

# 广发瑞安精选股票型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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>                        | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>2 基金简介</b>                           | <b>5</b>  |
| 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>                  | <b>6</b>  |
| 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>                          | <b>9</b>  |
| 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                 | 10        |
| 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             | 11        |
| 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                 | 12        |
| <b>5 托管人报告</b>                          | <b>13</b> |
| 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>                | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | <b>46</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 46        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 46        |
| 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       | 47        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51        |
| 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      | 51        |
| 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   | 52        |
| 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   | 52        |
| 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      | 52        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 52        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 52        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 52        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | <b>53</b> |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 53        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 53        |
| 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 ..... | 54        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | <b>54</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | <b>54</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 54        |
| 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 .....  | 54        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 54        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 55        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 55        |
| 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 .....     | 55        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 55        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 56        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....          | <b>57</b> |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                  | <b>57</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 57        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 58        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 58        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金名称            | 广发瑞安精选股票型证券投资基金    |                  |
| 基金简称            | 广发瑞安精选股票           |                  |
| 基金主代码           | 010161             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日         | 2020 年 12 月 16 日   |                  |
| 基金管理人           | 广发基金管理有限公司         |                  |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 1,528,903,927.24 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 广发瑞安精选股票 A         | 广发瑞安精选股票 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 010161             | 010162           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,402,558,593.24 份 | 126,345,334.00 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握，自下而上地精选优质上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                            |
| 投资策略   | 本基金为一只股票型基金，其股票投资占基金资产的比例不低于 80%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。在境内股票和香港股票方面，本基金将综合考虑以下因素进行两地股票的配置：1、宏观经济因素（如 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）；2、估值因素（如市场整体估值水平、上市公司利润增长情况等）；3、政策因素（如财政政策、货币政策、税收政策等）；4、流动性因素（如货币政策的宽松情况、证券市场的资金面状况等）。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×65%+人民币计价的恒生指数收益率×15%+中证全债指数收益率×20%。                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。<br>本基金资产投资于港股，会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投资风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖                                       |

|  |                   |
|--|-------------------|
|  | 出，可能带来一定的流动性风险）等。 |
|--|-------------------|

## 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          |      | 广发基金管理有限公司                       | 中国建设银行股份有限公司      |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 程才良                              | 李申                |
|             | 联系电话 | 020-83936666                     | 021-60637102      |
|             | 电子邮箱 | ccl@gffunds.com.cn               | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 95105828                         | (021)60637111     |
| 传真          |      | 020-89899158                     | 021-60635778      |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区） | 北京市西城区金融大街25号     |
| 办公地址        |      | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼      | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码        |      | 510308                           | 100033            |
| 法定代表人       |      | 孙树明                              | 田国立               |

## 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 | <a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼                                       |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                        |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 广发基金管理有限公司 | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼 |

## 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（2021年1月1日至2021年6月30日） |
|---------------|---------------------------|

|                      | 广发瑞安精选股票 A                   | 广发瑞安精选股票 C     |
|----------------------|------------------------------|----------------|
| 本期已实现收益              | 272,232,942.82               | 19,779,211.68  |
| 本期利润                 | 380,894,135.62               | 27,958,012.92  |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.1594                       | 0.1668         |
| 本期加权平均净值利润率          | 15.65%                       | 16.34%         |
| 本期基金份额净值增长率          | 19.62%                       | 19.39%         |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2021 年 6 月 30 日)</b> |                |
|                      | 广发瑞安精选股票 A                   | 广发瑞安精选股票 C     |
| 期末可供分配利润             | 177,079,229.90               | 15,653,189.58  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.1263                       | 0.1239         |
| 期末基金资产净值             | 1,699,785,514.06             | 152,792,604.97 |
| 期末基金份额净值             | 1.2119                       | 1.2093         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2021 年 6 月 30 日)</b> |                |
|                      | 广发瑞安精选股票 A                   | 广发瑞安精选股票 C     |
| 基金份额累计净值增长率          | 21.19%                       | 20.93%         |

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

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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）期末可供分配利润采用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

广发瑞安精选股票 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      | 11.90%   | 1.64%       | -1.22%     | 0.60%         | 13.12% | 1.04% |
| 过去三个月      | 29.35%   | 1.56%       | 2.59%      | 0.72%         | 26.76% | 0.84% |
| 过去六个月      | 19.62%   | 1.57%       | 1.55%      | 0.97%         | 18.07% | 0.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.19%   | 1.49%       | 5.77%      | 0.95%         | 15.42% | 0.54% |

广发瑞安精选股票 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 | 11.87%   | 1.64%       | -1.22%     | 0.60%         | 13.09% | 1.04% |

|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 29.23% | 1.56% | 2.59% | 0.72% | 26.64% | 0.84% |
| 过去六个月      | 19.39% | 1.57% | 1.55% | 0.97% | 17.84% | 0.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.93% | 1.49% | 5.77% | 0.95% | 15.16% | 0.54% |

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

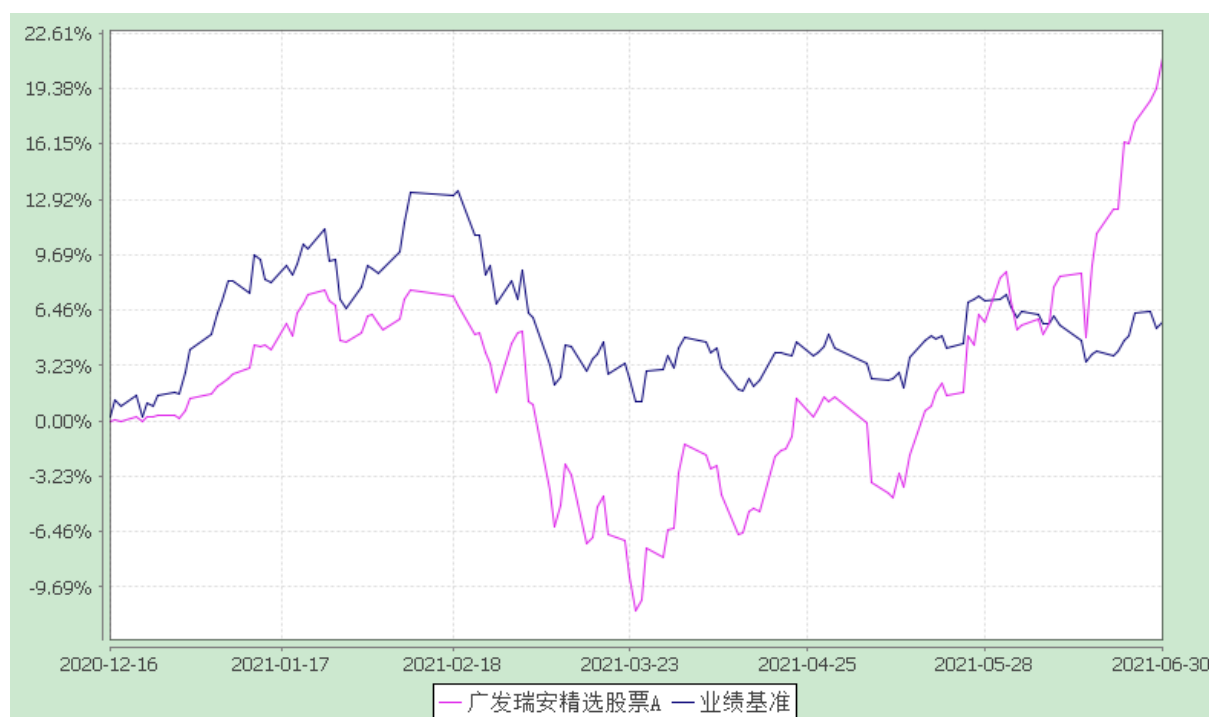
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 广发瑞安精选股票型证券投资基金

