

广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
2019 年年度报告摘要
2019 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年三月二十七日

§1 重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发沪深 300 指数增强	
基金主代码	006020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 29 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	443,551,778.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006020	006021
报告期末下属分级基金的份额总额	316,610,148.54 份	126,941,629.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邱春杨	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年		2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	25,736,873.80	17,218,049.76	-6,244,339.40	-2,464,603.99
本期利润	58,005,309.67	33,322,232.15	-11,017,589.50	-3,786,006.11
加权平均基金份额本期利润	0.4333	0.3890	-0.1226	-0.0996
本期基金份额净值增长率	47.40%	46.93%	-12.58%	-12.72%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末	
	广发沪深 300 指数	广发沪深 300 指数增	广发沪深 300 指数增	广发沪深 300 指数增

	增强 A	强 C	强 A	强 C
期末可供分配基金份额利润	0.1651	0.1594	-0.1258	-0.1272
期末基金资产净值	407,982,539.84	162,789,876.21	81,551,487.77	28,595,783.86
期末基金份额净值	1.2886	1.2824	0.8742	0.8728

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发沪深 300 指数增强 A:

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
过去三个月	8.91%	0.72%	7.03%	0.70%	1.88%	0.02%
过去六个月	14.55%	0.87%	6.74%	0.81%	7.81%	0.06%
过去一年	47.40%	1.20%	34.28%	1.18%	13.12%	0.02%
自基金合同生效起至今	28.86%	1.27%	18.70%	1.28%	10.16%	-0.01%

广发沪深 300 指数增强 C:

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
过去三个月	8.82%	0.72%	7.03%	0.70%	1.79%	0.02%
过去六个月	14.37%	0.87%	6.74%	0.81%	7.63%	0.06%
过去一年	46.93%	1.20%	34.28%	1.18%	12.65%	0.02%
自基金合同生效起至今	28.24%	1.27%	18.70%	1.28%	9.54%	-0.01%

注：（1）业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

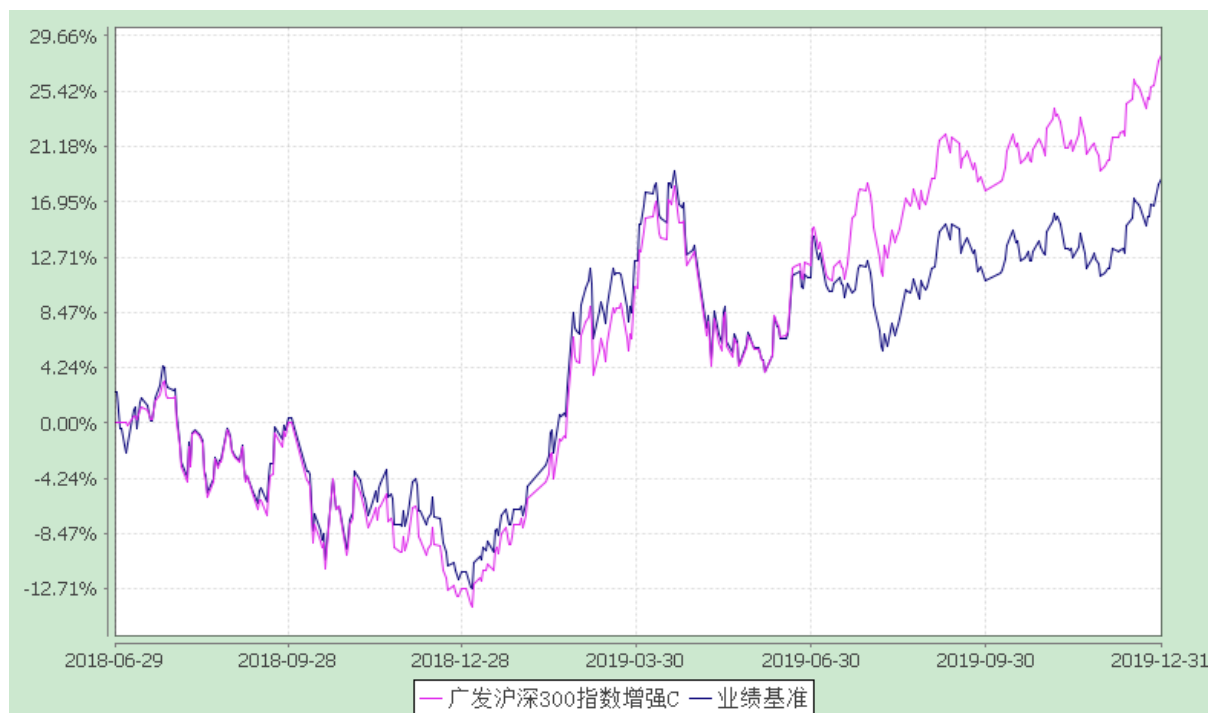
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018 年 6 月 29 日至 2019 年 12 月 31 日)

