

广发中小盘精选混合型证券投资基金
2022 年年度报告
2022 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。本年度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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	58

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 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	66
8.7 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	66
8.8 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	66
8.9 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	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	67
§9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 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情况	68
§10 开放式基金份额变动	69
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
§13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中小盘精选混合型证券投资基金	
基金简称	广发中小盘精选混合	
基金主代码	005598	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 4 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,103,757,982.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
下属分级基金的交易代码	005598	013955
报告期末下属分级基金的份额总额	665,859,770.54 份	437,898,212.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票，在深入研究的基础上，发掘被市场低估的中小市值公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为一只混合型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为 60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将根据对宏观经济环境、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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×35%+人民币计价的恒生综合中小型股指数收益率×35%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。 本基金将投资于港股通标的股票，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510308	100818
法定代表人		孙树明	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年		2021 年		2020 年	
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
本期已实现收益	-355,722,203.77	-158,499,001.86	40,766,154.09	-3,091,484.93	119,042,605.52	-
本期利润	-418,378,556.49	-263,104,711.69	84,555,022.37	1,556,581.61	83,071,166.75	-
加权平均基金份额本期利润	-0.8426	-1.0085	0.4197	0.0219	0.3921	-
本期加权平均净值利润率	-48.94%	-57.91%	23.32%	1.06%	27.37%	-
本期基金份额净值增长率	-24.85%	-25.16%	26.34%	12.64%	54.36%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
期末可供分配利润	116,513,716.07	73,776,444.37	401,656,339.42	186,998,811.40	131,934,745.70	-
期末可供分配	0.1750	0.1685	0.8767	0.8757	0.6361	-

基金份 额利润						
期 末 基 金 资 产 净 值	1,039,893,5 38.73	680,764,590 .70	952,098,889. 04	443,558,151. 59	341,151,284. 56	-
期 末 基 金 份 额 净 值	1.5617	1.5546	2.0782	2.0772	1.6449	-
3.1.3 累计 期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	广发中小盘 精选混合 A	广发中小盘 精选混合 C	广发中小盘 精选混合 A	广发中小盘 精选混合 C	广发中小盘 精选混合 A	广发中小盘精 选混合 C
基金份 额累 计 净 值 增 长 率	56.17%	-15.70%	107.82%	12.64%	64.49%	-

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

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

（3）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

广发中小盘精选混合 A：

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	-6.29%	1.86%	6.69%	0.97%	-12.98%	0.89%
过去六个月	-12.27%	1.94%	-4.36%	0.87%	-7.91%	1.07%
过去一年	-24.85%	2.03%	-10.07%	1.04%	-14.78%	0.99%
过去三年	46.56%	1.87%	4.47%	0.98%	42.09%	0.89%
自基金合同生 效起至今	56.17%	1.65%	2.56%	0.94%	53.61%	0.71%

广发中小盘精选混合 C：

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①－③	②－④
----	--------------	----------------	----------------	----------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-6.38%	1.86%	6.69%	0.97%	-13.07%	0.89%
过去六个月	-12.45%	1.94%	-4.36%	0.87%	-8.09%	1.07%
过去一年	-25.16%	2.03%	-10.07%	1.04%	-15.09%	0.99%
自基金合同生效起至今	-15.70%	1.94%	-11.11%	0.98%	-4.59%	0.96%

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。

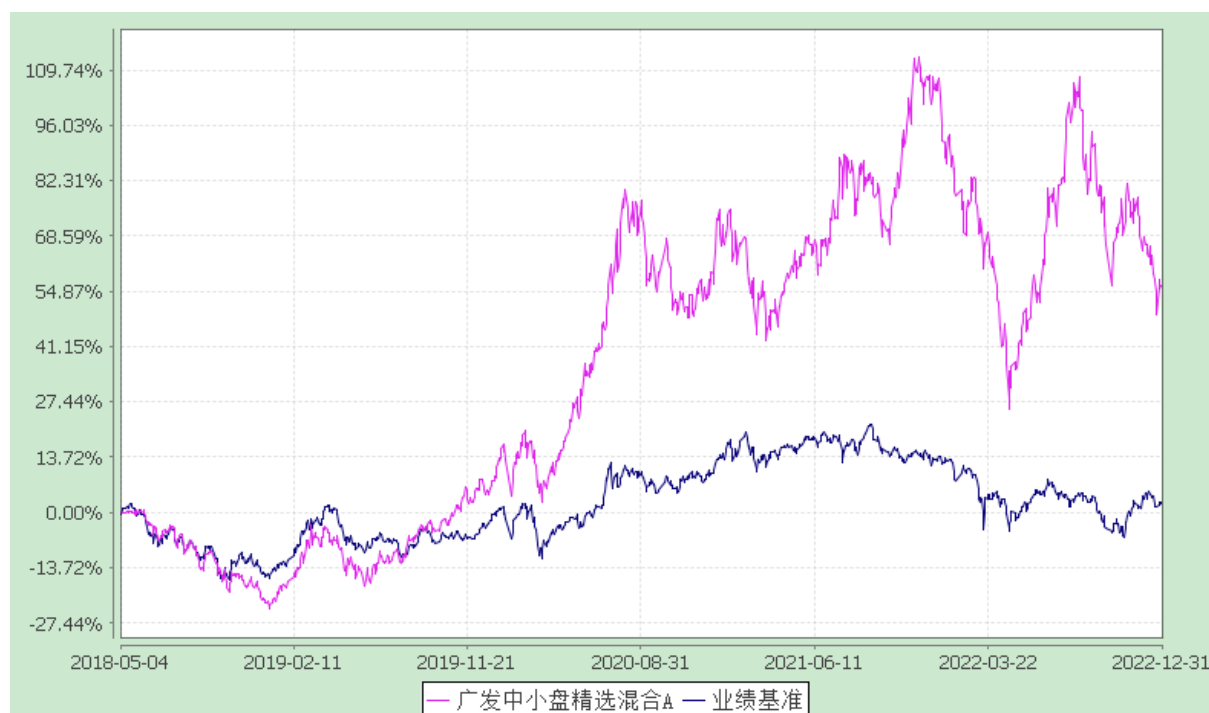
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中小盘精选混合型证券投资基金

