

# 广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

## 2014 年半年度报告

2014 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

## 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。本半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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 25 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	38

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
8.4 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 .....	39
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>40</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
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 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>11 备查文件目录</b> .....	<b>42</b>
11.1 备查文件目录 .....	42
11.2 存放地点 .....	43
11.3 查阅方式 .....	43

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	广发小盘成长股票（LOF）
场内简称	广发小盘
基金主代码	162703
交易代码	162703
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 2 月 2 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,235,416,469.78 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005 年 4 月 29 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于具有高成长性的小市值公司股票，以寻求资本的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略上采取小市值成长导向型，主要投资于基本面良好，具有高成长性的小市值公司股票。
业绩比较基准	天相小市值指数
风险收益特征	较高风险，较高收益

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	廖原
	联系电话	020-83936666	021-61618888
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95528
传真		020-89899158	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	上海市中山东一路12号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号	上海市中山东一路12号

	保利国际广场南塔31-33楼	
邮政编码	510308	200120
法定代表人	王志伟	吉晓辉

## 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、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	-106,373,691.91
本期利润	-498,964,055.29
加权平均基金份额本期利润	-0.1487
本期加权平均净值利润率	-8.83%
本期基金份额净值增长率	-8.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-1,636,596,131.89
期末可供分配基金份额利润	-0.5058
期末基金资产净值	5,371,831,796.94
期末基金份额净值	1.6603
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	254.72%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.38%	0.98%	3.27%	0.98%	-0.89%	0.00%
过去三个月	1.11%	0.96%	3.13%	1.02%	-2.02%	-0.06%
过去六个月	-8.13%	1.30%	1.45%	1.21%	-9.58%	0.09%
过去一年	-2.68%	1.31%	19.07%	1.29%	-21.75%	0.02%
过去三年	-22.73%	1.37%	-14.23%	1.43%	-8.50%	-0.06%
自基金合同生效起至今	254.72%	1.76%	298.75%	2.01%	-44.03%	-0.25%

