

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基 金

2017 年半年度报告

2017 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
8 基金份额持有人信息	49

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
9	开放式基金份额变动	51
10	重大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	52
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	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	52
11	影响投资者决策的其他重要信息	53
12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中小板 300ETF
场内简称	中小 300
基金主代码	159907
交易代码	159907
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	175,098,847.00 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	2011 年 8 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。</p> <p>本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑行业属性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。</p>
业绩比较基准	中小板 300 价格指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中小板 300 价格指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露	姓名	段西军	林葛

负责人	联系电话	020-83936666	010-66060069
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95599
传真		020-89899158	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市东城区建国门内大街69 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28 号凯晨世贸中心东座
邮政编码		510308	100031
法定代表人		孙树明	周慕冰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-3,938,138.53
本期利润	6,450,768.03
加权平均基金份额本期利润	0.0357
本期加权平均净值利润率	2.52%
本期基金份额净值增长率	2.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	60,033,168.75
期末可供分配基金份额利润	0.3429
期末基金资产净值	252,758,687.78
期末基金份额净值	1.4435

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	31.15%

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）。

（4）本基金本报告期末还原后基金份额净值为 1.3115。

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	6.34%	0.86%	6.15%	0.88%	0.19%	-0.02%
过去三个月	-0.45%	0.87%	-1.16%	0.88%	0.71%	-0.01%
过去六个月	2.30%	0.85%	0.78%	0.86%	1.52%	-0.01%
过去一年	-2.33%	0.88%	-5.09%	0.90%	2.76%	-0.02%
过去三年	51.15%	2.04%	49.90%	2.00%	1.25%	0.04%
自基金合同生效起至今	31.15%	1.77%	41.23%	1.76%	-10.08%	0.01%

注：本基金业绩比较基准是中小板 300 价格指数。

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

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金

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

（2011 年 6 月 3 日至 2017 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、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26个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、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）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），

参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 6 月 30 日,本基金管理人管理一百四十四只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金 (LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金,广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报

混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF)、广发景祥纯债债券型证券

投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 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）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发量化稳健基金的基金经理；广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理；广发中证 500ETF 基金的基金经理；广发中证 500ETF 联接 (LOF) 基金的基金经理；广发沪深 300ETF 基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板 300 联接基金的基金经理；广发军工 ETF 基金的基金经理；广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理；	2016-01-25	-	13 年	男，中国籍，工学学士，持有中国证券基金从业证书，2004 年 7 月至 2010 年 11 月在广发基金管理有限公司信息技术部工作，2010 年 11 月至 2014 年 3 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员，2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日任广发沪深 300 指数基金的基金经理，2014 年 4 月 1 日起任广发中证 500ETF 以及广发中证 500ETF 联接 (LOF) 基金的基金经理，2015 年 8 月 20 日起任广发沪深 300ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 18 日起任广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 25 日起任广发中小板 300ETF 及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日起任数量投资部总经理助理，2016 年 8 月 30 日起任广发中证军工 ETF 基金的基金经理，2016 年 9 月 26 日起任广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理，2017 年 1 月 25 日起任广发中证环保 ETF 基金的基金经理，2017 年 4 月 25 日起任广发创业板 ETF 基金的基金经理，2017 年 5 月 25 日起任广发创业板 ETF 联接基金的基金经理。

	广发中证环保 ETF 基金的基金经理；广发创业板 ETF 基金的基金经理；广发创业板 ETF 联接基金的基金经理；数量投资部总经理助理				
--	---	--	--	--	--

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》及其配套法规、《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金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，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%，未发现本基金存在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

（1）投资策略

作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

（2）运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，符合要求。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素；作为 ETF 基金，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响相对较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%，较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在金融去杠杆、减持新政和加强监管等影响下，上半年市场呈现了明显“一九行情”，白酒、家电和金融等白马股表现最好。

展望下半年，随着 A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，未来 A 股市场或将进一步助推境外机构的价值投资理念。随着经济稳定且逐步好转，未来政策或转向监管和流动性之间的协调平衡，权益类资产的配置机会仍然值得关注。

中小板 300 指数里含有众多优质的企业，可以期待中小板 300 指数良好的成长性为投资者带来相对超额收益；同时，中小板 300 指数优秀的弹性也可作为波段操作的有力工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及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。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—广发基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额

申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，广发基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

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：广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	6,387,492.98	6,073,667.93
结算备付金		-	-
存出保证金		2,596.93	3,548.28
交易性金融资产	6.4.7.2	250,528,211.08	261,366,019.77
其中：股票投资		250,444,079.69	261,310,913.53
基金投资		-	-
债券投资		84,131.39	55,106.24
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	1,198.09	1,502.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		256,919,499.08	267,444,738.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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		3,251,509.61	2,379,457.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		102,179.78	115,185.07
应付托管费		20,435.94	23,037.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,329.88	32,169.64
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	773,356.09	896,136.30
负债合计		4,160,811.30	3,445,985.77
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	192,725,519.03	205,933,522.79
未分配利润	6.4.7.1 0	60,033,168.75	58,065,229.62
所有者权益合计		252,758,687.78	263,998,752.41
负债和所有者权益总计		256,919,499.08	267,444,738.18

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4435 元，基金份额总额 175,098,847.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		7,587,472.34	-46,599,686.24
1. 利息收入		18,176.21	28,438.44
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	18,003.51	28,333.04

