

# 广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

## 2019 年半年度报告

### 2019 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

送出日期：二〇一九年八月二十八日

## 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 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 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.....	9
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.....	11
<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的真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 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 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	36
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	36

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	36
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
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 .....	37
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4 基金投资策略的改变 .....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
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 .....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	38
10.8 其他重大事件 .....	40
<b>11 备查文件目录</b> .....	<b>40</b>
11.1 备查文件目录 .....	40
11.2 存放地点 .....	40
11.3 查阅方式 .....	41

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	广发小盘成长混合（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	1,815,612,003.29 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	本基金的股票资产配置比例为 60%-95%，债券资产配置比例为 0-15%，现金大于等于 5%。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	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

### 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	邱春杨	胡波
	联系电话	020-83936666	021-61618888
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		95105828	95528
传真		020-89899158	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路	上海市中山东一路12号

	6号105室-49848（集中办公区）	
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	上海市北京东路689号
邮政编码	510308	200001
法定代表人	孙树明	高国富

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金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（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	179,883,228.70
本期利润	594,366,224.38
加权平均基金份额本期利润	0.3268
本期加权平均净值利润率	25.32%
本期基金份额净值增长率	30.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-267,751,875.56
期末可供分配基金份额利润	-0.1475
期末基金资产净值	2,497,580,745.92
期末基金份额净值	1.3756
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	478.01%

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	1.14%	1.42%	0.98%	1.40%	0.16%	0.02%
过去三个月	-3.22%	1.53%	-9.63%	1.81%	6.41%	-0.28%
过去六个月	30.85%	1.68%	19.01%	1.78%	11.84%	-0.10%
过去一年	2.07%	1.73%	-4.79%	1.68%	6.86%	0.05%
过去三年	21.32%	1.33%	-27.97%	1.31%	49.29%	0.02%
自基金合同生效起至今	478.01%	1.75%	378.96%	1.96%	99.05%	-0.21%

