

# 广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管 理计划

2024 年中期报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月二十八日

## § 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。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 5 月 7 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 2024 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>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
<b>§5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<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	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划
基金简称	广发资管价值增长灵活配置混合
基金主代码	871003
交易代码	871003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	393,303,790.47 份
基金合同存续期	自本集合合同变更生效日起至 2024 年 12 月 31 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动的资产配置和价值成长策略对股票进行投资布局，实现产品资产在管理期限内稳健增值。
投资策略	本集合计划将采用“自上而下”的分析方法，分析宏观经济的发展趋势，判断当前所处的经济周期阶段和货币政策变化的趋势，并利用当前股票市场的估值状况与国债收益率、利率变化趋势判断股票市场的估值合理程度，然后进行权益类资产与债券类资产、现金等大类资产之间的战略性配置。本集合计划将综合分析未来一段时间内各类资产的预期收益及风险特征，合理制定和调整股票、债券、现金等各类资产的配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% + 中债总指数收益率×30% + 恒生中国企业指数收益率×10%
风险收益特征	本集合计划为灵活配置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、货币市场基金，低于股票型基金，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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	蒋荣	方圆
	联系电话	020-66336614	95559
	电子邮箱	limingyang@gf.com.cn	fangy_20@bankcomm.com

客户服务电话	95575	95559
传真	020-87553363	021-62701216
注册地址	珠海横琴新区荣珠道191号写字 楼2005房	中国（上海）自由贸易试验区银 城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	510075	200336
法定代表人	秦力	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-38,064,391.13
本期利润	-5,004,097.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0125
本期加权平均净值利润率	-1.19%
本期基金份额净值增长率	-0.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	123,568,203.10
期末可供分配基金份额利润	0.3142
期末基金资产净值	430,848,424.10
期末基金份额净值	1.0955
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.91%

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

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	2.43%	0.60%	-1.80%	0.33%	4.23%	0.27%
过去三个月	3.11%	0.66%	0.17%	0.52%	2.94%	0.14%
过去六个月	-0.96%	0.91%	2.83%	0.64%	-3.79%	0.27%
过去一年	-14.53%	0.91%	-4.18%	0.63%	-10.35%	0.28%
过去三年	-32.01%	1.38%	-21.21%	0.77%	-10.80%	0.61%
自基金合同生效起至今	8.91%	1.38%	-5.20%	0.79%	14.11%	0.59%

#### 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

广发资管价值增长灵活配置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5月7日至2024年6月30日）



## §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证、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。

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2024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		
刘文靓	投资经理	2022-11-28	-	9 年	刘文靓女士，中国籍，硕士研究生，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任香港东英金融集团投资助理，千石资本行业研究员、投资经理，华安基金管理有限公司行业研究员，广发证券资产管理（广东）有限公司行业研究员、投资经理。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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

2024 年上半年，A 股市场整体先抑后扬，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，创业板下跌 10.99%，沪深 300 上涨 0.89%。二季度以来，国内经济环境有所疲软，主要指数有所调整。分析其原因，主要源于内外两方面原因：首先，5、6 月 PMI 落于 50 以下，6 月呈现需求偏弱拖累生产和企业采购，新订单-产成品反映经济动能转弱，新出口订单环比符合季节性，外需仍好于内需。其次，美联储停止加息的预期逐步形成，海外紧缩冲击最大的阶段实际已经过去，但降息拐点短期还未明确，恒生指数在外部环境得以改善的情况下，有所好转，还需进一步跟踪国内经济环境。

观察结构，短期维度，不乏企业在内循环中积极提升自己的产品力，提升市场份额，如半导体行业中设备厂商等，同时也有企业积极出海，降本增效，不断夯实中长期的发展，如家电、工程机械、船舶等行业龙头等。中期维度，进入高质量发展阶段，企业端在再投资和提高股东回报之间需要更为审慎的考量，龙头企业的竞争优势仍在加强，且未来有望进一步提升分红比例，提升股东回报。