#### 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

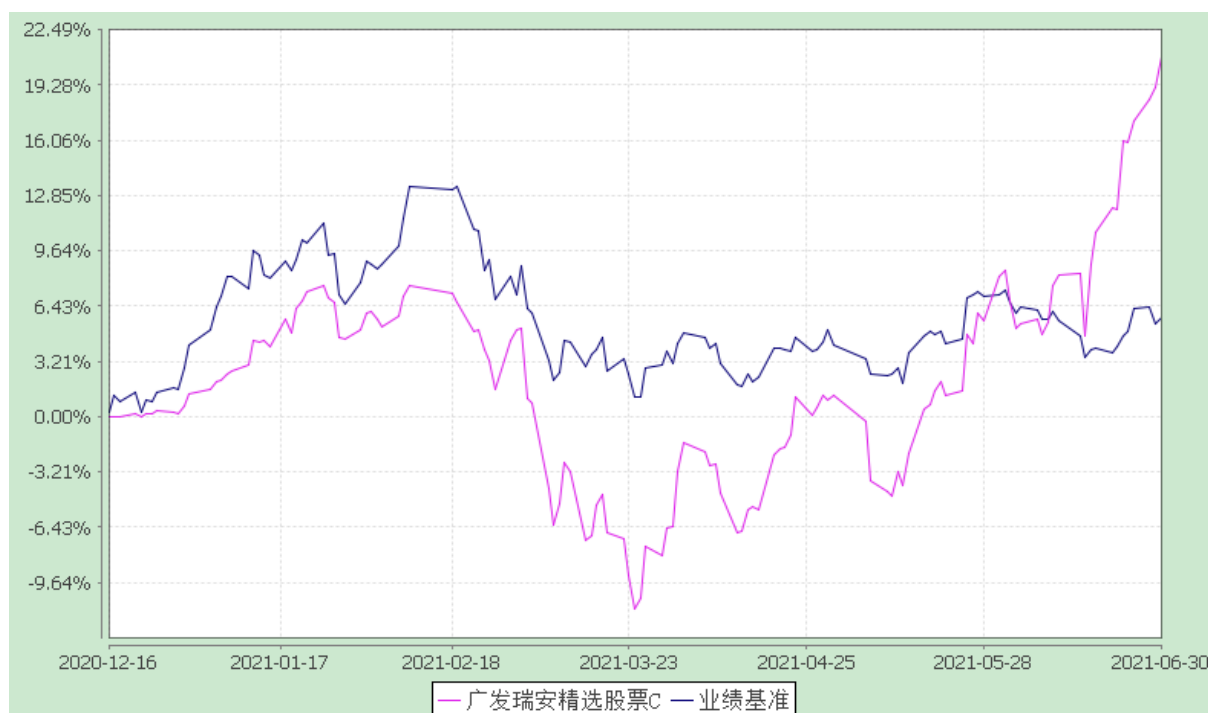
（2020 年 12 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日）

#### 广发瑞安精选股票 A



#### 广发瑞安精选股票 C





注：（1）本基金合同生效日期为 2020 年 12 月 16 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## 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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 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<br>（助理）期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明 |
|----|----|---------------------|------|------------|----|
|    |    | 任职日期                | 离任日期 |            |    |

|    |                                                                       |            |   |      |                                                                                                                                                                       |
|----|-----------------------------------------------------------------------|------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 费逸 | 本基金的基金经理；广发聚瑞混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发盛兴混合型证券投资基金的基金经理 | 2020-12-16 | - | 11 年 | 费逸先生，金融学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 4 月 27 日至 2019 年 6 月 26 日)、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 3 月 2 日至 2021 年 5 月 13 日)。 |
|----|-----------------------------------------------------------------------|------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《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

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

#### 4.3 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

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

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 13 次，其中 7 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合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

2021 年上半年，市场主要指数经历了较大的波动。以医药、半导体、光伏和电动车为代表的成长股表现较好，周期股整体上涨后在高位震荡。

本基金的投资策略是寻找持续创造价值的伟大企业。因为我们相信基金回报的差异主要是来自于能否重仓投资到那些极少数的超级成长股，我们会在顺应时代发展趋势的行业中选择优秀管理层经营的企业。因此，在一季度市场调整时，我们继续建仓光伏和电动车行业的龙头公司，加仓半导体行业的龙头公司，并在二季度的市场低点加快了建仓速度。

报告期内，我们新增了半导体 MCU 细分行业中有成长潜力的公司，提高了港股的配置比例，以半导体、医药和医疗服务为主。我们反思了在一些新消费领域错过的机会，修正了成见，今后将以更开放的心态去对待变化。我们会通过更加勤勉的态度和不懈的努力去探求更接近真实的基本面，以量化的手段来控制盈利回撤的幅度，希望能够给投资人创造理想的回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 19.62%，C 类基金份额净值增长率为 19.39%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管全球复苏进程会时不时被新冠疫情打断，但总体上各种生产生活已经在有序地恢复，因此要着眼于疫情后那些给经济生活带来长久变化的部分，而不是疫情当前的临时状态。我们发现，数字化、线上化是一个长期的趋势。人工智能越来越多地渗透到生产生活的方方面面，以至于各国政府都开始重视底层数据的规范，开始治理数据的安全使用问题。

我们认为疫情后的一个大问题是，全球宽松的流动性何时逆转。这也是始终困扰着投资人的高估值问题的根源。无数的经济学家、机构和研究员就此给出了自己的答案，我们目前的做法是选择

投资那些优秀的公司，希望他们能穿越周期，这看似短期回避了估值的问题，但我们也知道能穿越周期的公司是极少数的，大部分公司都是在泡沫中起舞。因此我们也会密切关注宏观的变化，不断调整和筛选组合的成分股。

我们始终相信，在实现中华民族伟大复兴的征程中，我们的资本市场也会一同走向繁荣，道路可能会有颠簸，但不妨碍我们长期投资者与优秀企业家同行的决心。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