债券利息收入		172.70	105.40
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）		-2,817,204.73	-13,503,961.30
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-4,164,448.52	-15,061,249.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	8,947.44
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	1,347,243.79	1,548,341.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	10,388,906.56	-33,072,317.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-2,405.70	-51,845.78
减：二、费用		1,136,704.31	1,285,071.95
1. 管理人报酬		633,084.22	682,973.56
2. 托管费		126,616.80	136,594.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	27,067.53	115,279.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	349,935.76	350,224.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,450,768.03	-47,884,758.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,450,768.03	-47,884,758.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	205,933,522.79	58,065,229.62	263,998,752.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,450,768.03	6,450,768.03
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）	-13,208,003.76	-4,482,828.90	-17,690,832.66
其中：1. 基金申购款	23,114,006.58	6,688,586.70	29,802,593.28
2. 基金赎回款	-36,322,010.34	-11,171,415.60	-47,493,425.94
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）	192,725,519.03	60,033,168.75	252,758,687.78
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	209,235,523.73	121,478,637.57	330,714,161.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-47,884,758.19	-47,884,758.19
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）	21,463,006.11	5,471,637.13	26,934,643.24
其中：1. 基金申购款	56,134,015.98	13,968,110.02	70,102,126.00
2. 基金赎回款	-34,671,009.87	-8,496,472.89	-43,167,482.76
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）	230,698,529.84	79,065,516.51	309,764,046.35

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

1. 基金募集成立

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2011]424 号《关于核准广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2011 年 6 月 3 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金募集期为 2011 年 5 月 3 日至 2011 年 5 月 27 日,本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币 718,294,002.00 元,有效认购户数为 9,415 户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 59,530.17 元,折合基金份额 55,268.00 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,折算差额人民币 4,262.17 元计入基金资产。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。

根据《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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括:具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股和备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准:中小板 300 价格指数。

2. 基金份额折算

为了与中小板 300 价格指数进行对比,根据基金合同和《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(“招募说明书”)的有关规定,广发基金管理有限公司确定 2011 年 7 月 25 日为本基金的基金份额折算日。当日中小板 300 价格指数收盘值为 1078.962 点,本基金资产净值为人民币 704,134,532.97 元,折算前基金份额总额为 718,294,002.00 份,折算前基金份额净值为人民币 0.9803 元。

根据招募说明书中约定的基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.90854670,折算后基金份额总额为 652,598,847.00 份,折算后基金份额净值为人民币 1.0790 元。

广发基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,

并由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于 2011 年 7 月 26 日进行了变更登记。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 22 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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	6,387,492.98
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,387,492.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	285,072,409.23	250,444,079.69	-34,628,329.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	79,800.00	84,131.39
	银行间市场	-	-
	合计	79,800.00	84,131.39
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	285,152,209.23	250,528,211.08	-34,623,998.15
----	----------------	----------------	----------------

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,137.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1.08
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	60.00
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	1,198.09

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	13,329.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,329.88

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
预提费用	198,356.09
应付指数使用费	75,000.00
合计	773,356.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,098,847.00	205,933,522.79
本期申购	21,000,000.00	23,114,006.58
本期赎回（以“-”号填列）	-33,000,000.00	-36,322,010.34
本期末	175,098,847.00	192,725,519.03

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	129,740,734.29	-71,675,504.67	58,065,229.62
本期利润	-3,938,138.53	10,388,906.56	6,450,768.03
本期基金份额交易产生的变动数	-8,193,499.01	3,710,670.11	-4,482,828.90
其中：基金申购款	14,397,083.87	-7,708,497.17	6,688,586.70
基金赎回款	-22,590,582.88	11,419,167.28	-11,171,415.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,609,096.75	-57,575,928.00	60,033,168.75

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	26.41
结算备付金利息收入	362.20
其他	-
合计	18,003.51

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-6,275,888.92
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-4,164,448.52

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,484,439.78
减：卖出股票成本总额	7,372,999.38
买卖股票差价收入	2,111,440.40

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	47,493,425.94
减：现金支付赎回款总额	3,267,124.94
减：赎回股票成本总额	50,502,189.92
赎回差价收入	-6,275,888.92

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,347,243.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,347,243.79

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	10,388,906.56
——股票投资	10,388,581.41
——债券投资	325.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	10,388,906.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
手续费返还	-
基金转换费收入	-
印花税返还	-
替代损益	-2,405.70
其他	-
合计	-2,405.70

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	27,067.53
银行间市场交易费用	-
合计	27,067.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	1,579.67
上市费	29,752.78
指数使用费	150,000.00
合计	349,935.76

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
中国农业银行股份有限公司	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
广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	17,238,141.18	100.00%	77,797,868.62	100.00%

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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	-	-	42,970.91	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	16,053.91	100.00%	13,329.88	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	72,453.79	100.00%	28,282.39	100.00%

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	633,084.22	682,973.56
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,616.80	136,594.70

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	151,717,345.00	86.65%	160,336,045.00	85.70%

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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
中国农业银行股份有限公司	6,387,492.98	17,614.90	9,582,286.66	26,902.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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（2017 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
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股流通受限	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-

