

广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	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
7 投资组合报告	34
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	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
8 基金份额持有人信息	41

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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
9	开放式基金份额变动.....	42
10	重大事件揭示.....	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变.....	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
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	47
11	备查文件目录.....	48
11.1	备查文件目录.....	48
11.2	存放地点.....	48
11.3	查阅方式.....	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发创新升级混合
基金主代码	002939
交易代码	002939
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 24 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,713,402,425.10 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过深度挖掘并精选因创新实现转型或升级的优质上市企业，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证全债指数收益率。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号	北京市西城区复兴门内大街55号

	保利国际广场南塔31-33楼	号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	195,428,840.17
本期利润	3,165,865,802.50
加权平均基金份额本期利润	0.6872
本期加权平均净值利润率	30.19%
本期基金份额净值增长率	46.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	489,110,307.32
期末可供分配基金份额利润	0.1038
期末基金资产净值	12,751,124,765.75
期末基金份额净值	2.7053
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	182.36%

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	15.77%	1.11%	3.34%	0.44%	12.43%	0.67%
过去三个月	30.51%	1.62%	6.14%	0.45%	24.37%	1.17%
过去六个月	46.60%	2.14%	2.46%	0.74%	44.14%	1.40%
过去一年	127.58%	1.96%	7.64%	0.60%	119.94%	1.36%
过去三年	150.43%	1.69%	16.99%	0.62%	133.44%	1.07%
自基金合同生效起至今	182.36%	1.52%	21.71%	0.57%	160.65%	0.95%

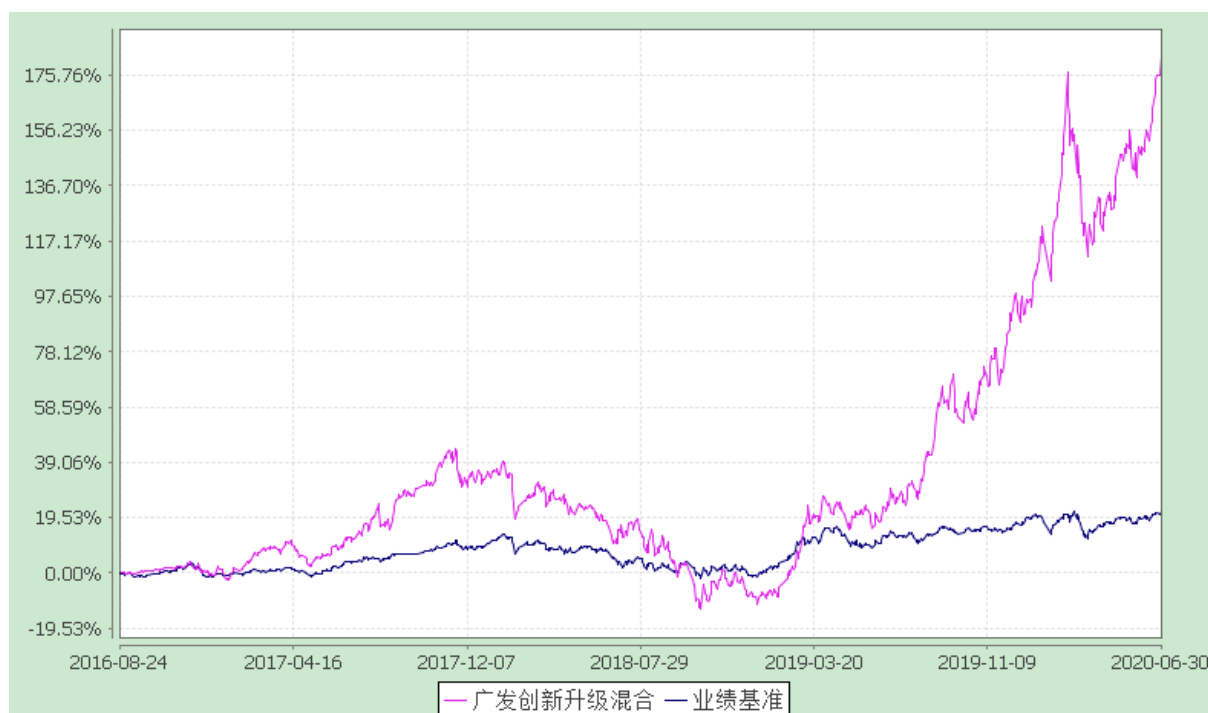
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

