发证券资产管理（广东）有限公司，托管人为招商银行股份有限公司。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自 2022 年 4 月 11 日起，《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

产管理计划资产管理合同》生效，原《广发增强型基金优选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，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票及存托凭证（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、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、货币市场工具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。

#### 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	4,071,436.18
等于：本金	4,070,142.09
加：应计利息	1,294.09
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	9,666,248.81
等于：本金	9,665,380.41

加：应计利息	868.40
合计	13,737,684.99

注：其他存款为存放在证券经纪商集合计划专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 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		-	-	-	-
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		131,899,759.44	-	132,301,028.93	401,269.49
其他		-	-	-	-
合计		131,899,759.44	-	132,301,028.93	401,269.49

#### 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,367.52
合计	76,367.52

#### 6.4.7.7 实收基金

广发资管智荟广易六个月持有期混合 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	154,413,570.25	92,000,083.09
本期申购	2,113.09	1,258.95
本期赎回（以“-”号填列）	-13,240,922.43	-7,888,957.35
本期末	141,174,760.91	84,112,384.69

广发资管智荟广易六个月持有期混合 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	9,135,681.84	9,135,681.84
本期申购	0.99	0.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,733,996.22	-1,733,996.22
本期末	7,401,686.61	7,401,686.61

#### 6.4.7.8 未分配利润

广发资管智荟广易六个月持有期混合 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	88,795,014.09	-26,807,106.69	61,987,907.40
本期利润	613,423.08	661,239.89	1,274,662.97
本期基金份额交易产生的变动数	-7,660,716.97	2,231,801.44	-5,428,915.53
其中：基金申购款	1,219.91	-356.91	863.00
基金赎回款	-7,661,936.88	2,232,158.35	-5,429,778.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	81,747,720.20	-23,914,065.36	57,833,654.84

#### 广发资管智荟广易六个月持有期混合 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	-119,583.87	72,330.43	-47,253.44
本期利润	23,364.17	39,073.78	62,437.95
本期基金份额交易产生的变动数	14,170.55	-21,653.29	-7,482.74
其中：基金申购款	-0.01	0.02	0.01
基金赎回款	14,170.56	-21,653.31	-7,482.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-82,049.15	89,750.92	7,701.77

#### 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	35,592.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,786.27
结算备付金利息收入	-
其他	1.32
合计	47,380.21

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商集合计划专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本集合计划本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	129,856,963.88
减：卖出/赎回基金成本总额	129,312,114.52
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	38,554.50

减：交易费用	121,959.24
基金投资收益	384,335.62

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 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	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	999,535.89
合计	999,535.89

#### 6.4.7.15 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	700,313.67
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	700,313.67
——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	700,313.67

#### 6.4.7.16 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.17 持有基金产生的费用

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务	106,713.66

费（元）	
当期持有基金产生的应支付管理费 （元）	451,521.72
当期持有基金产生的应支付托管费 （元）	96,407.26

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。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 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	16,860.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,525.76
合计	77,893.28

#### 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

本集合计划本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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	本集合计划托管人、销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	本集合计划管理人母公司、销售机构

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 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未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 基金交易

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4月11日（基金合同生效日） 至2022年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券	178,893,070.41	100.00%	28,599,934.70	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 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	94,646.17	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年4月11日（基金合同生效日）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	13,984.57	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证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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年6月 30日	2022年4月11日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	627,499.12	186,970.33
其中：支付销售机构的客户维护费	308,728.10	86,894.25

注：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。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.8% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div 365$$

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中扣除本集合计划持有的管理人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所对应资产净值后的余额（若为负数，则取 0）

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。

#### 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4月11日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,832.68	18,937.54

注：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。本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div 365$$

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中扣除本集合计划持有的托管人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所对应资产净值后的余额（若为负数，则取 0）

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付给托管人。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	本期
------------	----

关联方名称	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	合计
广发证券	-	1.81	1.81
招商银行	-	16,596.65	16,596.65
合计	-	16,598.46	16,598.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年4月11日（基金合同生效日）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	合计
广发证券	-	0.56	0.56
合计	-	0.56	0.56

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 0.4%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.4% 的年费率计提，销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div 365$$

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

广发资管智荟广易六个月持有期混合 A

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

广发资管智荟广易六个月持有期混合 C

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年4月11日（基金合同生效日）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
招商银行-活期存款	4,071,436.18	35,592.62	8,323,436.93	23,997.23
广发证券-其他存款	9,666,248.81	11,786.27	284,851.16	184.02

注：本集合计划的活期存款由托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息，其他存款为存放在证券经纪商集合计划专用证券账户的证券交易结算资金，由广发证券保管，按约定利率计息。

#### 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及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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

