

# 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基 金

## 2018 年半年度报告

### 2018 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：二〇一八年八月二十四日

## 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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	47

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	48
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 .....	48
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>49</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4	基金投资策略的改变 .....	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8	其他重大事件 .....	50
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>51</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
12.1	备查文件目录 .....	51
12.2	存放地点 .....	51
12.3	查阅方式 .....	51

## 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	164,598,847.00 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>一般情形下，本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，以更紧密的跟踪标的指数。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 负责人	姓名	段西军	贺倩
	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华路 6号105室-49848（集中办公区）	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F9
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	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-3,383,785.99
本期利润	-35,376,168.48
加权平均基金份额本期利润	-0.2226

本期加权平均净值利润率	-15.41%
本期基金份额净值增长率	-15.00%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	29,839,629.79
期末可供分配基金份额利润	0.1813
期末基金资产净值	211,008,145.53
期末基金份额净值	1.2820
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	16.48%

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 1.1648。

### 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	-8.88%	1.68%	-9.37%	1.71%	0.49%	-0.03%
过去三个月	-13.51%	1.30%	-14.39%	1.32%	0.88%	-0.02%
过去六个月	-15.00%	1.37%	-16.01%	1.39%	1.01%	-0.02%
过去一年	-11.19%	1.16%	-12.74%	1.18%	1.55%	-0.02%
过去三年	-32.85%	1.84%	-35.86%	1.81%	3.01%	0.03%
自基金合同生效起至今	16.48%	1.70%	23.24%	1.69%	-6.76%	0.01%

注：业绩比较基准：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 2018 年 6 月 30 日）



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、受托管理保险资金投资管理、保险保障基金委托资产管理投资管理、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30个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、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、养老金与战略业务部、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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 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；广发中证环保 ETF 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；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；广发	2016-01-25	-	14 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日）。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 8 月 20 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 18 日起任职）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 30 日起任职）、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基金经

	<p>量化稳健混合基金的基金经理；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数（QDII）基金的基金经理；广发纳指 100ETF 基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）基金的基金经理；广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理；广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理；指数投资部总经理助理</p>				<p>理(自 2016 年 9 月 26 日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 25 日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 25 日起任职）、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基金经理（自 2017 年 5 月 25 日起任职）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 8 月 4 日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2018 年 4 月 26 日起任职）、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）。</p>
--	--	--	--	--	--

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,投资的债券必须来自公司债券库。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。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%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

###### (1) 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，本基金净值增长率为-15.00%，同期业绩基准收益率为-16.01%，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

上半年，受金融去杠杆、信用债违约以及中美贸易战升级的持续不利影响，整体市场预期较为悲观，主流指数均呈现较大幅度的下挫，但同时也释放了一定的市场风险，目前很多行业估值均已处于历史低位，而随着流动性的逐步改善和市场环境的逐步消化，市场对于风险应对或许存在一定的过度反应。结合目前的估值水平，A 股市场进入了相对值得配置的阶段，投资者应关注未来的 A 股投资机会。

## 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、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**

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,577,472.30	4,978,059.31
结算备付金		4,083.82	3,571.91
存出保证金		2,744.43	4,559.19
交易性金融资产	6.4.7.2	209,336,015.05	228,855,977.48
其中：股票投资		209,179,887.05	228,494,103.10
基金投资		-	-
债券投资		156,128.00	361,874.38
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	1,234.00	983.34
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		216,921,549.60	233,843,151.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,027,644.84	2,651,536.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		86,677.79	96,136.84
应付托管费		17,335.56	19,227.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,390.93	18,821.35

应交税费		0.67	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	773,354.28	901,321.60
负债合计		5,913,404.07	3,687,043.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	181,168,515.74	167,960,511.99
未分配利润	6.4.7.10	29,839,629.79	62,195,595.85
所有者权益合计		211,008,145.53	230,156,107.84
负债和所有者权益总计		216,921,549.60	233,843,151.23

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.2820 元，基金份额总额 164,598,847.00 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-34,301,759.58</b>	<b>7,587,472.34</b>
1.利息收入		16,089.03	18,176.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,967.35	18,003.51
债券利息收入		121.68	172.70
资产支持证券利息收入		0.00	-
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）		-2,318,726.02	-2,817,204.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,731,835.03	-4,164,448.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	67,554.54	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,345,554.47	1,347,243.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-31,992,382.49	10,388,906.56
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	-6,740.10	-2,405.70

<b>减：二、费用</b>		<b>1,074,408.90</b>	<b>1,136,704.31</b>
1. 管理人报酬		567,638.65	633,084.22
2. 托管费		113,527.73	126,616.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	43,775.73	27,067.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.33	-
7. 其他费用	6.4.7.19	349,466.46	349,935.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-35,376,168.48</b>	<b>6,450,768.03</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-35,376,168.48</b>	<b>6,450,768.03</b>