广发创新升级灵活配置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

（2016 年 8 月 24 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日，公司管理 225 只开放式基金，管理公募基金规模为 6394.81 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		
刘格菰	本基金的基金经理；广发小盘成长混合型证券投资基金 (LOF) 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；广发科技创新混合型证券投资基金的基金经理；广发科技先锋混合型证券投资基金的基金经理；成长投资部总经理	2017-07-05	-	10 年	刘格菰先生，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)。
费逸	本基金的基金经理；广发聚瑞混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金	2020-03-02	-	10 年	费逸先生，金融学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 4 月 27 日至 2019 年 6 月 26 日)。

	经理				
--	----	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 3 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

2020 年上半年，全球遭遇新冠疫情，并引发了全球性的经济衰退。国内由于防控措施得力，二季度疫情逐步缓解、可控，企业有序推进复工复产，各项经济指标均呈现明显的触底反弹趋势。但是，海外疫情仍在持续。面对全球经济的巨大下滑，各国纷纷出手救市，开启史无前例的财政及货币宽松政策，大幅向市场注入流动性。

上半年，沪深 300 指数上涨 1.64%，中小板指数上涨 20.85%，创业板指上涨 35.60%。一季度国内经济受疫情冲击下滑严重，GDP 同比降 6.8%。货币环境整体保持宽松，随着国内经济复苏，二季度后期，货币宽松力度有所收敛。

上半年，市场结构性分化比较明显。医药、食品饮料和科技行业的涨幅居前。中美贸易摩擦不断，但市场对此显然已经有了较充分的预期，科技创新成为市场共识。

本报告期内本基金重点配置了以云计算、半导体为主的新兴成长行业。

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 46.60%，同期业绩比较基准收益率为 2.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断，国内局部疫情不影响整体复苏态势，经济有望逐季向上。总体来看，随着国内疫情可控以及财政、货币、资本市场改革政策的逐步落地，未来国内消费和投资将持续改善，助力经济恢复增长。

展望下半年，财政有望发力，货币环境宽松格局不变。下半年流动性趋势性宽松，但考虑到经济复苏有序推进、信贷环境持续改善，“大水漫灌”难以出现，预计仍将维持在“放水养鱼”的程度。

我们认为，A 股仍具有较高吸引力，看好 A 股的中长期投资价值。同时，由于理财产品净值化后，收益率波动加大；随着国债收益率触底上行，理财收益率走低，资金“搬家”的趋势愈发明显。

行业配置上，科技成长股是中长期主线，同时把握以内需为主且长期确定性高的投资机会。我们认为，随着人们生活水平提高、人均可支配收入增长、医疗服务行业持续发展，消费升级的趋势已经非常明确。同时，随着海外疫情的缓解，经济修复的可持续性或来源于海外经济错位复苏拉动中国出口，外需链条也将开始进入修复期。在标的选择上，本基金将通过精选重点行业中具备核心竞争力和竞争壁垒的优质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，本基金托管人在对广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司

在广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,055,237,327.45	678,007,894.91
结算备付金		13,498,328.48	13,431,148.21
存出保证金		2,634,518.01	720,346.74
交易性金融资产	6.4.7.2	11,836,962,190.65	5,103,824,613.84
其中：股票投资		11,836,962,190.65	5,103,824,613.84
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	102,358.75	182,028.57
应收股利		-	-
应收申购款		123,162,332.73	71,792,489.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		13,031,597,056.07	5,867,958,521.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债:			
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		-	12,252,868.98
应付赎回款		256,553,717.91	61,239,342.97
应付管理人报酬		14,784,021.86	6,237,109.52
应付托管费		2,464,003.65	1,039,518.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,019,337.91	3,561,006.44
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	651,208.99	236,275.05
负债合计		280,472,290.32	84,566,121.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,713,402,425.10	3,133,963,246.08
未分配利润	6.4.7.10	8,037,722,340.65	2,649,429,154.67
所有者权益合计		12,751,124,765.75	5,783,392,400.75
负债和所有者权益总计		13,031,597,056.07	5,867,958,521.94