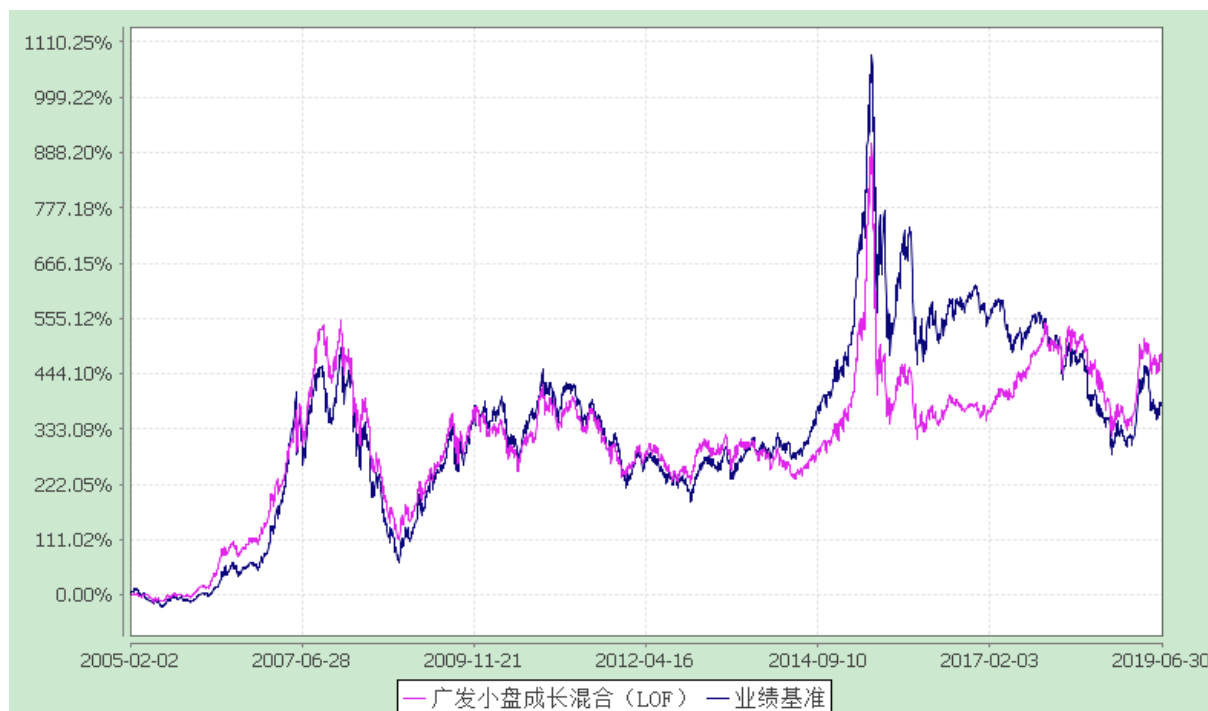
注：业绩比较基准：天相小市值指数。

#### 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

广发小盘成长混合型证券投资基金（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2019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金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理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、合格境内机构投资者境外证券投资（QDII）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 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国



际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至2019年6月30日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为4452亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘格菘	本基金的基金经理；广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发双擎升级混合型证券投资基金的基金经理；广发多元新兴股票型证券投资基金的基金经理；广发集嘉债券型证券投资基金的基金经理；成长投资部总经理	2017-06-19	-	9年	刘格菘先生，经济学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理，融通基金管理有限公司权益投资部总经理、基金经理，广发基金管理有限公司权益投资一部研究员、权益投资一部副总经理、北京权益投资部总经理、广发行业领先混合型证券投资基金基金经理(自2017年6月19日至2019年5月31日)。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合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进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

#### 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。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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 4 次，均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。

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

2019 年上半年国内外宏观环境相比 2018 年边际有所改善，A 股也走出了一定的反弹行情。其中上证综指上行 19.4%，沪深 300 指数和中证 1000 指数分别上行 27.1% 和 20.1%，食品饮料、非银金融和农林牧渔等行业涨幅居前。

2019 年上半年全球宏观环境的特征是随着全球经济降速迹象的出现，主要央行开始释放流动性宽松预期。从国内经济来看，2019 年一季度逆周期调节政策发力，GDP 增速超市场预期。但二季度经济热度开始降温，结构性下行压力开始显现。整个上半年，除了房地产景气维持在相对高位之外，其他经济数据均有走弱的迹象。

2019 年上半年，本基金在一季度适度上调了权益资产比重，在二季度则由于内外部影响因素的复杂化，选择了较为中性的仓位配置。行业配置方面，本基金致力于寻找中国创新性行业中的确定成长公司，重点围绕中小板和创业板配置生物医药、科技及自主可控、新能源等确定性成长行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 30.85%，同期业绩比较基准收益率为 19.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年全球经济放缓的迹象逐步显现，主要央行先后释放宽松预期，预计经济预期下修伴随流动性宽松将是下半年全球宏观的重要特征。国内经济方面，本轮经济周期具有非典型性特征，传统的逆周期对冲方式效果并不明显，经济增速可能继续延续缓慢下行的趋势。政策方面，当前政策的主基调是托而不举，结构性改革以及针对性的产业政策可能推出。外部环境方面，中美问题是长期问题，会阶段性扰动市场情绪但投资者具备学习效应，事件性的冲击效果会逐步弱化。

考虑到 A 股当前偏低的估值以及相对友好的政策环境，本基金对权益市场的中长期走势保持乐观。行业配置上沿着核心资产和弹性资产为主要的两条主线进行行业选择。在标的选择上，通过精选重点行业中具备核心竞争力和竞争壁垒的相对优势公司来增厚组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）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，对广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）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：广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	159,444,134.84	151,525,848.82
结算备付金		1,353,734.29	4,336,458.00
存出保证金		958,239.46	1,477,451.97