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	167,960,511.99	62,195,595.85	230,156,107.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-35,376,168.48	-35,376,168.48
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）	13,208,003.75	3,020,202.42	16,228,206.17
其中：1.基金申购款	31,369,008.92	8,866,926.93	40,235,935.85
2.基金赎回款	-18,161,005.17	-5,846,724.51	-24,007,729.68
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）	181,168,515.74	29,839,629.79	211,008,145.53
项目	上年度可比期间 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	205,933,522.79	58,065,229.62	263,998,752.41



金净值)			
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

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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，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。

### 6.4.7 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 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	7,577,472.30
定期存款	-
其他存款	-
合计	7,577,472.30

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	252,687,777.78	209,179,887.05	-43,507,890.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	136,000.00	20,128.00
	银行间市场	-	-
	合计	136,000.00	20,128.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	252,823,777.78	209,336,015.05	-43,487,762.73

#### 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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,015.55
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	130.93
应收债券利息	86.44
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,234.00

#### 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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,390.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,390.93

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	198,354.28
应付指数使用费	75,000.00
合计	773,354.28

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,598,847.00	167,960,511.99
本期申购	28,500,000.00	31,369,008.92
本期赎回（以“-”号填列）	-16,500,000.00	-18,161,005.17
本期末	164,598,847.00	181,168,515.74

#### 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	92,037,042.34	-29,841,446.49	62,195,595.85
本期利润	-3,383,785.99	-31,992,382.49	-35,376,168.48
本期基金份额交易产生的变动数	7,129,021.09	-4,108,818.67	3,020,202.42
其中：基金申购款	16,855,168.27	-7,988,241.34	8,866,926.93
基金赎回款	-9,726,147.18	3,879,422.67	-5,846,724.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,782,277.44	-65,942,647.65	29,839,629.79

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,371.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	33.07
结算备付金利息收入	562.53
其他	-
合计	15,967.35

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,211,549.72
股票投资收益——赎回差价收入	-1,520,285.31
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-3,731,835.03

##### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,474,894.94
减：卖出股票成本总额	15,686,444.66
买卖股票差价收入	-2,211,549.72

##### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	24,007,729.68
减：现金支付赎回款总额	1,733,743.68
减：赎回股票成本总额	23,794,271.31
赎回差价收入	-1,520,285.31

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	428,637.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	361,000.00

成本总额	
减：应收利息总额	82.99
买卖债券差价收入	67,554.54

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,345,554.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,345,554.47

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-31,994,218.49
——股票投资	-32,013,472.11
——债券投资	19,253.62
——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	1,836.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-31,992,382.49

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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	-6,740.10
其他	-

合计	-6,740.10
----	-----------

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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	43,775.73
银行间市场交易费用	-
合计	43,775.73

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	1,112.18
上市费	29,752.78
指数使用费	150,000.00
合计	349,466.46

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	29,689,347.94	100.00%	17,238,141.18	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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	428,637.53	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 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	27,649.89	100.00%	8,390.93	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金

	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%

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	567,638.65	633,084.22
其中：支付销售机构的客户维护费	8,117.02	-

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	113,527.73	126,616.80

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	142,733,586.00	86.72%	131,554,233.00	86.21%

### 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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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	7,577,472.30	15,371.75	6,387,492.98	17,614.90

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（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002005	德豪润达	2018-01-02	重大事项停牌	4.36	2018-07-02	3.92	32,249.00	269,652.56	140,605.64	-
002502	骅威文化	2018-06-05	重大事项停牌	5.82	-	-	36,800.00	404,846.48	214,176.00	-
002445	中南文化	2018-06-13	重大事项停牌	8.44	-	-	27,400.00	478,898.80	231,256.00	-
002011	盾安环境	2018-05-02	重大事项停牌	6.40	-	-	39,400.00	313,513.23	252,160.00	-
002143	印纪传媒	2018-02-02	重大事项停牌	12.09	2018-07-09	10.88	23,300.00	463,753.13	281,697.00	-
002121	科陆电子	2018-06-07	重大事项停牌	6.49	2018-08-06	5.84	43,447.00	483,399.26	281,971.03	-
002464	众应互联	2018-02-02	重大事项停牌	21.19	2018-07-31	19.07	14,140.00	286,181.52	299,626.60	-
002512	达华智能	2018-06-19	重大事项停牌	9.70	-	-	32,100.00	514,932.46	311,370.00	-
002436	兴森科技	2018-06-14	重大事项停牌	4.29	-	-	73,684.00	449,754.81	316,104.36	-
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大事项停牌	6.20	2018-08-13	5.57	55,986.00	546,385.02	347,113.20	-
002263	*ST 东南	2018-02-26	重大事项停牌	2.96	-	-	117,440.00	496,951.99	347,622.40	-
002110	冠福股份	2018-06-01	重大事项停牌	4.07	-	-	96,603.00	454,001.94	393,174.21	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项停牌	3.31	-	-	120,967.00	679,081.66	400,400.77	-
002089	新海宜	2018-04-20	重大事项停牌	6.05	2018-07-20	5.45	67,400.00	610,779.00	407,770.00	-
002668	奥马电器	2018-06-15	重大事项停牌	20.10	-	-	20,520.00	454,816.83	412,452.00	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项停牌	18.76	2018-07-02	16.88	22,380.00	408,395.40	419,848.80	-
002716	金贵银业	2018-05-03	重大事项停牌	16.84	-	-	25,500.00	538,511.10	429,420.00	-
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项停牌	6.71	-	-	64,030.00	633,807.24	429,641.30	-
002630	华西能源	2018-06-20	重大事项停牌	6.54	-	-	72,560.00	578,873.28	474,542.40	-
002211	飞马国际	2018-03	重大事	12.33	2018-0	11.07	40,090.00	433,456.74	494,309.70	-