注:报告截止日 2020 年 6 月 30 日,基金份额净值人民币 2.7053 元,基金份额总额 4,713,402,425.10 份。

6.2 利润表

会计主体: 广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,273,249,810.75	485,935,006.28
1.利息收入		4,147,508.74	963,903.84
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	4,147,508.74	959,590.20
债券利息收入		-	4,313.64
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		238,249,162.24	180,558,494.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	204,233,632.10	179,411,486.42
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	-	-2,805,180.00
股利收益	6.4.7.15	34,015,530.14	3,952,188.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,970,436,962.33	303,049,786.93
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	60,416,177.44	1,362,820.67
减：二、费用		107,384,008.25	18,389,236.01
1. 管理人报酬		77,681,554.66	11,060,978.94
2. 托管费		12,946,925.81	1,843,496.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	16,627,790.36	5,369,529.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	15.50
7. 其他费用	6.4.7.19	127,737.42	115,215.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,165,865,802.50	467,545,770.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,165,865,802.50	467,545,770.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	3,133,963,246.08	2,649,429,154.67	5,783,392,400.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,165,865,802.50	3,165,865,802.50

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,579,439,179.02	2,222,427,383.48	3,801,866,562.50
其中：1.基金申购款	7,118,642,476.34	9,198,560,911.18	16,317,203,387.52
2.基金赎回款	-5,539,203,297.32	-6,976,133,527.70	-12,515,336,825.02
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）	4,713,402,425.10	8,037,722,340.65	12,751,124,765.75
项目	上年度可比期间 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）	1,492,356,545.50	-183,254,970.00	1,309,101,575.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	467,545,770.27	467,545,770.27
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）	-200,409,463.84	-40,538,165.33	-240,947,629.17
其中：1.基金申购款	494,889,559.51	53,133,508.64	548,023,068.15
2.基金赎回款	-695,299,023.35	-93,671,673.97	-788,970,697.32
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）	1,291,947,081.66	243,752,634.94	1,535,699,716.60

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

广发创新升级灵活配置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[2016]1280 号文《关于准予广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的批准，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《广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2016 年 8 月 24 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2016 年 7 月 25 日至 2016 年 8 月 19 日，本基金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 360,203,432.15 元，有效认购户数为 5,515 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 62,235.95 元，折合基金份额 62,235.95 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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,055,237,327.45
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	1,055,237,327.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,655,570,729.18	11,836,962,190.65	4,181,391,461.47
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		7,655,570,729.18	11,836,962,190.65	4,181,391,461.47

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	95,825.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,066.95
应收结算备付金利息	5,466.06
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	102,358.75

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,019,337.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,019,337.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	545,738.07
应付证券出借违约金	-
预提费用	105,470.92
合计	651,208.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,133,963,246.08	3,133,963,246.08
本期申购	7,118,642,476.34	7,118,642,476.34
本期赎回（以“-”号填列）	-5,539,203,297.32	-5,539,203,297.32
本期末	4,713,402,425.10	4,713,402,425.10

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	198,451,004.84	2,450,978,149.83	2,649,429,154.67
本期利润	195,428,840.17	2,970,436,962.33	3,165,865,802.50
本期基金份额交易产生的变动数	95,230,462.31	2,127,196,921.17	2,222,427,383.48
其中：基金申购款	510,969,658.89	8,687,591,252.29	9,198,560,911.18
基金赎回款	-415,739,196.58	-6,560,394,331.12	-6,976,133,527.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	489,110,307.32	7,548,612,033.33	8,037,722,340.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,021,542.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	14,240.77
结算备付金利息收入	111,725.51
其他	-
合计	4,147,508.74

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,516,607,376.67
减：卖出股票成本总额	4,312,373,744.57
买卖股票差价收入	204,233,632.10

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	34,015,530.14
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	34,015,530.14

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	2,970,436,962.33
——股票投资	2,970,436,962.33
——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	2,970,436,962.33

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	55,055,674.84
基金转换费收入	5,360,502.60

合计	60,416,177.44
----	---------------

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	16,627,790.36
银行间市场交易费用	-
合计	16,627,790.36

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	36,798.58
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	12,666.50
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	127,737.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	213,536,531.55	1.71%	3,790.00	0.00%

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 2020年1月1日至2020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	193,068.55	1.76%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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 2020年1月1日至2020年6月	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月
----	-------------------------	------------------------------