交易性金融资产	6.4.7.2	2,344,018,426.25	1,719,398,660.11
其中：股票投资		2,344,018,426.25	1,719,398,660.11
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		-	40,618,250.13
应收利息	6.4.7.5	70,451.15	72,329.34
应收股利		-	-
应收申购款		274,357.17	380,931.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,506,119,343.16	1,917,809,930.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018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		17,999.38	12,562,240.42
应付赎回款		2,673,757.30	479,383.73
应付管理人报酬		2,966,725.34	2,514,889.62
应付托管费		494,454.23	419,148.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,249,660.20	1,403,048.34
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	1,136,000.79	1,380,192.00
负债合计		8,538,597.24	18,758,902.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,815,612,003.29	1,806,440,090.86
未分配利润	6.4.7.10	681,968,742.63	92,610,937.09
所有者权益合计		2,497,580,745.92	1,899,051,027.95
负债和所有者权益总计		2,506,119,343.16	1,917,809,930.32

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值人民币1.3756元，基金份额总额1,815,612,003.29份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>619,590,534.62</b>	<b>-110,534,250.76</b>
1.利息收入		2,375,956.70	3,126,614.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,375,956.70	3,126,614.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		202,173,007.11	-262,543.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	195,950,422.36	-8,476,828.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	6,222,584.75	8,214,285.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	414,482,995.68	-113,721,834.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	558,575.13	323,512.44
<b>减：二、费用</b>		<b>25,224,310.24</b>	<b>27,928,127.36</b>
1. 管理人报酬		17,352,871.95	18,592,616.87
2. 托管费		2,892,145.30	3,098,769.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,844,766.72	6,006,004.60
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	134,526.27	230,736.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>594,366,224.38</b>	<b>-138,462,378.12</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>594,366,224.38</b>	<b>-138,462,378.12</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	1,806,440,090.86	92,610,937.09	1,899,051,027.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	594,366,224.38	594,366,224.38
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）	9,171,912.43	-5,008,418.84	4,163,493.59
其中：1.基金申购款	305,156,028.77	98,964,481.56	404,120,510.33
2.基金赎回款	-295,984,116.34	-103,972,900.40	-399,957,016.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,815,612,003.29	681,968,742.63	2,497,580,745.92
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	1,623,174,533.87	682,712,407.02	2,305,886,940.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-138,462,378.12	-138,462,378.12
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）	214,703,300.55	94,831,367.34	309,534,667.89
其中：1.基金申购款	391,294,091.12	172,157,850.61	563,451,941.73
2.基金赎回款	-176,590,790.57	-77,326,483.27	-253,917,273.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,837,877,834.42	639,081,396.24	2,476,959,230.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（“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》、《公开募集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《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金自 2015 年 8 月 7 日起由股票型基金变更为混合型基金，基金名称由“广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”变更为“广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）”。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规



定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年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相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2019年6月30日
活期存款	159,444,134.84
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	159,444,134.84

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,125,578,650.77	2,344,018,426.25	218,439,775.48
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	2,125,578,650.77	2,344,018,426.25	218,439,775.48

**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 2019年6月30日
应收活期存款利息	69,514.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	388.17
应收结算备付金利息	548.28
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
其他	
合计	70,451.15

#### 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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,249,660.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,249,660.20

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	10,066.34
预提费用	125,934.45
合计	1,136,000.79

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,806,440,090.86	1,806,440,090.86
本期申购	305,156,028.77	305,156,028.77
本期赎回（以“-”号填列）	-295,984,116.34	-295,984,116.34
本期末	1,815,612,003.29	1,815,612,003.29

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

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	-438,089,995.76	530,700,932.85	92,610,937.09
本期利润	179,883,228.70	414,482,995.68	594,366,224.38
本期基金份额交易产生的变动数	-9,545,108.50	4,536,689.66	-5,008,418.84

其中：基金申购款	-65,917,354.36	164,881,835.92	98,964,481.56
基金赎回款	56,372,245.86	-160,345,146.26	-103,972,900.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-267,751,875.56	949,720,618.19	681,968,742.63