## 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## 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：广发瑞安精选股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产     | 附注号     | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |         | -                      | -                        |
| 银行存款    | 6.4.7.1 | 182,691,160.64         | 720,854,286.97           |
| 结算备付金   |         | 3,698,779.40           | 509,010,874.99           |
| 存出保证金   |         | 1,166,389.95           | 27,566.03                |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,750,536,302.21       | 879,745,821.37           |
| 其中：股票投资 |         | 1,750,536,302.21       | 879,745,821.37           |
| 基金投资    |         | -                      | -                        |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | 869,200,000.00                   |
| 应收证券清算款         |            | 11,684,931.60                  | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 26,629.66                      | 1,111,577.10                     |
| 应收股利            |            | 157,517.60                     | -                                |
| 应收申购款           |            | 19,253,751.13                  | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,969,215,462.19               | 2,979,950,126.46                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 0.01                           | 46,469,550.77                    |
| 应付赎回款           |            | 111,144,427.17                 | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 2,734,154.33                   | 1,781,358.41                     |
| 应付托管费           |            | 455,692.38                     | 296,893.07                       |
| 应付销售服务费         |            | 46,241.90                      | 36,518.03                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,924,749.04                   | 803,108.46                       |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 332,078.33                     | -                                |
| 负债合计            |            | 116,637,343.16                 | 49,387,428.74                    |
| <b>所有者权益:</b>   |            | -                              | -                                |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 1,528,903,927.24               | 2,892,798,837.71                 |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 323,674,191.79                 | 37,763,860.01                    |
| 所有者权益合计         |            | 1,852,578,119.03               | 2,930,562,697.72                 |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,969,215,462.19               | 2,979,950,126.46                 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发瑞安精选股票 A 基金份额净值人民币 1.2119 元，基金份额总额 1,402,558,593.24 份；广发瑞安精选股票 C 基金份额净值人民币 1.2093 元，基金份额总额 126,345,334.00 份；总份额总额 1,528,903,927.24 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发瑞安精选股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>442,775,814.46</b>                 |
| 1.利息收入                     |          | 4,696,389.10                          |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 3,185,281.91                          |
| 债券利息收入                     |          | 78,890.69                             |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -                                     |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 1,432,216.50                          |
| 证券出借利息收入                   |          | -                                     |
| 其他利息收入                     |          | -                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 318,126,135.86                        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 309,279,993.70                        |
| 基金投资收益                     |          | -                                     |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | 420,315.66                            |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                                     |
| 贵金属投资收益                    |          | -                                     |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                                     |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 8,425,826.50                          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | 116,839,994.04                        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 3,113,295.46                          |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>33,923,665.92</b>                  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 19,525,891.04                         |
| 2. 托管费                     |          | 3,254,315.23                          |
| 3. 销售服务费                   |          | 343,889.70                            |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 10,676,255.43                         |
| 5. 利息支出                    |          | -                                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                                     |
| 6. 税金及附加                   |          | 2.15                                  |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 123,312.37                            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>408,852,148.54</b>                 |
| 减：所得税费用                    |          | -                                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>408,852,148.54</b>                 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发瑞安精选股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                  | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,892,798,837.71                      | 37,763,860.01   | 2,930,562,697.72  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 408,852,148.54  | 408,852,148.54    |
| 三、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）      | -1,363,894,910.47                     | -122,941,816.76 | -1,486,836,727.23 |
| 其中：1.基金申购款                             | 195,522,142.49                        | 11,865,272.23   | 207,387,414.72    |
| 2.基金赎回款                                | -1,559,417,052.96                     | -134,807,088.99 | -1,694,224,141.95 |
| 四、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） | -                                     | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,528,903,927.24                      | 323,674,191.79  | 1,852,578,119.03  |

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

广发瑞安精选股票型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2020]1933 号《关于准予广发瑞安精选股票型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发瑞安精选股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2020 年 12 月 7 日向社会公开发行募集并于 2020 年 12 月 16 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。



本基金募集期间为 2020 年 12 月 7 日至 2020 年 12 月 11 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 2,892,798,837.71 元，有效认购户数为 45,784 户。其中广发瑞安精选股票 A（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 2,670,149,650.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 248,435.31 元；广发瑞安精选股票 C（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 222,385,957.30 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 14,795.10 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

## （2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技

术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下与基金托管人协商一致后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应予变更实施日前在指定媒介公告。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金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

本基金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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

#### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金

从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### (5) 境外投资

本基金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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 182,691,160.64         |
| 定期存款           | -                      |
| 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           | -                      |
| 合计             | 182,691,160.64         |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                |
|---------------|-------|------------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 1,596,786,993.81       | 1,750,536,302.21 | 153,749,308.40 |
| 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            |       | 1,596,786,993.81       | 1,750,536,302.21 | 153,749,308.40 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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

本基金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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 19,265.99              |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | 628.56                 |
| 应收结算备付金利息  | 6,735.11               |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 26,629.66              |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,924,749.04           |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 1,924,749.04           |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 231,375.02             |



|           |            |
|-----------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          |
| 预提费用      | 100,703.31 |
| 合计        | 332,078.33 |

#### 6.4.7.9 实收基金

广发瑞安精选股票 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                   |
|---------------|----------------------|-------------------|
|               | 2021年1月1日至2021年6月30日 |                   |
|               | 基金份额（份）              | 账面金额              |
| 上年度末          | 2,670,398,085.31     | 2,670,398,085.31  |
| 本期申购          | 147,606,776.73       | 147,606,776.73    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,415,446,268.80    | -1,415,446,268.80 |
| 本期末           | 1,402,558,593.24     | 1,402,558,593.24  |

广发瑞安精选股票 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                 |
|---------------|----------------------|-----------------|
|               | 2021年1月1日至2021年6月30日 |                 |
|               | 基金份额（份）              | 账面金额            |
| 上年度末          | 222,400,752.40       | 222,400,752.40  |
| 本期申购          | 47,915,365.76        | 47,915,365.76   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -143,970,784.16      | -143,970,784.16 |
| 本期末           | 126,345,334.00       | 126,345,334.00  |

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

广发瑞安精选股票 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           | 822,557.14      | 34,072,050.25  | 34,894,607.39   |
| 本期利润           | 272,232,942.82  | 108,661,192.80 | 380,894,135.62  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -95,976,270.06  | -22,585,552.13 | -118,561,822.19 |
| 其中：基金申购款       | 9,962,204.85    | -1,306,496.02  | 8,655,708.83    |
| 基金赎回款          | -105,938,474.91 | -21,279,056.11 | -127,217,531.02 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |

|     |                |                |                |
|-----|----------------|----------------|----------------|
| 本期末 | 177,079,229.90 | 120,147,690.92 | 297,226,920.82 |
|-----|----------------|----------------|----------------|

广发瑞安精选股票 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           | 31,988.51     | 2,837,264.11  | 2,869,252.62  |
| 本期利润           | 19,779,211.68 | 8,178,801.24  | 27,958,012.92 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,158,010.61 | -221,983.96   | -4,379,994.57 |
| 其中：基金申购款       | 3,420,854.46  | -211,291.06   | 3,209,563.40  |
| 基金赎回款          | -7,578,865.07 | -10,692.90    | -7,589,557.97 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 15,653,189.58 | 10,794,081.39 | 26,447,270.97 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 852,909.30                            |
| 定期存款利息收入  | 1,419,166.66                          |
| 其他存款利息收入  | 18,769.79                             |
| 结算备付金利息收入 | 894,436.16                            |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 3,185,281.91                          |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 3,545,032,258.74                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,235,752,265.04                      |
| 买卖股票差价收入   | 309,279,993.70                        |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 420,315.66                 |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                          |
| 合计                           | 420,315.66                 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 19,191,380.33              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 18,584,004.70              |
| 减：应收利息总额               | 187,059.97                 |
| 买卖债券差价收入               | 420,315.66                 |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 8,425,826.50               |
| 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            | 8,425,826.50               |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 116,839,994.04             |
| ——股票投资                 | 116,839,994.04             |
| ——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                     | 116,839,994.04             |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|         | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,028,997.61         |
| 基金转换费收入 | 84,297.85            |
| 合计      | 3,113,295.46         |

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 10,676,255.43              |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 10,676,255.43              |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 36,695.94                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行汇划费   | 19,609.06                  |
| 账户维护费   | 7,500.00                   |
| 合计      | 123,312.37                 |

#### 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，本基金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，本基金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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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                    |
|--------------|----------------------------|
| 中国建设银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构                 |
| 广发基金管理有限公司   | 基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构 |
| 广发证券股份有限公司   | 基金管理人控股股东、代销机构             |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |              |
|------------|----------------------------|--------------|
|            | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 531,429,380.57             | 7.09%        |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |              |
|------------|----------------------------|--------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 2,493,400.00               | 6.63%        |

##### 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<br>2021年1月1日至2021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 |
| 广发证券股份有限公司 | 526,684.92                 | 9.12%      | -        | -            |