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	77,681,554.66	11,060,978.94
其中：支付销售机构的客户维护费	23,426,947.22	3,021,357.99

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 5 个工作日内从基金财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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,946,925.81	1,843,496.48

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 5 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
报告期初持有的基金份额	-	11,116,504.85
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	-	11,116,504.85
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发期货有限公司	3,248,424.20	0.07%	3,248,424.20	0.10%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国工商银行股份有限公司	1,055,237,327.45	4,021,542.46	159,865,445.75	921,796.03

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

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（2020 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
603986	兆易创新	2020-01-02	2020-07-02	大宗买入流通受限	188.50	234.34	350,000.00	47,125,000.00	82,019,000.00	2020-05-07 除权除息, 派息比例 0.3800 (含税), 转增比例 0.4000
000938	紫光股份	2020-03-02	2020-09-02	大宗买入流通受限	41.79	41.52	1,000,000.00	41,790,000.00	41,520,000.00	-
000938	紫光股份	2020-03-06	2020-09-07	大宗买入流通受限	43.56	41.45	1,000,000.00	43,560,000.00	41,450,000.00	-
000063	中兴通讯	2020-02-03	2021-02-04	非公开发行流通受限	30.21	36.48	993,048.00	29,999,980.08	36,226,391.04	-
000063	中兴通讯	2020-02-03	2022-02-04	非公开发行流通受限	30.21	34.60	993,049.00	30,000,010.29	34,359,495.40	-

				限						
688200	华峰测控	2020-02-11	2020-08-18	新股流通受限	107.41	270.02	3,780.00	406,009.80	1,020,675.60	2020-06-01 除权除息, 派息比例 0.6000 (含税)
688598	金博股份	2020-05-08	2020-11-18	新股流通受限	47.20	77.94	7,645.00	360,844.00	595,851.30	-
688080	映翰通	2020-02-03	2020-08-12	新股流通受限	27.63	86.78	2,233.00	61,697.79	193,779.74	2020-06-18 除权除息, 派息比例 0.2000 (含税)
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股流通受限	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股流通受限	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股流通受限	15.50	15.50	5,468.00	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股流通受限	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
30084	酷特	2020-0	2020-0	新股	5.94	5.94	1,185.	7,038.	7,038.	-

0	智能	6-30	7-08	流通受限			00	90	90	
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股流通受限	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-

注：截至本报告期末 2020 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 2020 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 2020 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 2020 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、

无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资、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的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	1,055,237,327.45	-	-	-	1,055,237,327.45
结算备付金	13,498,328.48	-	-	-	13,498,328.48
存出保证金	2,634,518.01	-	-	-	2,634,518.01
交易性金融资产	-	-	-	11,836,962,190.65	11,836,962,190.65
应收利息	-	-	-	102,358.75	102,358.75
应收申购款	-	-	-	123,162,332.73	123,162,332.73
资产总计	1,071,370,173.94	-	-	11,960,226,882.13	13,031,597,056.07
负债：					
应付赎回款	-	-	-	256,553,717.91	256,553,717.91
应付管理人报酬	-	-	-	14,784,021.86	14,784,021.86
应付托管费	-	-	-	2,464,003.65	2,464,003.65
应付交易费用	-	-	-	6,019,337.91	6,019,337.91
其他负债	-	-	-	651,208.99	651,208.99
负债总计	-	-	-	280,472,290.32	280,472,290.32
利率敏感度缺口	1,071,370,173.94	-	-	11,679,754,591.81	12,751,124,765.75
上年度末 2019 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	678,007,894.91	-	-	-	678,007,894.91

结算备付金	13,431,148.21	-	-	-	13,431,148.21
存出保证金	720,346.74	-	-	-	720,346.74
交易性金融资产	-	-	-	5,103,824,613.84	5,103,824,613.84
应收利息	-	-	-	182,028.57	182,028.57
应收申购款	-	-	-	71,792,489.67	71,792,489.67
资产总计	692,159,389.86	-	-	5,175,799,132.08	5,867,958,521.94
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	12,252,868.98	12,252,868.98
应付赎回款	-	-	-	61,239,342.97	61,239,342.97
应付管理人报酬	-	-	-	6,237,109.52	6,237,109.52
应付托管费	-	-	-	1,039,518.23	1,039,518.23
应付交易费用	-	-	-	3,561,006.44	3,561,006.44
其他负债	-	-	-	236,275.05	236,275.05
负债总计	-	-	-	84,566,121.19	84,566,121.19
利率敏感度缺口	692,159,389.86	-	-	5,091,233,010.89	5,783,392,400.75