注：截至本报告期末 2017 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002331	皖通科技	2017-05-02	重大事项停牌	14.16	-	-	6,280.00	123,052.38	88,924.80	-
002312	*ST 三泰	2017-03-31	重大事项停牌	6.82	2017-07-24	7.16	17,317.00	358,829.82	118,101.94	-
002619	巨龙管业	2017-05-24	重大事项停牌	6.37	-	-	27,180.00	258,707.48	173,136.60	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项停牌	2.44	2017-08-02	2.44	101,100.00	327,262.47	246,684.00	-
002504	*ST 弘高	2017-05-02	重大事项停牌	8.10	-	-	37,926.00	353,914.87	307,200.60	-
002143	印纪传媒	2017-04-18	重大事项停牌	24.93	-	-	16,000.00	517,623.12	398,880.00	-
002675	东诚药业	2017-01-03	重大事项停牌	14.26	2017-07-17	12.84	28,900.00	417,611.00	412,114.00	-
002010	传化智联	2017-06-26	重大事项	15.26	2017-06-26	15.50	27,300.00	529,190.93	416,598.00	-

002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项停牌	12.59	2017-07-03	12.70	34,562.00	606,113.04	435,135.58	-
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大事项停牌	11.46	2017-08-09	6.25	38,388.00	396,954.13	439,926.48	-
002263	大东南	2017-04-24	重大事项停牌	3.28	-	-	136,640.00	585,413.87	448,179.20	-
002625	光启技术	2017-04-13	重大事项停牌	36.36	-	-	13,000.00	588,974.41	472,680.00	-
002418	康盛股份	2017-03-20	重大事项停牌	9.31	2017-07-10	9.30	51,100.00	530,541.50	475,741.00	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项停牌	8.70	2017-08-14	9.57	60,376.00	623,552.51	525,271.20	-
002070	*ST 众和	2017-05-02	重大事项停牌	10.17	-	-	51,879.00	834,209.07	527,609.43	-
002447	壹桥股份	2017-05-02	重大事项停牌	9.00	-	-	58,856.00	654,540.14	529,704.00	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项停牌	17.02	2017-07-12	16.68	31,300.00	593,078.69	532,726.00	-
002638	勤上股份	2017-04-26	重大事项停牌	8.14	-	-	69,427.00	568,700.03	565,135.78	-
002505	大康农业	2017-03-13	重大事项停牌	3.50	-	-	166,810.00	703,825.75	583,835.00	-
002547	春兴精工	2017-02-20	重大事项停牌	10.89	2017-08-18	9.80	56,800.00	696,651.51	618,552.00	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项停牌	20.23	-	-	32,725.00	647,483.96	662,026.75	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项停牌	24.95	2017-07-04	22.46	27,243.00	707,568.52	679,712.85	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项停牌	25.06	2017-07-07	22.54	27,995.00	897,018.29	701,554.70	-
002622	融钰集团	2017-04-20	重大事项停牌	12.30	-	-	63,900.00	832,324.16	785,970.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项停牌	10.33	2017-08-02	11.36	81,616.00	914,252.51	843,093.28	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项停牌	30.82	2017-07-17	27.74	35,524.00	1,553,051.86	1,094,849.68	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大事项停牌	16.12	-	-	70,500.00	886,402.91	1,136,460.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项停牌	7.68	-	-	167,950.00	1,451,790.10	1,289,856.00	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项停牌	16.99	-	-	76,982.00	1,037,633.32	1,307,924.18	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.27	-	-	169,586.00	2,694,232.35	1,402,476.22	-

002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项停牌	20.24	-	-	85,815.00	1,858,757.95	1,736,895.60	-
--------	------	------------	--------	-------	---	---	-----------	--------------	--------------	---

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 2017 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 2017 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监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	84,131.39	55,106.24

未评级	-	-
合计	84,131.39	55,106.24

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、政策性金融债和央行票据。

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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.4 市场风险

本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 2017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	6,387,492.98	-	-	-	6,387,492.98
存出保证金	2,596.93	-	-	-	2,596.93
交易性金融资产	84,131.39	-	-	250,444,079.69	250,528,211.08
应收利息	-	-	-	1,198.09	1,198.09
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,474,221.30	-	-	250,445,277.78	256,919,499.08
负债					

应付证券清算款	-	-	-	3,251,509.61	3,251,509.61
应付管理人报酬	-	-	-	102,179.78	102,179.78
应付托管费	-	-	-	20,435.94	20,435.94
应付交易费用	-	-	-	13,329.88	13,329.88
其他负债	-	-	-	773,356.09	773,356.09
负债总计	-	-	-	4,160,811.30	4,160,811.30
利率敏感度缺口	6,474,221.30	-	-	246,284,466.48	252,758,687.78
上年度末 2016 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	6,073,667.93	-	-	-	6,073,667.93
存出保证金	3,548.28	-	-	-	3,548.28
交易性金融资产	55,106.24	-	-	261,310,913.53	261,366,019.77
应收利息	-	-	-	1,502.20	1,502.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,132,322.45	-	-	261,312,415.73	267,444,738.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,379,457.76	2,379,457.76
应付管理人报酬	-	-	-	115,185.07	115,185.07
应付托管费	-	-	-	23,037.00	23,037.00
应付交易费用	-	-	-	32,169.64	32,169.64
其他负债	-	-	-	896,136.30	896,136.30
负债总计	-	-	-	3,445,985.77	3,445,985.77
利率敏感度缺口	6,132,322.45	-	-	257,866,429.96	263,998,752.41

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

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

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	12,409.38	-
	市场利率下降 25 个基点	-12,409.38	-

注：本基金上年度末持有的交易性债券投资占基金资产净值比例较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	250,444,079.69	99.08	261,310,913.53	98.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	84,131.39	0.03	55,106.24	0.02
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	250,528,211.08	99.12	261,366,019.77	99.00

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

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	13,493,703.98	13,041,919.30
	业绩比较基准下降 5%	-13,493,703.98	-13,041,919.30

