

# 广发中小盘精选混合型证券投资基金

## 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>42</b>

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	42
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4	基金投资策略的改变 .....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8	其他重大事件 .....	45
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>46</b>
11.1	备查文件目录 .....	46
11.2	存放地点 .....	46
11.3	查阅方式 .....	46

## 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
交易代码	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	561,189,831.37 份
基金合同存续期	不定期

### 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。

### 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	邱春杨	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	qcy@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宝华路	北京市西城区复兴门内大街1

	6号105室-49848（集中办公区）	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	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-9,977,521.09
本期利润	67,774,395.79
加权平均基金份额本期利润	0.1096
本期加权平均净值利润率	12.56%
本期基金份额净值增长率	12.49%
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	-88,204,258.81
期末可供分配基金份额利润	-0.1572
期末基金资产净值	491,210,907.61
期末基金份额净值	0.8753
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	-12.47%

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	1.84%	1.59%	1.63%	0.77%	0.21%	0.82%
过去三个月	-6.66%	1.73%	-5.15%	0.93%	-1.51%	0.80%
过去六个月	12.49%	1.57%	9.82%	0.92%	2.67%	0.65%
过去一年	-9.17%	1.34%	-2.05%	0.96%	-7.12%	0.38%
自基金合同生效起至今	-12.47%	1.27%	-6.81%	0.94%	-5.66%	0.33%

注：（1）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%。

（2）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。

#### 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历史走势对比图

（2018 年 5 月 4 日至 2019 年 6 月 30 日）



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

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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管理（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		
张东一	本基金的基金经理；广发聚优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发估值优势混合型证券投资基金的基金经理	2018-05-23	-	11 年	张东一女士，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研究发展部研究员、投资经理、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 6 月 25 日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 3 月 20 日至 2019 年 5 月 21 日)。
余昊	本基金的基金经理；广发沪港深新机遇股票型证券投资基金的基金经理；广发全球精选股票型证券投资基金的基金经理；广发沪港深行业龙头混合型证券投资基金的基金经理；广发国际资产管理有限公司权益投资总监	2018-05-04	-	9 年	余昊先生，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研究发展部研究员、国际业务部研究员、基金经理助理、投资经理、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 2 月 28 日至 2018 年 4 月 18 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，全球货币政策快速转向，美联储货币政策判断由是否最后一次加息，快速过渡到是否第一次降息。除美国外，全球主要经济体也回到了货币宽松的政策上。欧央行重启 TLTRO，而全球其他央行比如澳洲印度，也继续着降息的步伐。快速的货币政策转向大幅降低了无风险利率，是上半年全球股市普遍上涨的主要原因。稍显曲折的是国内货币政策，在一月份全面降准后，四月份货币政策口径开始转向偏紧，同时包商事件代表的金融体制改革和抑制地产价格上升的政策诉求，也起到了偏紧的效果，后续管理人认为监管将着力于降低企业的融资成本，特别是中小企业的融资

成本，这也将是长期主导港股 A 股金融市场的主旋律之一。另外，贸易战卷土重来，美股、港股和 A 股均经历了贸易战再次爆发，到华为禁运发酵，再回到 G20 谈和，市场也经历了大幅下跌后反弹的过程。7 月份是观察二季度企业盈利的主要窗口，从 A 股角度看，随着贸易战告一段落、政策强刺激并未出台，同时地产周期维持高位，预计经济并不会出现大幅走强或者走弱的情况，预计市场配置将继续集中在盈利预期稳定的核心资产。从港股角度看，美联储或早或晚宽松终将使港股受益，而中国企业盈利整体虽然承压，但各行业的龙头公司和创新公司有望走出独立的盈利增长行情。

上半年本基金仓位由年初的六成提升至约八成五，在市场方面主要配置 A 股，灵活配置部分港股，平均比例大约 7: 3；行业方面，主要关注科技和消费。

#### 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 12.49%，同期业绩比较基准收益率为 9.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为随着贸易战预期的偃旗息鼓，风险偏好得到回升，而同时也意味着货币宽松的预期不再，A 股有望继续拥抱核心资产，而港股有望回归对微观企业盈利趋势的跟踪。宏观层面有诸多相互制约的因素，主要是经济向下的风险和刺激政策的对冲，管理人认为宏观因素对市场不会产生方向性影响，而更多是导致指数均值回归的波动。在行业选择上，本基金将坚持中小市值的风格，在 A 股着重筛选细分行业龙头，在港股遴选业绩超预期的个股。管理人将保持谨慎态度，继续重视现金流好而估值相对低的品种。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 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：广发中小盘精选混合型证券投资基金