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	上年度末
----	-----	------

	2020 年 6 月 30 日		2019 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	11,836,962,190.65	92.83	5,103,824,613.84	88.25
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	11,836,962,190.65	92.83	5,103,824,613.84	88.25

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	765,068,408.75	366,436,754.61
	业绩比较基准下降 5%	-765,068,408.75	-366,436,754.61

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

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

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 11,598,939,012.37 元，属于第二层次的余额为人民币 238,023,178.28 元，无属于第三层次的金额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 5,096,710,140.39 元，属于第二层次的余额为人民币 7,114,473.45 元，无属于第三层次的金额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	11,836,962,190.65	90.83
	其中：股票	11,836,962,190.65	90.83
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	1,068,735,655.93	8.20
8	其他各项资产	125,899,209.49	0.97
9	合计	13,031,597,056.07	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	-	-
C	制造业	9,240,910,221.94	72.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	433,463,069.11	3.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,255,603,657.18	9.85
J	金融业	1,856,640.46	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	579,589,111.65	4.55
N	水利、环境和公共设施管理业	218,312.43	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	101,872,359.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	223,436,052.56	1.75
S	综合	-	-
	合计	11,836,962,190.65	92.83

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	6,569,909	1,065,376,443.44	8.36
2	300661	圣邦股份	2,722,266	830,427,243.30	6.51

3	300014	亿纬锂能	16,433,126	786,325,079.10	6.17
4	000661	长春高新	1,776,704	773,399,251.20	6.07
5	600703	三安光电	29,594,464	739,861,600.00	5.80
6	601012	隆基股份	18,009,891	733,542,860.43	5.75
7	300529	健帆生物	10,117,135	703,140,882.50	5.51
8	600438	通威股份	40,094,651	696,845,034.38	5.46
9	600276	恒瑞医药	7,066,366	652,225,581.80	5.12
10	600536	中国软件	7,386,309	584,995,672.80	4.59
11	603986	兆易创新	2,222,942	523,864,747.22	4.11
12	603259	药明康德	4,899,689	473,309,957.40	3.71
13	000938	紫光股份	10,536,479	449,867,867.42	3.53
14	600588	用友网络	9,875,442	435,506,992.20	3.42
15	600009	上海机场	6,014,473	433,463,069.11	3.40
16	600584	长电科技	10,321,981	322,768,345.87	2.53
17	002371	北方华创	1,462,367	249,933,143.97	1.96
18	000681	视觉中国	11,999,788	223,436,052.56	1.75
19	300457	赢合科技	6,091,798	194,206,520.24	1.52
20	000915	山大华特	4,599,955	150,648,526.25	1.18
21	688018	乐鑫科技	536,799	110,365,874.40	0.87
22	300548	博创科技	1,800,000	107,640,000.00	0.84
23	300759	康龙化成	1,075,000	105,780,000.00	0.83
24	300347	泰格医药	999,925	101,872,359.00	0.80
25	300212	易华录	1,513,437	84,752,472.00	0.66
26	002414	高德红外	2,549,998	74,663,941.44	0.59
27	000063	中兴通讯	1,986,097	70,585,886.44	0.55
28	300731	科创新源	1,399,860	46,195,380.00	0.36
29	002301	齐心集团	2,508,000	41,181,360.00	0.32
30	688039	当虹科技	300,000	28,017,000.00	0.22
31	002685	华东重机	1,000,000	5,900,000.00	0.05
32	688012	中微公司	23,850	5,230,543.50	0.04
33	688111	金山办公	14,659	5,007,221.22	0.04
34	688169	石头科技	5,382	2,028,475.80	0.02
35	688599	天合光能	102,459	1,721,311.20	0.01
36	688158	优刻得	20,700	1,467,630.00	0.01
37	688106	金宏气体	26,075	1,355,378.50	0.01
38	688188	柏楚电子	7,847	1,279,845.70	0.01
39	688318	财富趋势	4,356	1,237,104.00	0.01
40	601916	浙商银行	294,195	1,159,128.30	0.01
41	688200	华峰测控	3,780	1,020,675.60	0.01
42	688023	安恒信息	2,728	839,951.20	0.01
43	688321	微芯生物	13,328	834,332.80	0.01
44	688208	道通科技	14,165	801,030.75	0.01
45	688505	复旦张江	22,688	772,072.64	0.01
46	688085	三友医疗	8,807	698,307.03	0.01