广发沪深 300 指数增强 A



广发沪深 300 指数增强 C

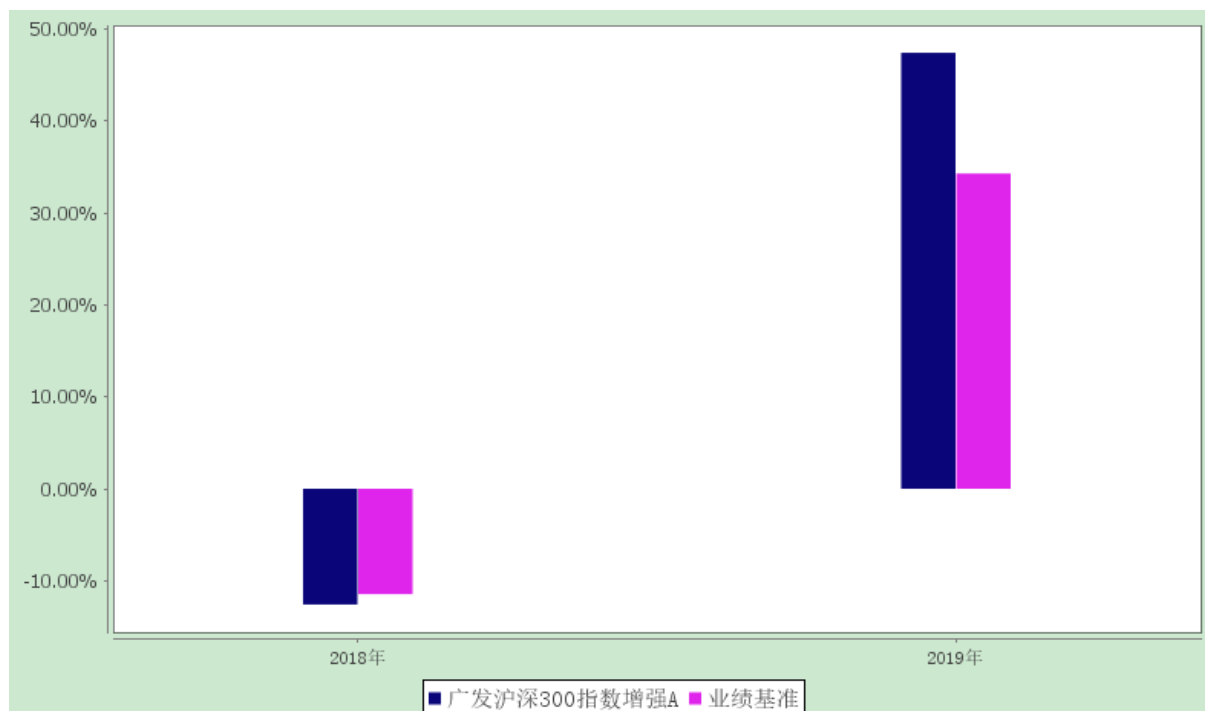


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

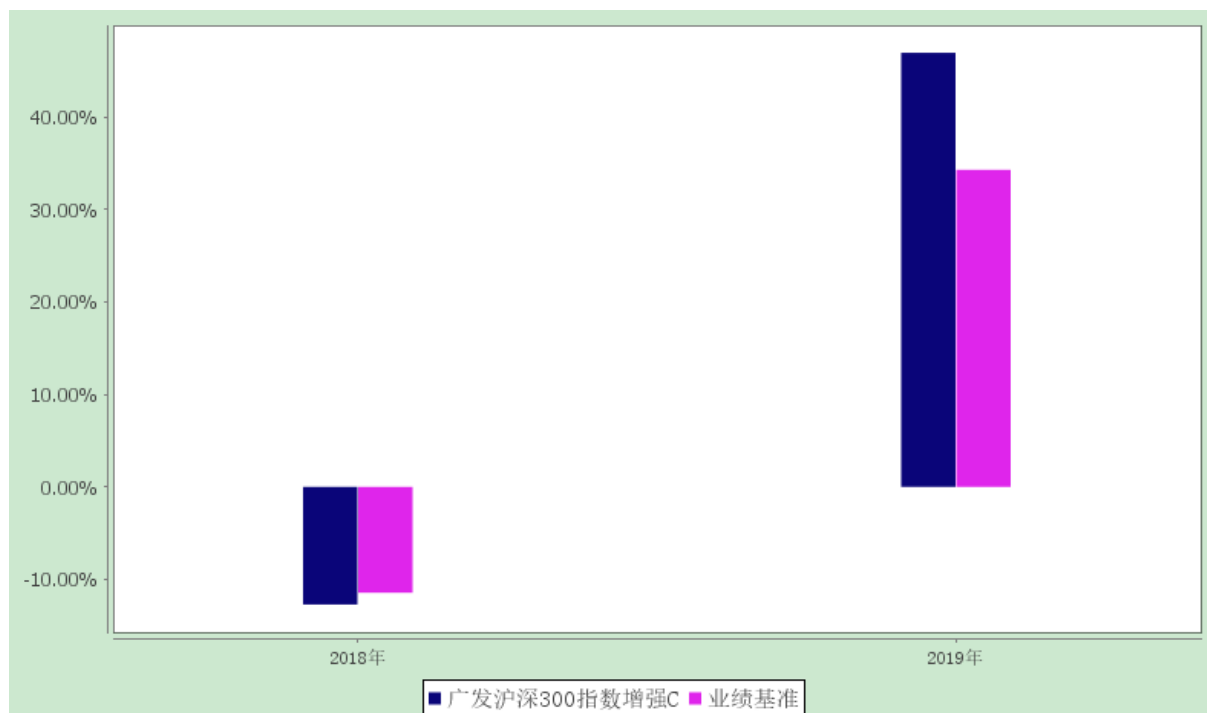
广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