各指数及行业当前的估值已接近历史极值附近，管理人判断市场已步入底部区域，下行空间较为有限，上行动力来自内外部环境的边际改善。本集合计划目前保持较中高仓位运作，持仓结构较为均衡，积极布局出海企业以及提升股东回报的企业，积极挖掘优势龙头企业以及未来有望成为龙头的企业。

##### 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

展望 2024 年下半年，国内外宏观经济情况、产业发展趋势以及提升股东回报是影响市场的核心变量。自上而下的策略选择产生了更强的作用力，自下而上的选股更需认真考虑企业端的成长以及股东回报。出海是个长周期的课题，许多企业在海外市场进一步夯实了自己的竞争力，逐步形成新的成长动能，虽然短期可能会受到关税等影响，但中国制造业优势仍然保持，管理人会持续积极挖掘。AI 产业的创新发展，从云端到终端，从生产工具到个人助手，作为生产工具，企业运用 AI 降本增效是个持续耕耘的过程，作为个人助手，如果在终端的创新可以满足用户需求，AI 个人助手有可能是爆发性的过程，后续还可以持续观察。

#### 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，集合计划托管人在广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害集合计划持有人利益的行为。

#### 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，广发证券资产管理（广东）有限公司在广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支、集合计划收益分配等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由广发证券资产管理（广东）有限公司编制并经托管人复核审查的有关广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	93,577,953.37	109,574,437.53
结算备付金		5,788,756.02	10,257,086.17
存出保证金		196,923.04	328,471.23
交易性金融资产	6.4.7.2	324,143,061.41	351,097,420.27
其中：股票投资		324,143,061.41	351,097,420.27
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		7,214,273.91	-
应收股利		841,034.23	-
应收申购款		2,357.65	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		431,764,359.63	471,257,415.20
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	20,103,733.67
应付赎回款		166,938.17	180,759.61
应付管理人报酬		424,298.67	459,984.97
应付托管费		63,644.81	68,997.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	595.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	261,053.88	410,322.61
负债合计		915,935.53	21,224,394.52
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	247,324,678.39	255,854,462.10
未分配利润	6.4.7.8	183,523,745.71	194,178,558.58
净资产合计		430,848,424.10	450,033,020.68
负债和净资产总计		431,764,359.63	471,257,415.20

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，本集合计划份额净值人民币 1.0955 元，份额总额 393,303,790.47

份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,024,846.09	9,594,783.63
1.利息收入		446,518.57	323,214.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	347,141.60	323,214.37
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		99,376.97	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-35,532,559.37	442,312.18
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-39,773,789.46	-3,915,854.94
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	4,241,230.09	4,358,167.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	33,060,293.15	8,817,891.48
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	901.56	11,365.60
<b>减：二、营业总支出</b>		2,979,251.89	4,558,269.30
1. 管理人报酬		2,522,469.81	3,777,411.85
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		378,370.46	566,611.79
3. 销售服务费		-	-
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		357.76	119,825.28
8. 其他费用	6.4.7.17	78,053.86	94,420.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>-5,004,097.98</b>	<b>5,036,514.33</b>

列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-5,004,097.98</b>	<b>5,036,514.33</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5,004,097.98	5,036,514.33

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	255,854,462.10	194,178,558.58	450,033,020.68
二、本期期初净资产	255,854,462.10	194,178,558.58	450,033,020.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,529,783.71	-10,654,812.87	-19,184,596.58
（一）、综合收益总额	-	-5,004,097.98	-5,004,097.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-8,529,783.71	-5,650,714.89	-14,180,498.60
其中：1.基金申购款	336,693.61	222,186.31	558,879.92
2.基金赎回款	-8,866,477.32	-5,872,901.20	-14,739,378.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	247,324,678.39	183,523,745.71	430,848,424.10
项目	上年度可比期间 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	320,698,700.42	330,103,267.90	650,801,968.32
二、本期期初净资产	320,698,700.42	330,103,267.90	650,801,968.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,656,186.01	-37,237,365.02	-75,893,551.03
（一）、综合收益总额	-	5,036,514.33	5,036,514.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-38,656,186.01	-42,273,879.35	-80,930,065.36
其中：1.基金申购款	2,350,956.13	2,700,644.54	5,051,600.67
2.基金赎回款	-41,007,142.14	-44,974,523.89	-85,981,666.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	282,042,514.41	292,865,902.88	574,908,417.29