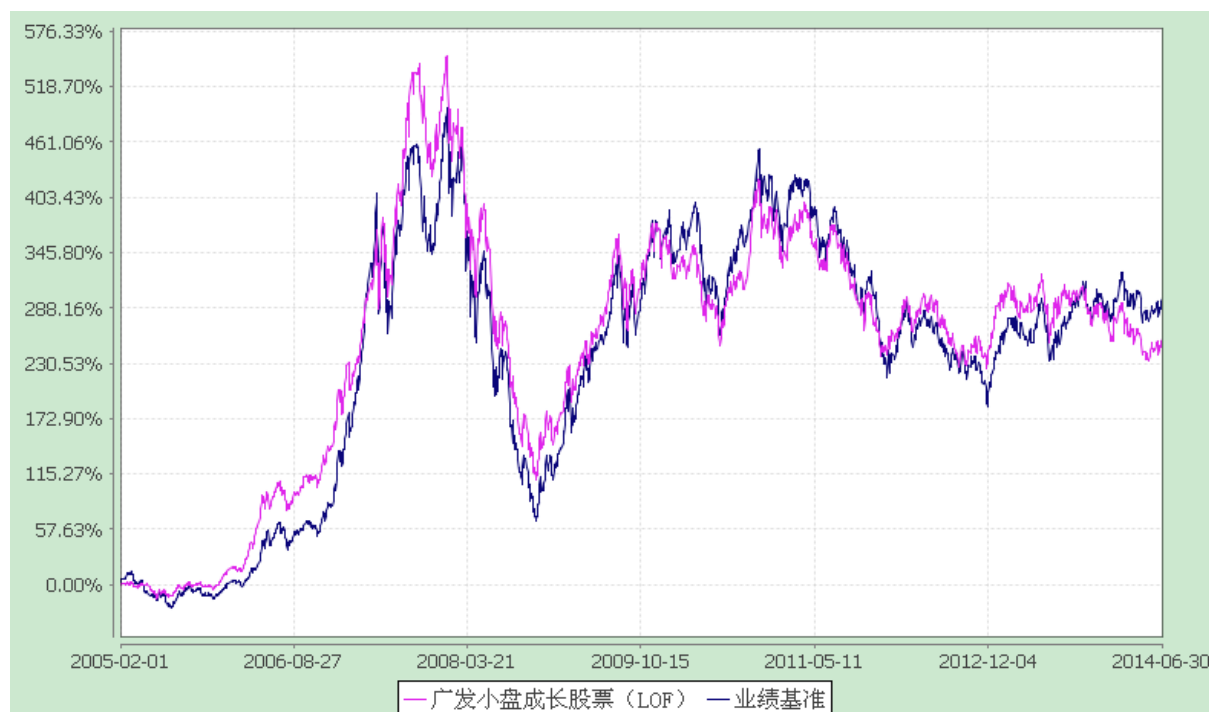
注：本基金业绩比较基准为天相小市值指数。

#### 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

广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

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

（2005年2月2日至2014年6月30日）



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理人（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 22 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、国际业务部、营销服务部、互联网金融部（下辖深圳理财中心、杭州理财中心）、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人管理五十一只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型



证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金和广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为 1271.27 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
陈仕德	本基金的基金经理；广发内需增长混合基金的基金经理；投资总监、权益投资一部总经理	2005-02-02	-	20	男，中国籍，经济学硕士，持有基金业执业资格证书，1997 年至 2001 年任职于广发证券股份有限公司，2001 年至 2003 年 8 月参与筹建广发基金管理有限公司，2003 年 8 月 5 日至 2014 年 1 月 20 日先后任广发基金管理有限公司投资管理部副总经理、投资管理部总经理，2005 年 2 月 2 日起任广发小盘成长股票（LOF）基金的基金经理，2010 年 4 月 19 日起任广发内需增长混合基金的基金经理，2012 年 7 月 11 日起任广发基金管理有限公司投资总监，2014 年 1 月 21 日起任广发基金管理有限公司权益投资一部总经理。
苗宇	本基金的基金经理助理	2010-05-10	-	6	男，中国籍，理学博士，持有基金业执业资格证书，2008 年 7 月 1 日至 2010 年 5 月 9 日任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员，2010 年 5 月 10 日起任广发小盘成长股票（LOF）基金的基金经理。

注：1. 基金经理的“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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《证券投资基金法》及其配套法规、《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。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，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，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。监察稽核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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

## 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

#### 1. 市场回顾

本报告期内，市场波动较大，上证指数下跌 3.20%，创业板上涨 7.69%。分行业来看，计算机、军工等行业表现较好，煤炭、传媒等行业表现较差。本报告期内，国家采取定向刺激政策，经济有企稳的迹象。

## 2. 基金运作回顾

本报告期内，我们增持了计算机、医药等行业，减持了部分制造业。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发小盘基金本报告期内净值增长率为-8.13%，同期业绩比较基准收益率为 1.45%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本报告期内，经济降温明显，地产经历了去年井喷式的放量，今年销量表现较差，带来的是地产商的投资意愿下降，所以我们可以看到上半年的地产投资增长乏力，投资的增长主要靠基建的增长。下半年的情况更为复杂，我们需要关注限购取消后的地产销量是否能够起来，这对于下半年的经济增长非常重要。从行业基本上来看，部分 TMT、大消费和先进制造业的基本面依然良好，这些行业在上半年或多或少都有一些表现。市场在后半段表现活跃，转型的公司比比皆是，尽管不一定都能取得成功，但是转型的方向没有问题，市场给予这些企业一定的估值溢价也是正常的。

展望下半年，我们可以对市场稍微乐观一些，政治形势稳定的大前提下，风险偏好提升带来的估值修复是值得期待的，这种修复的高度尽管难以把握，但是值得参与。我们认为未来大的机会仍然在新兴行业中，这些标的广泛的存在于科技和新型服务行业中，例如移动互联网、医药医疗服务、先进制造业等。还有一些行业是国家鼓励发展的，例如新能源汽车、节能环保等行业，也存在较大的投资机会。对于成长性行业，我们还需要仔细甄别，有些行业已经进入了成长降速阶段，增速已经放缓或者行业空间已经有限，对于这些成长股，谨防落入估值陷阱。