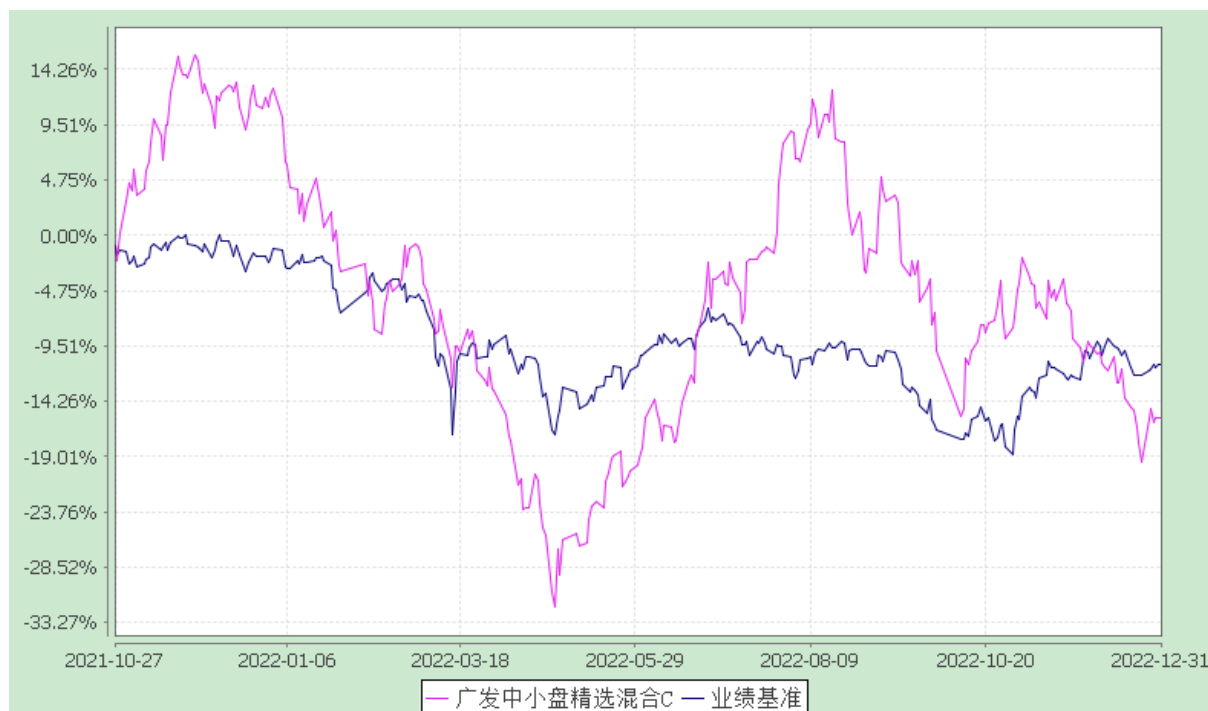
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 5 月 4 日至 2022 年 12 月 31 日)

广发中小盘精选混合 A



广发中小盘精选混合 C

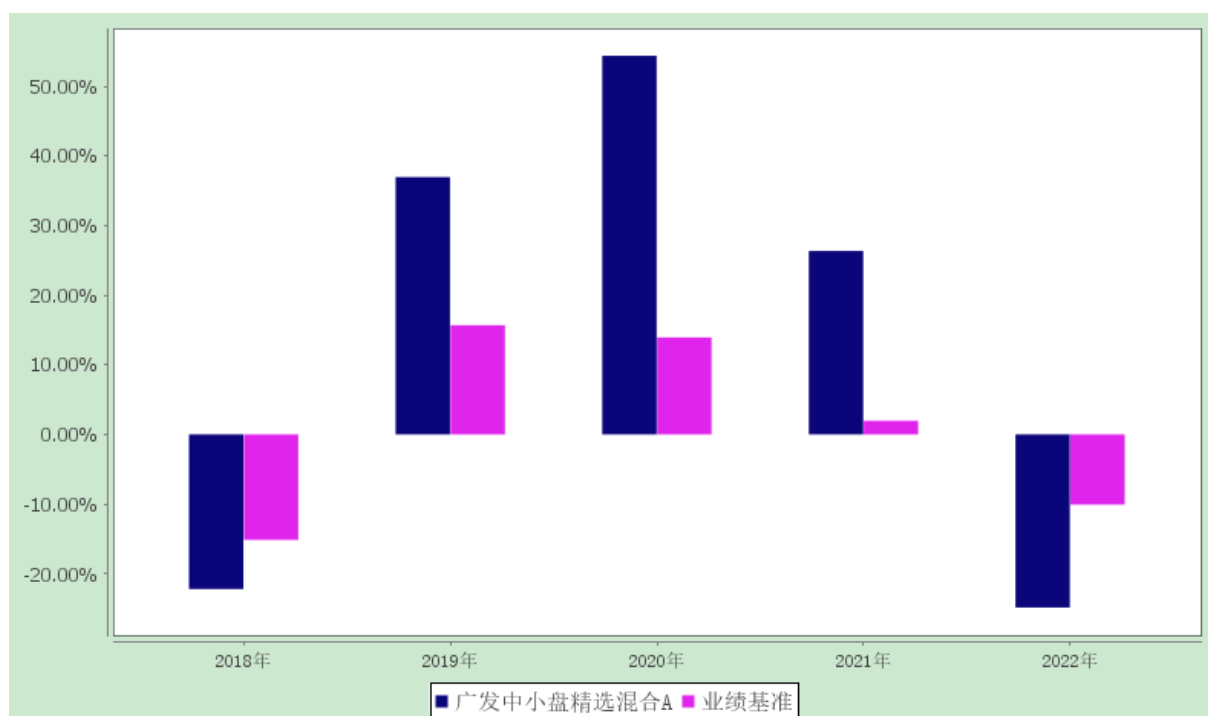


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小盘精选混合型证券投资基金

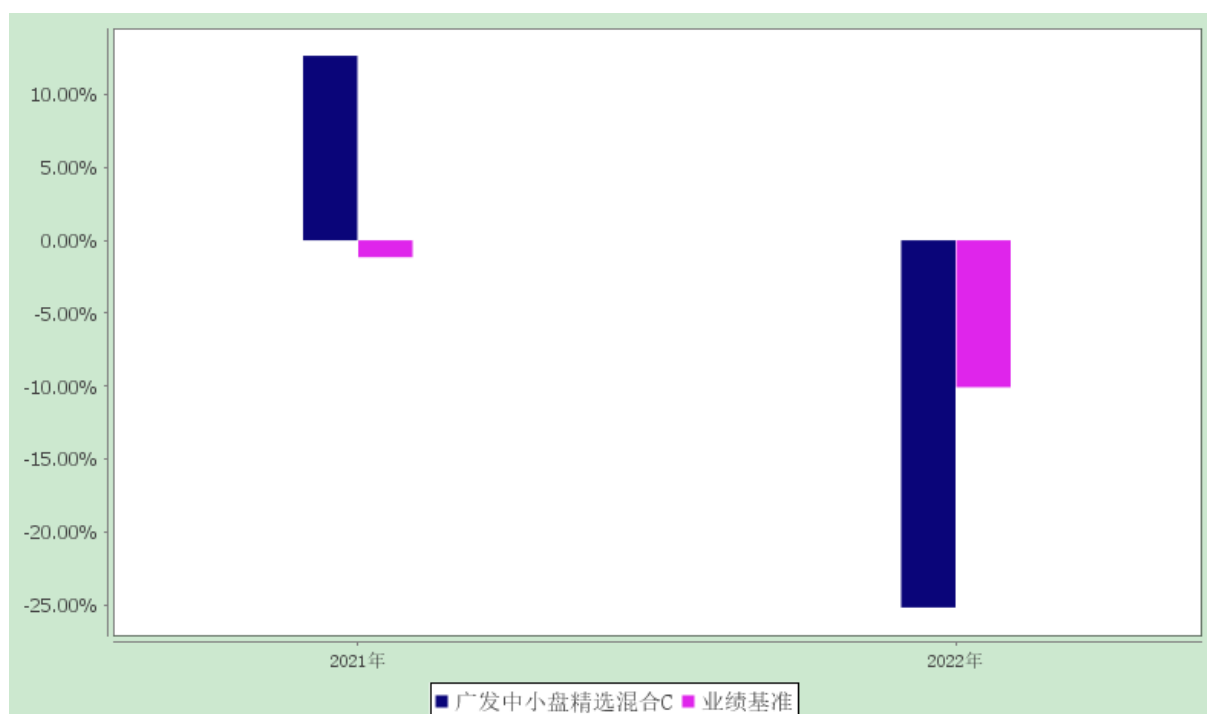
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