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

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为广发集合资产管理计划（3 号）（以下简称“原集合计划”），于 2005 年 11 月 10 日经中国证监会许可（2005）122 号文核准设立，自 2005 年 11 月 28 日开始募集，于 2006 年 1 月 13 日结束募集工作，并于 2006 年 1 月 18 日成立。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币 393,816,465.14 元（含利息转份额），折合 393,816,465.14 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，托管人为交通银行股份有限公司。

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，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自 2020 年 5 月 7 日起，《广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划合同》生效，原《广发集合资产管理计划（3 号）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、次级债及其他中国证监会允许投资的债券）、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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和集合计划净资产变动情况。

#### 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

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 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。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	93,577,953.37
等于：本金	93,569,264.75
加：应计利息	8,688.62
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	93,577,953.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	304,257,327.98	-	324,143,061.41	19,885,733.43
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	304,257,327.98	-	324,143,061.41	19,885,733.43

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	183,479.86
其中：交易所市场	183,479.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,573.86
合计	261,053.88

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	406,868,067.55	255,854,462.10
本期申购	535,422.25	336,693.61
本期赎回（以“-”号填列）	-14,099,699.33	-8,866,477.32
本期末	393,303,790.47	247,324,678.39

#### 6.4.7.8 未分配利润

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	166,004,091.44	28,174,467.14	194,178,558.58
本期期初	166,004,091.44	28,174,467.14	194,178,558.58
本期利润	-38,064,391.13	33,060,293.15	-5,004,097.98
本期基金份额交易产生的变动数	-4,371,497.21	-1,279,217.68	-5,650,714.89
其中：基金申购款	165,274.18	56,912.13	222,186.31
基金赎回款	-4,536,771.39	-1,336,129.81	-5,872,901.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	123,568,203.10	59,955,542.61	183,523,745.71

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	320,688.45
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	24,306.06	
其他	2,147.09	
合计	347,141.60	

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	卖出股票成交总额	850,137,526.50
减：卖出股票成本总额	888,015,023.68	
减：交易费用	1,896,292.28	
买卖股票差价收入	-39,773,789.46	

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,241,230.09
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	4,241,230.09

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	33,060,293.15
——股票投资	33,060,293.15
——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	33,060,293.15

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	901.56
合计	901.56

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,901.52

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	480.00
合计	78,053.86

#### 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
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	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
吉林敖东药业集团股份有限公司	本集合计划管理人的关联方

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,682,359,763.54	100.00%	4,291,115,915.35	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	247,588,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	1,167,298.43	100.00%	183,479.86	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	3,024,716.43	100.00%	413,700.62	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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,522,469.81	3,777,411.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,107,694.01	1,697,769.75
应支付基金管理人的净管理费	1,414,775.80	2,079,642.10

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.2% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div 365$$

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，托管人自动于次月前 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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	378,370.46	566,611.79

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，托管人自动于次月前 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。

#### 6.4.10.3 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未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

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
报告期初持有的基金份额	36,567,000.14	36,567,000.14
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	36,567,000.14	36,567,000.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.30%	8.15%

注：本集合计划管理人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。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
吉林敖东药业集团股份有限公司	4,969,594.26	1.26%	4,969,594.26	1.22%

注：本集合计划除管理人外的其他关联方本报告期末及上年度末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。

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
交通银行	93,577,953.37	320,688.45	81,411,901.98	284,939.65

注：本集合计划的上述银行存款由托管人交通银行保管，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及上年度可比期间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

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 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
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	134.00	2,330.26	2,760.40	2024-06-07 除权除息，派息比例 0.2700（含税）
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	157.00	2,736.51	5,425.92	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	150.00	1,830.00	6,249.00	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	90.00	2,520.90	3,404.70	2024-06-05 除权除息，派息比例 0.5250（含税）
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	415.00	6,706.40	13,392.05	2024-06-07 除权除息，派息比例 0.1000（含税）
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通	39.87	91.24	119.00	4,744.70	10,857.56	2024-05-22