尽管面临较多的不确定，我们相信通过深入的基本面研究，一定能寻找到能穿越周期的投资标的，为持有人带来满意的回报。

### 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、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核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其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。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察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签署服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的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“基金的收益与分配”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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对广发小盘成长股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对广发小盘成长股票型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由广发基金管理有限公司编制本托管人复核的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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资 产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	446,862,480.27	340,882,502.21
结算备付金		23,016,354.44	3,266,733.24
存出保证金		5,210,735.38	3,876,380.11
交易性金融资产	6.4.7.2	4,427,439,293.25	6,014,089,777.65
其中：股票投资		4,427,439,293.25	6,014,089,777.65
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	-	-
应收证券清算款		528,593,214.03	-
应收利息	6.4.7.5	344,821.05	155,979.83
应收股利		-	-
应收申购款		237,348.19	796,415.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,431,704,246.61	6,363,067,788.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013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		28,161,641.77	-
应付赎回款		8,466,457.10	8,811,936.07
应付管理人报酬		6,545,445.77	8,129,386.25
应付托管费		1,090,907.64	1,354,897.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,214,301.44	5,325,067.74
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	1,393,695.95	1,346,558.57
负债合计		59,872,449.67	24,967,846.35
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	3,235,416,469.78	3,506,991,960.84
未分配利润	6.4.7.1 0	2,136,415,327.16	2,831,107,980.89
所有者权益合计		5,371,831,796.94	6,338,099,941.73
负债和所有者权益总计		5,431,704,246.61	6,363,067,788.08

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.6603 元，基金份额总额 3,235,416,469.78 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-423,848,588.18</b>	<b>-403,077,868.27</b>
1. 利息收入		7,925,619.44	5,556,959.92
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	5,627,475.15	5,541,538.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,298,144.29	15,421.44
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-39,927,002.53	48,733,067.48
其中：股票投资收益	6.4.7.1	-85,993,541.65	-1,950,908.21

	2		
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	46,066,539.12	50,683,975.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-392,590,363.38	-459,011,188.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	743,158.29	1,643,292.64
<b>减：二、费用</b>		<b>75,115,467.11</b>	<b>82,984,279.34</b>
1. 管理人报酬		42,096,709.84	60,213,443.44
2. 托管费		7,016,118.29	10,035,573.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	25,733,152.32	12,494,997.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	269,486.66	240,264.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-498,964,055.29</b>	<b>-486,062,147.61</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-498,964,055.29</b>	<b>-486,062,147.61</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	3,506,991,960.84	2,831,107,980.89	6,338,099,941.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-498,964,055.29	-498,964,055.29

润)			
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）	-271,575,491.06	-195,728,598.44	-467,304,089.50
其中：1. 基金申购款	75,259,185.21	51,498,637.43	126,757,822.64
2. 基金赎回款	-346,834,676.27	-247,227,235.87	-594,061,912.14
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）	3,235,416,469.78	2,136,415,327.16	5,371,831,796.94
项目	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	4,544,757,248.84	3,763,796,912.34	8,308,554,161.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-486,062,147.61	-486,062,147.61
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）	-416,445,465.04	-362,595,709.01	-779,041,174.05
其中：1. 基金申购款	268,333,203.50	228,793,551.20	497,126,754.70
2. 基金赎回款	-684,778,668.54	-591,389,260.21	-1,276,167,928.75
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）	4,128,311,783.80	2,915,139,055.72	7,043,450,839.52

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：王志伟，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

广发小盘成长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”）证监基金字[2004]195 号文《关于同意广发小盘成长股票型证券投资基金募集的批复》批准，由基金发



起人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》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2005 年 2 月 2 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。本基金已向中国证监会备案，并获中国证监会基金部函(2005)27 号《关于广发小盘成长股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为 2004 年 12 月 20 日至 2005 年 1 月 25 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 1,175,436,171.10 元，有效认购户数为 12,393 户。其中，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 247,780.56 元，利息结转的基金份额 247,780.56 份，按照基金合同的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳天健信德会计师事务所验资。基金合同于 2005 年 2 月 2 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,175,436,171.10 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准采用：天相小市值指数。

本基金的财务报表于 2014 年 8 月 25 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于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及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。

#### 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 对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，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- 4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- 6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	446,862,480.27
定期存款	-
其他存款	-
合计	446,862,480.27

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,542,729,581.32	4,427,439,293.25	-115,290,288.07
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	4,542,729,581.32	4,427,439,293.25	-115,290,288.07