广发中小盘精选混合 A



注：本基金的基金合同于 2018 年 5 月 4 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

广发中小盘精选混合 C



注：本基金自 2021 年起增设 C 类份额，C 类份额增设当年（2021 年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、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、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈韞中	本基金的基金	2021-09-2	-	7 年	陈韞中先生，环境管理硕士，持

	经理	8			有中国证券投资基金业从业证书。曾任上海南土资产管理有限公司研究部研究员，上海南土资产管理有限公司(有限合伙)研究部研究员，广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员。
李耀柱	本基金的基金经理；广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理；广发科技动力股票型证券投资基金的基金经理；广发港股通成长精选股票型证券投资基金的基金经理；广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金(QDII)的基金经理；广发全球精选股票型证券投资基金的基金经理；广发沪港深价值成长混合型证券投资基金的基金经理；广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理；国际业务部总经理	2020-02-14	2022-09-26	12 年	李耀柱先生，理学硕士，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中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、国际业务部总经理助理、国际业务部副总经理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 9 月 21 日至 2018 年 10 月 16 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2019 年 4 月 12 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 10 日至 2019 年 4 月 12 日)、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 12 月 17 日至 2020 年 2 月 14 日)、广发消费升级股票型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 27 日至 2020 年 7 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 3 月 7 日至

					2020 年 8 月 10 日)、广发港股通优质增长混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 6 日至 2020 年 8 月 10 日)、广发海外多元配置证券投资基金(QDII)基金经理(自 2018 年 2 月 8 日至 2020 年 11 月 27 日)、广发高股息优享混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 1 月 20 日至 2021 年 2 月 1 日)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 2 月 14 日至 2022 年 9 月 26 日)、广发瑞福精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 11 月 10 日至 2022 年 9 月 26 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合的同时

同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。在本年度本基金与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差专项分析中，未发现存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 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 19 次，其中 16 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 3 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

2022 年上半年，A 股整体表现先抑后扬。1 月至 4 月，受到俄乌战争及各种复杂因素带来的通胀高企影响，市场出现了大幅调整，其中成长板块调整幅度较大。在 4 月底国内疫情影响出现边际拐点之后，A 股大幅反弹并且明显强于全球市场的表现。成长板块继上半年大幅回撤后，在 5、6 月份的市场反弹过程中表现亮眼，尤其是在全球经济下滑背景下需求依旧强劲的新能源及军工产业链在反弹中表现出色。港股以互联网为首的核心行业也出现了较大的反弹，前期外资撤出反而为南下资金提供了较好的配置窗口期。三季度，宏观因子再次对市场产生了影响，欧美通胀预期再次抬头，市场从 8 月起便开启了新一轮调整，调整持续至接近年底，成长板块再次出现了集体下跌的状况，市场对国内经济疲软弱现实，以及海外潜在衰退预期的反馈均较为负面。但随着四季度疫情对经济的扰动得到了较好的缓解之后，市场阶段性见底回升态势明显，前期撤出的外资也在重新评估配置

中国资产的性价比，A 股整体表现以震荡为主，在这样的宏观环境下，此前反弹较好的成长板块回撤明显，而博弈宏观经济复苏的价值板块获得了市场的青睐，虽然基本面尚未真正复苏，但经济刺激政策的陆续出台让市场对 2023 年的展望逐渐积极起来。

本报告期内，本基金保持高仓位，主要配置 A 股。在产品风格定位方面，本基金坚持中小盘风格；在行业配置方面，主要关注科技成长方向。

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-24.85%，C 类基金份额净值增长率为-25.16%，同期业绩比较基准收益率为-10.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2022 年 11 月美国通胀数据低预期、美联储鸽派发言之后，海外综合金融条件有所改善，整体边际利好国内的流动性环境，偏宽松的基调一直延续到 2023 年初，且趋势较为持续，因此我们展望未来一年，市场边际触底回升的可能性较大。从成长板块的选择来看，在经济复苏背景下，半导体设计产业链以及工控自动化板块预计将有不错的顺周期演绎；在受地缘政治催化的国家安全方向上，信创及军工将会是不错的选择；另外，在成长板块中，新技术在行情的演绎中有望成为高弹性品种，例如新能源中的钙钛矿、氢能源，TMT 中的人工智能等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司严格按照法律法规和监管部门要求，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

（一）积极推进内部制度修订完善，不折不扣做好监管新规内化工作，扎实推进制度全覆盖工作，确保公司经营管理与业务开展有章可循，规范有序。

（二）强化投资组合日常风险监控，有效执行关联交易内控措施，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平，实现对投资组合更精细化的风险管理。

（三）加强稽核审计工作闭环管理，通过专项检查、组织自查等方式进行了常规稽核检查，制定整改方案，并做好持续跟踪与督办。

（四）建立合规培训长效机制，持续落实常规化培训，积极拓展多元化培训，不断探索培训创新，提高员工的主动合规意识，强化第一道防线风险意识。

（五）加强公司员工对外言行管理，通过发布通知等规范性文件明确对全体员工的要求，压实管理级员工的监督管理责任。

（六）扎实推进反洗钱日常工作，围绕反洗钱工作的基本要求，按时保质完成洗钱风险自评估、反洗钱主题宣传等工作，不断完善工作机制、提升工作质量。

（七）完善子公司日常管理机制，推动境内子公司相关制度修订与完善，增强对子公司合规负责人的履职监督与保障，加强对子公司报告事项的研究分析。

（八）强化疫情防控远程权限及行为管理，制定远程办公应急预案及各类远程办公合规指引，强调信息技术安全及合规要求，全力保障疫情期间公司各项业务合规、平稳运作。

（九）推进信息披露自动化和智能化建设，探索运用信息技术手段提升管理效能，并不断完善工作指引，在降低操作风险、提高工作效率的同时确保工作质量。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中小盘精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明(2023)审字第 60873695_G143 号

广发中小盘精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发中小盘精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中小盘精选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发中小盘精选混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发中小盘精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

广发中小盘精选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发中小盘精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发中小盘精选混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发

现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发中小盘精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发中小盘精选混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 黄浩松

中国 北京

2023 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	119,537,707.86	68,923,548.64
结算备付金		11,477,941.44	5,229,569.07