				受限						除权 除息， 派息 比例 0.7000 (含 税)， 送转 比例 0.4000
30153 9	宏鑫 科技	2024-0 4-03	6 个月	新股 流通 受限	10.64	19.82	245.00	2,606. 80	4,855. 90	2024-0 5-29 除权 除息， 派息 比例 0.2000 (含 税)
30158 7	中瑞 股份	2024-0 3-27	6 个月	新股 流通 受限	21.73	25.26	239.00	5,193. 47	6,037. 14	-
30158 8	美新 科技	2024-0 3-06	6 个月	新股 流通 受限	14.50	21.25	127.00	1,841. 50	2,698. 75	2024-0 6-21 除权 除息， 派息 比例 0.1900 (含 税)
30158 9	诺瓦 星云	2024-0 2-01	6 个月	新股 流通 受限	70.53	188.01	860.00	60,653 .42	161,68 8.60	2024-0 5-30 除权 除息， 派息 比例 9.7000 (含 税)， 送转 比例 0.8000
60103 3	永兴 股份	2024-0 1-11	6 个月	新股 流通	16.20	15.96	627.00	10,157 .40	10,006 .92	2024-0 5-09

				受限						除权 除息， 派息 比例 0.5200 (含 税)
60308 2	北自 科技	2024-0 1-23	6 个月	新股 流通 受限	21.28	29.49	65.00	1,383. 20	1,916. 85	2024-0 6-06 除权 除息， 派息 比例 0.5800 (含 税)
60334 4	星德 胜	2024-0 3-13	6 个月	新股 流通 受限	19.18	22.66	152.00	2,915. 36	3,444. 32	-
60337 5	盛景 微	2024-0 1-17	6 个月	新股 流通 受限	38.18	38.90	36.00	1,374. 48	1,400. 40	-
68853 0	欧莱 新材	2024-0 4-29	6 个月	新股 流通 受限	9.60	16.10	232.00	2,227. 20	3,735. 20	-
68858 4	上海 合晶	2024-0 2-01	6 个月	新股 流通 受限	22.66	15.89	673.00	15,250 .18	10,693 .97	-
68869 5	中创 股份	2024-0 3-06	6 个月	新股 流通 受限	22.43	31.55	137.00	3,072. 91	4,322. 35	2024-0 6-27 除权 除息， 派息 比例 0.2400 (含 税)
68870 9	成都 华微	2024-0 1-31	6 个月	新股 流通 受限	15.69	18.79	813.00	12,755 .97	15,276 .27	2024-0 6-18 除权 除息， 派息 比例 0.1120 (含



#### 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交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公

开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易。本集合计划管理人建立了科学的资产负债管理和头寸管理机制，并通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致本集合计划收益水平变化而产生的风险，反映了本集合计划资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划管理人通过设置久期、偏离度、VaR 等指标对利率风险进行管理。本集合计划持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本集合计划的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，受市场利率变动影响较小。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	93,569,264.75	-	-	8,688.62	93,577,953.37
结算备付金	5,787,849.23	-	-	906.79	5,788,756.02
存出保证金	196,849.24	-	-	73.80	196,923.04
交易性金融资产	-	-	-	324,143,061.41	324,143,061.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,214,273.91	7,214,273.91
应收股利	-	-	-	841,034.23	841,034.23
应收申购款	-	-	-	2,357.65	2,357.65

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	99,553,963.22	-	-	332,210,396.41	431,764,359.63
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	-	-	-	166,938.17	166,938.17
应付管理人报酬	-	-	-	424,298.67	424,298.67
应付托管费	-	-	-	63,644.81	63,644.81
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	-	-	-	261,053.88	261,053.88
负债总计	-	-	-	915,935.53	915,935.53
利率敏感度缺口	99,553,963.22	-	-	331,294,460.88	430,848,424.10
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	109,554,034.06	-	-	20,403.47	109,574,437.53
结算备付金	10,255,610.44	-	-	1,475.73	10,257,086.17
存出保证金	328,323.53	-	-	147.70	328,471.23
交易性金融资产	-	-	-	351,097,420.27	351,097,420.27
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	-	-	-	-	-
资产总计	120,137,968.03	-	-	351,119,447.17	471,257,415.20
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	-	-	-	20,103,733.67	20,103,733.67
应付赎回款	-	-	-	180,759.61	180,759.61
应付管理人报酬	-	-	-	459,984.97	459,984.97
应付托管费	-	-	-	68,997.75	68,997.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	595.91	595.91
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	410,322.61	410,322.61
负债总计	-	-	-	21,224,394.52	21,224,394.52
利率敏感度缺口	120,137,968.03	-	-	329,895,052.65	450,033,020.68