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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 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 230,497,146.90 元，属于第二层级的余额为 19,956,954.87 元，属于第三层级的余额为 74,109.31 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票(2016 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 249,724,687.51 元，第二层级的余额为 11,511,468.85 元，第三层级的余额为 129,863.41 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票)。

(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。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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	250,444,079.69	97.48
	其中：股票	250,444,079.69	97.48

2	固定收益投资	84,131.39	0.03
	其中：债券	84,131.39	0.03
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,387,492.98	2.49
7	其他各项资产	3,795.02	0.00
8	合计	256,919,499.08	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,785,330.39	1.50
B	采矿业	1,169,848.98	0.46
C	制造业	176,677,657.54	69.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	935,920.95	0.37
E	建筑业	8,535,171.28	3.38
F	批发和零售业	8,635,903.54	3.42
G	交通运输、仓储和邮政业	1,363,900.74	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,517,169.99	10.10
J	金融业	9,972,515.33	3.95
K	房地产业	2,859,519.34	1.13
L	租赁和商务服务业	4,807,170.61	1.90
M	科学研究和技术服务业	85,254.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,144,256.00	0.45

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,388,271.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	3,566,190.00	1.41
S	综合	-	-
	合计	250,444,079.69	99.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002415	海康威视	280,582	9,062,798.60	3.59
2	002450	康得新	229,750	5,173,970.00	2.05
3	002304	洋河股份	51,964	4,510,994.84	1.78
4	002024	苏宁云商	354,996	3,993,705.00	1.58
5	002230	科大讯飞	87,759	3,501,584.10	1.39
6	002456	欧菲光	182,045	3,307,757.65	1.31
7	002466	天齐锂业	60,363	3,280,729.05	1.30
8	002236	大华股份	140,807	3,211,807.67	1.27
9	002142	宁波银行	165,924	3,202,333.20	1.27
10	002241	歌尔股份	165,228	3,185,595.84	1.26
11	002008	大族激光	80,178	2,777,365.92	1.10
12	002594	比亚迪	52,178	2,606,291.10	1.03
13	002673	西部证券	181,095	2,575,170.90	1.02
14	002475	立讯精密	83,651	2,445,955.24	0.97
15	002202	金风科技	155,027	2,398,267.69	0.95
16	002736	国信证券	170,567	2,260,012.75	0.89
17	002460	赣锋锂业	47,684	2,205,385.00	0.87
18	002739	万达电影	39,300	2,003,121.00	0.79
19	002572	索菲亚	47,900	1,963,900.00	0.78
20	002508	老板电器	44,265	1,924,642.20	0.76
21	002007	华兰生物	52,123	1,902,489.50	0.75
22	002085	万丰奥威	95,644	1,860,275.80	0.74
23	002271	东方雨虹	49,684	1,843,276.40	0.73

24	002065	东华软件	83,708	1,823,997.32	0.72
25	002310	东方园林	106,402	1,779,041.44	0.70
26	002252	上海莱士	85,815	1,736,895.60	0.69
27	002465	海格通信	157,734	1,694,063.16	0.67
28	002340	格林美	272,107	1,646,247.35	0.65
29	002405	四维图新	77,978	1,540,845.28	0.61
30	002081	金螳螂	128,120	1,406,757.60	0.56
31	002129	中环股份	169,586	1,402,476.22	0.55
32	002044	美年健康	81,663	1,388,271.00	0.55
33	002050	三花智控	81,954	1,337,489.28	0.53
34	002168	深圳惠程	76,982	1,307,924.18	0.52
35	002074	国轩高科	41,300	1,303,015.00	0.52
36	002092	中泰化学	102,263	1,298,740.10	0.51
37	002426	胜利精密	167,950	1,289,856.00	0.51
38	002385	大北农	203,023	1,277,014.67	0.51
39	002146	荣盛发展	122,790	1,211,937.30	0.48
40	002183	怡亚通	138,700	1,196,981.00	0.47
41	002500	山西证券	122,356	1,172,170.48	0.46
42	002038	双鹭药业	40,206	1,172,004.90	0.46
43	002311	海大集团	63,460	1,159,414.20	0.46
44	002179	中航光电	37,036	1,155,152.84	0.46
45	002573	清新环境	60,800	1,144,256.00	0.45
46	002294	信立泰	31,974	1,140,192.84	0.45
47	002075	沙钢股份	70,500	1,136,460.00	0.45
48	002410	广联达	59,918	1,126,458.40	0.45
49	002407	多氟多	50,895	1,119,181.05	0.44
50	002027	分众传媒	80,800	1,111,808.00	0.44
51	002049	紫光国芯	35,524	1,094,849.68	0.43
52	002422	科伦药业	65,382	1,080,110.64	0.43
53	002223	鱼跃医疗	45,108	1,068,157.44	0.42
54	002030	达安基因	48,815	1,063,678.85	0.42
55	002185	华天科技	143,926	1,042,024.24	0.41
56	002470	金正大	137,744	1,037,212.32	0.41
57	002400	省广股份	127,497	1,023,800.91	0.41
58	002583	海能达	63,060	1,014,635.40	0.40
59	002195	二三四五	138,648	991,333.20	0.39
60	002051	中工国际	47,285	980,218.05	0.39
61	002273	水晶光电	46,907	967,691.41	0.38
62	002384	东山精密	38,892	960,632.40	0.38
63	002138	顺络电子	50,812	944,086.96	0.37
64	002001	新和成	48,029	932,242.89	0.37
65	002439	启明星辰	50,068	931,264.80	0.37
66	002108	沧州明珠	68,567	915,369.45	0.36
67	002004	华邦健康	116,852	914,951.16	0.36