**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**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.5 应收利息**

单位: 人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	333,389.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,110.41
应收结算备付金利息	9,321.57
应收债券利息	-
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	-
其他	-
合计	344,821.05

**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 2014年6月30日

交易所市场应付交易费用	14,210,027.21
银行间市场应付交易费用	4,274.23
合计	14,214,301.44

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	31,908.85
预提费用	292,939.10
其他	68,848.00
合计	1,393,695.95

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,506,991,960.84	3,506,991,960.84
本期申购	75,259,185.21	75,259,185.21
本期赎回（以“-”号填列）	-346,834,676.27	-346,834,676.27
本期末	3,235,416,469.78	3,235,416,469.78

注：本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,667,243,791.95	4,498,351,772.84	2,831,107,980.89
本期利润	-106,373,691.91	-392,590,363.38	-498,964,055.29
本期基金份额交易产生的变动数	137,021,351.97	-332,749,950.41	-195,728,598.44
其中：基金申购款	-37,604,605.58	89,103,243.01	51,498,637.43
基金赎回款	174,625,957.55	-421,853,193.42	-247,227,235.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,636,596,131.89	3,773,011,459.05	2,136,415,327.16

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	5,478,704.49
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	36,696.31

结算备付金利息收入	111,926.29
其他	148.06
合计	5,627,475.15

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	8,879,767,364.16
减：卖出股票成本总额	8,965,760,905.81
买卖股票差价收入	-85,993,541.65

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**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 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	46,066,539.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	46,066,539.12

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-392,590,363.38
——股票投资	-392,590,363.38
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-392,590,363.38

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日

基金赎回费收入	741,321.16
手续费返还	-
基金转换费收入	1,255.76
印花税返还	581.37
其他	-
合计	743,158.29

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	25,733,152.32
银行间市场交易费用	-
合计	25,733,152.32

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	11,647.56
账户维护费	9,000.00
上市费	60,000.00
其他	400.00
合计	269,486.66

### 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，本基金并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重大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

本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	3,022,154,309.37	18.38%	4,570,238,157.02	57.39%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	2,751,709.98	18.38%	1,861,127.39	13.10%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	4,138,218.62	58.90%	2,691,716.82	36.10%

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 2014年1月1日至2014年6月	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	42,096,709.84	60,213,443.44
其中：支付销售机构的客户维护费	9,438,444.93	11,932,078.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,016,118.29	10,035,573.95

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 为每日应支付的基金托管费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
期初持有的基金份额	24,234,199.30	24,234,199.30
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	16,502,558.00	-
期末持有的基金份额	7,731,641.30	24,234,199.30
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.24%	0.59%

注：基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

##### 6.4.10.4.2 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



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。

6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	446,862,480.27	5,478,704.49	1,026,031,212.15	5,481,157.57

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券股份有限公司	600089	特变电工	配股	1,628,257.00	11,234,973.30
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-

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(2014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
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新股流通受限	12.20	12.20	34,975.00	426,695.00	426,695.00	-

600594	益佰制药	2014-01-21	2015-01-19	非公开发行流通受限	31.35	35.62	526,300.00	16,499,505.00	18,746,806.00	2014年7月14日除息除权，比例：每10股派现金红利1.20元（含税）
002618	丹邦科技	2013-10-28	2014-10-29	非公开发行流通受限	26.50	29.92	2,000,000.00	53,000,000.00	59,840,000.00	2014年6月26日除息除权，比例：每10股派现金红利0.29元（含税）
600705	中航投资	2014-03-20	2015-03-19	非公开发行流通受限	14.54	14.97	11,000,000.00	159,940,000.00	164,670,000.00	2014年7月23日除息除权，比例：每10股派现金红利0.70元（含税）

注：截至本报告期末 2014 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的债券和权证。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300323	华灿光电	2014-04-28	重大事项	20.06	2014-07-28	11.21	499,928.00	10,060,381.20	10,028,555.68	-
002019	鑫富药业	2014-06-25	重大事项	23.76	2014-07-04	26.14	480,000.00	11,932,649.25	11,404,800.00	-
002551	尚荣医疗	2014-06-12	重大事项	34.01	-	-	731,235.00	24,731,907.14	24,869,302.35	-
000547	闽福发A	2014-04-17	重大事项	5.97	-	-	4,634,245.00	28,515,499.99	27,666,442.65	-
002602	世纪华通	2014-06-25	重大事项	24.68	2014-07-02	25.50	5,408,102.00	136,248,437.61	133,471,957.36	-
600418	江淮汽车	2014-04-14	重大事项	10.24	2014-07-11	11.22	23,500,136.00	229,614,356.15	240,641,392.64	-