报告期末（2023 年 6 月 30 日），本集合计划持有管理人关联方广发基金管理有限公司所管理的基金合计人民币 5,016,058.16 元，占本集合计划资产净值的比例为 3.36%；持有管理人关联方易方达基金管理有限公司所管理的基金合计人民币 23,119,127.84 元，占本集合计划资产净值的比例为 15.48%。

##### 6.4.10.8.2 当期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

项目	本期费用 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费	1,598.72	1,000.00

（元）		
当期交易基金产生的赎回费（元）	20,733.35	2,140.08
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	106,713.66	7,653.01
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	451,521.72	33,799.68
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	96,407.26	9,326.50
当期交易基金产生的交易费（元）	99,627.17	952.00
当期交易基金产生的转换费（元）	-	44,665.39

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。

#### 6.4.11 利润分配情况

广发资管智荟广易六个月持有期混合 A

本报告期内未发生利润分配。

广发资管智荟广易六个月持有期混合 C

本报告期内未发生利润分配。

#### 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

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证券。

#### 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基金中基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。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。本集合计划的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

##### 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招商银行，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	13,735,522.50	-	-	2,162.49	13,737,684.99
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	132,301,028.93	132,301,028.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,000,000.00	4,000,000.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,735,522.50	-	-	136,303,191.42	150,038,713.92

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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	494,914.94	494,914.94
应付管理人报酬	-	-	-	98,885.33	98,885.33
应付托管费	-	-	-	10,654.14	10,654.14
应付销售服务费	-	-	-	2,464.08	2,464.08
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	-	-	-	76,367.52	76,367.52
负债总计	-	-	-	683,286.01	683,286.01
利率敏感度缺口	13,735,522.50	-	-	135,619,905.41	149,355,427.91
<b>上年度末</b>					
<b>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	12,101,328.43	-	-	2,290.49	12,103,618.92
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	151,208,938.00	151,208,938.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	4,612.65	4,612.65
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,101,328.43	-	-	151,215,841.14	163,317,169.57

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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	80,291.47	80,291.47
应付管理人报酬	-	-	-	111,225.74	111,225.74
应付托管费	-	-	-	12,138.77	12,138.77
应付销售服务费	-	-	-	3,094.70	3,094.70
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	-	-	-	34,000.00	34,000.00
负债总计	-	-	-	240,750.68	240,750.68
利率敏感度缺口	12,101,328.43	-	-	150,975,090.46	163,076,418.89

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 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	其他币种 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	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日

	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

#### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	132,301,028.93	88.58	151,208,938.00	92.72
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	132,301,028.93	88.58	151,208,938.00	92.72

##### 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
	业绩比较基准上升 5%	6,129,246.13	4,030,988.09
业绩比较基准下跌 5%	-6,129,246.13	-4,030,988.09	

#### 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	132,301,028.93
第二层次	-
第三层次	-
合计	132,301,028.93

##### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	132,301,028.93	88.18
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	13,737,684.99	9.16
8	其他各项资产	4,000,000.00	2.67
9	合计	150,038,713.92	100.00

## 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

本集合计划本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 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。

## 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

本集合计划本报告期末未持有股票。

## 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

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

### 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

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

#### **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 本报告期投资基金情况**

##### **7.12.1 投资政策及风险说明**

## 1.投资政策：

本集合计划投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金(权益类资产比例不低于 60%)合计占集合计划资产的比例为 20%-65%(本集合计划投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%)。

本集合计划的主要投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、股票投资者策略、存托凭证投资策略、固定收益类投资策略、新股申购投资策略、现金类管理工具投资策略等。在资产配置上，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，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。对于基金投资，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。对于股票投资，本集合计划对内地股票及港股通标的股票主要通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。本集合计划投资存托凭证的策略依照上述上市交易的股票投资策略执行。在债券组合构建方面，主要将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、品种流动性的高低等因素。本集合计划将适度参与新股申购，以取得较低风险下的较高回报。此外，本集合计划将投资于现金、各类银行存款（包括但不限于同业存款、协议存款、通知存款、活期存款、一年以内（含一年）定期存款和大额存单等）等高流动性短期金融产品来保障资产的安全性和流动性。

本集合计划将按照相关法律法规和招募说明书的约定，遵循相关投资政策、投资限制和投资禁止要求，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。

## 2.风险说明

本集合计划为混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划，其预期风险收益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。

本集合计划主要面临的风险包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险、锁定持有期内不能赎回的风险、基金中基金运作的风险等。