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
活期存款利息收入	2,342,629.40	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	9,146.41	
结算备付金利息收入	20,077.43	
其他	4,103.46	
合计	2,375,956.70	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
卖出股票成交总额	1,690,275,385.59	
减：卖出股票成本总额	1,494,324,963.23	
买卖股票差价收入	195,950,422.36	

#### 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
股票投资产生的股利收益	6,222,584.75	
基金投资产生的股利收益	-	
合计	6,222,584.75	

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
1.交易性金融资产	414,482,995.68	
——股票投资	414,482,995.68	
——债券投资	-	

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	414,482,995.68

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	557,238.06
基金转换费收入	1,337.07
合计	558,575.13

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	4,844,766.72
银行间市场交易费用	-
合计	4,844,766.72

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	54,985.73
银行汇划费	4,091.82
账户维护费	9,000.00
上市费	29,752.78
合计	134,526.27

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期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	基金管理人母公司、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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	626,020,727.84	18.44%	523,187,588.34	12.52%

##### 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 2019年1月1日至2019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	462,074.00	16.19%	353,294.25	28.27%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券股份有限公司	423,199.63	11.66%	241,192.35	3.61%

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,352,871.95	18,592,616.87
其中：支付销售机构的客户维护费	3,243,858.74	3,584,640.81

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

$$H = E \times 1.5\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首三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、休息日等，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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,892,145.30	3,098,769.55

注：基金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：

$$H = E \times 0.25\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金



托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
报告期初持有的基金份额	15,846,894.85	26,359,868.95
报告期间申购/买入总份额	-	13,956,036.29
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	6,338,800.00	8,622,115.54
报告期末持有的基金份额	9,508,094.85	31,693,789.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.52%	1.72%

注：基金管理人本报告期内及上年度可比期间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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	159,444,134.84	2,342,629.40	653,895,981.65	3,070,265.98

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，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 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（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2019 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证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 2019 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的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约

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

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	159,444,134.84	-	-	-	159,444,134.84
结算备付金	1,353,734.29	-	-	-	1,353,734.29
存出保证金	958,239.46	-	-	-	958,239.46
交易性金融资产	-	-	-	2,344,018,426.25	2,344,018,426.25
应收利息	-	-	-	70,451.15	70,451.15
应收申购款	27,319.57	-	-	247,037.60	274,357.17
资产总计	161,783,428.16	-	-	2,344,335,915.00	2,506,119,343.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,999.38	17,999.38
应付赎回款	-	-	-	2,673,757.30	2,673,757.30
应付管理人报酬	-	-	-	2,966,725.34	2,966,725.34
应付托管费	-	-	-	494,454.23	494,454.23
应付交易费用	-	-	-	1,249,660.20	1,249,660.20
其他负债	-	-	-	1,136,000.79	1,136,000.79
负债总计	-	-	-	8,538,597.24	8,538,597.24
利率敏感度缺口	161,783,428.16	-	-	-2,335,797,317.76	-2,173,913,889.60
上年度末 2018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	151,525,848.82	-	-	-	151,525,848.82
结算备付金	4,336,458.00	-	-	-	4,336,458.00
存出保证金	1,477,451.97	-	-	-	1,477,451.97
交易性金融资产	-	-	-	1,719,398,660.11	1,719,398,660.11
应收证券清算款	-	-	-	40,618,250.13	40,618,250.13
应收利息	-	-	-	72,329.34	72,329.34
应收申购款	-	-	-	380,931.95	380,931.95

资产总计	157,339,758.79	-	-	1,760,470,171.53	1,917,809,930.32
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,562,240.42	12,562,240.42
应付赎回款	-	-	-	479,383.73	479,383.73
应付管理人报酬	-	-	-	2,514,889.62	2,514,889.62
应付托管费	-	-	-	419,148.26	419,148.26
应付交易费用	-	-	-	1,403,048.34	1,403,048.34
其他负债	-	-	-	1,380,192.00	1,380,192.00
负债总计	-	-	-	18,758,902.37	18,758,902.37
利率敏感度缺口	157,339,758.79	-	-	1,741,711,269.16	1,899,051,027.95