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 |
|----|----|
|----|----|

|                 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 19,525,891.04        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,081,233.49         |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,254,315.23               |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |            |           |
|----------------|----------------------------|------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |            |           |
|                | 广发瑞安精选股票 A                 | 广发瑞安精选股票 C | 合计        |
| 广发基金管理有限公司     | -                          | 11,735.76  | 11,735.76 |
| 广发证券股份有限公司     | -                          | 42,129.04  | 42,129.04 |

|    |   |           |           |
|----|---|-----------|-----------|
| 合计 | - | 53,864.80 | 53,864.80 |
|----|---|-----------|-----------|

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

#### 广发瑞安精选股票 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 广发瑞安精选股票 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |            |
|--------------|----------------------------|------------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入     |
| 中国建设银行股份有限公司 | 182,691,160.64             | 852,909.30 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 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      | 可流通日       | 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                             |
| 600584               | 长电科技 | 2021-04-29 | 2021-10-26 | 非公开发行流通受限 | 28.30    | 35.44    | 706,714.00 | 20,000,006.20 | 25,045,944.16 | -                              |
| 688169               | 石头科技 | 2021-05-31 | 2021-11-29 | 老股流通受限    | 1,111.00 | 1,138.55 | 13,924.00  | 15,469,564.00 | 15,853,170.20 | -                              |
| 688606               | 奥泰生物 | 2021-03-17 | 2021-09-27 | 新股流通受限    | 133.67   | 139.31   | 2,703.00   | 361,310.01    | 376,554.93    | 20210610 除权除息,派息比例 2.0000 (含税) |
| 300957               | 贝泰妮  | 2021-03-18 | 2021-09-27 | 新股流通受限    | 47.33    | 251.96   | 853.00     | 40,372.49     | 214,921.88    | 20210624 除权除息,派息比例 0.4500 (含税) |
| 688630               | 芯碁微装 | 2021-03-25 | 2021-10-08 | 新股流通      | 15.23    | 58.42    | 3,397.00   | 51,736.31     | 198,452.74    | -                              |



|        |      |            |            |        |       |        |          |           |            |                                |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|-----------|------------|--------------------------------|
|        |      |            |            | 受限     |       |        |          |           |            |                                |
| 688613 | 奥精医疗 | 2021-05-13 | 2021-11-22 | 新股流通受限 | 16.43 | 63.50  | 2,617.00 | 42,997.31 | 166,179.50 | -                              |
| 688329 | 艾隆科技 | 2021-03-16 | 2021-09-29 | 新股流通受限 | 16.81 | 50.04  | 1,846.00 | 31,031.26 | 92,373.84  | 20210609 除权除息,派息比例 0.3000 (含税) |
| 688499 | 利元亨  | 2021-06-23 | 2021-07-01 | 新股流通受限 | 38.85 | 38.85  | 2,149.00 | 83,488.65 | 83,488.65  | -                              |
| 300979 | 华利集团 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股流通受限 | 33.22 | 87.50  | 925.00   | 30,728.50 | 80,937.50  | -                              |
| 688468 | 科美诊断 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 7.15  | 16.50  | 3,919.00 | 28,020.85 | 64,663.50  | -                              |
| 688676 | 金盘科技 | 2021-03-02 | 2021-09-09 | 新股流通受限 | 10.10 | 16.24  | 3,750.00 | 37,875.00 | 60,900.00  | 20210429 除权除息,派息比例 0.2000 (含税) |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股流通受限 | 8.29  | 8.29   | 7,029.00 | 58,270.41 | 58,270.41  | -                              |
| 300981 | 中红医疗 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股流通受限 | 48.59 | 90.39  | 601.00   | 29,202.59 | 54,324.39  | -                              |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 新股流通受限 | 21.96 | 21.96  | 2,469.00 | 54,219.24 | 54,219.24  | -                              |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360.00   | 10,180.80 | 41,655.60  | 20210622 除权除息,派息比例 0.5000      |

|        |      |            |            |        |       |       |          |           |           |                                |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|----------|-----------|-----------|--------------------------------|
|        |      |            |            |        |       |       |          |           |           | (含税)                           |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股流通受限 | 9.46  | 9.46  | 2,609.00 | 24,681.14 | 24,681.14 | -                              |
| 300953 | 震裕科技 | 2021-03-11 | 2021-09-22 | 新股流通受限 | 28.77 | 99.85 | 240.00   | 6,904.80  | 23,964.00 | 20210617 除权除息,派息比例 0.1400 (含税) |
| 301009 | 可靠股份 | 2021-06-08 | 2021-12-17 | 新股流通受限 | 12.54 | 27.89 | 801.00   | 10,044.54 | 22,339.89 | -                              |
| 300941 | 创识科技 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股流通受限 | 21.31 | 49.94 | 399.00   | 8,502.69  | 19,926.06 | 20210629 除权除息,派息比例 0.3000 (含税) |
| 688226 | 威腾电气 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股流通受限 | 6.42  | 6.42  | 2,693.00 | 17,289.06 | 17,289.06 | -                              |
| 300982 | 苏文电能 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股流通受限 | 15.83 | 45.29 | 317.00   | 5,018.11  | 14,356.93 | 20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税) |
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 6.87  | 12.07 | 1,162.00 | 7,982.94  | 14,025.34 | -                              |
| 300940 | 南极光  | 2021-01-27 | 2021-08-03 | 新股流通受限 | 12.76 | 43.38 | 307.00   | 3,917.32  | 13,317.66 | 20210618 除权除息,派息比例 0.0790 (含税) |

|        |      |            |            |        |       |       |          |           |           |                                |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|----------|-----------|-----------|--------------------------------|
| 300614 | 百川畅银 | 2021-05-18 | 2021-11-25 | 新股流通受限 | 9.19  | 40.38 | 329.00   | 3,023.51  | 13,285.02 | -                              |
| 300937 | 药易购  | 2021-01-20 | 2021-07-27 | 新股流通受限 | 12.25 | 53.71 | 244.00   | 2,989.00  | 13,105.24 | 20210521 除权除息,派息比例 0.2000 (含税) |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股流通受限 | 5.31  | 28.52 | 443.00   | 2,352.33  | 12,634.36 | 20210602 除权除息,派息比例 0.0450 (含税) |
| 300997 | 欢乐家  | 2021-05-26 | 2021-12-02 | 新股流通受限 | 4.94  | 13.05 | 928.00   | 4,584.32  | 12,110.40 | -                              |
| 300933 | 中辰股份 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股流通受限 | 3.37  | 10.44 | 1,112.00 | 3,747.44  | 11,609.28 | 20210618 除权除息,派息比例 0.0300 (含税) |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股流通受限 | 31.56 | 31.56 | 349.00   | 11,014.44 | 11,014.44 | -                              |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021-03-16 | 2021-09-24 | 新股流通受限 | 16.53 | 46.07 | 232.00   | 3,834.96  | 10,688.24 | 20210628 除权除息,派息比例 0.4100 (含税) |
| 300996 | 普联软件 | 2021-05-26 | 2021-12-03 | 新股流通受限 | 20.81 | 42.23 | 241.00   | 5,015.21  | 10,177.43 | -                              |
| 300955 | 英力   | 2021-0     | 2021-0     | 新股     | 12.85 | 25.80 | 371.00   | 4,767.    | 9,571.    | 20210                          |