0	际	-26	项停牌		8-13					
002411	必康股份	2018-06-19	重大事项停牌	28.34	-	-	17,506.00	342,116.55	496,120.04	-
002665	首航节能	2018-05-29	重大事项停牌	5.80	-	-	86,383.00	790,102.65	501,021.40	-
002426	胜利精密	2018-06-19	重大事项停牌	3.60	2018-07-03	3.26	143,250.00	1,166,928.11	515,700.00	-
002573	清新环境	2018-06-19	重大事项停牌	11.55	-	-	48,000.00	953,662.83	554,400.00	-
002610	爱康科技	2018-06-05	重大事项停牌	2.10	-	-	268,300.00	718,829.61	563,430.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项停牌	15.27	-	-	38,845.00	719,397.09	593,163.15	-
002147	新光圆成	2018-01-18	重大事项停牌	14.76	-	-	41,160.00	512,131.01	607,521.60	-
002359	北讯集团	2018-05-21	重大事项停牌	19.58	-	-	31,400.00	710,719.56	614,812.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	22,600.00	637,728.40	734,500.00	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大事项停牌	12.28	-	-	60,017.00	512,078.18	737,008.76	-
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	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	15.03	-	-	102,702.00	1,526,543.27	1,543,611.06	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项停牌	19.52	-	-	99,175.00	2,087,334.16	1,935,896.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	39,600.00	3,204,665.25	2,060,784.00	-
002450	康得新	2018-06-04	重大事项停牌	17.08	-	-	152,350.00	2,726,086.59	2,602,138.00	-

#### 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 2018 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 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人

制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	336,300.00
AAA 以下	156,128.00	25,574.38
未评级	-	-
合计	-	361,874.38

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基

金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

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

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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	7,577,472.30	-	-	-	7,577,472.30

结算备付金	4,083.82	-	-	-	4,083.82
存出保证金	2,744.43	-	-	-	2,744.43
交易性金融资产	156,128.00	-	-	209,179,887.05	209,336,015.05
应收利息	-	-	-	1,234.00	1,234.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,740,428.55	-	-	209,181,121.05	216,921,549.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,027,644.84	5,027,644.84
应付管理人报酬	-	-	-	86,677.79	86,677.79
应交税金	-	-	-	0.67	0.67
应付托管费	-	-	-	17,335.56	17,335.56
应付交易费用	-	-	-	8,390.93	8,390.93
其他负债	-	-	-	773,354.28	773,354.28
负债总计	-	-	-	5,913,404.07	5,913,404.07
利率敏感度缺口	7,740,428.55	-	-	203,267,716.98	211,008,145.53
<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	4,978,059.31	-	-	-	4,978,059.31
结算备付金	3,571.91	-	-	-	3,571.91
存出保证金	4,559.19	-	-	-	4,559.19
交易性金融资产	361,874.38	-	-	228,494,103.10	228,855,977.48
应收利息	-	-	-	983.34	983.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,348,064.79	-	-	228,495,086.44	233,843,151.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,651,536.24	2,651,536.24
应付管理人报酬	-	-	-	96,136.84	96,136.84
应付托管费	-	-	-	19,227.36	19,227.36
应付交易费用	-	-	-	18,821.35	18,821.35



其他负债	-	-	-	901,321.60	901,321.60
负债总计	-	-	-	3,687,043.39	3,687,043.39
利率敏感度缺口	5,348,064.79	-	-	224,808,043.05	230,156,107.84

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末持有的债券占基金资产净值较小，上年度末持有的债券占基金资产净值较小，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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	209,179,887.05	99.13	228,494,103.10	99.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	156,128.00	0.07	361,874.38	0.16
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	209,336,015.05	99.21	228,855,977.48	99.44

#### 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	10,550,407.28	11,313,266.40
业绩比较基准下降 5%	-10,550,407.28	-11,313,266.40	

#### 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 2018 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 187,254,187.63 元，属于第二层级的余额为 22,081,827.42 元，无属于第三层级的金额（2017 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 218,043,567.67 元，属于第二层级的余额为 10,812,409.81 元，无属于第三层级的金额）。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