#### 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 2014 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 2014 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。

#### 6.4.13 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体系的建设, 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监察稽核部负责, 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。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核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，本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会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，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

#### 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、外汇风险和市场价格风险。

##### 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。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2014 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	446,862,480.27	-	-	-	446,862,480.27
结算备付金	23,016,354.44	-	-	-	23,016,354.44
存出保证金	5,210,735.38	-	-	-	5,210,735.38
交易性金融资产	0.00	-	-	4,427,439,293.	4,427,439,293.

				25	3.25
应收证券清算款	-	-	-	528,593,214.03	528,593,214.03
应收利息	-	-	-	344,821.05	344,821.05
应收申购款	20,750.26	-	-	216,597.93	237,348.19
资产总计	475,110,320.35	-	-	4,956,593,926.26	5,431,704,246.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	28,161,641.77	28,161,641.77
应付赎回款	-	-	-	8,466,457.10	8,466,457.10
应付管理人报酬	-	-	-	6,545,445.77	6,545,445.77
应付托管费	-	-	-	1,090,907.64	1,090,907.64
应付交易费用	-	-	-	14,214,301.44	14,214,301.44
其他负债	-	-	-	1,393,695.95	1,393,695.95
负债总计	-	-	-	59,872,449.67	59,872,449.67
利率敏感度缺口	475,110,320.35	-	-	4,896,721,476.59	5,371,831,796.94
<b>上年度末</b>					
<b>2013年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	340,882,502.21	-	-	-	340,882,502.21
结算备付金	3,266,733.24	-	-	-	3,266,733.24
存出保证金	3,876,380.11	-	-	-	3,876,380.11
交易性金融资产	-	-	-	6,014,089,777.65	6,014,089,777.65
应收利息	-	-	-	155,979.83	155,979.83
应收申购款	104,057.85	-	-	692,357.19	796,415.04
资产总计	348,129,673.41	-	-	6,014,938,114.67	6,363,067,788.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,811,936.07	8,811,936.07
应付管理人报酬	-	-	-	8,129,386.25	8,129,386.25

其他负债	-	-	-	1,346,558.57	1,346,558.57
应付托管费	-	-	-	1,354,897.72	1,354,897.72
应付交易费用	-	-	-	5,325,067.74	5,325,067.74
负债总计	-	-	-	24,967,846.35	24,967,846.35
利率敏感度缺口	348,129,673.41	-	-	5,989,970,268.32	6,338,099,941.73

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投资，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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指以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，通过标准差、跟踪误差、beta 值、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 2014年6月30日		上年度末 2013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	4,427,439,293.25	82.42	6,014,089,777.65	94.89
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	4,427,439,293.25	82.42	6,014,089,777.65	94.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2014年6月30日	2013年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	268,589,853.00	279,655,174.66
	业绩比较基准下降 5%	-268,589,853.00	-279,655,174.66

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

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	4,427,439,293.25	81.51
	其中：股票	4,427,439,293.25	81.51
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	469,878,834.71	8.65
7	其他各项资产	534,386,118.65	9.84
8	合计	5,431,704,246.61	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,363,496.52	0.25
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,543,925,083.54	47.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	163,795,183.17	3.05
F	批发和零售业	175,637,975.22	3.27
G	交通运输、仓储和邮政业	73,934,358.82	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	468,991,546.29	8.73
J	金融业	164,670,000.00	3.07
K	房地产业	676,587,593.37	12.60
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,182,724.75	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	108,439,450.77	2.02
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	28,911,880.80	0.54
S	综合	-	-
	合计	4,427,439,293.25	82.42

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
1	002195	海隆软件	5,150,605	246,456,449.25	4.59
2	600418	江淮汽车	23,500,136	240,641,392.64	4.48