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交易性债券投资，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。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	2,344,018,426.25	93.85	1,719,398,660.11	90.54
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>2,344,018,426.25</b>	<b>93.85</b>	<b>1,719,398,660.11</b>	<b>90.54</b>

#### 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
		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	124,751,572.22	89,255,398.31
	业绩比较基准下降 5%	-124,751,572.22	-89,255,398.31

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 2,344,018,426.25 元，无属于第二层级和第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 1,716,660,679.75 元，属于第二层级的余额为人民币 2,737,980.36 元，无属于第三层级的金额）。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,344,018,426.25	93.53
	其中：股票	2,344,018,426.25	93.53
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	160,797,869.13	6.42
8	其他各项资产	1,303,047.78	0.05
9	合计	2,506,119,343.16	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	10,650.00	0.00
C	制造业	1,759,685,898.49	70.46

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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	547,624,530.76	21.93
J	金融业	7,340.00	0.00
K	房地产业	18,980,007.00	0.76
L	租赁和商务服务业	17,710,000.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	2,344,018,426.25	93.85

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300601	康泰生物	4,529,540	237,800,850.00	9.52
2	300661	圣邦股份	1,925,113	195,918,750.01	7.84
3	600536	中国软件	3,063,586	164,422,660.62	6.58
4	300529	健帆生物	2,397,508	149,484,623.80	5.99
5	002049	紫光国微	3,300,000	145,563,000.00	5.83
6	300595	欧普康视	3,874,364	137,927,358.40	5.52
7	300226	上海钢联	1,671,580	125,301,636.80	5.02



8	600703	三安光电	11,000,000	124,080,000.00	4.97
9	601012	隆基股份	5,030,500	116,254,855.00	4.65
10	300003	乐普医疗	4,674,700	107,611,594.00	4.31
11	300454	深信服	1,210,436	105,961,567.44	4.24
12	300457	赢合科技	3,999,657	99,711,449.01	3.99
13	300014	亿纬锂能	2,599,906	79,193,136.76	3.17
14	002301	齐心集团	6,506,600	75,411,494.00	3.02
15	002488	金固股份	8,997,501	74,949,183.33	3.00
16	002821	凯莱英	704,185	69,066,464.80	2.77
17	002230	科大讯飞	2,000,000	66,480,000.00	2.66
18	002594	比亚迪	1,299,989	65,935,442.08	2.64
19	002624	完美世界	2,369,863	61,166,164.03	2.45
20	300274	阳光电源	4,921,667	46,017,586.45	1.84
21	300766	每日互动	599,963	24,292,501.87	0.97
22	002146	荣盛发展	2,021,300	18,980,007.00	0.76
23	300662	科锐国际	500,000	17,710,000.00	0.71
24	300400	劲拓股份	1,184,279	17,539,171.99	0.70
25	600438	通威股份	1,000,000	14,060,000.00	0.56
26	601138	工业富联	249,588	3,007,535.40	0.12
27	603697	有友食品	3,383	64,006.36	0.00
28	300771	智莱科技	1,126	62,887.10	0.00
29	300775	三角防务	500	14,700.00	0.00
30	600989	宝丰能源	1,000	11,810.00	0.00
31	600968	海油发展	3,000	10,650.00	0.00
32	002958	青农商行	1,000	7,340.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002049	紫光国微	137,849,313.90	7.26
2	002405	四维图新	124,524,230.11	6.56
3	300003	乐普医疗	123,515,414.44	6.50
4	600703	三安光电	122,819,824.19	6.47
5	300595	欧普康视	118,814,647.75	6.26
6	300226	上海钢联	108,651,881.57	5.72
7	600536	中国软件	105,711,181.86	5.57
8	300274	阳光电源	99,554,220.91	5.24
9	601012	隆基股份	89,696,919.64	4.72