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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	25,650,608.81	46,680,367.79
结算备付金		4,995,281.85	470,318.27
存出保证金		2,020,417.42	124,938.39
交易性金融资产	6.4.7.2	464,364,641.28	344,475,629.59
其中：股票投资		463,089,708.24	344,475,629.59
基金投资		-	-
债券投资		1,274,933.04	-
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	-	150,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	7,100.12	173,571.11
应收股利		120,411.60	94,236.80
应收申购款		115,951.20	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		497,274,412.28	542,019,061.95
<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		4,743,531.19	18,211,386.78
应付赎回款		255,365.32	-
应付管理人报酬		593,807.03	691,465.96
应付托管费		98,967.85	115,244.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	290,057.97	509,330.08

应交税费		8.41	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,766.90	253,001.00
负债合计		6,063,504.67	19,780,428.14
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	561,189,831.37	671,155,482.03
未分配利润	6.4.7.10	-69,978,923.76	-148,916,848.22
所有者权益合计		491,210,907.61	522,238,633.81
负债和所有者权益总计		497,274,412.28	542,019,061.95

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.8753 元，基金份额总额 561,189,831.37 份。

## 6.2 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：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 5 月 4 日（基 金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>75,432,677.44</b>	<b>-25,423,978.11</b>
1.利息收入		541,479.21	1,489,797.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	292,334.24	520,836.28
债券利息收入		779.04	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		248,365.93	968,961.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,991,666.04	-6,318,103.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,325,089.65	-8,151,846.28
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	2,333,423.61	1,833,742.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	77,751,916.88	-20,677,895.00
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	130,947.39	82,222.81
<b>减：二、费用</b>		<b>7,658,281.65</b>	<b>3,134,628.81</b>
1. 管理人报酬		4,007,859.60	1,859,225.04
2. 托管费		667,976.56	309,870.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,887,526.84	894,698.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.81	-
7. 其他费用	6.4.7.19	94,915.84	70,834.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>67,774,395.79</b>	<b>-28,558,606.92</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>67,774,395.79</b>	<b>-28,558,606.92</b>

注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 4 日，上年度可比期间不完整。

### 6.3 所有者权益（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：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）	671,155,482.03	-148,916,848.22	522,238,633.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,774,395.79	67,774,395.79
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）	-109,965,650.66	11,163,528.67	-98,802,121.99
其中：1.基金申购款	12,148,325.30	-1,435,264.70	10,713,060.60
2.基金赎回款	-122,113,975.96	12,598,793.37	-109,515,182.59
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）	561,189,831.37	-69,978,923.76	491,210,907.61
项目	上年度可比期间 2018 年 5 月 4 日（基金合同生效日）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）	811,802,111.33	-	811,802,111.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,558,606.92	-28,558,606.92
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）	-61,837,685.69	1,326,469.42	-60,511,216.27
其中：1.基金申购款	4,114,853.74	-52,578.36	4,062,275.38
2.基金赎回款	-65,952,539.43	1,379,047.78	-64,573,491.65
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）	749,964,425.64	-27,232,137.50	722,732,288.14

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。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	25,650,608.81
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	25,650,608.81

#### 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	442,727,321.68	463,089,708.24	20,362,386.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,134,900.00	140,033.04
	银行间市场	-	-
	合计	1,134,900.00	140,033.04
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	443,862,221.68	464,364,641.28	20,502,419.60
----	----------------	----------------	---------------

### 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	5,299.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	280.39
应收结算备付金利息	717.86
应收债券利息	802.45
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	7,100.12

### 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	290,057.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	290,057.97