47	601077	渝农商行	147,778	697,512.16	0.01
48	688086	紫晶存储	9,361	634,582.19	0.00
49	688278	特宝生物	8,636	611,083.36	0.00
50	688598	金博股份	7,645	595,851.30	0.00
51	688051	佳华科技	4,053	514,690.47	0.00
52	688222	成都先导	9,201	499,154.25	0.00
53	688166	博瑞医药	8,041	497,657.49	0.00
54	688268	华特气体	5,216	482,740.80	0.00
55	688365	光云科技	8,249	481,246.66	0.00
56	688566	吉贝尔	9,882	449,631.00	0.00
57	688198	佰仁医疗	3,213	423,248.49	0.00
58	688312	燕麦科技	7,390	404,233.00	0.00
59	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.00
60	688157	松井股份	3,402	375,580.80	0.00
61	688360	德马科技	6,109	363,913.13	0.00
62	688189	南新制药	6,833	363,515.60	0.00
63	688186	广大特材	8,033	283,484.57	0.00
64	688181	八亿时空	4,306	267,919.32	0.00
65	688004	博汇科技	2,500	249,875.00	0.00
66	603195	公牛集团	1,359	218,323.35	0.00
67	688466	金科环境	4,907	218,312.43	0.00
68	688228	开普云	2,718	212,330.16	0.00
69	688058	宝兰德	1,450	205,871.00	0.00
70	688080	映翰通	2,233	193,779.74	0.00
71	688516	奥特维	3,440	187,996.00	0.00
72	688398	赛特新材	3,246	184,210.50	0.00
73	688159	有方科技	3,341	181,048.79	0.00
74	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
75	688118	普元信息	4,028	163,335.40	0.00
76	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
77	688078	龙软科技	2,811	115,813.20	0.00
78	688096	京源环保	4,485	114,905.70	0.00
79	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
80	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
81	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
82	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
83	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
84	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.00
85	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
86	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
87	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
88	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
89	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
90	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00

91	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
92	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600276	恒瑞医药	565,060,934.72	9.77
2	601012	隆基股份	555,084,617.94	9.60
3	600438	通威股份	540,386,645.75	9.34
4	600009	上海机场	479,067,651.27	8.28
5	000938	紫光股份	462,763,243.54	8.00
6	000661	长春高新	431,323,989.58	7.46
7	603259	药明康德	380,226,027.86	6.57
8	000725	京东方 A	350,892,490.65	6.07
9	600588	用友网络	342,707,498.84	5.93
10	000063	中兴通讯	290,952,475.14	5.03
11	600584	长电科技	247,992,897.59	4.29
12	000977	浪潮信息	243,720,245.63	4.21
13	000681	视觉中国	235,684,053.10	4.08
14	600118	中国卫星	221,493,955.29	3.83
15	601698	中国卫通	181,450,246.62	3.14
16	002475	立讯精密	160,920,229.50	2.78
17	600536	中国软件	157,736,379.44	2.73
18	002223	鱼跃医疗	149,039,389.93	2.58
19	000066	中国长城	148,517,143.20	2.57
20	000333	美的集团	141,958,270.94	2.45
21	600703	三安光电	140,474,061.94	2.43
22	300014	亿纬锂能	139,479,116.75	2.41
23	600745	闻泰科技	129,932,596.00	2.25
24	603160	汇顶科技	127,858,093.47	2.21
25	600030	中信证券	119,983,834.29	2.07
26	603501	韦尔股份	118,330,818.42	2.05