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划于 2024 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		
	2024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			
货币资金	-	-	-
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	114,688,596.12	114,688,596.12
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>114,688,596.12</b>	<b>114,688,596.12</b>
以外币计价的负债			
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	-	-	-
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>114,688,596.12</b>	<b>114,688,596.12</b>
项目	上年度末		
	2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
货币资金	-	-	-
结算备付金	-	-	-

存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	32,412,949.93	32,412,949.93
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>32,412,949.93</b>	<b>32,412,949.93</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>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>-</b>	<b>32,412,949.93</b>	<b>32,412,949.93</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
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	5,734,429.81	1,620,647.50
	所有外币相对人民币贬值 5%	-5,734,429.81	-1,620,647.50

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	324,143,061.41	75.23	351,097,420.27	78.02
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	324,143,061.41	75.23	351,097,420.27	78.02

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
	各板块市场指数上涨 5%	14,306,345.43	18,657,928.36
	各板块市场指数下跌 5%	-14,306,345.43	-18,657,928.36

### 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	323,874,895.11
第二层次	-
第三层次	268,166.30
合计	324,143,061.41

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以报告期期初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	324,143,061.41	75.07
	其中：股票	324,143,061.41	75.07
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	99,366,709.39	23.01
8	其他各项资产	8,254,588.83	1.91
9	合计	431,764,359.63	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 114,688,596.12 元，占集合计划资产净值比例 26.62%。

## 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	16,141,967.00	3.75
C	制造业	150,974,584.71	35.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,651,954.00	9.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	854,188.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,821,764.66	0.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,006.92	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,454,465.29	48.61

### 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	6,143,040.00	1.43
房地产	-	-
非日常生活消费品	17,116,320.00	3.97
日常消费品	-	-
能源	23,362,920.00	5.42
金融	7,625,690.00	1.77
医疗保健	-	-
工业	5,364,988.00	1.25
通信服务	52,184,088.12	12.11
信息技术	2,891,550.00	0.67
合计	114,688,596.12	26.62

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	00700	腾讯控股	74,799.00	25,422,684.12	5.90
2	00941	中国移动	348,000.00	24,457,440.00	5.68
3	00883	中国海洋石油	1,143,000.00	23,362,920.00	5.42
4	600031	三一重工	1,051,200.00	17,344,800.00	4.03
5	600519	贵州茅台	11,700.00	17,168,463.00	3.98
6	03690	美团-W	168,800.00	17,116,320.00	3.97
7	002475	立讯精密	381,700.00	15,004,627.00	3.48
8	600150	中国船舶	364,900.00	14,855,079.00	3.45
9	600886	国投电力	732,700.00	13,364,448.00	3.10
10	000425	徐工机械	1,422,000.00	10,167,300.00	2.36
11	001286	陕西能源	844,800.00	9,740,544.00	2.26