##### 2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	209,179,887.05	96.43
	其中：股票	209,179,887.05	96.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	156,128.00	0.07
	其中：债券	156,128.00	0.07
	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	7,581,556.12	3.50
8	其他各项资产	3,978.43	0.00
9	合计	216,921,549.60	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 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	2,705,226.50	1.28
B	采矿业	885,367.92	0.42
C	制造业	142,443,919.72	67.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	603,684.60	0.29
E	建筑业	5,615,724.24	2.66
F	批发和零售业	8,147,564.54	3.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,836,787.26	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,747,708.62	10.31
J	金融业	7,913,055.38	3.75
K	房地产业	3,183,852.86	1.51
L	租赁和商务服务业	7,348,956.81	3.48
M	科学研究和技术服务业	151,040.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	810,441.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,376,977.60	1.13
R	文化、体育和娱乐业	3,409,580.00	1.62
S	综合	-	-
	合计	209,179,887.05	99.13

### 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	258,232	9,588,154.16	4.54
2	002304	洋河股份	43,564	5,733,022.40	2.72
3	002027	分众传媒	399,896	3,827,004.72	1.81
4	002230	科大讯飞	118,988	3,815,945.16	1.81
5	002024	苏宁易购	269,196	3,790,279.68	1.80
6	002008	大族激光	68,478	3,642,344.82	1.73
7	002475	立讯精密	137,926	3,108,852.04	1.47
8	002594	比亚迪	64,078	3,055,239.04	1.45
9	002236	大华股份	128,307	2,893,322.85	1.37
10	002142	宁波银行	175,511	2,859,074.19	1.35
11	002466	天齐锂业	55,697	2,762,014.23	1.31
12	002450	康得新	152,350	2,602,138.00	1.23
13	002456	欧菲科技	156,145	2,518,618.85	1.19
14	002044	美年健康	105,176	2,376,977.60	1.13

15	002460	赣锋锂业	59,176	2,283,010.08	1.08
16	002422	科伦药业	69,593	2,233,935.30	1.06
17	002202	金风科技	166,915	2,109,805.60	1.00
18	002739	万达电影	39,600	2,060,784.00	0.98
19	002252	上海莱士	99,175	1,935,896.00	0.92
20	002241	歌尔股份	153,128	1,560,374.32	0.74
21	002310	东方园林	102,702	1,543,611.06	0.73
22	002572	索菲亚	45,400	1,460,972.00	0.69
23	002410	广联达	51,418	1,425,821.14	0.68
24	002007	华兰生物	42,923	1,380,403.68	0.65
25	002340	格林美	224,637	1,359,053.85	0.64
26	002405	四维图新	66,978	1,356,304.50	0.64
27	002049	紫光国微	30,624	1,351,130.88	0.64
28	002736	国信证券	141,767	1,290,079.70	0.61
29	002001	新和成	67,309	1,276,178.64	0.60
30	002038	双鹭药业	33,006	1,253,897.94	0.59
31	002050	三花智控	65,954	1,243,232.90	0.59
32	002065	东华软件	144,016	1,238,537.60	0.59
33	002179	中航光电	31,526	1,229,514.00	0.58
34	002146	荣盛发展	139,590	1,218,620.70	0.58
35	002271	东方雨虹	70,982	1,207,403.82	0.57
36	002508	老板电器	37,149	1,137,502.38	0.54
37	002075	沙钢股份	70,500	1,136,460.00	0.54
38	002673	西部证券	149,745	1,130,574.75	0.54
39	002311	海大集团	53,360	1,125,896.00	0.53
40	002714	牧原股份	25,224	1,121,459.04	0.53
41	002797	第一创业	162,420	1,099,583.40	0.52
42	002081	金螳螂	108,270	1,093,527.00	0.52
43	002129	中环股份	138,786	1,086,694.38	0.52
44	002294	信立泰	28,774	1,069,529.58	0.51
45	002092	中泰化学	110,463	1,064,863.32	0.50
46	002465	海格通信	124,634	1,000,811.02	0.47
47	002078	太阳纸业	100,756	976,325.64	0.46
48	002176	江特电机	98,130	953,823.60	0.45
49	002493	荣盛石化	92,136	950,843.52	0.45
50	002195	二三四五	217,124	929,290.72	0.44
51	002439	启明星辰	42,868	909,658.96	0.43
52	002223	鱼跃医疗	46,608	908,389.92	0.43
53	002127	南极电商	93,300	876,087.00	0.42
54	002589	瑞康医药	64,200	875,688.00	0.42
55	002019	亿帆医药	49,335	870,762.75	0.41
56	002217	合力泰	104,900	865,425.00	0.41
57	002500	山西证券	128,156	863,771.44	0.41
58	002624	完美世界	27,497	852,681.97	0.40