### 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	-
应付赎回费	498.16
预提费用	81,268.74
合计	81,766.90

### 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	671,155,482.03	671,155,482.03
本期申购	12,148,325.30	12,148,325.30
本期赎回（以“-”号填列）	-122,113,975.96	-122,113,975.96
本期末	561,189,831.37	561,189,831.37

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	-94,261,222.81	-54,655,625.41	-148,916,848.22
本期利润	-9,977,521.09	77,751,916.88	67,774,395.79
本期基金份额交易产生的变动数	16,034,485.09	-4,870,956.42	11,163,528.67
其中：基金申购款	-1,839,049.64	403,784.94	-1,435,264.70
基金赎回款	17,873,534.73	-5,274,741.36	12,598,793.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-88,204,258.81	18,225,335.05	-69,978,923.76

#### 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
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,822.15
结算备付金利息收入	33,620.69
其他	-
合计	292,334.24

#### 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
减：卖出股票成本总额	876,339,429.63
买卖股票差价收入	-5,325,089.65

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,333,423.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,333,423.61

#### 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	77,751,916.88
——股票投资	77,611,883.84
——债券投资	140,033.04
——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	77,751,916.88

#### 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	112,949.26
基金转换费收入	17,998.13
合计	130,947.39

#### 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	2,887,526.84

银行间市场交易费用	-
合计	2,887,526.84

#### 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		26,283.01
信息披露费		54,985.73
银行汇划费		13,647.10
合计		94,915.84

#### 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
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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年5月4日（基金合同生效日） 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	1,047,036,994.20	58.56%	357,980,720.58	58.41%
------------	------------------	--------	----------------	--------

#### 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 债券交易

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5月4日（基金合同生效日） 至2018年6月30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	1,134,900.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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5月4日（基金合同生效日） 至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	1,107,100,000.00	75.64%

#### 6.4.10.1.5 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	1,000,907.73	64.87%	127,856.64	44.08%
关联方名称	上年度可比期间			



	2018 年 5 月 4 日（基金合同生效日）至 2018 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	347,514.68	65.09%	347,514.68	65.09%

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5月4日（基金合同生 效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,007,859.60	1,859,225.04
其中：支付销售机构的客户维护费	1,923,478.81	885,139.71

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。

#### 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5月4日（基金合同生 效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	667,976.56	309,870.82

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。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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5月4日（基金合同生效 日）至2018年6月30日
基金合同生效日（2018年5月4日）持有的基金份额	-	10,000,200.02
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.78%	1.49%

注：基金管理人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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年5月4日（基金合同生效日） 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
中国银行股份有限公司	25,650,608.81	254,891.40	395,839,921.84	500,036.86

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。

#### 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

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
002410	广联达	2019-03-15	2019-09-15	大宗买入流通受限	26.19	31.53	360,000.00	9,428,400.00	11,350,800.00	2019-05-14 除权除息，比例：每 10 股派现金红利 2.00 元（含税）
601236	红塔证券	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	1,000.00	3,460.00	3,460.00	-

注：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债券和权证。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 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。

##### 6.4.13.2.1 按短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短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,274,933.04	-
未评级	-	-

合计	1,274,933.04	-
----	--------------	---

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剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

### 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、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	25,650,608.81	-	-	-	25,650,608.81
结算备付金	4,995,281.85	-	-	-	4,995,281.85
存出保证金	2,020,417.42	-	-	-	2,020,417.42
交易性金融资产	1,274,933.04	-	-	463,089,708.24	464,364,641.28
应收利息	-	-	-	7,100.12	7,100.12
应收股利	-	-	-	120,411.60	120,411.60
应收申购款	-	-	-	115,951.20	115,951.20
资产总计	33,941,241.12	-	-	463,333,171.16	497,274,412.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,743,531.19	4,743,531.19
应付赎回款	-	-	-	255,365.32	255,365.32
应付管理人报酬	-	-	-	593,807.03	593,807.03
应付托管费	-	-	-	98,967.85	98,967.85
应付交易费用	-	-	-	290,057.97	290,057.97
应交税费	-	-	-	8.41	8.41
其他负债	-	-	-	81,766.90	81,766.90
负债总计	-	-	-	6,063,504.67	6,063,504.67
利率敏感度缺口	33,941,241.12	-	-	457,269,666.49	491,210,907.61
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	46,680,367.79	-	-	-	46,680,367.79
结算备付金	470,318.27	-	-	-	470,318.27
存出保证金	124,938.39	-	-	-	124,938.39
交易性金融资产	-	-	-	344,475,629.59	344,475,629.59
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	150,000,000.00
应收利息	-	-	-	173,571.11	173,571.11