68	002366	台海核电	19,400	910,054.00	0.36
69	002217	合力泰	91,800	906,984.00	0.36
70	002176	江特电机	99,530	867,901.60	0.34
71	002221	东华能源	78,698	858,595.18	0.34
72	002714	牧原股份	31,324	852,639.28	0.34
73	002019	亿帆医药	50,635	844,591.80	0.33
74	002013	中航机电	81,616	843,093.28	0.33
75	002555	三七互娱	32,720	836,650.40	0.33
76	002292	奥飞娱乐	49,008	828,235.20	0.33
77	002078	太阳纸业	112,356	825,816.60	0.33
78	002408	齐翔腾达	74,517	825,648.36	0.33
79	002250	联化科技	57,638	824,223.40	0.33
80	002640	跨境通	38,700	822,375.00	0.33
81	002048	宁波华翔	39,164	816,961.04	0.32
82	002131	利欧股份	244,439	804,204.31	0.32
83	002701	奥瑞金	125,203	800,047.17	0.32
84	002191	劲嘉股份	84,478	790,714.08	0.31
85	002622	融钰集团	63,900	785,970.00	0.31
86	002501	利源精制	68,860	782,938.20	0.31
87	002424	贵州百灵	41,268	778,314.48	0.31
88	002152	广电运通	93,628	778,048.68	0.31
89	002665	首航节能	107,783	776,037.60	0.31
90	002028	思源电气	48,521	773,424.74	0.31
91	002462	嘉事堂	19,500	766,155.00	0.30
92	002280	联络互动	70,282	764,668.16	0.30
93	002431	棕榈股份	69,230	762,914.60	0.30
94	002491	通鼎互联	56,700	762,048.00	0.30
95	002411	必康股份	26,206	757,877.52	0.30
96	002444	巨星科技	48,499	755,614.42	0.30
97	002266	浙富控股	153,225	747,738.00	0.30
98	002353	杰瑞股份	47,264	747,716.48	0.30
99	002174	游族网络	23,400	743,184.00	0.29
100	002589	瑞康医药	46,780	720,412.00	0.29
101	002497	雅化集团	74,100	718,770.00	0.28
102	002558	巨人网络	15,520	717,334.40	0.28
103	002373	千方科技	52,381	714,476.84	0.28
104	002389	南洋科技	33,900	713,934.00	0.28
105	002002	鸿达兴业	91,047	712,898.01	0.28
106	002153	石基信息	31,153	708,107.69	0.28
107	002595	豪迈科技	31,800	706,914.00	0.28
108	002477	雏鹰农牧	158,867	703,780.81	0.28
109	002602	世纪华通	19,400	703,444.00	0.28
110	002244	滨江集团	101,634	703,307.28	0.28
111	002642	荣之联	27,995	701,554.70	0.28

112	002630	华西能源	60,400	700,036.00	0.28
113	002022	科华生物	40,110	696,710.70	0.28
114	002570	贝因美	51,222	696,619.20	0.28
115	002262	恩华药业	45,244	684,541.72	0.27
116	002025	航天电器	27,243	679,712.85	0.27
117	002522	浙江众成	40,800	667,080.00	0.26
118	002672	东江环保	39,437	666,090.93	0.26
119	002544	杰赛科技	29,200	665,760.00	0.26
120	002603	以岭药业	38,006	663,584.76	0.26
121	002368	太极股份	23,960	663,452.40	0.26
122	002440	闰土股份	43,412	662,467.12	0.26
123	002399	海普瑞	32,725	662,026.75	0.26
124	002281	光迅科技	29,621	658,178.62	0.26
125	002383	合众思壮	41,900	656,573.00	0.26
126	002043	兔宝宝	46,800	647,712.00	0.26
127	002285	世联行	80,488	645,513.76	0.26
128	002155	湖南黄金	67,354	644,577.78	0.26
129	002299	圣农发展	42,915	638,146.05	0.25
130	002018	华信国际	92,761	635,412.85	0.25
131	002268	卫士通	37,682	633,811.24	0.25
132	002421	达实智能	101,826	623,175.12	0.25
133	002489	浙江永强	97,400	621,412.00	0.25
134	002390	信邦制药	71,170	619,890.70	0.25
135	002547	春兴精工	56,800	618,552.00	0.24
136	002117	东港股份	23,704	613,459.52	0.24
137	002104	恒宝股份	65,217	612,387.63	0.24
138	002047	宝鹰股份	70,800	611,712.00	0.24
139	002261	拓维信息	52,006	608,990.26	0.24
140	002308	威创股份	46,313	604,384.65	0.24
141	002396	星网锐捷	31,231	604,319.85	0.24
142	002436	兴森科技	95,584	602,179.20	0.24
143	002343	慈文传媒	15,600	590,616.00	0.23
144	002055	得润电子	25,840	587,343.20	0.23
145	002505	大康农业	166,810	583,835.00	0.23
146	002023	海特高新	56,488	580,131.76	0.23
147	002317	众生药业	46,480	577,281.60	0.23
148	002375	亚厦股份	64,284	572,770.44	0.23
149	002056	横店东磁	75,792	568,440.00	0.22
150	002089	新海宜	83,800	567,326.00	0.22
151	002276	万马股份	56,084	565,887.56	0.22
152	002638	勤上股份	69,427	565,135.78	0.22
153	002517	恺英网络	16,000	563,040.00	0.22
154	002326	永太科技	40,600	562,716.00	0.22
155	002479	富春环保	47,144	561,013.60	0.22