3	000651	格力电器	8,000,000	235,600,000.00	4.39
4	300020	银江股份	6,807,586	208,312,131.60	3.88
5	002152	广电运通	12,091,770	206,043,760.80	3.84
6	000977	浪潮信息	5,059,718	178,000,879.24	3.31
7	000024	招商地产	16,452,124	171,431,132.08	3.19
8	600705	中航投资	11,000,000	164,670,000.00	3.07
9	000961	中南建设	25,083,489	163,795,183.17	3.05
10	002146	荣盛发展	17,081,326	161,760,157.22	3.01
11	600048	保利地产	29,318,608	145,420,295.68	2.71
12	002354	科冕木业	3,074,101	135,260,444.00	2.52
13	002602	世纪华通	5,408,102	133,471,957.36	2.48
14	300028	金亚科技	10,000,000	123,000,000.00	2.29
15	000926	福星股份	17,537,632	114,345,360.64	2.13
16	002484	江海股份	5,916,294	109,806,416.64	2.04
17	000938	紫光股份	4,207,976	107,387,547.52	2.00
18	000069	华侨城 A	21,218,433	99,514,450.77	1.85
19	600153	建发股份	17,862,598	97,351,159.10	1.81
20	600062	华润双鹤	5,275,135	90,679,570.65	1.69
21	300165	天瑞仪器	4,534,892	89,881,559.44	1.67
22	000656	金科股份	12,137,975	83,630,647.75	1.56
23	300072	三聚环保	3,514,673	70,258,313.27	1.31
24	600594	益佰制药	1,591,969	62,577,771.97	1.16
25	600079	人福医药	2,031,395	60,637,140.75	1.13
26	002618	丹邦科技	2,000,000	59,840,000.00	1.11
27	600261	阳光照明	6,014,602	59,424,267.76	1.11
28	601000	唐山港	11,829,395	51,812,750.10	0.96
29	300329	海伦钢琴	2,767,698	48,739,161.78	0.91
30	000963	华东医药	889,799	48,049,146.00	0.89
31	002209	达意隆	6,073,299	44,152,883.73	0.82
32	002022	科华生物	1,469,580	33,873,819.00	0.63
33	002491	通鼎光电	1,879,857	30,641,669.10	0.57
34	000906	物产中拓	2,058,769	29,810,975.12	0.55
35	000547	闽福发 A	4,634,245	27,666,442.65	0.52
36	002535	林州重机	3,047,085	25,534,572.30	0.48
37	600420	现代制药	1,342,315	24,899,943.25	0.46
38	002551	尚荣医疗	731,235	24,869,302.35	0.46
39	002184	海得控制	2,000,000	23,200,000.00	0.43
40	600270	外运发展	1,831,259	22,121,608.72	0.41
41	600776	东方通信	1,445,138	19,292,592.30	0.36
42	601098	中南传媒	1,318,620	19,040,872.80	0.35
43	300003	乐普医疗	829,882	17,344,533.80	0.32
44	300049	福瑞股份	571,896	16,470,604.80	0.31
45	002488	金固股份	1,400,067	16,380,783.90	0.30
46	000973	佛塑科技	3,000,000	15,840,000.00	0.29