12	002371	北方华创	28,812.00	9,216,670.68	2.14
13	300308	中际旭创	64,340.00	8,871,199.20	2.06
14	600900	长江电力	289,400.00	8,369,448.00	1.94
15	000725	京东方 A	2,024,500.00	8,280,205.00	1.92
16	00939	建设银行	1,447,000.00	7,625,690.00	1.77
17	601985	中国核电	653,000.00	6,960,980.00	1.62
18	000333	美的集团	106,400.00	6,862,800.00	1.59
19	601138	工业富联	248,100.00	6,797,940.00	1.58
20	300502	新易盛	63,200.00	6,670,760.00	1.55
21	688012	中微公司	44,157.00	6,237,617.82	1.45
22	01071	华电国际电力股份	1,422,000.00	6,143,040.00	1.43
23	688169	石头科技	15,156.00	5,950,245.60	1.38
24	000975	银泰黄金	363,300.00	5,918,157.00	1.37
25	02057	中通快递-W	35,800.00	5,364,988.00	1.25
26	688036	传音控股	64,329.00	4,923,741.66	1.14
27	603986	兆易创新	49,400.00	4,723,628.00	1.10
28	601899	紫金矿业	248,200.00	4,360,874.00	1.01
29	601088	中国神华	75,800.00	3,363,246.00	0.78
30	00981	中芯国际	185,000.00	2,891,550.00	0.67
31	601225	陕西煤业	97,000.00	2,499,690.00	0.58
32	01024	快手-W	54,700.00	2,303,964.00	0.53
33	002938	鹏鼎控股	45,600.00	1,813,056.00	0.42
34	000338	潍柴动力	108,000.00	1,753,920.00	0.41
35	688153	唯捷创芯	46,149.00	1,707,513.00	0.40
36	301269	华大九天	18,823.00	1,450,312.15	0.34
37	002911	佛燃能源	133,100.00	1,216,534.00	0.28
38	688170	德龙激光	47,706.00	1,050,486.12	0.24
39	601006	大秦铁路	119,300.00	854,188.00	0.20
40	300782	卓胜微	9,700.00	754,078.00	0.18
41	002601	龙佰集团	21,400.00	397,398.00	0.09
42	688052	纳芯微	3,572.00	367,130.16	0.09
43	301589	诺瓦星云	860.00	161,688.60	0.04
44	300274	阳光电源	2,520.00	156,315.60	0.04
45	688709	成都华微	813.00	15,276.27	0.00
46	301536	星辰科技	415.00	13,392.05	0.00
47	300476	胜宏科技	400.00	12,904.00	0.00
48	301538	骏鼎达	119.00	10,857.56	0.00
49	688584	上海合晶	673.00	10,693.97	0.00
50	601033	永兴股份	627.00	10,006.92	0.00
51	301392	汇成真空	150.00	6,249.00	0.00
52	301587	中瑞股份	239.00	6,037.14	0.00

53	001389	广合科技	157.00	5,425.92	0.00
54	301539	宏鑫科技	245.00	4,855.90	0.00
55	688695	中创股份	137.00	4,322.35	0.00
56	688530	欧莱新材	232.00	3,735.20	0.00
57	603344	星德胜	152.00	3,444.32	0.00
58	301502	华阳智能	90.00	3,404.70	0.00
59	001359	平安电工	134.00	2,760.40	0.00
60	301588	美新科技	127.00	2,698.75	0.00
61	603082	北自科技	65.00	1,916.85	0.00
62	603375	盛景微	36.00	1,400.40	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	00941	中国移动	25,103,129.64	5.58
1	600941	中国移动	2,120,962.00	0.47
2	300502	新易盛	25,905,812.00	5.76
3	03690	美团-W	24,821,399.59	5.52
4	601138	工业富联	20,947,627.00	4.65
5	002371	北方华创	20,320,856.00	4.52
6	688012	中微公司	19,679,325.50	4.37
7	600031	三一重工	19,636,702.00	4.36
8	688036	传音控股	19,290,148.83	4.29
9	00883	中国海洋石油	18,438,730.11	4.10
10	000425	徐工机械	17,068,917.00	3.79
11	300475	香农芯创	16,999,347.00	3.78
12	600150	中国船舶	15,308,821.00	3.40
13	300394	天孚通信	14,182,720.56	3.15
14	300308	中际旭创	13,923,409.88	3.09
15	000975	银泰黄金	13,040,656.00	2.90
16	00700	腾讯控股	12,895,798.86	2.87
17	002475	立讯精密	12,895,320.00	2.87
18	002920	德赛西威	11,720,732.00	2.60
19	600886	国投电力	10,991,108.00	2.44
20	001286	陕西能源	10,972,220.00	2.44
21	000810	创维数字	10,370,028.00	2.30
22	002156	通富微电	10,193,485.00	2.27
23	601689	拓普集团	9,829,012.00	2.18