156	002325	洪涛股份	76,797	560,618.10	0.22
157	002709	天赐材料	13,600	559,912.00	0.22
158	002624	完美世界	16,200	555,660.00	0.22
159	002067	景兴纸业	94,600	555,302.00	0.22
160	002376	新北洋	40,462	555,138.64	0.22
161	002437	誉衡药业	74,486	542,258.08	0.21
162	002121	科陆电子	62,047	533,604.20	0.21
163	002245	澳洋顺昌	59,073	532,838.46	0.21
164	002358	森源电气	31,300	532,726.00	0.21
165	002130	沃尔核材	82,750	532,082.50	0.21
166	002447	壹桥股份	58,856	529,704.00	0.21
167	002106	莱宝高科	52,167	528,451.71	0.21
168	002070	*ST 众和	51,879	527,609.43	0.21
169	002237	恒邦股份	50,212	526,723.88	0.21
170	002128	露天煤业	60,376	525,271.20	0.21
171	002503	搜于特	74,380	522,891.40	0.21
172	002097	山河智能	58,750	522,287.50	0.21
173	002073	软控股份	61,570	522,113.60	0.21
174	002657	中科金财	18,000	521,820.00	0.21
175	002663	普邦股份	95,589	519,048.27	0.21
176	002123	梦网荣信	46,470	516,281.70	0.20
177	002354	天神娱乐	23,835	512,452.50	0.20
178	002463	沪电股份	110,562	503,057.10	0.20
179	002482	广田集团	55,082	495,187.18	0.20
180	002242	九阳股份	25,157	494,838.19	0.20
181	002313	日海通讯	24,101	494,311.51	0.20
182	002341	新纶科技	26,400	492,360.00	0.19
183	002151	北斗星通	17,611	492,227.45	0.19
184	002468	申通快递	19,300	490,413.00	0.19
185	002303	美盈森	63,500	490,220.00	0.19
186	002036	联创电子	29,700	490,050.00	0.19
187	002428	云南锗业	45,834	489,507.12	0.19
188	002099	海翔药业	73,330	488,377.80	0.19
189	002668	奥马电器	24,760	487,772.00	0.19
190	002643	万润股份	33,000	487,080.00	0.19
191	002031	巨轮智能	155,737	484,342.07	0.19
192	002429	兆驰股份	156,815	481,422.05	0.19
193	002797	第一创业	52,200	480,762.00	0.19
194	002156	通富微电	47,169	480,180.42	0.19
195	002041	登海种业	36,017	477,225.25	0.19
196	002418	康盛股份	51,100	475,741.00	0.19
197	002091	江苏国泰	49,599	473,670.45	0.19
198	002625	光启技术	13,000	472,680.00	0.19
199	002190	成飞集成	17,501	469,026.80	0.19

200	002005	德豪润达	98,249	468,647.73	0.19
201	002063	远光软件	44,198	460,543.16	0.18
202	002413	雷科防务	41,000	459,200.00	0.18
203	002011	盾安环境	40,441	459,005.35	0.18
204	002449	国星光电	27,681	458,120.55	0.18
205	002283	天润曲轴	71,366	456,742.40	0.18
206	002481	双塔食品	67,800	452,226.00	0.18
207	002263	大东南	136,640	448,179.20	0.18
208	002474	榕基软件	41,200	447,020.00	0.18
209	002690	美亚光电	23,254	446,011.72	0.18
210	002145	中核钛白	72,900	443,232.00	0.18
211	002433	太安堂	47,900	443,075.00	0.18
212	002224	三力士	39,800	441,780.00	0.17
213	002600	江粉磁材	38,388	439,926.48	0.17
214	002512	达华智能	27,000	436,050.00	0.17
215	002681	奋达科技	34,562	435,135.58	0.17
216	002467	二六三	54,808	434,079.36	0.17
217	002254	泰和新材	32,547	432,875.10	0.17
218	002367	康力电梯	36,800	429,824.00	0.17
219	002249	大洋电机	65,208	429,068.64	0.17
220	002161	远望谷	52,844	428,036.40	0.17
221	002716	金贵银业	22,300	427,937.00	0.17
222	002649	博彦科技	38,700	426,861.00	0.17
223	002563	森马服饰	50,200	425,696.00	0.17
224	002318	久立特材	51,925	424,746.50	0.17
225	002032	苏泊尔	10,296	422,650.80	0.17
226	002402	和而泰	42,750	421,515.00	0.17
227	002284	亚太股份	37,800	419,580.00	0.17
228	002010	传化智联	27,300	416,598.00	0.16
229	002675	东诚药业	28,900	412,114.00	0.16
230	002371	北方华创	17,100	409,032.00	0.16
231	002581	未名医药	19,800	404,910.00	0.16
232	002215	诺普信	47,493	401,790.78	0.16
233	002493	荣盛石化	40,924	399,418.24	0.16
234	002498	汉缆股份	109,100	399,306.00	0.16
235	002143	印纪传媒	16,000	398,880.00	0.16
236	002339	积成电子	28,900	394,196.00	0.16
237	002052	同洲电子	62,022	393,219.48	0.16
238	002329	皇氏集团	40,800	392,088.00	0.16
239	002095	生意宝	11,169	386,000.64	0.15
240	002344	海宁皮城	45,928	382,120.96	0.15
241	002253	川大智胜	15,874	380,976.00	0.15
242	002707	众信旅游	28,700	376,831.00	0.15
243	002635	安洁科技	10,400	376,688.00	0.15