|        |      |            |            |        |       |       |        |          |          |                                      |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|--------|----------|----------|--------------------------------------|
| 6      | 股份   | 3-16       | 9-27       | 流通受限   |       |       |        | 35       | 80       | 527 除权除息,派息比例<br>0.3000<br>(含税)      |
| 300962 | 中金辐照 | 2021-03-29 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 3.40  | 16.37 | 576.00 | 1,958.40 | 9,429.12 | 20210610 除权除息,派息比例<br>0.1600<br>(含税) |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股流通受限 | 11.72 | 27.08 | 340.00 | 3,984.80 | 9,207.20 | 20210603 除权除息,派息比例<br>0.2200<br>(含税) |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021-06-23 | 2021-12-30 | 新股流通受限 | 13.75 | 32.98 | 275.00 | 3,781.25 | 9,069.50 | -                                    |
| 300966 | 共同药业 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 8.24  | 31.54 | 286.00 | 2,356.64 | 9,020.44 | -                                    |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股流通受限 | 4.56  | 18.88 | 474.00 | 2,161.44 | 8,949.12 | 20210609 除权除息,派息比例<br>0.0950<br>(含税) |
| 300948 | 冠中生态 | 2021-02-18 | 2021-08-24 | 新股流通受限 | 13.00 | 27.42 | 324.00 | 2,808.00 | 8,884.08 | 20210604 除权除息,派息比例<br>0.0800<br>(含   |

|            |          |                |                |                |       |       |              |              |              |                                                          |
|------------|----------|----------------|----------------|----------------|-------|-------|--------------|--------------|--------------|----------------------------------------------------------|
|            |          |                |                |                |       |       |              |              |              | 税),转<br>增比<br>例<br>0.5000                                |
| 30093<br>1 | 通用<br>电梯 | 2021-0<br>1-13 | 2021-0<br>7-21 | 新股<br>流通<br>受限 | 4.31  | 13.11 | 672.00       | 2,896.<br>32 | 8,809.<br>92 | -                                                        |
| 30096<br>1 | 深水<br>海纳 | 2021-0<br>3-23 | 2021-0<br>9-30 | 新股<br>流通<br>受限 | 8.48  | 22.07 | 394.00       | 3,341.<br>12 | 8,695.<br>58 | 20210<br>611 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.0530<br>(含税) |
| 30095<br>0 | 德固<br>特  | 2021-0<br>2-24 | 2021-0<br>9-03 | 新股<br>流通<br>受限 | 8.41  | 39.13 | 219.00       | 1,841.<br>79 | 8,569.<br>47 | 20210<br>601 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.1000<br>(含税) |
| 60516<br>2 | 新中<br>港  | 2021-0<br>6-29 | 2021-0<br>7-07 | 新股<br>流通<br>受限 | 6.07  | 6.07  | 1,377.<br>00 | 8,358.<br>39 | 8,358.<br>39 | -                                                        |
| 30098<br>6 | 志特<br>新材 | 2021-0<br>4-21 | 2021-1<br>1-01 | 新股<br>流通<br>受限 | 14.79 | 30.57 | 264.00       | 3,904.<br>56 | 8,070.<br>48 | -                                                        |
| 30098<br>7 | 川网<br>传媒 | 2021-0<br>4-28 | 2021-1<br>1-11 | 新股<br>流通<br>受限 | 6.79  | 26.81 | 301.00       | 2,043.<br>79 | 8,069.<br>81 | -                                                        |
| 30093<br>0 | 屹通<br>新材 | 2021-0<br>1-13 | 2021-0<br>7-21 | 新股<br>流通<br>受限 | 13.11 | 24.48 | 322.00       | 4,221.<br>42 | 7,882.<br>56 | 20210<br>528 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.1000<br>(含税) |
| 30098<br>5 | 致远<br>新能 | 2021-0<br>4-21 | 2021-1<br>0-29 | 新股<br>流通<br>受限 | 24.90 | 24.81 | 295.00       | 7,345.<br>50 | 7,318.<br>95 | -                                                        |
| 30097<br>1 | 博亚<br>精工 | 2021-0<br>4-07 | 2021-1<br>0-15 | 新股<br>流通       | 18.24 | 28.29 | 245.00       | 4,468.<br>80 | 6,931.<br>05 | 20210<br>611 除                                           |

|            |          |                |                |                |       |       |        |              |              |                                                          |
|------------|----------|----------------|----------------|----------------|-------|-------|--------|--------------|--------------|----------------------------------------------------------|
|            |          |                |                | 受限             |       |       |        |              |              | 权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.4000<br>(含税)                   |
| 30101<br>8 | 申菱<br>环境 | 2021-0<br>6-28 | 2022-0<br>1-07 | 新股<br>流通<br>受限 | 8.29  | 8.29  | 782.00 | 6,482.<br>78 | 6,482.<br>78 | -                                                        |
| 30097<br>5 | 商络<br>电子 | 2021-0<br>4-14 | 2021-1<br>0-21 | 新股<br>流通<br>受限 | 5.48  | 13.03 | 492.00 | 2,696.<br>16 | 6,410.<br>76 | 20210<br>608 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.0360<br>(含税) |
| 30096<br>3 | 中洲<br>特材 | 2021-0<br>3-30 | 2021-1<br>0-11 | 新股<br>流通<br>受限 | 12.13 | 22.49 | 283.00 | 3,432.<br>79 | 6,364.<br>67 | 20210<br>611 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.1500<br>(含税) |
| 30094<br>3 | 春晖<br>智控 | 2021-0<br>2-03 | 2021-0<br>8-10 | 新股<br>流通<br>受限 | 9.79  | 23.01 | 255.00 | 2,496.<br>45 | 5,867.<br>55 | 20210<br>617 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.1000<br>(含税) |
| 30097<br>2 | 万辰<br>生物 | 2021-0<br>4-08 | 2021-1<br>0-19 | 新股<br>流通<br>受限 | 7.19  | 12.65 | 430.00 | 3,091.<br>70 | 5,439.<br>50 | -                                                        |
| 30092<br>9 | 华骐<br>环保 | 2021-0<br>1-12 | 2021-0<br>7-21 | 新股<br>流通<br>受限 | 13.87 | 29.55 | 183.00 | 2,538.<br>21 | 5,407.<br>65 | 20210<br>618 除<br>权除<br>息,派<br>息比<br>例<br>0.1200<br>(含税) |
| 30096      | 通业       | 2021-0         | 2021-0         | 新股             | 12.08 | 23.06 | 234.00 | 2,826.       | 5,396.       | 20210                                                    |

|        |      |            |            |        |       |       |        |          |          |                           |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---------------------------|
| 0      | 科技   | 3-22       | 9-29       | 流通受限   |       |       |        | 72       | 04       | 623 除权除息,派息比例 0.4000 (含税) |
| 300995 | 奇德新材 | 2021-05-17 | 2021-11-26 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191.00 | 2,811.52 | 4,454.12 | -                         |
| 301007 | 德迈仕  | 2021-06-04 | 2021-12-16 | 新股流通受限 | 5.29  | 14.44 | 303.00 | 1,602.87 | 4,375.32 | -                         |
| 300998 | 宁波方正 | 2021-05-25 | 2021-12-02 | 新股流通受限 | 6.02  | 21.32 | 201.00 | 1,210.02 | 4,285.32 | -                         |
| 301012 | 扬电科技 | 2021-06-15 | 2021-12-22 | 新股流通受限 | 8.05  | 24.26 | 170.00 | 1,368.50 | 4,124.20 | -                         |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021-05-17 | 2021-11-25 | 新股流通受限 | 9.36  | 20.32 | 200.00 | 1,872.00 | 4,064.00 | -                         |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股流通受限 | 9.46  | 9.46  | 290.00 | 2,743.40 | 2,743.40 | -                         |

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/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 2021 年 6 月 30 日止，本基金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 2021 年 6 月 30 日止，本基金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 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所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 2021 年 6 月 30 日止，本基金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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 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，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金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；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。



### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

基金的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，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 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。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 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                   | 182,691,160.64 | -     | -     | -                | 182,691,160.64   |
| 结算备付金                  | 3,698,779.40   | -     | -     | -                | 3,698,779.40     |
| 存出保证金                  | 1,166,389.95   | -     | -     | -                | 1,166,389.95     |
| 交易性金融资产                | -              | -     | -     | 1,750,536,302.21 | 1,750,536,302.21 |
| 应收证券清算款                | -              | -     | -     | 11,684,931.60    | 11,684,931.60    |
| 应收利息                   | -              | -     | -     | 26,629.66        | 26,629.66        |
| 应收股利                   | -              | -     | -     | 157,517.60       | 157,517.60       |
| 应收申购款                  | -              | -     | -     | 19,253,751.13    | 19,253,751.13    |
| 资产总计                   | 187,556,329.99 | -     | -     | 1,781,659,132.20 | 1,969,215,462.19 |

|                                  |                  |              |              |                  |                  |
|----------------------------------|------------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| <b>负债：</b>                       |                  |              |              |                  |                  |
| 应付证券清算款                          | -                | -            | -            | 0.01             | 0.01             |
| 应付赎回款                            | -                | -            | -            | 111,144,427.17   | 111,144,427.17   |
| 应付管理人报酬                          | -                | -            | -            | 2,734,154.33     | 2,734,154.33     |
| 应付托管费                            | -                | -            | -            | 455,692.38       | 455,692.38       |
| 应付销售服务费                          | -                | -            | -            | 46,241.90        | 46,241.90        |
| 应付交易费用                           | -                | -            | -            | 1,924,749.04     | 1,924,749.04     |
| 其他负债                             | -                | -            | -            | 332,078.33       | 332,078.33       |
| 负债总计                             | -                | -            | -            | 116,637,343.16   | 116,637,343.16   |
| 利率敏感度缺口                          | 187,556,329.99   | -            | -            | 1,665,021,789.04 | 1,852,578,119.03 |
| <b>上年度末<br/>2020 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>        |
| <b>资产：</b>                       |                  |              |              |                  |                  |
| 银行存款                             | 720,854,286.97   | -            | -            | -                | 720,854,286.97   |
| 结算备付金                            | 509,010,874.99   | -            | -            | -                | 509,010,874.99   |
| 存出保证金                            | 27,566.03        | -            | -            | -                | 27,566.03        |
| 交易性金融资产                          | -                | -            | -            | 879,745,821.37   | 879,745,821.37   |
| 买入返售金融资产                         | 869,200,000.00   | -            | -            | -                | 869,200,000.00   |
| 应收利息                             | -                | -            | -            | 1,111,577.10     | 1,111,577.10     |
| 资产总计                             | 2,099,092,727.99 | -            | -            | 880,857,398.47   | 2,979,950,126.46 |
| <b>负债：</b>                       |                  |              |              |                  |                  |
| 应付证券清算款                          | -                | -            | -            | 46,469,550.77    | 46,469,550.77    |
| 应付管理人报酬                          | -                | -            | -            | 1,781,358.41     | 1,781,358.41     |
| 应付托管费                            | -                | -            | -            | 296,893.07       | 296,893.07       |
| 应付销售服务费                          | -                | -            | -            | 36,518.03        | 36,518.03        |
| 应付交易费用                           | -                | -            | -            | 803,108.46       | 803,108.46       |
| 负债总计                             | -                | -            | -            | 49,387,428.74    | 49,387,428.74    |
| 利率敏感度缺口                          | 2,099,092,727.99 | -            | -            | 831,469,969.73   | 2,930,562,697.72 |

注：上表按金融资产和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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2021年6月30日   |                |                |
|-------------------|---------------------|----------------|----------------|
|                   | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币    | 合计             |
| 以外币计价的资产          |                     |                |                |
| 交易性金融资产           | -                   | 219,808,013.00 | 219,808,013.00 |
| 资产合计              | -                   | 219,808,013.00 | 219,808,013.00 |
| 以外币计价的负债          |                     |                |                |
| 负债合计              | -                   | -              | -              |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | -                   | 219,808,013.00 | 219,808,013.00 |
| 项目                | 上年度末<br>2020年12月31日 |                |                |
|                   | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币    | 合计             |
| 以外币计价             |                     |                |                |

|                   |   |                       |                       |
|-------------------|---|-----------------------|-----------------------|
| 的资产               |   |                       |                       |
| 交易性金融资产           | - | 106,312,934.89        | 106,312,934.89        |
| 资产合计              | - | <b>106,312,934.89</b> | <b>106,312,934.89</b> |
| 以外币计价的负债          |   |                       |                       |
| 负债合计              | - | -                     | -                     |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | - | <b>106,312,934.89</b> | <b>106,312,934.89</b> |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                          |
|----|------------------|-----------------------------|--------------------------|
| 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<br>2021 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%   | 10,990,400.65               | 5,315,646.74             |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -10,990,400.65              | -5,315,646.74            |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性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。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                          |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
|              |                        |                          |                          |                          |
| 交易性金融资产—股票投资 | 1,750,536,302.21       | 94.49                    | 879,745,821.37           | 30.02                    |

|               |                  |       |                |       |
|---------------|------------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—基金投资  | -                | -     | -              | -     |
| 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            | 1,750,536,302.21 | 94.49 | 879,745,821.37 | 30.02 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                          |
|----|----------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 上升 5%                | 123,144,642.20                  | 46,170,842.40            |
|    | 下降 5%                | -123,144,642.20                 | -46,170,842.40           |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### （1）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### （2）以公允价值计量的金融工具

##### （i）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。

##### （ii）各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 1,707,643,468.40 元，属于第二层次的余额为人民币 42,892,833.81 元，无属于第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 879,745,821.37 元，无属于第二层次和第三层次的金额）。

##### （iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，

本基金分别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证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金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              | 1,750,536,302.21 | 88.90        |
|    | 其中：股票             | 1,750,536,302.21 | 88.90        |
| 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      | 186,389,940.04   | 9.47         |
| 8  | 其他各项资产            | 32,289,219.94    | 1.64         |
| 9  | 合计                | 1,969,215,462.19 | 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 219,808,013.00 元，占基金资产净值比例 11.86%。

### 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         | 5,439.50         | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 1,518,428,305.70 | 81.96        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 216,540.39       | 0.01         |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| E | 建筑业             | 25,371.37        | 0.00  |
| F | 批发和零售业          | 28,465.12        | 0.00  |
| 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 | 50,403.70        | 0.00  |
| J | 金融业             | 11,937,491.10    | 0.64  |
| 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   | 36,272.33        | 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              | 1,530,728,289.21 | 82.63 |

### 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（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 公用事业     | -              | -            |
| 金融       | -              | -            |
| 工业       | -              | -            |
| 能源       | -              | -            |
| 日常消费品    | -              | -            |
| 房地产      | -              | -            |
| 原材料      | -              | -            |
| 通信服务     | -              | -            |
| 信息技术     | 162,532,413.30 | 8.77         |
| 医疗保健     | 57,265,825.80  | 3.09         |
| 非日常生活消费品 | 9,773.90       | 0.00         |
| 合计       | 219,808,013.00 | 11.86        |