应收股利	-	-	-	94,236.80	94,236.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	197,275,624.45	-	-	344,743,437.50	542,019,061.95
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	18,211,386.78	18,211,386.78
应付管理人报酬	-	-	-	691,465.96	691,465.96
应付托管费	-	-	-	115,244.32	115,244.32
应付交易费用	-	-	-	509,330.08	509,330.08
其他负债	-	-	-	253,001.00	253,001.00
负债总计	-	-	-	19,780,428.14	19,780,428.14
利率敏感度缺口	197,275,624.45	-	-	324,963,009.36	522,238,633.81

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

本基金本报告期末持有的债券占基金资产净值较小，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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	123,768,584.25	123,768,584.25
应收股利	-	96,723.60	96,723.60
资产合计	-	123,865,307.85	123,865,307.85
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	-	123,865,307.85	123,865,307.85
项目	上年度末 2018年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价 的资产			
交易型金融资 产	-	145,738,858.58	145,738,858.58
应收股利	-	-	-
资产合计	-	145,738,858.58	145,738,858.58
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	-	145,738,858.58	145,738,858.58

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	6,193,265.39	7,286,942.93
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,193,265.39	-7,286,942.93

#### 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	463,089,708.24	94.28	344,475,629.59	65.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,274,933.04	0.26	-	-
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	464,364,641.28	94.53	344,475,629.59	65.96

#### 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%	22,269,211.47	15,667,159.01
	业绩比较基准下降 5%	-22,269,211.47	-15,667,159.01

#### 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 453,010,381.28 元，属于第二层级的余额为人民币 11,354,260.00 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 331,887,010.09 元，属于第二层级的余额为人民币 12,588,619.50 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	463,089,708.24	93.13
	其中：股票	463,089,708.24	93.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,274,933.04	0.26
	其中：债券	1,274,933.04	0.26
	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	30,645,890.66	6.16

	计		
8	其他各项资产	2,263,880.34	0.46
9	合计	497,274,412.28	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 123,768,584.25 元，占基金资产净值比例 25.20%。

## 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	22,328,413.90	4.55
B	采矿业	10,650.00	0.00
C	制造业	174,775,965.57	35.58
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	17,581,179.00	3.58
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	76,040,728.62	15.48
J	金融业	3,460.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,134,602.10	3.49
M	科学研究和技术服务业	20,122,560.00	4.10
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	4,642,116.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	6,681,448.80	1.36
S	综合	-	-
	合计	339,321,123.99	69.08

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

能源	-	-
房地产	-	-
金融	-	-
通信服务	-	-
原材料	-	-
医疗保健	-	-
非日常生活消费品	53,139,636.05	10.82
工业	32,717,229.57	6.66
信息技术	24,391,142.11	4.97
日常消费品	8,731,012.55	1.78
公用事业	4,789,563.97	0.98
合计	123,768,584.25	25.20

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	002410	广联达	841,992	27,203,516.88	5.54
2	03808	中国重汽	2,052,000	24,404,442.57	4.97
3	300012	华测检测	1,863,200	20,122,560.00	4.10
4	600132	重庆啤酒	409,614	19,317,396.24	3.93
5	002727	一心堂	617,100	17,581,179.00	3.58
6	603019	中科曙光	490,793	17,226,834.30	3.51
7	300662	科锐国际	483,755	17,134,602.10	3.49
8	000568	泸州老窖	205,100	16,578,233.00	3.37
9	300357	我武生物	486,324	16,496,110.08	3.36
10	002821	凯莱英	168,100	16,487,248.00	3.36
11	300383	光环新网	923,352	15,484,613.04	3.15
12	300498	温氏股份	375,265	13,457,002.90	2.74
13	002049	紫光国微	274,700	12,117,017.00	2.47
14	03888	金山软件	796,000	11,833,538.18	2.41
15	00921	海信科龙	1,390,000	11,591,455.75	2.36
16	002371	北方华创	164,000	11,357,000.00	2.31
17	300601	康泰生物	209,600	11,004,000.00	2.24
18	01128	永利澳门	674,000	10,375,589.70	2.11
19	00968	信义光能	3,026,000	10,248,126.97	2.09