47	002364	中恒电气	873,928	15,564,657.68	0.29
48	002099	海翔药业	2,000,000	13,860,000.00	0.26
49	000768	中航飞机	1,300,000	13,689,000.00	0.25
50	000998	隆平高科	486,299	13,363,496.52	0.25
51	002191	劲嘉股份	999,910	13,298,803.00	0.25
52	600249	两面针	2,463,160	13,079,379.60	0.24
53	300077	国民技术	468,900	12,913,506.00	0.24
54	600517	置信电气	1,220,205	12,397,282.80	0.23
55	002290	禾盛新材	869,975	11,492,369.75	0.21
56	002019	鑫富药业	480,000	11,404,800.00	0.21
57	002445	中南重工	699,902	10,953,466.30	0.20
58	002174	游族网络	195,000	10,730,850.00	0.20
59	002108	沧州明珠	806,369	10,216,695.23	0.19
60	300323	华灿光电	499,928	10,028,555.68	0.19
61	600880	博瑞传播	833,700	9,871,008.00	0.18
62	000513	丽珠集团	200,746	9,481,233.58	0.18
63	002143	高金食品	499,885	9,252,871.35	0.17
64	600081	东风科技	664,015	9,223,168.35	0.17
65	600645	中源协和	330,909	9,182,724.75	0.17
66	600054	黄山旅游	700,000	8,925,000.00	0.17
67	002104	恒宝股份	299,979	5,879,588.40	0.11
68	002049	同方国芯	240,000	5,700,000.00	0.11
69	300010	立思辰	200,000	4,984,000.00	0.09
70	300310	宜通世纪	199,916	3,848,383.00	0.07
71	300255	常山药业	100,000	2,819,000.00	0.05
72	600667	太极实业	600,000	2,778,000.00	0.05
73	300299	富春通信	214,242	2,746,582.44	0.05
74	002410	广联达	100,000	2,644,000.00	0.05
75	002437	誉衡药业	48,375	2,491,312.50	0.05
76	002584	西陇化工	150,000	2,332,500.00	0.04
77	600884	杉杉股份	105,000	1,804,950.00	0.03
78	002266	浙富控股	100,000	709,000.00	0.01
79	002727	一心堂	34,975	426,695.00	0.01
80	300385	雪浪环境	15,852	406,762.32	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	002181	粤传媒	256,251,930.62	4.04
2	300028	金亚科技	234,742,490.74	3.70
3	600880	博瑞传播	218,307,835.72	3.44
4	002195	海隆软件	197,396,636.34	3.11
5	000977	浪潮信息	186,481,161.06	2.94
6	002354	科冕木业	160,762,484.37	2.54
7	600705	中航投资	159,940,000.00	2.52
8	300165	天瑞仪器	157,436,154.06	2.48
9	002602	世纪华通	144,191,059.46	2.27
10	000024	招商地产	138,811,582.44	2.19
11	002146	荣盛发展	126,538,862.95	2.00
12	601000	唐山港	125,400,619.68	1.98
13	000938	紫光股份	110,192,434.25	1.74
14	600048	保利地产	107,314,123.80	1.69
15	601098	中南传媒	104,841,254.61	1.65
16	002008	大族激光	98,481,878.26	1.55
17	600261	阳光照明	98,474,477.45	1.55
18	600804	鹏博士	78,127,038.27	1.23
19	600519	贵州茅台	74,085,857.55	1.17
20	002551	尚荣医疗	73,344,833.99	1.16

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 (%)
1	600383	金地集团	337,889,319.82	5.33
2	000651	格力电器	284,585,168.67	4.49
3	600388	龙净环保	263,203,184.51	4.15
4	600887	伊利股份	240,305,588.03	3.79
5	002181	粤传媒	235,891,767.19	3.72
6	000997	新大陆	228,127,008.35	3.60
7	600880	博瑞传播	197,539,805.56	3.12
8	600048	保利地产	192,751,989.26	3.04
9	000024	招商地产	189,293,517.01	2.99
10	002146	荣盛发展	184,632,233.11	2.91
11	000568	泸州老窖	175,845,058.08	2.77
12	000001	平安银行	150,079,276.48	2.37
13	002202	金风科技	145,960,424.80	2.30
14	600030	中信证券	144,601,936.48	2.28

15	000917	电广传媒	140,980,184.09	2.22
16	600062	华润双鹤	132,934,727.14	2.10
17	300079	数码视讯	126,814,625.05	2.00
18	000069	华侨城 A	124,286,301.62	1.96
19	002001	新 和 成	117,308,126.21	1.85
20	002630	华西能源	110,351,181.31	1.74

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	7,771,700,784.79
卖出股票的收入（成交）总额	8,879,767,364.16

#### 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 根据银江股份（300020）2013 年 11 月 11 日收到证监会浙江监管局的《关于对银江股份有限公司采取责令整改措施的决定》（[2013]12 号）（以下简称“《责令整改决定书》”）的公告显示：银江股份 2012 年的公司年报存在两方面问题，一是信息披露方面比如涉及关联交易、各项合同的财务明细情况等未按照要求进行及时、准确地披露；二是财务会计方面如涉及到合同收入和成本等问题未确保及时、准确、完整地确认。

我司广发小盘成长基金在 2013 年 12 月、2014 年 1 月和 2 月陆续买入了银江股份的股票。关于上市公司被责令整改的事情，我们进行分析后认为对公司的实质性影响非常小。涉及到的合同金额收入确认偏差在 1379 万，占 2012 年收入的比例不到 1%，涉及到对净利润的影响 86 万，占当年净利润的比例不到 1%。