存出保证金		943,558.49	266,978.10
交易性金融资产	7.4.7.2	1,591,257,978.51	1,321,388,644.37
其中：股票投资		1,591,257,978.51	1,305,922,959.77
基金投资		-	-
债券投资		-	15,465,684.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	3,554,221.72
应收股利		-	-
应收申购款		24,092,726.57	135.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	340,427.51
资产总计		1,747,309,912.87	1,399,703,525.34
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,376,094.74	110,503.62
应付赎回款		13,069,875.37	-

应付管理人报酬		2,297,059.86	1,476,063.37
应付托管费		382,843.30	246,010.56
应付销售服务费		247,565.20	97,656.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	4,278,344.97	2,116,250.82
负债合计		26,651,783.44	4,046,484.71
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	1,103,757,982.88	671,669,873.39
未分配利润	7.4.7.9	616,900,146.55	723,987,167.24
净资产合计		1,720,658,129.43	1,395,657,040.63
负债和净资产总计		1,747,309,912.87	1,399,703,525.34

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，广发中小盘精选混合 A 基金份额净值人民币 1.5617 元，基金份额总额 665,859,770.54 份；广发中小盘精选混合 C 基金份额净值人民币 1.5546 元，基金份额总额 437,898,212.34 份；总份额总额 1,103,757,982.88 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
-----	-----	---	--

一、营业总收入		-656,608,405.32	99,182,141.29
1.利息收入		583,074.62	406,444.49
其中：存款利息收入	7.4.7.10	583,074.62	205,264.44
债券利息收入		-	190,232.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	10,947.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-492,901,421.82	49,790,289.63
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-497,878,083.97	48,728,404.79
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	812,641.67	-1,991.89
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-346,500.00
股利收益	7.4.7.17	4,164,020.48	1,410,376.73
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-167,262,062.55	48,436,934.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,972,004.43	548,472.35
减：二、营业总支出		24,874,862.86	13,070,537.31
1. 管理人报酬		19,550,359.88	5,751,374.61
2. 托管费		3,258,393.37	958,562.52
3. 销售服务费		1,802,892.28	105,112.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.33	-
8. 其他费用	7.4.7.21	263,217.00	6,255,487.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-681,483,268.18	86,111,603.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-681,483,268.18	86,111,603.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-681,483,268.18	86,111,603.98

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	671,669,873.39	723,987,167.24	1,395,657,040.63
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	671,669,873.39	723,987,167.24	1,395,657,040.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	432,088,109.49	-107,087,020.69	325,001,088.80
（一）、综合收益总额	-	-681,483,268.18	-681,483,268.18
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	432,088,109.49	574,396,247.49	1,006,484,356.98

其中：1.基金申购款	1,696,238,940.50	1,451,953,644.94	3,148,192,585.44
2.基金赎回款	-1,264,150,831.01	-877,557,397.45	-2,141,708,228.46
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,103,757,982.88	616,900,146.55	1,720,658,129.43
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	207,399,711.86	133,751,572.70	341,151,284.56
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	207,399,711.86	133,751,572.70	341,151,284.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	464,270,161.53	590,235,594.54	1,054,505,756.07
（一）、综合收益总额	-	86,111,603.98	86,111,603.98
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	464,270,161.53	504,123,990.56	968,394,152.09
其中：1.基金申购款	683,862,568.98	671,455,854.50	1,355,318,423.48
2.基金赎回款	-219,592,407.45	-167,331,863.94	-386,924,271.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	671,669,873.39	723,987,167.24	1,395,657,040.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发中小盘精选混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）

证监许可[2018]53 号《关于准予广发中小盘精选混合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《广发中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 4 月 9 日向社会公开发行人募集并于 2018 年 5 月 4 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 4 月 9 日至 2018 年 4 月 27 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 811,802,111.33 元，有效认购户数为 14,126 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 137,396.10 元；折合基金份额 137,396.10 份，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。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金自 2021 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。

本基金的财务报表于 2023 年 3 月 27 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信

用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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并确认产生的资产和负债；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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意

义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应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，应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，应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其公允价值的，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；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）。

7.4.4.9 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）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

（5）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（6）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（7）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

（8）黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

（9）黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

（10）其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流

入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 68,923,548.64 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 7,844.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 68,931,393.54 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,229,569.07 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,347.17 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,231,916.24 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 266,978.10 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 120.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 267,098.30 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 340,427.51 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 7,844.90 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,347.17 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 120.20 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币

民币 330,115.24 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,321,388,644.37 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 330,115.24 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,321,718,759.61 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	119,537,707.86	68,923,548.64
等于：本金	119,524,551.09	68,923,548.64
加：应计利息	13,156.77	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	119,537,707.86	68,923,548.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,692,580,400.24	-	1,591,257,978.51	-101,322,421.73
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		1,692,580,400.24	-	1,591,257,978.51	-101,322,421.73
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,239,975,139.00	-	1,305,922,959.77	65,947,820.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	15,473,864.55	-	15,465,684.60	-8,179.95
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	15,473,864.55	-	15,465,684.60	-8,179.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,255,449,003.55	-	1,321,388,644.37	65,939,640.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	340,427.51
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	340,427.51

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,680.40	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,075,164.57	1,957,750.82
其中：交易所市场	4,074,814.57	1,957,750.82
银行间市场	350.00	-
应付利息	-	-
预提费用	198,500.00	158,500.00
合计	4,278,344.97	2,116,250.82

7.4.7.8 实收基金

广发中小盘精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	458,133,708.46	458,133,708.46
本期申购	763,703,739.48	763,703,739.48
本期赎回（以“-”号填列）	-555,977,677.40	-555,977,677.40
本期末	665,859,770.54	665,859,770.54

广发中小盘精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	213,536,164.93	213,536,164.93
本期申购	932,535,201.02	932,535,201.02
本期赎回（以“-”号填列）	-708,173,153.61	-708,173,153.61
本期末	437,898,212.34	437,898,212.34

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。

7.4.7.9 未分配利润

广发中小盘精选混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	401,656,339.42	92,308,841.16	493,965,180.58
本期利润	-355,722,203.77	-62,656,352.72	-418,378,556.49
本期基金份额交易产生的变动数	70,579,580.42	227,867,563.68	298,447,144.10
其中：基金申购款	320,071,455.42	348,009,780.75	668,081,236.17
基金赎回款	-249,491,875.00	-120,142,217.07	-369,634,092.07

本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,513,716.07	257,520,052.12	374,033,768.19

广发中小盘精选混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	186,998,811.40	43,023,175.26	230,021,986.66
本期利润	-158,499,001.86	-104,605,709.83	-263,104,711.69
本期基金份额交易产生的变动数	45,276,634.83	230,672,468.56	275,949,103.39
其中：基金申购款	345,570,204.63	438,302,204.14	783,872,408.77
基金赎回款	-300,293,569.80	-207,629,735.58	-507,923,305.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,776,444.37	169,089,933.99	242,866,378.36

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	448,760.52	103,528.80
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	3,790.66
结算备付金利息收入	123,532.63	97,944.98
其他	10,781.47	-
合计	583,074.62	205,264.44

注：“其他”包含保证金利息收入，以往期间在“其他存款利息收入”列示。

7.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,508,159,774.63	1,918,105,973.83
减：卖出股票成本总额	8,982,558,121.70	1,869,377,569.04
减：交易费用	23,479,736.90	-
买卖股票差价收入	-497,878,083.97	48,728,404.79