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。

**7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

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	9,529,300. 11	9,994,329. 96	6.69	否
2	519782	交银裕隆 纯债债券 A	契约型开 放式	5,907,955. 77	7,744,148. 42	5.19	否
3	016049	华商甄选 回报混合 C	契约型开 放式	5,641,617. 90	7,549,613. 07	5.05	否
4	006320	易方达安 瑞短债债 券 C	契约型开 放式	6,829,027. 06	6,863,172. 20	4.60	是
5	512660	国泰中证 军工 ETF	契约型开 放式	6,000,000. 00	6,744,000. 00	4.52	否
6	110053	易方达安 源中短债 债券 A	契约型开 放式	5,351,253. 22	5,833,401. 14	3.91	是
7	011404	融通鑫新 成长混合 C	契约型开 放式	4,543,966. 76	5,694,499. 14	3.81	否
8	515900	博时央企 创新驱动 ETF	契约型开 放式	4,000,000. 00	5,544,000. 00	3.71	否
9	000403	工银纯债 债券 B	契约型开 放式	4,762,130. 20	5,511,689. 49	3.69	否
10	000032	易方达信 用债债券 A	契约型开 放式	4,681,928. 66	5,261,551. 43	3.52	是
11	005955	易方达鑫 转添利混 合 A	契约型开 放式	3,009,857. 74	5,161,003. 07	3.46	是
12	004672	华夏短债 债券 A	契约型开 放式	4,898,579. 13	5,157,713. 97	3.45	否
13	010145	格林中短 债债券 A	契约型开 放式	4,742,033. 38	5,126,612. 29	3.43	否
14	003949	兴全稳泰	契约型开	4,506,896.	5,103,158.	3.42	否

		债券 A	放式	24	61		
15	270049	广发纯债 债券 C	契约型开 放式	4,074,783. 23	5,016,058. 16	3.36	是
16	006646	添富短债 债券 A	契约型开 放式	4,493,670. 10	5,007,296. 59	3.35	否
17	014106	融通成长 30 灵活配 置混合 C	契约型开 放式	1,587,301. 59	4,009,523. 82	2.68	否
18	012940	中泰星元 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	1,688,088. 93	3,989,460. 57	2.67	否
19	511990	华宝添益 货币 A	契约型开 放式	39,346.00	3,934,442. 62	2.63	否
20	001388	中融新经 济混合 C	契约型开 放式	1,535,001. 95	3,559,669. 52	2.38	否
21	005577	交银丰晟 收益债券 A	契约型开 放式	2,759,735. 19	3,225,854. 46	2.16	否
22	018413	大成竞争 优势混合 C	契约型开 放式	1,898,244. 28	3,030,357. 17	2.03	否
23	008836	富国量化 对冲策略 三个月持 有期混合 C	契约型开 放式	2,732,100. 60	2,899,031. 95	1.94	否
24	519756	交银国企 改革灵活 配置混合 A	契约型开 放式	1,371,245. 71	2,467,556. 66	1.65	否
25	016858	国金量化 多因子股 票 C	契约型开 放式	990,834.7 8	2,052,018. 83	1.37	否
26	008173	兴全稳泰 债券 C	契约型开 放式	1,778,410. 44	1,998,044. 13	1.34	否
27	010761	华商甄选 回报混合 A	契约型开 放式	1,438,941. 01	1,936,239. 02	1.30	否
28	015208	信澳健康 中国混合 C	契约型开 放式	741,289.8 4	1,886,582. 64	1.26	否

### 7.13 投资组合报告附注

**7.13.1** 2022 年 11 月，建信基金管理有限责任公司因在过往年度基金销售业务中存在问题，收到中国证券监督管理委员会北京监管局《关于对建信基金管理有限责任公司采取出具警示函行政监管措施的决定》。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。

**7.13.2** 报告期内，本集合计划未投资股票。

#### 7.13.3 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	-
2	应收清算款	4,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,000,000.00

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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未持有股票。

## §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
广发资管智荟广易六个月持有期混合 A	722	195,532.91	2,131,719.73	1.51%	139,043,041.18	98.49%
广发资管智荟广易六个月持有期混合 C	63	117,487.09	-	-	7,401,686.61	100.00%
合计	784	189,510.77	2,131,719.73	1.43%	146,444,727.79	98.57%

### 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	广发资管智荟广易六个月持有期混合 A	99,816.27	0.07%
	广发资管智荟广易六个月持有期混合 C	100.99	0.00%
	合计	99,917.26	0.07%

注：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	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	广发资管智荟广易六个月持有期混合 A	0~10
	广发资管智荟广易六个月持有期混合 C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日（2022 年 4 月 11 日）基金份额总额	105,397,268.44	-
本报告期期初基金份额总额	154,413,570.25	9,135,681.84
本报告期基金总申购份额	2,113.09	0.99
减：本报告期基金总赎回份额	13,240,922.43	1,733,996.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	141,174,760.91	7,401,686.61

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

本报告期内未召开份额持有人大会。

### 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，无涉及本集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

本报告期内，无涉及本集合计划管理人的重大人事变动。

### 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

本报告期内本集合计划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

本报告期内本集合计划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	-	-	94,646.17	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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	178,893,070.41	100.00%

## 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	广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金	基金电子披露网站及管	2023-01-20

	中基金（FOF）集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	理人网站	
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	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2023-04-12
7	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 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 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。

### 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