59	002470	金正大	123,844	852,046.72	0.40
60	002035	华帝股份	34,300	837,949.00	0.40
61	002168	深圳惠程	79,982	822,214.96	0.39
62	002821	凯莱英	9,400	819,962.00	0.39
63	002085	万丰奥威	86,924	817,085.60	0.39
64	002221	东华能源	83,598	816,752.46	0.39
65	002640	跨境通	53,500	803,570.00	0.38
66	002262	恩华药业	39,164	783,671.64	0.37
67	002384	东山精密	32,592	782,208.00	0.37
68	002013	中航机电	103,324	782,162.68	0.37
69	002183	怡亚通	117,600	782,040.00	0.37
70	002074	国轩高科	53,230	748,413.80	0.35
71	002185	华天科技	132,426	746,882.64	0.35
72	002408	齐翔腾达	60,017	737,008.76	0.35
73	002602	世纪华通	22,600	734,500.00	0.35
74	002110	三钢闽光	45,400	727,762.00	0.34
75	002385	大北农	174,623	721,192.99	0.34
76	002153	石基信息	24,353	706,237.00	0.33
77	002558	巨人网络	29,660	705,314.80	0.33
78	002506	协鑫集成	149,700	700,596.00	0.33
79	002371	北方华创	14,100	700,347.00	0.33
80	002273	水晶光电	54,139	696,768.93	0.33
81	002138	顺络电子	42,912	687,021.12	0.33
82	002497	雅化集团	64,700	681,938.00	0.32
83	002268	卫士通	31,102	678,956.66	0.32
84	002030	达安基因	44,027	678,896.34	0.32
85	002373	千方科技	49,683	648,363.15	0.31
86	002028	思源电气	38,121	640,051.59	0.30
87	002353	杰瑞股份	39,364	639,665.00	0.30
88	002023	海特高新	49,888	625,595.52	0.30
89	002280	联络互动	107,882	617,085.04	0.29
90	002407	多氟多	43,995	616,809.90	0.29
91	002399	海普瑞	27,825	616,045.50	0.29
92	002032	苏泊尔	11,956	615,734.00	0.29
93	002359	北讯集团	31,400	614,812.00	0.29
94	002147	新光圆成	41,160	607,521.60	0.29
95	002491	通鼎互联	54,700	605,529.00	0.29
96	002440	闰土股份	51,568	602,829.92	0.29
97	002341	新纶科技	45,200	600,708.00	0.28
98	002563	森马服饰	41,900	599,170.00	0.28
99	002396	星网锐捷	29,231	598,358.57	0.28
100	002051	中工国际	38,845	593,163.15	0.28
101	002352	顺丰控股	13,008	585,360.00	0.28
102	002244	滨江集团	112,534	585,176.80	0.28

103	002174	游族网络	29,000	577,100.00	0.27
104	002383	合众思壮	34,400	569,320.00	0.27
105	002583	海能达	67,860	566,631.00	0.27
106	002610	爱康科技	268,300	563,430.00	0.27
107	002601	龙麟佰利	43,502	562,480.86	0.27
108	002366	台海核电	39,400	561,844.00	0.27
109	002376	新北洋	33,962	561,731.48	0.27
110	002573	清新环境	48,000	554,400.00	0.26
111	002701	奥瑞金	101,303	553,114.38	0.26
112	002600	领益智造	104,876	544,306.44	0.26
113	002299	圣农发展	34,715	537,735.35	0.25
114	002368	太极股份	17,960	522,097.20	0.25
115	002191	劲嘉股份	69,278	517,506.66	0.25
116	002426	胜利精密	143,250	515,700.00	0.24
117	002281	光迅科技	24,221	513,485.20	0.24
118	002131	利欧股份	241,248	506,620.80	0.24
119	002152	广电运通	85,528	502,904.64	0.24
120	002372	伟星新材	28,340	501,334.60	0.24
121	002665	首航节能	86,383	501,021.40	0.24
122	002595	豪迈科技	28,700	499,093.00	0.24
123	002597	金禾实业	24,600	498,888.00	0.24
124	002411	必康股份	17,506	496,120.04	0.24
125	002210	飞马国际	40,090	494,309.70	0.23
126	002517	恺英网络	68,050	489,279.50	0.23
127	002745	木林森	27,500	489,225.00	0.23
128	002444	巨星科技	44,199	486,630.99	0.23
129	002343	慈文传媒	25,760	483,515.20	0.23
130	002317	众生药业	45,680	482,837.60	0.23
131	002709	天赐材料	12,500	481,750.00	0.23
132	002266	浙富控股	127,125	476,718.75	0.23
133	002004	华邦健康	93,552	475,244.16	0.23
134	002630	华西能源	72,560	474,542.40	0.22
135	002285	世联行	75,488	473,309.76	0.22
136	002603	以岭药业	33,506	468,413.88	0.22
137	002831	裕同科技	9,300	465,000.00	0.22
138	002128	露天煤业	51,176	463,654.56	0.22
139	002419	天虹股份	31,650	462,090.00	0.22
140	002108	沧州明珠	78,460	460,560.20	0.22
141	002424	贵州百灵	40,168	456,308.48	0.22
142	002505	大康农业	207,310	443,643.40	0.21
143	002056	横店东磁	62,792	440,171.92	0.21
144	002025	航天电器	18,943	437,583.30	0.21
145	002690	美亚光电	18,254	435,175.36	0.21
146	002151	北斗星通	16,811	432,042.70	0.20