7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	44,712.48	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	767,929.19	-1,991.89
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	812,641.67	-1,991.89

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,286,991.66	19,652,547.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,123,781.60	19,459,189.15
减：应计利息总额	394,907.23	195,349.80
减：交易费用	373.64	-
买卖债券差价收入	767,929.19	-1,991.89

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-	-346,500.00

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,164,020.48	1,410,376.73
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,164,020.48	1,410,376.73

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-167,262,062.55	48,436,934.82
——股票投资	-167,270,242.50	48,447,273.97
——债券投资	8,179.95	-10,339.15
——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	-167,262,062.55	48,436,934.82

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	2,672,754.45	396,509.43
基金转换费收入	299,249.98	151,962.92
合计	2,972,004.43	548,472.35

7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	74,000.00	34,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	49,693.64	32,517.79
账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	1,523.36	6,050,969.63
合计	263,217.00	6,255,487.42

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	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
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司）	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人全资子公司
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司、代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券股份有限公司	1,064,780,843.46	5.94%	106,628,010.98	2.26%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	363,700.00	2.20%	-	-

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2022年1月1日至2022年12月31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	994,080.82	7.46%	503,566.55	12.36%
关联方名称	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31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	106,628.02	3.03%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,550,359.88	5,751,374.61
其中：支付销售机构的客户维护费	3,520,434.97	1,531,495.30

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金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，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,258,393.37	958,562.52

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金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，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	1,274,609.14	1,274,609.14
广发证券股份有限公司	-	11.62	11.62
合计	-	1,274,620.76	1,274,620.76
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	82,823.45	82,823.45
合计	-	82,823.45	82,823.45

注：本基金自2021年10月27日起增设C类份额。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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	广发中小盘精选混合A	广发中小盘精选混合C	广发中小盘精选混合A	广发中小盘精选混合C
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	5,832,604.26	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	5,832,604.26	10,000,200.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.50%	1.33%	2.18%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.5.2 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

广发中小盘精选混合 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发中小盘精选混合 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	119,537,707.86	448,760.52	68,923,548.64	103,528.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
688200	华峰测控	2022-12-06	6 个月	大宗买入流通受限	260.79	251.44	120,000.00	31,294,800.00	30,172,800.00	-
688676	金盘科技	2022-11-10	6 个月	大宗买入流通受限	31.83	32.77	785,000.00	24,986,550.00	25,724,450.00	-
688188	柏楚电子	2022-09-29	6 个月	老股流通受限	176.00	206.01	90,000.00	15,840,000.00	18,540,900.00	-
300693	盛弘股份	2022-10-12	6 个月	大宗买入流通受限	39.89	49.41	300,000.00	11,967,000.00	14,823,000.00	-
300847	中船汉光	2022-11-30	6 个月	大宗买入流通受限	17.00	14.54	1,000,000.00	17,000,000.00	14,540,000.00	-

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	15,465,684.60
合计	-	15,465,684.60

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	119,537,707.86	-	-	-	119,537,707.86
结算备付金	11,477,941.44	-	-	-	11,477,941.44
存出保证金	943,558.49	-	-	-	943,558.49
交易性金融资产	-	-	-	1,591,257,978.51	1,591,257,978.51
应收申购款	-	-	-	24,092,726.57	24,092,726.57
资产总计	131,959,207.79	-	-	1,615,350,705.08	1,747,309,912.87
负债					
应付清算款	-	-	-	6,376,094.74	6,376,094.74
应付赎回款	-	-	-	13,069,875.37	13,069,875.37
应付管理人报酬	-	-	-	2,297,059.86	2,297,059.86
应付托管费	-	-	-	382,843.30	382,843.30
应付销售服务费	-	-	-	247,565.20	247,565.20
其他负债	-	-	-	4,278,344.97	4,278,344.97
负债总计	-	-	-	26,651,783.44	26,651,783.44
利率敏感度缺口	131,959,207.79	-	-	1,588,698,921.64	1,720,658,129.43
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	68,923,548.64	-	-	-	68,923,548.64
结算备付金	5,229,569.07	-	-	-	5,229,569.07

存出保证金	266,978.10	-	-	-	266,978.10
交易性金融资产	15,465,684.60	-	-	1,305,922,959.77	1,321,388,644.37
应收证券清算款	-	-	-	3,554,221.72	3,554,221.72
应收利息	-	-	-	340,427.51	340,427.51
应收申购款	-	-	-	135.93	135.93
资产总计	89,885,780.41	-	-	1,309,817,744.93	1,399,703,525.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	110,503.62	110,503.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,476,063.37	1,476,063.37
应付托管费	-	-	-	246,010.56	246,010.56
应付销售服务费	-	-	-	97,656.34	97,656.34
应付交易费用	-	-	-	1,957,750.82	1,957,750.82
其他负债	-	-	-	158,500.00	158,500.00
负债总计	-	-	-	4,046,484.71	4,046,484.71
利率敏感度缺口	89,885,780.41	-	-	1,305,771,260.22	1,395,657,040.63

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-4,666.26
	市场利率下降 25 个基点	-	4,671.26

注：本基金本报告期末未持有债券资产（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。

7.4.13.4.2 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。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末			
	2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	14,062,720.00	-	14,062,720.00
资产合计	-	14,062,720.00	-	14,062,720.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	14,062,720.00	-	14,062,720.00

7.4.13.4.2.2 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	上年度末
		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	-	703,136.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-703,136.00

注：本基金本报告期末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2022 年 12 月 31 日		2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,591,257,978.51	92.48	1,305,922,959.77	93.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	1,591,257,978.51	92.48	1,305,922,959.77	93.57

7.4.13.4.3.2 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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	上升 5%	40,354,682.37	62,575,150.82
	下降 5%	-40,354,682.37	-62,575,150.82

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,487,456,828.51	1,304,005,594.90
第二层次	-	17,383,049.47
第三层次	103,801,150.00	-
合计	1,591,257,978.51	1,321,388,644.37

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	101,088,350.00	101,088,350.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	2,712,800.00	2,712,800.00
其中：计入损益的利得或损失	-	2,712,800.00	2,712,800.00
期末余额	-	103,801,150.00	103,801,150.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,712,800.00	2,712,800.00
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	103,801,150.00	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	45.62%-74.85%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值

					值之 间的 关系
无	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,591,257,978.51	91.07
	其中：普通股	1,591,257,978.51	91.07
	存托凭证	-	-
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	131,015,649.30	7.50
8	其他各项资产	25,036,285.06	1.43
9	合计	1,747,309,912.87	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,392,771,410.96	80.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	50,171,138.00	2.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,937,474.10	3.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	81,377,955.45	4.73
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,591,257,978.51	92.48