24	00939	建设银行	9,725,494.75	2.16
25	688111	金山办公	9,664,146.34	2.15
26	301308	江波龙	9,615,905.00	2.14
27	601899	紫金矿业	9,429,450.00	2.10
28	600519	贵州茅台	9,279,611.60	2.06

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	300475	香农芯创	30,099,593.57	6.69
2	300502	新易盛	23,436,074.29	5.21
3	300394	天孚通信	21,126,536.70	4.69
4	002371	北方华创	20,509,478.00	4.56
5	002156	通富微电	19,694,247.00	4.38
6	688036	传音控股	17,251,644.49	3.83
7	688111	金山办公	15,182,987.63	3.37
8	002920	德赛西威	15,163,450.96	3.37
9	601208	东材科技	15,080,562.00	3.35
10	601138	工业富联	15,012,131.72	3.34
11	688012	中微公司	14,947,475.44	3.32
12	600809	山西汾酒	12,654,531.00	2.81
13	002273	水晶光电	11,883,498.36	2.64
14	600519	贵州茅台	11,434,678.00	2.54
15	000810	创维数字	11,169,477.80	2.48
16	000425	徐工机械	10,910,166.00	2.42
17	603596	伯特利	10,861,283.01	2.41
18	000400	许继电气	10,804,606.00	2.40
19	301269	华大九天	10,717,546.08	2.38
20	301308	江波龙	10,532,926.80	2.34
21	688153	唯捷创芯	10,122,822.20	2.25
22	002223	鱼跃医疗	10,014,905.00	2.23
23	601689	拓普集团	9,761,199.20	2.17
24	601799	星宇股份	9,561,090.00	2.12
25	300260	新莱应材	9,284,158.76	2.06
26	688548	广钢气体	9,250,520.33	2.06
27	03690	美团-W	9,150,243.27	2.03

28	002831	裕同科技	9,003,622.00	2.00
----	--------	------	--------------	------

#### 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	828,000,371.67
卖出股票收入（成交）总额	850,137,526.50

#### 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** 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受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 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的情形。

**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	196,923.04
2	应收清算款	7,214,273.91
3	应收股利	841,034.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,357.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,254,588.83

**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

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

5,298	74,236.28	46,490,323.19	11.82%	346,813,467.28	88.18%
-------	-----------	---------------	--------	----------------	--------

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,135,090.01	0.29%

## 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年5月7日）基金份额总额	516,410,645.34
本报告期期初基金份额总额	406,868,067.55
本报告期基金总申购份额	535,422.25
减：本报告期基金总赎回份额	14,099,699.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	393,303,790.47

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，本集合计划管理人发生如下重大人事变动：

2024 年 3 月，本集合计划管理人聘任王华先生担任公司副总经理。

2024 年 6 月，本集合计划管理人聘任孔维成先生担任公司总经理，秦力先生不再兼任公司总经理职务；孔维成先生不再担任公司首席风险官、合规负责人，聘任吴顺虎先生兼任公司合规负责人，由蒋荣先生代行公司首席风险官职务。

具体详见管理人发布的相关公告。

## 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	1,682,359,763.54	100.00%	1,167,298.43	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	
	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
广发证券	-	-	247,588,000.00	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	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2023 年第四季度报告提示性公告	规定媒介	2024-01-19
2	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	规定媒介	2024-01-19
3	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定媒介	2024-03-16
4	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告	规定媒介	2024-03-27
5	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2023 年年度报告提示性公告	规定媒介	2024-03-27
6	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2024 年第一季度报告提示性公告	规定媒介	2024-04-19
7	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	规定媒介	2024-04-19
8	广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划更新(图数据更新)基金产品资料概要 2024-05-21	规定媒介	2024-05-21
9	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业	规定媒介	2024-06-07

	高级管理人员变更公告		
10	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定媒介	2024-06-07
11	广发证券资产管理(广东)有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定媒介	2024-06-07

## §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、《关于准予广发集合资产管理计划（3 号）合同变更的回函》（机构部函【2020】713 号）；
- 2、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 5、广发资管价值增长灵活配置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

二〇二四年八月二十八日