147	002313	日海智能	18,001	430,763.93	0.20
148	002431	棕榈股份	64,030	429,641.30	0.20
149	002716	金贵银业	25,500	429,420.00	0.20
150	002156	通富微电	39,469	427,449.27	0.20
151	002155	湖南黄金	61,654	421,713.36	0.20
152	002672	东江环保	32,137	420,673.33	0.20
153	002699	美盛文化	22,380	419,848.80	0.20
154	002727	一心堂	12,900	418,605.00	0.20
155	002250	联化科技	47,238	416,639.16	0.20
156	002668	奥马电器	20,520	412,452.00	0.20
157	002358	森源电气	27,400	412,370.00	0.20
158	002036	联创电子	31,400	411,968.00	0.20
159	002402	和而泰	49,350	409,605.00	0.19
160	002089	新海宜	67,400	407,770.00	0.19
161	002389	南洋科技	30,100	407,554.00	0.19
162	002161	远望谷	41,844	405,468.36	0.19
163	002449	国星光电	37,766	401,830.24	0.19
164	002237	恒邦股份	43,912	400,916.56	0.19
165	002477	雏鹰农牧	120,967	400,400.77	0.19
166	002048	宁波华翔	32,164	396,582.12	0.19
167	002292	奥飞娱乐	44,408	396,563.44	0.19
168	002233	塔牌集团	34,600	395,824.00	0.19
169	002102	冠福股份	96,603	393,174.21	0.19
170	002022	科华生物	32,710	387,613.50	0.18
171	002099	海翔药业	74,930	384,390.90	0.18
172	002240	威华股份	29,300	380,900.00	0.18
173	002400	省广集团	117,197	378,546.31	0.18
174	002390	信邦制药	51,470	376,760.40	0.18
175	002421	达实智能	92,226	373,515.30	0.18
176	002180	纳思达	13,600	373,456.00	0.18
177	002254	泰和新材	32,700	372,126.00	0.18
178	002123	梦网集团	41,370	367,779.30	0.17
179	002680	长生生物	16,100	358,869.00	0.17
180	002002	鸿达兴业	77,547	357,491.67	0.17
181	002501	利源精制	57,460	356,252.00	0.17
182	002042	华孚时尚	47,600	354,144.00	0.17
183	002463	沪电股份	93,562	349,921.88	0.17
184	002670	国盛金控	32,470	349,701.90	0.17
185	002812	创新股份	7,100	348,823.00	0.17
186	002263	*ST 东南	117,440	347,622.40	0.16
187	002437	誉衡药业	55,986	347,113.20	0.16
188	002354	天神娱乐	37,395	346,277.70	0.16
189	002468	申通快递	19,800	339,570.00	0.16
190	002073	软控股份	59,030	339,422.50	0.16



191	002544	杰赛科技	24,700	338,143.00	0.16
192	002139	拓邦股份	59,175	336,705.75	0.16
193	002664	长鹰信质	13,400	336,340.00	0.16
194	002511	中顺洁柔	35,500	334,410.00	0.16
195	002104	恒宝股份	49,017	333,805.77	0.16
196	002707	众信旅游	34,600	332,160.00	0.16
197	002242	九阳股份	18,657	330,042.33	0.16
198	002222	福晶科技	25,300	329,912.00	0.16
199	002308	威创股份	39,613	328,787.90	0.16
200	002130	沃尔核材	75,350	328,526.00	0.16
201	002245	澳洋顺昌	50,773	328,501.31	0.16
202	002555	三七互娱	26,920	327,078.00	0.16
203	002043	兔宝宝	42,100	322,486.00	0.15
204	002429	兆驰股份	129,665	321,569.20	0.15
205	002675	东诚药业	31,500	320,985.00	0.15
206	002303	美盈森	60,700	320,496.00	0.15
207	002047	宝鹰股份	54,600	319,956.00	0.15
208	002635	安洁科技	18,600	319,920.00	0.15
209	002434	万里扬	36,400	319,592.00	0.15
210	002095	生意宝	8,889	319,026.21	0.15
211	002436	兴森科技	73,684	316,104.36	0.15
212	002503	搜于特	89,480	313,180.00	0.15
213	002512	达华智能	32,100	311,370.00	0.15
214	002608	江苏国信	45,000	310,500.00	0.15
215	002055	得润电子	19,440	310,068.00	0.15
216	002063	远光软件	36,598	309,619.08	0.15
217	002157	正邦科技	76,042	309,490.94	0.15
218	002067	景兴纸业	78,700	308,504.00	0.15
219	002145	中核钛白	83,700	308,016.00	0.15
220	002657	中科金财	19,200	304,128.00	0.14
221	002596	海南瑞泽	29,600	303,696.00	0.14
222	002643	万润股份	40,500	302,535.00	0.14
223	002428	云南锗业	39,034	301,342.48	0.14
224	002537	海联金汇	31,800	300,192.00	0.14
225	002464	众应互联	14,140	299,626.60	0.14
226	002773	康弘药业	5,754	299,265.54	0.14
227	002020	京新药业	25,200	296,856.00	0.14
228	002489	浙江永强	81,400	296,296.00	0.14
229	002375	亚厦股份	54,184	289,342.56	0.14
230	002117	东港股份	19,504	289,244.32	0.14
231	002462	嘉事堂	14,900	289,060.00	0.14
232	002642	荣之联	31,195	286,682.05	0.14
233	002249	大洋电机	66,408	286,218.48	0.14
234	002622	融钰集团	58,400	282,656.00	0.13