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002050	三花智控	4,608,350	97,789,187.00	5.68
2	002384	东山精密	3,793,400	93,810,782.00	5.45
3	300416	苏试试验	2,699,103	81,377,955.45	4.73
4	300124	汇川技术	1,143,100	79,445,450.00	4.62
5	300260	新莱应材	1,124,800	75,474,080.00	4.39
6	688676	金盘科技	1,998,958	69,645,450.44	4.05
7	002472	双环传动	2,588,200	65,869,690.00	3.83
8	300847	中船汉光	3,671,900	56,756,020.00	3.30
9	688084	晶品特装	632,846	52,323,707.28	3.04
10	301029	怡合达	794,020	52,198,874.80	3.03
11	603056	德邦股份	2,408,600	50,171,138.00	2.92
12	003031	中瓷电子	511,800	49,286,340.00	2.86
13	002979	雷赛智能	2,141,976	48,430,077.36	2.81
14	688305	科德数控	520,637	46,076,374.50	2.68
15	600875	东方电气	2,126,100	44,690,622.00	2.60
16	601689	拓普集团	735,700	43,097,306.00	2.50
17	301391	卡莱特	489,575	41,858,662.50	2.43
18	688122	西部超导	435,469	41,234,559.61	2.40
19	688697	纽威数控	1,732,362	39,515,177.22	2.30
20	688200	华峰测控	143,418	36,647,174.46	2.13
21	603915	国茂股份	1,731,271	36,079,687.64	2.10
22	300965	恒宇信通	702,885	30,406,805.10	1.77
23	002859	洁美科技	989,100	27,922,293.00	1.62
24	603728	鸣志电器	820,852	27,358,997.16	1.59
25	688052	纳芯微	83,671	26,573,909.60	1.54
26	002520	日发精机	3,717,586	26,208,981.30	1.52
27	688320	禾川科技	559,950	26,205,660.00	1.52
28	300585	奥联电子	1,346,200	26,116,280.00	1.52
29	603011	合锻智能	2,919,900	23,855,583.00	1.39
30	688060	云涌科技	373,037	21,822,664.50	1.27
31	300660	江苏雷利	893,099	20,889,585.61	1.21
32	300661	圣邦股份	118,550	20,461,730.00	1.19
33	002959	小熊电器	332,810	20,075,099.20	1.17
34	603298	杭叉集团	1,158,200	19,469,342.00	1.13
35	603986	兆易创新	182,600	18,711,022.00	1.09
36	688188	柏楚电子	90,000	18,540,900.00	1.08
37	688311	盟升电子	184,049	14,948,459.78	0.87
38	300693	盛弘股份	300,000	14,823,000.00	0.86
39	301059	金三江	275,100	5,089,350.00	0.30

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002050	三花智控	204,223,871.76	14.63
2	688385	复旦微电	162,204,444.77	11.62
2	01385	上海复旦	38,024,390.74	2.72
3	002384	东山精密	176,476,268.18	12.64
4	603986	兆易创新	170,183,614.37	12.19
5	300660	江苏雷利	141,269,782.79	10.12
6	603728	鸣志电器	139,095,287.66	9.97
7	002472	双环传动	130,801,960.58	9.37
8	688676	金盘科技	126,337,730.75	9.05
9	300260	新莱应材	125,129,386.84	8.97
10	601677	明泰铝业	122,426,495.65	8.77
11	002371	北方华创	119,523,982.37	8.56
12	002056	横店东磁	119,066,229.14	8.53
13	300059	东方财富	119,040,889.02	8.53
14	688017	绿的谐波	114,507,979.27	8.20
15	300373	扬杰科技	104,006,836.51	7.45
16	000768	中航西飞	99,939,146.33	7.16
17	688052	纳芯微	97,271,969.74	6.97
18	688599	天合光能	94,797,834.37	6.79
19	688200	华峰测控	93,803,786.62	6.72
20	688320	禾川科技	93,098,723.11	6.67
21	300124	汇川技术	91,942,098.99	6.59
22	002049	紫光国微	87,707,177.50	6.28
23	300416	苏试试验	84,617,761.39	6.06
24	601877	正泰电器	80,884,813.88	5.80
25	300604	长川科技	79,365,539.12	5.69
26	601689	拓普集团	79,343,491.10	5.69
27	002463	沪电股份	76,380,747.22	5.47
28	603267	鸿远电子	75,291,751.36	5.39
29	300274	阳光电源	74,393,576.50	5.33
30	300007	汉威科技	73,594,366.38	5.27
31	301099	雅创电子	73,352,866.89	5.26
32	603501	韦尔股份	70,314,023.34	5.04
33	300661	圣邦股份	69,690,087.12	4.99
34	301391	卡莱特	69,322,957.44	4.97

35	300101	振芯科技	67,775,035.15	4.86
36	002979	雷赛智能	67,742,492.89	4.85
37	688031	星环科技-U	67,686,423.88	4.85
38	688012	中微公司	66,486,786.70	4.76
39	300847	中船汉光	66,095,141.12	4.74
40	600875	东方电气	65,928,109.86	4.72
41	600487	亨通光电	65,243,277.07	4.67
42	688063	派能科技	61,099,227.47	4.38
43	002436	兴森科技	60,965,336.14	4.37
44	000519	中兵红箭	60,641,452.26	4.35
45	688120	华海清科	59,503,314.08	4.26
46	300750	宁德时代	58,648,908.61	4.20
47	688084	晶品特装	57,574,926.03	4.13
48	002843	泰嘉股份	57,099,364.50	4.09
49	300014	亿纬锂能	56,776,321.00	4.07
50	688697	纽威数控	56,540,262.38	4.05
51	002706	良信股份	55,952,206.35	4.01
52	002158	汉钟精机	55,818,858.97	4.00
53	688305	科德数控	55,488,316.67	3.98
54	002475	立讯精密	55,341,511.14	3.97
55	300316	晶盛机电	55,225,194.10	3.96
56	301029	怡合达	55,052,413.48	3.94
57	300724	捷佳伟创	55,051,145.00	3.94
58	603056	德邦股份	54,196,572.37	3.88
59	603666	亿嘉和	54,110,323.87	3.88
60	003031	中瓷电子	53,877,228.28	3.86
61	688188	柏楚电子	53,430,112.32	3.83
62	000970	中科三环	53,366,858.31	3.82
63	300403	汉宇集团	53,249,230.90	3.82
64	300415	伊之密	52,950,294.21	3.79
65	300565	科信技术	52,463,632.00	3.76
66	688383	新益昌	49,925,820.00	3.58
67	001270	铖昌科技	49,542,341.00	3.55
68	688123	聚辰股份	47,837,838.91	3.43
69	300693	盛弘股份	47,022,926.00	3.37
70	300585	奥联电子	46,486,149.00	3.33
71	603019	中科曙光	46,228,352.20	3.31
72	002446	盛路通信	45,878,592.43	3.29
73	300408	三环集团	45,447,436.34	3.26
74	300747	锐科激光	43,901,150.43	3.15
75	603995	甬金股份	43,759,894.10	3.14
76	688122	西部超导	43,424,017.12	3.11
77	688390	固德威	43,114,895.77	3.09
78	002396	星网锐捷	42,785,253.68	3.07