我们买入银江股份的主要理由是，看好国家在出台《国务院关于促进信息消费扩大内需的若干意见》的政策后，提出要加快智慧城市建设，而银江股份的业务就是智慧交通、智慧建筑、智慧医疗，完全符合国家的政策导向。我们预计公司会受益于各地方政府的智慧城市建设大潮。当时根据 2014 年的盈利预测，每股收益 0.9 元，增速 40%。当时股价在 20-25 元之间，对应 PE 不到 30 倍，跟整个计算机板块比，跟相同主业的公司比，估值非常便宜，有很大的比价优势。因此我们开始逐步买入公司股票。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

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	5,210,735.38
2	应收证券清算款	528,593,214.03
3	应收股利	-

4	应收利息	344,821.05
5	应收申购款	237,348.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,386,118.65

#### 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

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	600418	江淮汽车	240,641,392.64	4.48	重大事项
2	600705	中航投资	164,670,000.00	3.07	非公开发行 流通受限

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
298,841	10,826.55	57,716,057.00	1.78%	3,177,700,412.78	98.22%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	厦门市担保有限公司	1,515,717.00	1.42%
2	钟晖	1,061,900.00	0.99%
3	向华	800,000.00	0.75%
4	苏楞格	738,446.00	0.69%
5	郑学诚	660,000.00	0.62%
6	高玉英	601,676.00	0.56%
7	田开满	597,500.00	0.56%
8	朱月媚	440,000.00	0.41%
9	程朝康	415,760.00	0.39%
10	金丹	415,723.00	0.39%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	633,614.09	0.0196%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 2 月 2 日）基金份额总额	1,175,436,171.10
本报告期期初基金份额总额	3,506,991,960.84
本报告期基金总申购份额	75,259,185.21
减：本报告期基金总赎回份额	346,834,676.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,235,416,469.78

## 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，基金管理人无重大人事变动。

经上海浦东发展银行股份有限公司决定，其资产托管与养老金业务部原总经理李桦同志自 2014 年 4 月起不再担任其资产托管与养老金业务部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及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组合策略没有重大改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚



的情况。

### 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	
申银万国	1	84,506,847.78	0.51%	76,935.02	0.51%	-
长城证券	1	70,654,490.86	0.43%	64,323.11	0.43%	-
广州证券	1	5,147,704,475.61	31.31%	4,686,478.45	31.31%	-
财通证券	1	419,659,761.01	2.55%	382,058.85	2.55%	-
兴业证券	1	375,576,927.91	2.28%	341,927.60	2.28%	-
东海证券	1	373,971,699.11	2.27%	340,466.76	2.27%	-
广发证券	2	3,022,154,309.37	18.38%	2,751,709.98	18.38%	-
国信证券	1	2,830,683,789.60	17.22%	2,577,054.66	17.21%	-
国金证券	1	2,805,338,521.83	17.06%	2,553,983.40	17.06%	-
中金公司	1	1,312,651,107.38	7.98%	1,195,033.11	7.98%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易席位选择标准：

- (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. 交易席位选择流程：

- (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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额

		额的比例		额的比例		额的比例
长城证券	-	-	200,000,000.00	5.52%	-	-
国信证券	-	-	3,390,000,000.00	93.50%	-	-
国金证券	-	-	35,553,000.00	0.98%	-	-

### 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	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加特变电工股份有限公司 A 股配股发行结果的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-01-29
2	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金广发基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众禄基金为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-02-28
3	广发基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-02-28
4	广发基金管理有限公司关于增加嘉实财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-03-18
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金投资中航投资（600705）非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-03-24
6	广发基金管理有限公司关于增加东兴证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-04-03
7	广发基金管理有限公司关于增加大同证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-06-11
8	广发基金管理有限公司关于增加恒天明泽为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-06-13
9	广发基金管理有限公司关于增加爱建证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2014-06-27

注：无

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发小盘成长股票型证券投资基金募集的文件；

2. 《广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《广发小盘成长股票型证券投资基金托管协议》；
4. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 《广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新版；
6. 《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；
7. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
8. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 11.2 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

## 11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，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>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：[services@gf-funds.com.cn](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇一四年八月二十九日