235	002121	科陆电子	43,447	281,971.03	0.13
236	002143	印纪传媒	23,300	281,697.00	0.13
237	002474	榕基软件	35,500	281,515.00	0.13
238	002212	南洋股份	23,600	280,604.00	0.13
239	002258	利尔化学	14,400	278,784.00	0.13
240	002094	青岛金王	30,940	278,769.40	0.13
241	002467	二六三	51,308	278,089.36	0.13
242	002447	晨鑫科技	80,584	275,597.28	0.13
243	002276	万马股份	47,084	274,970.56	0.13
244	002010	传化智联	21,600	262,440.00	0.12
245	002482	广田集团	43,782	261,378.54	0.12
246	002510	天汽模	54,600	258,258.00	0.12
247	002061	浙江交科	24,500	256,515.00	0.12
248	002717	岭南股份	26,100	256,041.00	0.12
249	002091	江苏国泰	40,089	254,565.15	0.12
250	002841	视源股份	4,760	254,231.60	0.12
251	002916	深南电路	4,000	254,040.00	0.12
252	002011	盾安环境	39,400	252,160.00	0.12
253	002663	普邦股份	84,489	250,932.33	0.12
254	002106	莱宝高科	43,467	250,369.92	0.12
255	002120	韵达股份	4,699	249,281.95	0.12
256	002681	奋达科技	28,662	248,212.92	0.12
257	002625	光启技术	20,740	242,865.40	0.12
258	002302	西部建设	22,500	242,325.00	0.11
259	002251	步步高	21,200	241,256.00	0.11
260	002167	东方锆业	38,900	238,846.00	0.11
261	002807	江阴银行	41,600	233,792.00	0.11
262	002445	中南文化	27,400	231,256.00	0.11
263	002626	金达威	13,300	230,755.00	0.11
264	002190	成飞集成	13,401	229,023.09	0.11
265	002326	永太科技	32,900	228,655.00	0.11
266	002522	浙江众成	34,400	222,568.00	0.11
267	002479	富春环保	39,244	221,728.60	0.11
268	002307	北新路桥	39,520	218,150.40	0.10
269	002261	拓维信息	47,306	217,607.60	0.10
270	002097	山河智能	33,150	216,801.00	0.10
271	002502	骅威文化	36,800	214,176.00	0.10
272	002581	未名医药	20,000	213,000.00	0.10
273	002531	天顺风能	48,700	211,845.00	0.10
274	002342	巨力索具	55,500	210,345.00	0.10
275	002509	天广中茂	70,400	204,864.00	0.10
276	002413	雷科防务	37,610	202,717.90	0.10
277	002041	登海种业	29,617	201,987.94	0.10
278	002649	博彦科技	21,700	197,904.00	0.09

279	002148	北纬科技	34,000	197,200.00	0.09
280	002542	中化岩土	36,700	195,978.00	0.09
281	002818	富森美	7,400	195,212.00	0.09
282	002045	国光电器	27,300	195,195.00	0.09
283	002080	中材科技	22,880	194,480.00	0.09
284	002695	煌上煌	14,517	194,237.46	0.09
285	002547	春兴精工	44,600	194,010.00	0.09
286	002247	帝龙文化	23,600	193,520.00	0.09
287	002320	海峡股份	10,200	193,290.00	0.09
288	002118	紫鑫药业	26,600	190,190.00	0.09
289	002215	诺普信	27,193	189,263.28	0.09
290	002344	海宁皮城	37,428	181,900.08	0.09
291	002016	世荣兆业	12,000	180,840.00	0.09
292	002418	康盛股份	42,800	180,616.00	0.09
293	002318	久立特材	29,725	178,944.50	0.08
294	002648	卫星石化	16,200	178,686.00	0.08
295	002430	杭氧股份	12,215	175,040.95	0.08
296	002443	金洲管道	25,464	172,136.64	0.08
297	002920	德赛西威	5,700	170,430.00	0.08
298	002325	洪涛股份	44,197	163,528.90	0.08
299	002283	天润曲轴	41,166	163,017.36	0.08
300	002175	东方网络	41,300	157,353.00	0.07
301	002636	金安国纪	19,200	154,944.00	0.07
302	002178	延华智能	23,600	151,040.00	0.07
303	002224	三力士	24,500	146,020.00	0.07
304	002414	高德红外	10,850	145,824.00	0.07
305	002158	汉钟精机	16,100	144,578.00	0.07
306	002182	云海金属	23,300	141,897.00	0.07
307	002711	欧浦智网	16,800	140,784.00	0.07
308	002005	德豪润达	32,249	140,605.64	0.07
309	002253	川大智胜	9,674	140,369.74	0.07
310	002619	艾格拉斯	32,480	136,091.20	0.06
311	002284	亚太股份	23,200	134,560.00	0.06
312	002498	汉缆股份	60,700	134,147.00	0.06
313	002392	北京利尔	38,500	130,900.00	0.06
314	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.06
315	002409	雅克科技	6,200	120,900.00	0.06
316	002305	南国置业	39,200	118,384.00	0.06
317	002339	积成电子	16,100	118,335.00	0.06
318	002329	皇氏集团	27,600	117,576.00	0.06
319	002416	爱施德	19,540	114,699.80	0.05
320	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.05
321	002378	章源钨业	15,000	99,150.00	0.05
322	002631	德尔未来	13,100	96,940.00	0.05