79	002139	拓邦股份	41,230,992.29	2.95
80	301195	北路智控	41,084,374.60	2.94
81	002943	宇晶股份	40,780,511.76	2.92
82	002812	恩捷股份	40,627,562.00	2.91
83	603908	牧高笛	40,364,103.84	2.89
84	300938	信测标准	40,078,183.90	2.87
85	688223	晶科能源	38,813,989.51	2.78
86	688601	力芯微	38,783,287.22	2.78
87	603915	国茂股份	38,727,565.10	2.77
88	002886	沃特股份	38,399,106.20	2.75
89	000819	岳阳兴长	38,122,956.69	2.73
90	000977	浪潮信息	38,005,152.45	2.72
91	00354	中国软件国际	37,899,965.48	2.72
92	603612	索通发展	37,591,589.00	2.69
93	688268	华特气体	36,086,188.05	2.59
94	688061	灿瑞科技	35,895,651.24	2.57
95	002607	中公教育	35,858,484.90	2.57
96	603595	东尼电子	35,842,323.00	2.57
97	002520	日发精机	35,715,779.00	2.56
98	688439	振华风光	35,674,466.11	2.56
99	300398	飞凯材料	35,453,231.87	2.54
100	002459	晶澳科技	34,879,825.00	2.50
101	603366	日出东方	34,450,942.79	2.47
102	300965	恒宇信通	34,285,061.01	2.46
103	688357	建龙微纳	33,913,413.46	2.43
104	300916	朗特智能	33,473,560.85	2.40
105	300763	锦浪科技	33,109,240.50	2.37
106	600460	士兰微	32,718,378.25	2.34
107	300401	花园生物	32,205,199.00	2.31
108	300696	爱乐达	31,507,272.75	2.26
109	600522	中天科技	31,147,620.49	2.23
110	000065	北方国际	30,987,394.10	2.22
111	603011	合锻智能	30,660,618.64	2.20
112	301189	奥尼电子	30,502,449.46	2.19
113	603032	德新科技	30,178,536.00	2.16
114	605123	派克新材	29,846,773.00	2.14
115	002782	可立克	29,789,895.34	2.13
116	688680	海优新材	29,224,587.73	2.09
117	600761	安徽合力	28,706,776.08	2.06
118	002837	英维克	28,699,745.00	2.06
119	600062	华润双鹤	28,664,768.32	2.05
120	688019	安集科技	28,637,418.39	2.05
121	603298	杭叉集团	28,404,074.10	2.04
122	300229	拓尔思	28,389,356.50	2.03

123	000810	创维数字	28,287,722.64	2.03
124	601878	浙商证券	28,103,189.76	2.01

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688385	复旦微电	171,898,923.71	12.32
1	01385	上海复旦	36,940,619.98	2.65
2	002056	横店东磁	149,569,308.45	10.72
3	603986	兆易创新	148,007,882.71	10.60
4	300660	江苏雷利	132,059,068.99	9.46
5	603728	鸣志电器	124,597,328.75	8.93
6	688599	天合光能	120,223,340.14	8.61
7	002371	北方华创	116,437,257.31	8.34
8	300059	东方财富	116,320,880.58	8.33
9	002384	东山精密	116,052,488.75	8.32
10	601677	明泰铝业	106,803,032.87	7.65
11	300373	扬杰科技	105,394,213.42	7.55
12	688017	绿的谐波	96,372,583.31	6.91
13	002049	紫光国微	94,269,390.33	6.75
14	603501	韦尔股份	92,427,356.32	6.62
15	000768	中航西飞	92,274,065.00	6.61
16	301099	雅创电子	88,495,155.00	6.34
17	002050	三花智控	85,032,515.96	6.09
18	688031	星环科技-U	82,185,135.50	5.89
19	300408	三环集团	79,514,149.52	5.70
20	300604	长川科技	76,333,239.20	5.47
21	688052	纳芯微	75,631,547.99	5.42
22	002463	沪电股份	75,583,256.37	5.42
23	300274	阳光电源	73,332,147.10	5.25
24	002139	拓邦股份	68,206,911.02	4.89
25	603267	鸿远电子	65,511,248.38	4.69
26	300007	汉威科技	64,956,467.55	4.65

27	688320	禾川科技	64,528,234.70	4.62
28	300101	振芯科技	64,244,495.00	4.60
29	601877	正泰电器	63,815,237.13	4.57
30	688676	金盘科技	62,939,332.70	4.51
31	002459	晶澳科技	62,504,341.45	4.48
32	688063	派能科技	62,462,105.00	4.48
33	688120	华海清科	61,005,186.41	4.37
34	002837	英维克	60,852,746.36	4.36
35	600487	亨通光电	60,683,330.26	4.35
36	000970	中科三环	59,920,595.49	4.29
37	688012	中微公司	59,122,102.29	4.24
38	300260	新莱应材	58,723,588.00	4.21
39	002843	泰嘉股份	57,989,191.00	4.15
40	601689	拓普集团	57,905,222.00	4.15
41	000519	中兵红箭	57,774,221.80	4.14
42	300661	圣邦股份	57,715,621.75	4.14
43	688383	新益昌	56,188,345.33	4.03
44	300014	亿纬锂能	55,279,785.99	3.96
45	002008	大族激光	54,653,618.80	3.92
46	605111	新洁能	54,409,125.92	3.90
47	001270	铖昌科技	53,661,765.92	3.84
48	300316	晶盛机电	51,863,359.13	3.72
49	300415	伊之密	49,896,311.53	3.58
50	002475	立讯精密	49,067,769.60	3.52
51	688123	聚辰股份	48,809,105.63	3.50
52	300403	汉宇集团	47,595,265.50	3.41
53	002706	良信股份	47,277,664.75	3.39
54	688200	华峰测控	47,270,904.21	3.39
55	002436	兴森科技	46,831,982.00	3.36
56	002158	汉钟精机	46,090,358.05	3.30
57	300750	宁德时代	45,735,460.00	3.28
58	300724	捷佳伟创	44,774,188.00	3.21
59	002446	盛路通信	43,329,605.70	3.10
60	600707	彩虹股份	42,885,770.66	3.07
61	002472	双环传动	42,364,791.68	3.04
62	688439	振华风光	42,129,292.16	3.02
63	688188	柏楚电子	42,084,930.38	3.02
64	688223	晶科能源	42,079,321.40	3.02
65	603612	索通发展	41,733,145.00	2.99
66	688601	力芯微	41,733,059.46	2.99
67	002396	星网锐捷	41,581,154.37	2.98
68	300565	科信技术	40,220,131.00	2.88
69	603908	牧高笛	40,219,433.49	2.88
70	300747	锐科激光	40,169,339.30	2.88