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(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 603986 | 兆易创新   | 762,035   | 143,186,376.50 | 7.73         |
| 2  | 002371 | 北方华创   | 505,505   | 140,216,976.90 | 7.57         |
| 3  | 002459 | 晶澳科技   | 2,775,723 | 136,010,427.00 | 7.34         |
| 4  | 002475 | 立讯精密   | 2,888,067 | 132,851,082.00 | 7.17         |
| 5  | 601012 | 隆基股份   | 1,418,146 | 125,988,090.64 | 6.80         |
| 6  | 300677 | 英科医疗   | 1,007,752 | 125,767,449.60 | 6.79         |
| 7  | 000333 | 美的集团   | 1,453,808 | 103,758,276.96 | 5.60         |
| 8  | 603501 | 韦尔股份   | 264,100   | 85,040,200.00  | 4.59         |
| 9  | 300014 | 亿纬锂能   | 774,289   | 80,471,855.77  | 4.34         |
| 10 | 300628 | 亿联网络   | 886,737   | 74,308,560.60  | 4.01         |
| 11 | 00981  | 中芯国际   | 3,474,717 | 69,100,696.26  | 3.73         |
| 12 | 688200 | 华峰测控   | 120,043   | 56,819,953.19  | 3.07         |
| 13 | 600519 | 贵州茅台   | 23,900    | 49,155,130.00  | 2.65         |
| 14 | 601966 | 玲珑轮胎   | 1,052,950 | 46,056,033.00  | 2.49         |
| 15 | 300630 | 普利制药   | 852,213   | 44,655,961.20  | 2.41         |
| 16 | 01801  | 信达生物   | 470,000   | 35,412,076.68  | 1.91         |
| 17 | 00285  | 比亚迪电子  | 765,500   | 32,484,819.24  | 1.75         |
| 18 | 02382  | 舜宇光学科技 | 158,100   | 32,282,823.50  | 1.74         |
| 19 | 01347  | 华虹半导体  | 803,000   | 28,664,074.30  | 1.55         |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药   | 397,700   | 27,031,669.00  | 1.46         |
| 21 | 600584 | 长电科技   | 706,714   | 25,045,944.16  | 1.35         |
| 22 | 600745 | 闻泰科技   | 256,921   | 24,895,644.90  | 1.34         |
| 23 | 300274 | 阳光电源   | 201,400   | 23,173,084.00  | 1.25         |
| 24 | 688169 | 石头科技   | 18,959    | 22,202,305.20  | 1.20         |
| 25 | 01951  | 锦欣生殖   | 1,340,000 | 21,853,749.12  | 1.18         |
| 26 | 603236 | 移远通信   | 125,320   | 21,380,845.20  | 1.15         |
| 27 | 300776 | 帝尔激光   | 135,100   | 20,178,536.00  | 1.09         |
| 28 | 300059 | 东方财富   | 363,000   | 11,902,770.00  | 0.64         |
| 29 | 603799 | 华友钴业   | 73,000    | 8,336,600.00   | 0.45         |
| 30 | 688606 | 奥泰生物   | 2,703     | 376,554.93     | 0.02         |
| 31 | 300957 | 贝泰妮    | 853       | 214,921.88     | 0.01         |
| 32 | 600905 | 三峡能源   | 32,000    | 203,520.00     | 0.01         |
| 33 | 688630 | 芯碁微装   | 3,397     | 198,452.74     | 0.01         |
| 34 | 688613 | 奥精医疗   | 2,617     | 166,179.50     | 0.01         |
| 35 | 688329 | 艾隆科技   | 1,846     | 92,373.84      | 0.00         |
| 36 | 688499 | 利元亨    | 2,149     | 83,488.65      | 0.00         |
| 37 | 300979 | 华利集团   | 925       | 80,937.50      | 0.00         |
| 38 | 301018 | 申菱环境   | 7,811     | 64,753.19      | 0.00         |
| 39 | 688468 | 科美诊断   | 3,919     | 64,663.50      | 0.00         |
| 40 | 688676 | 金盘科技   | 3,750     | 60,900.00      | 0.00         |
| 41 | 300981 | 中红医疗   | 601       | 54,324.39      | 0.00         |



|    |        |        |       |           |      |
|----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 42 | 688087 | 英科再生   | 2,469 | 54,219.24 | 0.00 |
| 43 | 300973 | 立高食品   | 360   | 41,655.60 | 0.00 |
| 44 | 601528 | 瑞丰银行   | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 45 | 301021 | 英诺激光   | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 46 | 300953 | 震裕科技   | 240   | 23,964.00 | 0.00 |
| 47 | 001207 | 联科科技   | 682   | 22,581.02 | 0.00 |
| 48 | 301009 | 可靠股份   | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 49 | 300941 | 创识科技   | 399   | 19,926.06 | 0.00 |
| 50 | 688226 | 威腾电气   | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 51 | 300982 | 苏文电能   | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 52 | 300968 | 格林精密   | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 53 | 001208 | 华菱线缆   | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 54 | 300940 | 南极光    | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 55 | 300614 | 百川畅银   | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 56 | 300937 | 药易购    | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 57 | 300942 | 易瑞生物   | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 58 | 603171 | 税友股份   | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 59 | 300997 | 欢乐家    | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 60 | 300933 | 中辰股份   | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 61 | 605287 | 德才股份   | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 62 | 300955 | 嘉亨家化   | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 63 | 300996 | 普联软件   | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 64 | 00027  | 银河娱乐   | 189   | 9,773.90  | 0.00 |
| 65 | 300956 | 英力股份   | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 66 | 688538 | 和辉光电-U | 2,500 | 9,525.00  | 0.00 |
| 67 | 300962 | 中金辐照   | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 68 | 300952 | 恒辉安防   | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 69 | 301016 | 雷尔伟    | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 70 | 300966 | 共同药业   | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 71 | 300945 | 曼卡龙    | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 72 | 300948 | 冠中生态   | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 73 | 300931 | 通用电梯   | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 74 | 300961 | 深水海纳   | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 75 | 300950 | 德固特    | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 76 | 605162 | 新中港    | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 77 | 300986 | 志特新材   | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 78 | 300987 | 川网传媒   | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 79 | 300930 | 屹通新材   | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 80 | 300985 | 致远新能   | 295   | 7,318.95  | 0.00 |
| 81 | 300971 | 博亚精工   | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 82 | 300975 | 商络电子   | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 83 | 300963 | 中洲特材   | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 84 | 300943 | 春晖智控   | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 85 | 300972 | 万辰生物   | 430   | 5,439.50  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 86 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 87 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 88 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 89 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 90 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 91 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 92 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 93 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 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<br>(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------------|
| 1  | 002459 | 晶澳科技 | 206,804,108.72 | 7.06               |
| 2  | 300014 | 亿纬锂能 | 198,511,213.11 | 6.77               |
| 3  | 300677 | 英科医疗 | 187,333,573.97 | 6.39               |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 177,899,970.75 | 6.07               |
| 5  | 002475 | 立讯精密 | 168,873,698.54 | 5.76               |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 159,844,593.70 | 5.45               |
| 7  | 002594 | 比亚迪  | 142,937,397.79 | 4.88               |
| 8  | 603986 | 兆易创新 | 125,562,402.95 | 4.28               |
| 9  | 00981  | 中芯国际 | 122,867,724.32 | 4.19               |
| 10 | 01801  | 信达生物 | 122,857,190.21 | 4.19               |
| 11 | 600745 | 闻泰科技 | 119,193,810.99 | 4.07               |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 108,957,261.92 | 3.72               |
| 13 | 603501 | 韦尔股份 | 105,982,537.06 | 3.62               |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 102,542,955.95 | 3.50               |
| 15 | 600276 | 恒瑞医药 | 96,942,507.77  | 3.31               |
| 16 | 688200 | 华峰测控 | 92,498,293.95  | 3.16               |
| 17 | 00941  | 中国移动 | 92,112,508.71  | 3.14               |
| 18 | 002371 | 北方华创 | 87,024,067.00  | 2.97               |
| 19 | 601966 | 玲珑轮胎 | 71,735,400.09  | 2.45               |
| 20 | 600763 | 通策医疗 | 71,701,630.00  | 2.45               |
| 21 | 688111 | 金山办公 | 69,429,805.69  | 2.37               |
| 22 | 00175  | 吉利汽车 | 59,463,329.75  | 2.03               |