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	000063	中兴通讯	641,376,098.70	11.09
2	000725	京东方 A	447,547,877.00	7.74
3	002156	通富微电	348,383,894.85	6.02
4	000066	中国长城	314,165,759.29	5.43
5	600584	长电科技	283,580,212.56	4.90
6	000977	浪潮信息	211,441,362.71	3.66
7	600118	中国卫星	190,308,071.05	3.29
8	002223	鱼跃医疗	184,075,624.05	3.18
9	002185	华天科技	180,282,138.45	3.12
10	002475	立讯精密	175,258,448.75	3.03
11	601698	中国卫通	159,573,447.31	2.76
12	000333	美的集团	150,969,680.49	2.61
13	603501	韦尔股份	144,713,736.35	2.50
14	600745	闻泰科技	118,179,387.52	2.04
15	600030	中信证券	114,370,067.07	1.98
16	300628	亿联网络	106,403,467.62	1.84
17	300457	赢合科技	100,954,921.16	1.75
18	603160	汇顶科技	100,559,384.15	1.74
19	300679	电连技术	83,633,611.44	1.45
20	600519	贵州茅台	77,584,277.32	1.34

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	8,075,074,359.05
卖出股票收入（成交）总额	4,516,607,376.67

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，惠州亿纬锂能股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国惠州海关的处罚。

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

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	2,634,518.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	102,358.75

5	应收申购款	123,162,332.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,899,209.49

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
405,839	11,613.97	883,693,398.94	18.75%	3,829,709,026.16	81.25%

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	3,856,152.15	0.0818%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 8 月 24 日）基金份额总额	360,203,432.15
本报告期期初基金份额总额	3,133,963,246.08
本报告期基金总申购份额	7,118,642,476.34
减：本报告期基金总赎回份额	5,539,203,297.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,713,402,425.10

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 2020 年 7 月 11 日发布公告，自 2020 年 7 月 11 日起，邱春杨先生不再担任公司督察长，程才良先生新任公司督察长。

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	
华泰证券	5	32,474,976.00	0.26%	30,243.75	0.28%	-
信达证券	3	36,991,731.53	0.30%	27,051.35	0.25%	-
华福证券	2	56,833,750.00	0.45%	52,929.48	0.48%	-
西藏东方财富证券	2	59,105,421.60	0.47%	43,224.13	0.39%	-
新时代证券	3	66,640,115.53	0.53%	62,061.07	0.57%	-
南京证券	1	69,217,710.31	0.55%	50,614.50	0.46%	-
安信证券	5	83,372,188.50	0.67%	60,970.55	0.56%	-
长城证券	2	97,721,388.94	0.78%	91,011.27	0.83%	-
国联证券	1	100,944,612.45	0.81%	94,009.95	0.86%	-
中银国际	2	138,745,661.27	1.11%	101,464.26	0.93%	-
西部证券	2	194,026,127.33	1.55%	141,892.90	1.30%	-
广发证券	7	213,536,531.55	1.71%	193,068.55	1.76%	-
天风证券	3	226,030,750.40	1.81%	165,292.50	1.51%	-
中信建投	5	360,568,531.32	2.88%	288,206.19	2.63%	-
瑞银证券	1	377,243,173.73	3.01%	351,326.72	3.21%	-
中信证券	5	391,356,288.02	3.13%	364,470.54	3.33%	-
太平洋证券	2	571,772,425.60	4.57%	418,135.88	3.82%	-
东北证券	4	619,962,633.84	4.95%	577,373.77	5.27%	-
方正证券	5	654,337,107.57	5.23%	604,438.08	5.52%	-
华安证券	1	690,554,032.47	5.52%	505,002.08	4.61%	-
国信证券	2	710,504,413.75	5.67%	662,334.77	6.05%	-
长江证券	3	973,120,872.47	7.77%	906,264.48	8.27%	-
东吴证券	1	986,780,908.79	7.88%	721,630.78	6.59%	-
光大证券	3	1,235,607,774.68	9.87%	1,150,683.09	10.50%	-
国泰君安	3	1,478,590,029.31	11.81%	1,377,006.65	12.57%	-
中泰证券	4	2,095,011,670.60	16.73%	1,914,680.62	17.48%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-

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服务实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-21
2	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27
3	关于广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-14
4	关于广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-29
5	关于广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-27
6	关于广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-21
7	关于旗下基金投资中兴通讯（000063）非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-05
8	关于增加微众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	2020-01-22
9	关于增加万和证券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	2020-01-20
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-17
11	关于增加陆享基金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	2020-01-16
12	关于增加北京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	2020-01-15
13	关于增加齐商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	2020-01-14
14	关于增加中国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	2020-01-09
15	关于增加坤元基金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	2020-01-07

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会注册广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书

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

二〇二〇年八月二十七日