10	002202	金风科技	80,048,432.73	4.22
11	002594	比亚迪	71,410,566.13	3.76
12	002301	齐心集团	68,160,749.88	3.59
13	002230	科大讯飞	67,435,978.19	3.55
14	300014	亿纬锂能	65,500,870.54	3.45
15	002821	凯莱英	62,480,179.18	3.29
16	002146	荣盛发展	57,589,021.19	3.03
17	300400	劲拓股份	48,259,915.80	2.54
18	300223	北京君正	32,120,085.62	1.69
19	300766	每日互动	30,618,375.76	1.61
20	300601	康泰生物	21,806,697.00	1.15

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	300750	宁德时代	165,172,907.94	8.70
2	002371	北方华创	159,073,243.35	8.38
3	300059	东方财富	139,423,854.96	7.34
4	002405	四维图新	132,383,047.14	6.97
5	002415	海康威视	129,209,500.86	6.80
6	600271	航天信息	96,740,781.67	5.09
7	002202	金风科技	91,420,860.26	4.81
8	002032	苏泊尔	80,358,462.42	4.23
9	002488	金固股份	77,798,978.76	4.10
10	601012	隆基股份	62,965,185.72	3.32
11	300124	汇川技术	62,915,129.42	3.31
12	002624	完美世界	62,416,399.04	3.29
13	300226	上海钢联	56,889,599.46	3.00
14	002739	万达电影	54,583,139.49	2.87
15	300274	阳光电源	52,895,740.27	2.79
16	002146	荣盛发展	48,206,034.35	2.54
17	300413	芒果超媒	34,936,864.75	1.84
18	300223	北京君正	28,856,292.41	1.52
19	300332	天壕环境	27,436,847.13	1.44
20	300454	深信服	25,901,605.00	1.36

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,704,461,733.69
卖出股票收入（成交）总额	1,690,275,385.59

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

## 7.12 投资组合报告附注

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

**7.12.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	958,239.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	70,451.15
5	应收申购款	274,357.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,303,047.78

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
105,689	17,178.82	338,548,266	18.65%	1,477,063,7	81.35%

		.18		37.11	
--	--	-----	--	-------	--

### 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	姜珊	815,061.00	1.42%
2	盛杰夫	700,000.00	1.22%
3	王景超	680,400.00	1.19%
4	张杰	660,200.00	1.15%
5	郑学诚	660,000.00	1.15%
6	吴昊	652,900.00	1.14%
7	高玉英	601,676.00	1.05%
8	王晓城	493,700.00	0.86%
9	高德荣	403,700.00	0.71%
10	郭小冰	368,832.00	0.64%

### 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	132,645.42	0.0073%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 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	1,806,440,090.86
本报告期基金总申购份额	305,156,028.77
减：本报告期基金总赎回份额	295,984,116.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,815,612,003.29

## 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

本基金管理人于2019年6月4日发布公告，自2019年6月1日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

西部证券	3	157,851,819.54	4.65%	109,293.12	3.83%	-
长城证券	1	159,312,961.63	4.69%	148,368.56	5.20%	-
中银国际	1	210,721,782.18	6.21%	154,094.64	5.40%	-
中信证券	1	213,497,909.50	6.29%	156,131.57	5.47%	-
国金证券	1	216,870,067.64	6.39%	201,971.91	7.07%	-
中投证券	1	315,872,829.57	9.31%	230,998.09	8.09%	-
财通证券	1	429,498,376.54	12.65%	399,992.44	14.01%	-
广发证券	3	626,020,727.84	18.44%	462,074.00	16.19%	-
广州证券	1	1,065,009,073.91	31.37%	991,843.59	34.74%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
西部证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
2	关于旗下部分基金在建设银行开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-19
3	关于调整旗下基金首次申购、追加申购及定期定额投资最低数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-01

## 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混合型证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2.《广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）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.《广发小盘成长混合型证券投资基金（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：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十八日