20	00780	同程艺龙	733,200	9,996,984.04	2.04
21	01478	丘钛科技	1,833,000	9,593,879.84	1.95
22	002777	久远银海	355,994	9,362,642.20	1.91
23	002157	正邦科技	540,400	9,003,064.00	1.83
24	002714	牧原股份	150,900	8,871,411.00	1.81
25	002912	中新赛克	93,285	8,756,662.95	1.78
26	601231	环旭电子	716,900	8,638,645.00	1.76
27	03899	中集安瑞科	1,500,000	8,312,787.00	1.69
28	002938	鹏鼎控股	251,280	7,377,580.80	1.50
29	00200	新濠国际发展	455,000	6,932,248.60	1.41
30	01610	中粮肉食	3,000,000	6,861,348.00	1.40
31	000681	视觉中国	344,760	6,681,448.80	1.36
32	603369	今世缘	234,200	6,531,838.00	1.33
33	000066	中国长城	532,400	5,473,072.00	1.11
34	300451	创业慧康	347,249	5,191,372.55	1.06
35	300253	卫宁健康	355,800	5,045,244.00	1.03
36	600536	中国软件	93,100	4,996,677.00	1.02
37	01600	天伦燃气	607,000	4,789,563.97	0.98
38	01070	TCL 电子	1,402,000	4,649,478.12	0.95
39	600763	通策医疗	52,400	4,642,116.00	0.95
40	300474	景嘉微	108,000	4,261,680.00	0.87
41	300628	亿联网络	33,112	3,545,301.84	0.72
42	002124	天邦股份	261,800	3,413,872.00	0.69
43	000860	顺鑫农业	70,200	3,274,830.00	0.67
44	300274	阳光电源	282,400	2,640,440.00	0.54
45	06865	福莱特玻璃	658,000	2,309,476.96	0.47
46	00506	中国食品	656,000	1,869,664.55	0.38
47	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
48	600968	海油发展	3,000	10,650.00	0.00
49	601236	红塔证券	1,000	3,460.00	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	06886	HTSC	45,105,436.31	8.64
2	300383	光环新网	33,676,486.19	6.45
3	03808	中国重汽	27,697,081.87	5.30
4	603019	中科曙光	24,436,044.45	4.68

5	300012	华测检测	20,306,023.06	3.89
6	002049	紫光国微	18,026,339.64	3.45
7	002777	久远银海	18,011,257.00	3.45
8	300037	新宙邦	17,467,930.00	3.34
9	002812	恩捷股份	17,370,234.09	3.33
10	300601	康泰生物	17,331,093.66	3.32
11	002727	一心堂	16,877,818.36	3.23
12	002912	中新赛克	16,340,986.01	3.13
13	01610	中粮肉食	16,144,630.47	3.09
14	000802	北京文化	16,116,433.66	3.09
15	601100	恒立液压	15,949,591.18	3.05
16	002821	凯莱英	15,890,459.00	3.04
17	000568	泸州老窖	15,785,548.00	3.02
18	000333	美的集团	15,551,015.36	2.98
19	600690	海尔智家	15,502,180.00	2.97
20	02238	广汽集团	15,101,291.78	2.89
21	00175	吉利汽车	15,095,431.58	2.89
22	01128	永利澳门	14,498,731.01	2.78
23	03888	金山软件	14,360,295.62	2.75
24	300498	温氏股份	14,301,990.83	2.74
25	600132	重庆啤酒	13,052,602.91	2.50
26	002402	和而泰	12,989,378.50	2.49
27	000651	格力电器	12,959,818.00	2.48
28	300357	我武生物	12,340,523.60	2.36
29	002234	民和股份	11,890,756.00	2.28
30	002458	益生股份	11,886,254.00	2.28
31	002371	北方华创	11,836,848.50	2.27
32	600718	东软集团	11,819,753.84	2.26
33	00921	海信科龙	11,745,586.56	2.25
34	300253	卫宁健康	11,742,786.00	2.25
35	01478	丘钛科技	11,714,401.65	2.24
36	002439	启明星辰	11,709,564.54	2.24
37	002938	鹏鼎控股	11,427,011.00	2.19
38	300394	天孚通信	11,156,373.00	2.14
39	300628	亿联网络	11,154,142.76	2.14
40	01788	国泰君安国际	11,046,005.63	2.12
41	00780	同程艺龙	10,641,363.78	2.04
42	002157	正邦科技	10,593,177.00	2.03