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金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<br>(%) |
|----|--------|-------|----------------|--------------------|
| 1  | 300014 | 亿纬锂能  | 223,684,899.77 | 7.63               |
| 2  | 002594 | 比亚迪   | 144,854,172.76 | 4.94               |
| 3  | 002459 | 晶澳科技  | 126,962,874.21 | 4.33               |
| 4  | 600809 | 山西汾酒  | 117,261,618.60 | 4.00               |
| 5  | 000725 | 京东方 A | 113,796,774.20 | 3.88               |
| 6  | 600519 | 贵州茅台  | 113,139,013.56 | 3.86               |
| 7  | 00981  | 中芯国际  | 112,997,577.53 | 3.86               |
| 8  | 00941  | 中国移动  | 103,984,752.36 | 3.55               |
| 9  | 600745 | 闻泰科技  | 101,184,134.63 | 3.45               |
| 10 | 002475 | 立讯精密  | 96,396,365.76  | 3.29               |
| 11 | 601012 | 隆基股份  | 94,181,384.34  | 3.21               |
| 12 | 01801  | 信达生物  | 90,994,985.47  | 3.11               |
| 13 | 600763 | 通策医疗  | 89,849,974.95  | 3.07               |
| 14 | 601966 | 玲珑轮胎  | 79,704,103.29  | 2.72               |
| 15 | 00027  | 银河娱乐  | 79,105,738.39  | 2.70               |
| 16 | 002371 | 北方华创  | 75,472,088.38  | 2.58               |
| 17 | 688111 | 金山办公  | 74,745,590.09  | 2.55               |
| 18 | 300122 | 智飞生物  | 74,303,216.82  | 2.54               |
| 19 | 603259 | 药明康德  | 67,583,061.40  | 2.31               |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科  | 65,402,220.02  | 2.23               |
| 21 | 600276 | 恒瑞医药  | 60,389,244.22  | 2.06               |

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,989,702,751.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,545,032,258.74 |

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金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

本基金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**

本基金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**

本基金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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

**7.12.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金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   | 1,166,389.95  |
| 2  | 应收证券清算款 | 11,684,931.60 |
| 3  | 应收股利    | 157,517.60    |
| 4  | 应收利息    | 26,629.66     |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | 19,253,751.13 |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 32,289,219.94 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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  |
| 广发瑞安精选股票 A | 21,324   | 65,773.71 | 1,576,701.32 | 0.11%  | 1,400,981,891.92 | 99.89%  |
| 广发瑞安精选股票 C | 9,181    | 13,761.61 | 0.00         | 0.00%  | 126,345,334.00   | 100.00% |
| 合计         | 30,505   | 50,119.78 | 1,576,701.32 | 0.10%  | 1,527,327,225.92 | 99.90%  |

#### 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 | 广发瑞安精选股票 A | 146,744.43 | 0.0105%  |
|                  | 广发瑞安精选股票 C | 10.00      | 0.0000%  |

|  |    |            |         |
|--|----|------------|---------|
|  | 合计 | 146,754.43 | 0.0096% |
|--|----|------------|---------|

### 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 | 广发瑞安精选股票 A | 0                 |
|                                | 广发瑞安精选股票 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 广发瑞安精选股票 A | 10~50             |
|                                | 广发瑞安精选股票 C | 0                 |
|                                | 合计         | 10~50             |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 广发瑞安精选股票 A       | 广发瑞安精选股票 C     |
|---------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）基金份额总额 | 2,670,398,085.31 | 222,400,752.40 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 2,670,398,085.31 | 222,400,752.40 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 147,606,776.73   | 47,915,365.76  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 1,415,446,268.80 | 143,970,784.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 1,402,558,593.24 | 126,345,334.00 |

## 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，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略新增存托凭证投资策略。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

#### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 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 |        |
| 中信建投   | 2      | 156,068,404.90   | 2.08%        | 114,133.30   | 1.98%      | -      |
| 广发证券   | 4      | 531,429,380.57   | 7.09%        | 526,684.92   | 9.12%      | -      |
| 开源证券   | 2      | 632,438,019.26   | 8.44%        | 466,390.37   | 8.07%      | -      |
| 申万宏源   | 1      | 637,622,575.23   | 8.51%        | 604,734.97   | 10.47%     | -      |
| 粤开证券   | 2      | 782,648,058.81   | 10.45%       | 577,454.66   | 10.00%     | 新增 2 个 |
| 东方证券   | 1      | 784,495,371.36   | 10.47%       | 573,685.13   | 9.93%      | -      |
| 方正证券   | 1      | 1,239,748,013.76 | 16.55%       | 906,626.44   | 15.69%     | -      |
| 光大证券   | 4      | 1,263,376,568.88 | 16.86%       | 934,666.21   | 16.18%     | 新增 2 个 |
| 中信证券   | 4      | 1,463,864,182.30 | 19.54%       | 1,072,626.46 | 18.57%     | -      |
| 宏信证券   | 2      | -                | -            | -            | -          | -      |
| 国海证券   | 2      | -                | -            | -            | -          | 新增 2 个 |
| 安信证券   | 2      | -                | -            | -            | -          | -      |
| 野村东方国际 | 2      | -                | -            | -            | -          | -      |
| 江海证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -      |

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

## 2、交易单元选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

## 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 |
| 中信建投   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 广发证券   | 2,493,400.00  | 6.63%        | -              | -              | -    | -            |
| 开源证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 申万宏源   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 粤开证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东方证券   | -             | -            | 739,600,000.00 | 44.88%         | -    | -            |
| 方正证券   | -             | -            | 908,500,000.00 | 55.12%         | -    | -            |
| 光大证券   | 2,947,817.54  | 7.84%        | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券   | 32,147,719.60 | 85.52%       | -              | -              | -    | -            |
| 宏信证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国海证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 安信证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 野村东方国际 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 江海证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

## 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  | 关于广发瑞安精选股票型证券投资基金 2021 年非港股通交易日暂停申购赎回等业务的公 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-02-09 |



|   |                                                  |              |            |
|---|--------------------------------------------------|--------------|------------|
|   | 告                                                |              |            |
| 2 | 关于广发瑞安精选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-02-09 |
| 3 | 关于旗下部分基金 2021 年 4 月 2 日、4 月 6 日暂停申购赎回等业务的提示性公告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-03-31 |
| 4 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告             | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-04-21 |
| 5 | 关于旗下部分基金 2021 年 4 月 29 日、4 月 30 日暂停申购赎回等业务的提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-04-27 |
| 6 | 关于旗下基金投资长电科技（600584）非公开发行股票的公告                   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-04-30 |
| 7 | 关于旗下部分基金 2021 年 5 月 19 日暂停申购赎回等业务的提示性公告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-05-14 |
| 8 | 关于旗下部分基金调整投资范围并相应修订基金合同等法律文件的公告                  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-05-31 |
| 9 | 关于旗下部分基金 2021 年 7 月 1 日暂停申购赎回等业务的提示性公告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021-06-29 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本公司就参与存托凭证投资事宜修订本基金基金合同等法律文件，本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，自 2021 年 5 月 31 日起正式生效。详情可见基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于旗下部分基金调整投资范围并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准广发瑞安精选股票型证券投资基金募集的文件
- （二）《广发瑞安精选股票型证券投资基金基金合同》
- （三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （四）《广发瑞安精选股票型证券投资基金托管协议》

- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

## 12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日