323	002590	万安科技	11,000	90,200.00	0.04
324	002658	雪迪龙	11,400	89,034.00	0.04
325	002839	张家港行	14,200	86,478.00	0.04
326	002703	浙江世宝	16,400	81,180.00	0.04
327	002018	*ST 华信	55,861	80,998.45	0.04
328	002901	大博医疗	2,200	79,904.00	0.04
329	002911	佛燃股份	3,200	71,456.00	0.03
330	002287	奇正藏药	2,400	69,096.00	0.03
331	002651	利君股份	11,900	61,285.00	0.03

## 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	002027	分众传媒	1,040,468.00	0.45
2	002594	比亚迪	549,985.00	0.24
3	002745	木林森	449,220.00	0.20
4	002727	一心堂	418,578.00	0.18
5	002035	华帝股份	383,253.00	0.17
6	002680	长生生物	359,918.00	0.16
7	002042	华孚时尚	353,213.00	0.15
8	002511	中顺洁柔	334,439.00	0.15
9	002110	三钢闽光	312,572.00	0.14
10	002610	爱康科技	305,377.00	0.13
11	002596	海南瑞泽	303,432.00	0.13
12	002475	立讯精密	301,284.00	0.13
13	002537	海联金汇	300,847.00	0.13
14	002020	京新药业	296,045.00	0.13
15	002212	南洋股份	281,234.00	0.12
16	002258	利尔化学	278,575.00	0.12
17	002359	北讯集团	265,992.00	0.12
18	002061	浙江交科	256,600.00	0.11
19	002717	岭南股份	255,429.00	0.11
20	002916	深南电路	253,811.00	0.11

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，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	358,043.90	0.16
2	002129	中环股份	321,907.00	0.14
3	002926	华西证券	293,487.00	0.13
4	002916	深南电路	285,451.68	0.12
5	002925	盈趣科技	245,088.20	0.11
6	002304	洋河股份	236,278.00	0.10
7	002920	德赛西威	216,154.04	0.09
8	002504	弘高创意	210,058.16	0.09
9	300454	深信服	181,091.72	0.08
10	002142	宁波银行	171,025.00	0.07
11	002649	博彦科技	166,923.00	0.07
12	002415	海康威视	154,600.00	0.07
13	002577	雷柏科技	151,379.00	0.07
14	002024	苏宁易购	150,285.00	0.07
15	300741	华宝股份	149,297.57	0.06
16	002031	巨轮智能	147,771.60	0.06
17	002638	勤上股份	134,547.44	0.06
18	002433	太安堂	134,514.00	0.06
19	002721	金一文化	131,666.00	0.06
20	002570	贝因美	130,329.30	0.06

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	17,119,759.53
卖出股票收入（成交）总额	13,474,894.94

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）	156,128.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	156,128.00	0.07

#### 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	128035	大族转债	1,360	156,128.00	0.07

#### 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在本报告期内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** 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	2,744.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,234.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,978.43

#### 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
1,176	139,965.01	148,069,654.00	89.96%	16,529,193.00	10.04%

### 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	山东龙信投资有限公司	4,543,364.00	2.76%
2	芮增璞	500,581.00	0.30%
3	张晓东	445,206.00	0.27%
4	翠庭置业（上海）有限公司	410,600.00	0.25%
5	陈江涛	399,785.00	0.24%
6	王迅	350,000.00	0.21%
7	钱中明	348,900.00	0.21%
8	景曹宇	307,700.00	0.19%
9	蔡细练	272,616.00	0.17%
10	吉林敖东延边药业股份有限公司	272,574.00	0.17%
11	广发中小板 300 交易型开 放式指数证券投资基金联 接基金	142,733,586.00	86.72%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	152,598,847.00
本报告期基金总申购份额	28,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期末基金份额总额	164,598,847.00

## 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

本报告期内无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 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	29,689,347.94	100.00%	27,649.89	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
太平洋证券	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研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
广发证券	428,637.53	100.00%	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22

## 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	20180101-20180630	131,554,233.00	28,500,000.00	17,320,647.00	142,733,586.00	86.72%
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>。

广发基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日