244	002721	金一文化	24,800	370,264.00	0.15
245	002588	史丹利	47,384	364,382.96	0.14
246	002445	中南文化	28,000	359,800.00	0.14
247	002550	千红制药	60,432	358,966.08	0.14
248	002699	美盛文化	25,920	357,696.00	0.14
249	002288	超华科技	50,818	354,201.46	0.14
250	002601	龙麟佰利	21,300	348,894.00	0.14
251	002222	福晶科技	24,300	346,761.00	0.14
252	002773	康弘药业	6,550	342,565.00	0.14
253	002364	中恒电气	25,000	342,250.00	0.14
254	002502	骅威文化	36,300	340,857.00	0.13
255	002352	顺丰控股	6,408	340,649.28	0.13
256	002414	高德红外	18,550	339,465.00	0.13
257	002488	金固股份	28,900	334,373.00	0.13
258	002556	辉隆股份	44,133	321,729.57	0.13
259	002180	纳思达	13,300	321,328.00	0.13
260	002297	博云新材	30,058	321,019.44	0.13
261	002102	冠福股份	76,203	318,528.54	0.13
262	002496	辉丰股份	63,460	314,761.60	0.12
263	002240	威华股份	26,771	314,559.25	0.12
264	002471	中超控股	63,600	311,004.00	0.12
265	002170	芭田股份	41,789	310,492.27	0.12
266	002434	万里扬	19,400	308,848.00	0.12
267	002504	*ST 弘高	37,926	307,200.60	0.12
268	002506	协鑫集成	66,800	306,612.00	0.12
269	002229	鸿博股份	27,150	304,080.00	0.12
270	002608	江苏国信	24,200	302,258.00	0.12
271	002636	金安国纪	17,400	300,498.00	0.12
272	002118	紫鑫药业	43,744	298,771.52	0.12
273	002342	巨力索具	29,300	295,051.00	0.12
274	002416	爱施德	27,200	293,488.00	0.12
275	002717	岭南园林	10,800	289,440.00	0.11
276	002309	中利集团	23,008	287,830.08	0.11
277	002695	煌上煌	13,317	284,451.12	0.11
278	002737	葵花药业	9,200	283,360.00	0.11
279	002670	国盛金控	17,740	282,066.00	0.11
280	002177	御银股份	49,655	282,040.40	0.11
281	002302	西部建设	12,700	281,559.00	0.11
282	002568	百润股份	16,909	281,027.58	0.11
283	002551	尚荣医疗	17,377	280,291.01	0.11
284	002448	中原内配	27,150	275,029.50	0.11
285	002369	卓翼科技	31,800	274,752.00	0.11
286	002071	长城影视	27,500	273,900.00	0.11
287	002604	龙力生物	29,279	272,587.49	0.11

288	002093	国脉科技	30,967	272,509.60	0.11
289	002298	中电鑫龙	25,056	272,358.72	0.11
290	002597	金禾实业	12,400	271,064.00	0.11
291	002197	证通电子	21,443	269,324.08	0.11
292	002079	苏州固锔	36,033	265,563.21	0.11
293	002751	易尚展示	7,100	263,055.00	0.10
294	002631	德尔未来	17,800	262,194.00	0.10
295	002279	久其软件	20,285	254,576.75	0.10
296	002609	捷顺科技	17,000	254,490.00	0.10
297	002542	中化岩土	20,700	250,263.00	0.10
298	002610	爱康科技	101,100	246,684.00	0.10
299	002577	雷柏科技	10,200	234,294.00	0.09
300	002698	博实股份	19,231	226,348.87	0.09
301	002167	东方锆业	20,500	225,090.00	0.09
302	002157	正邦科技	49,142	223,596.10	0.09
303	002094	青岛金王	10,100	215,433.00	0.09
304	002378	章源钨业	23,560	213,218.00	0.08
305	002210	飞马国际	12,100	207,757.00	0.08
306	002432	九安医疗	17,900	206,387.00	0.08
307	002443	金洲管道	20,200	185,840.00	0.07
308	002653	海思科	14,267	185,613.67	0.07
309	002538	司尔特	20,000	179,800.00	0.07
310	002702	海欣食品	21,660	179,128.20	0.07
311	002619	巨龙管业	27,180	173,136.60	0.07
312	002355	兴民智通	16,700	170,841.00	0.07
313	002782	可立克	8,050	168,647.50	0.07
314	002147	新光圆成	10,400	161,616.00	0.06
315	002419	天虹股份	11,100	159,618.00	0.06
316	002590	万安科技	10,800	151,308.00	0.06
317	002821	凯莱英	2,000	145,940.00	0.06
318	002703	浙江世宝	5,300	145,167.00	0.06
319	002314	南山控股	20,500	137,145.00	0.05
320	002831	裕同科技	1,700	127,500.00	0.05
321	002312	*ST 三泰	17,317	118,101.94	0.05
322	002786	银宝山新	8,000	116,640.00	0.05
323	002110	三钢闽光	7,500	96,150.00	0.04
324	002651	利君股份	9,400	91,274.00	0.04
325	002064	华峰氨纶	18,468	89,015.76	0.04
326	002331	皖通科技	6,280	88,924.80	0.04
327	002277	友阿股份	13,524	87,229.80	0.03
328	002332	仙琚制药	10,048	86,412.80	0.03
329	002020	京新药业	7,250	85,912.50	0.03
330	002178	延华智能	7,800	85,254.00	0.03
331	002564	天沃科技	9,310	85,000.30	0.03