71	603893	瑞芯微	39,327,154.00	2.82
72	300693	盛弘股份	39,199,540.61	2.81
73	000819	岳阳兴长	38,971,078.36	2.79
74	688390	固德威	38,705,169.92	2.77
75	603019	中科曙光	38,304,022.50	2.74
76	002812	恩捷股份	38,251,920.84	2.74
77	002943	宇晶股份	38,240,455.00	2.74
78	002438	江苏神通	37,915,996.48	2.72
79	301195	北路智控	37,421,830.00	2.68
80	002597	金禾实业	37,352,518.80	2.68
81	688019	安集科技	37,256,515.12	2.67
82	300938	信测标准	36,912,371.58	2.64
83	605358	立昂微	36,758,272.00	2.63
84	00354	中国软件国际	36,415,525.58	2.61
85	689009	九号公司	36,025,709.99	2.58
86	002886	沃特股份	35,694,170.71	2.56
87	300393	中来股份	35,486,964.18	2.54
88	300763	锦浪科技	34,344,035.90	2.46
89	688061	灿瑞科技	34,218,556.58	2.45
90	300916	朗特智能	33,890,131.61	2.43
91	688268	华特气体	33,866,603.18	2.43
92	600522	中天科技	33,565,256.42	2.40
93	688357	建龙微纳	33,391,058.97	2.39
94	603366	日出东方	33,147,927.00	2.38
95	603032	德新科技	32,982,342.00	2.36
96	601611	中国核建	32,879,740.17	2.36
97	600460	士兰微	32,459,641.40	2.33
98	600876	洛阳玻璃	32,248,914.19	2.31
99	605123	派克新材	31,912,079.00	2.29
100	300401	花园生物	31,783,655.61	2.28
101	002782	可立克	31,663,395.00	2.27
102	000977	浪潮信息	31,582,341.26	2.26
103	688608	恒玄科技	31,006,751.88	2.22
104	600562	国睿科技	31,000,897.83	2.22
105	300990	同飞股份	30,901,422.32	2.21
106	300487	蓝晓科技	30,797,010.60	2.21
107	002607	中公教育	30,614,686.96	2.19
108	600062	华润双鹤	30,552,374.15	2.19
109	600761	安徽合力	30,311,988.95	2.17
110	002841	视源股份	30,200,476.07	2.16
111	603995	甬金股份	29,581,990.05	2.12
112	002318	久立特材	29,364,150.00	2.10
113	601878	浙商证券	29,317,017.53	2.10
114	603595	东尼电子	29,279,770.00	2.10

115	600210	紫江企业	29,212,119.00	2.09
116	000810	创维数字	29,150,766.31	2.09
117	300994	久祺股份	29,105,365.80	2.09
118	300696	爱乐达	28,546,118.86	2.05
119	301391	卡莱特	28,454,742.98	2.04
120	603666	亿嘉和	28,253,442.50	2.02
121	301189	奥尼电子	27,915,272.28	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,435,163,382.94
卖出股票收入（成交）总额	8,508,159,774.63

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京晶品特装科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	943,558.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,092,726.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,036,285.06

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688676	金盘科技	25,724,450.00	1.50	大宗买入流通受限

2	300847	中船汉光	14,540,000.00	0.85	大宗买入流通受限
---	--------	------	---------------	------	----------

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
广发中小盘精选混合 A	19,826	33,585.18	446,561,006.36	67.07%	219,298,764.18	32.93%
广发中小盘精选混合 C	1,505	290,962.27	412,126,304.34	94.11%	25,771,908.00	5.89%
合计	21,331	51,744.31	858,687,310.70	77.80%	245,070,672.18	22.20%

9.2 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	广发中小盘精选混合 A	2,016,906.48	0.3029%
	广发中小盘精选混合 C	272,980.72	0.0623%
	合计	2,289,887.20	0.2075%

9.3 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	广发中小盘精选混合 A	50~100
	广发中小盘精选混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中小盘精选混合 A	10~50
	广发中小盘精选混合 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中小盘精选混合 A	广发中小盘精选混合 C
基金合同生效日（2018 年 5 月 4 日）基金份额总额	811,802,111.33	-
本报告期期初基金份额总额	458,133,708.46	213,536,164.93
本报告期基金总申购份额	763,703,739.48	932,535,201.02
减：本报告期基金总赎回份额	555,977,677.40	708,173,153.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	665,859,770.54	437,898,212.34

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 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。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 5 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 74,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	2	3,043,965,396.64	17.00%	2,226,504.70	16.71%	-
招商证券	2	2,443,231,401.69	13.64%	1,786,737.58	13.41%	-
西南证券	1	2,047,459,404.65	11.43%	1,502,679.59	11.28%	-
开源证券	2	1,649,366,584.35	9.21%	1,206,433.05	9.06%	新增 2 个
国金证券	4	1,286,844,335.56	7.18%	941,070.03	7.06%	-
银河证券	2	1,234,982,276.94	6.90%	903,424.02	6.78%	-
广发证券	3	1,064,780,843.46	5.94%	994,080.82	7.46%	-
华创证券	1	1,029,911,685.31	5.75%	753,298.86	5.66%	-
华西证券	1	762,402,182.84	4.26%	557,544.26	4.19%	-
中信证券	3	633,778,411.88	3.54%	463,483.99	3.48%	-
国联证券	1	612,235,169.04	3.42%	447,727.10	3.36%	-
摩根大通证券	2	440,642,442.37	2.46%	322,815.60	2.42%	-
英大证券	1	368,505,863.92	2.06%	269,486.78	2.02%	新增 1 个
粤开证券	3	300,895,282.29	1.68%	220,046.86	1.65%	-
安信证券	1	295,179,982.37	1.65%	215,865.44	1.62%	-
万和证券	1	210,926,809.01	1.18%	154,251.18	1.16%	新增 1 个
长江证券	2	194,022,916.73	1.08%	141,894.01	1.07%	-
东莞证券	1	163,298,190.51	0.91%	119,418.43	0.90%	-
大同证券	1	128,364,680.55	0.72%	93,872.89	0.70%	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
财达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
联储证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
山西证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
中泰证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	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。

11.7.2 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
海通证券	8,498,040.70	51.40%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	7,007,385.00	42.38%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	194,271.60	1.17%	-	-	-	-
广发证券	363,700.00	2.20%	-	-	-	-
华创证券	470,640.49	2.85%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

万和证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-21
2	关于旗下部分基金于 2022 年“春节”期间暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-25
3	关于旗下部分基金 2022 年 3 月 31 日至 2022 年 4 月 5 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-29
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-30
5	关于旗下部分基金 2022 年 4 月 15 日至 2022 年 4 月 18 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-13
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-21
7	关于旗下部分基金 2022 年 4 月 28 日至 2022 年 5 月 4 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-26
8	关于旗下部分基金 2022 年 5 月 9 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-05
9	关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-19
10	关于旗下部分基金 2022 年 7 月 1 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-06-29
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年	中国证监会规定报刊及	2022-07-20

	第 2 季度报告提示性公告	网站	
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-30
13	广发基金管理有限公司关于调整“特定投资群体(养老金客户)”的客户适用范围的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-02
14	广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-26
15	关于旗下部分基金 2022 年 9 月 29 日至 2022 年 10 月 9 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-27
16	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-10-26
17	关于旗下部分基金 2022 年 12 月 26 日至 2022 年 12 月 27 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-22

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20221028-20221231	65,975,495.14	227,704,961.70	-	293,680,456.84	26.61%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： ① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； ② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； ③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； ④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； ⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发中小盘精选混合型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发中小盘精选混合型证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

13.2 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

13.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司
二〇二三年三月三十日