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	06886	HTSC	39,759,378.02	7.61
2	00135	昆仑能源	28,303,200.04	5.42
3	601100	恒立液压	22,283,325.04	4.27
4	300383	光环新网	20,463,590.48	3.92
5	000651	格力电器	19,428,571.46	3.72
6	000333	美的集团	19,035,303.58	3.64
7	300750	宁德时代	18,484,343.00	3.54
8	600690	海尔智家	18,391,987.07	3.52
9	002812	恩捷股份	18,117,563.00	3.47
10	02238	广汽集团	17,519,849.95	3.35
11	00175	吉利汽车	17,389,510.75	3.33
12	000802	北京文化	17,072,819.64	3.27
13	01211	比亚迪股份	15,891,455.01	3.04
14	600025	华能水电	15,879,633.80	3.04
15	01610	中粮肉食	15,808,996.27	3.03
16	002912	中新赛克	15,729,856.98	3.01
17	002410	广联达	15,663,519.00	3.00
18	300037	新宙邦	15,623,040.46	2.99
19	01066	威高股份	14,759,750.70	2.83
20	00392	北京控股	14,026,112.46	2.69
21	600309	万华化学	13,001,513.06	2.49
22	002402	和而泰	12,943,460.50	2.48
23	00966	中国太平	12,649,117.15	2.42
24	00368	中外运航运	12,495,536.55	2.39
25	002439	启明星辰	12,410,832.16	2.38
26	300394	天孚通信	11,689,843.63	2.24
27	601888	中国国旅	11,553,832.40	2.21
28	002234	民和股份	11,332,479.20	2.17
29	002007	华兰生物	11,146,233.25	2.13
30	01788	国泰君安国际	10,864,667.03	2.08
31	002458	益生股份	10,856,108.00	2.08

## 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	917,341,624.44
卖出股票收入（成交）总额	871,014,339.98

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,274,933.04	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,274,933.04	0.26

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128067	一心转债	6,550	735,237.50	0.15
2	128058	拓邦转债	4,799	539,695.54	0.11

### 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	2,020,417.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	120,411.60
4	应收利息	7,100.12
5	应收申购款	115,951.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,263,880.34

**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	002410	广联达	11,350,800.00	2.31	限售股

## 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
8,881	63,189.94	32,766,753. 01	5.84%	528,423,078 .36	94.16%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业 人员持有本基金	1,228.03	0.0002%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	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（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	671,155,482.03
本报告期基金总申购份额	12,148,325.30
减：本报告期基金总赎回份额	122,113,975.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	561,189,831.37

## 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。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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	
恒泰证券	1	46,908,791.46	2.62%	34,304.46	2.22%	-
国融证券	1	82,804,150.48	4.63%	60,549.77	3.92%	-
华创证券	1	89,699,885.26	5.02%	65,597.36	4.25%	-
海通证券	2	135,774,395.25	7.59%	99,287.72	6.44%	-
安信证券	1	385,879,261.53	21.58%	282,195.38	18.29%	-
广发证券	3	1,047,036,994.20	58.56%	1,000,907.73	64.87%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	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
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	133,500,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,134,900.00	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加云南红塔银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-24
2	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
3	关于增加晋中银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-05
4	关于增加和耕传承为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-16
5	关于增加汇林保大为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-08

6	关于广发中小盘精选混合型证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-24
7	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
8	关于增加华泰期货为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-29

## 11 备查文件目录

### 11.1 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

### 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