332	002664	信质电机	2,900	82,998.00	0.03
333	002029	七匹狼	8,068	77,210.76	0.03
334	002345	潮宏基	7,083	76,992.21	0.03
335	002697	红旗连锁	12,220	74,175.40	0.03
336	002287	奇正藏药	1,800	73,998.00	0.03
337	002267	陕天然气	8,265	72,649.35	0.03
338	002233	塔牌集团	5,902	71,827.34	0.03
339	002658	雪迪龙	4,008	71,142.00	0.03
340	002818	富森美	1,800	71,046.00	0.03
341	002480	新筑股份	8,877	70,394.61	0.03
342	002269	美邦服饰	18,817	70,187.41	0.03
343	002815	崇达技术	2,100	69,384.00	0.03
344	002334	英威腾	9,272	67,222.00	0.03
345	002251	步步高	5,226	64,750.14	0.03
346	002154	报喜鸟	16,600	61,586.00	0.02
347	002009	天奇股份	4,853	55,421.26	0.02
348	002296	辉煌科技	5,100	54,978.00	0.02
349	002203	海亮股份	6,680	54,375.20	0.02
350	002527	新时达	5,050	53,681.50	0.02
351	002574	明牌珠宝	5,600	48,720.00	0.02
352	002235	安妮股份	3,600	43,920.00	0.02
353	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
354	002181	粤传媒	7,014	37,945.74	0.02
355	002315	焦点科技	1,500	37,410.00	0.01
356	002741	光华科技	2,200	34,408.00	0.01
357	300659	中孚信息	676	23,673.52	0.01
358	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
359	300655	晶瑞股份	773	22,857.61	0.01
360	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
361	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
362	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
363	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
364	300671	富满电子	942	7,639.62	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	002558	巨人网络	717,165.40	0.27

2	002635	安洁科技	376,370.00	0.14
3	002601	龙麟佰利	347,896.00	0.13
4	002434	万里扬	309,421.00	0.12
5	002608	江苏国信	301,664.00	0.11
6	002342	巨力索具	296,784.00	0.11
7	002506	协鑫集成	286,681.00	0.11
8	002302	西部建设	284,814.00	0.11
9	002597	金禾实业	270,590.00	0.10
10	002673	西部证券	264,804.15	0.10
11	002542	中化岩土	250,191.00	0.09
12	002797	第一创业	239,316.00	0.09
13	002167	东方锆业	223,474.00	0.08
14	002094	青岛金王	215,702.00	0.08
15	002210	飞马国际	207,674.00	0.08
16	002027	分众传媒	202,713.00	0.08
17	002443	金洲管道	185,675.00	0.07
18	002538	司尔特	179,588.00	0.07
19	002147	新光圆成	161,776.00	0.06
20	002419	天虹股份	159,484.00	0.06

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	002852	道道全	201,084.49	0.08
2	300618	寒锐钴业	164,314.00	0.06
3	002450	康得新	140,616.00	0.05
4	002851	麦格米特	135,171.12	0.05
5	300616	尚品宅配	134,736.46	0.05
6	300583	赛托生物	126,491.80	0.05
7	002024	苏宁云商	123,630.00	0.05
8	002011	盾安环境	113,100.00	0.04
9	002449	国星光电	112,265.00	0.04
10	002833	弘亚数控	109,464.55	0.04
11	002254	泰和新材	107,649.00	0.04
12	300623	捷捷微电	104,595.20	0.04
13	300641	正丹股份	103,756.20	0.04
14	002859	洁美科技	102,215.89	0.04
15	002850	科达利	98,746.80	0.04

16	300660	江苏雷利	93,606.70	0.04
17	002872	天圣制药	93,429.80	0.04
18	002848	高斯贝尔	91,200.00	0.03
19	002550	千红制药	89,543.00	0.03
20	002855	捷荣技术	87,588.50	0.03

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	9,255,146.03
卖出股票的收入（成交）总额	9,484,439.78

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）	84,131.39	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	84,131.39	0.03

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	128012	辉丰转债	511	51,467.92	0.02

2	128015	久其转债	287	32,663.47	0.01
---	--------	------	-----	-----------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期本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	2,596.93
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,198.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,795.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128012	辉丰转债	51,467.92	0.02

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
1,157	151,338.68	158,245,940.00	90.38%	16,852,907.00	9.62%

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	广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	151,717,345.00	86.65%
2	山东龙信投资有限公司	4,543,364.00	2.59%
3	翠庭置业（上海）有限公司	910,000.00	0.52%
4	方正证券股份有限公司	692,219.00	0.40%
5	齐晓燕	630,900.00	0.36%
6	芮增璞	500,581.00	0.29%
7	李希文	450,000.00	0.26%
8	张晓东	445,206.00	0.25%
9	陈江涛	399,785.00	0.23%
10	何凤珍	392,408.00	0.22%

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	0.00	0.0000%

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（2011 年 6 月 3 日）基金份额总额	718,294,002.00
本报告期期初基金份额总额	187,098,847.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	33,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	175,098,847.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
广发证券	3	17,238,141.18	100.00%	16,053.91	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

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。

10.8 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增加大同证券为	《中国证券报》、《证券时	2017-02-17

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	报》、《上海证券报》	
-------------------------------------	------------	--

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20170101-20170630	160,336,045.00	24,062,800.00	32,681,500.00	151,717,345.00	86.65%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
2. 《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新版；
5. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

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

广发基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日