广发沪深 300 指数增强 A



广发沪深 300 指数增强 C



注：合同生效当年（2018 年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2018 年 6 月 29 日）至报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产

配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2019 年 12 月 31 日，公司管理 207 只开放式基金，管理公募基金规模为 5025.61 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵杰	本基金的基金经理；广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理；广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018-06-29	-	11 年	赵杰先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资部量化研究员、量化投资经理，太平资产管理有限公司量化投资部量化投资经理，广发基金管理有限公司权益投资二部量化研究员、量化投资部量化研究员。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领

导严格审批并留痕备查。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 5 次，其中 4 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，1 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年市场整体取得了较大的涨幅，其中沪深 300 指数涨幅达 36.07%。一季度，受贸易战缓和、流动性充裕等因素的影响，A 股市场出现了一波较为快速的上涨走势。政府陆续出台多项措施稳经济，促改革，市场交投活跃，成交量显著放大，吸引了外资及国内增量资金的流入。二三季度市场则基本维持区间震荡：4 月初受 PMI、信贷、社融等多项经济数据超预期影响，市场继续一季度的上涨走势，但在月中货币政策委员会提出“把好货币供给总闸门”，政治局会议提出保持定力，市场转为震荡下跌。5 月受中美贸易争端升级影响，市场进一步下跌，而 6 月地方债新政推出，提升了市场对经济托底的预期，同时中美贸易争端出现缓和的可能，市场反弹。7 月 G20 会谈结果好于预期，但随后市场关注焦点回归到中报业绩及科创板推出，同时 8 月中美贸易争端又现波折，对市场走势造成扰动。9 月初国务院常务会议提出专项债要及时到位，同时及时运用降准工具，但之后流动性宽松低于预期。四季度市场整体震荡上涨。10、11 月延续了之前几个月的横盘震荡走势，虽然有中美达成第一阶段贸易谈判结果，以及 11 月月初 MLF 和 LPR 利率相继下调的利好，但猪肉价格持续上涨带动 CPI 走高，影响了市场的流动性预期和做多热情。12 月中央经济工作会议召开，把稳增长放在突出位置，中美达成阶段性贸易协议，同时存量浮动利率贷款 LPR 替代、《证券法》修订等改革利好频出，带动市场放量上涨。

在本报告期内，本基金仓位保持稳定，利用量化多因子模型进行股票组合的构建。模型在多个长期有效的选股因子上进行均衡配置，获取了一定的超额收益。同时模型严格控制在行业、市值等风险因子上的暴露，有效地控制了跟踪误差。另外，基金还通过新股申购、股指期货替代等方式增厚了产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 47.40%，C 类基金份额净值增长率为 46.93%，同期业绩比较基准收益率为 34.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，市场的估值从低位有所回升，但仍在历史估值的中位数附近，中长期来看仍具有一定的性价比。作为全面实现小康社会的收关年，2020 年国内经济增速预计仍将保持较高水平，整体上市企业盈利增长的势头有望持续。在权益市场地位和作用日益被重视的大背景下，来自多方面多渠道的资金仍将继续流入 A 股市场，这其中海外资金及国内场外资金的入市规模和节奏值得保持关注。本基金将继续坚持既有的投资策略，主要通过量化选股模型构建投资组合，获得相对基准的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律

法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 赵雅 马婧签字出具了安永华明（2020）审字第 60873695_G112 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	15,196,556.01	8,423,560.20
结算备付金	2,082,736.60	364,560.07
存出保证金	289,836.45	87,136.58
交易性金融资产	559,782,949.15	103,071,826.26
其中：股票投资	540,682,249.15	103,031,826.26

基金投资	-	-
债券投资	19,100,700.00	40,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	527,355.59	1,670.30
应收股利	-	-
应收申购款	1,329,881.29	493,300.35
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	579,209,315.09	112,442,053.76
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,738,457.90	962,993.51
应付赎回款	3,610,145.78	873,343.53
应付管理人报酬	424,349.57	93,085.72
应付托管费	106,087.39	23,271.45
应付销售服务费	53,897.35	9,307.61
应付交易费用	312,867.87	168,275.28
应交税费	18,700.65	0.14
应付利息	-	-
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	172,392.53	164,504.89
负债合计	8,436,899.04	2,294,782.13
所有者权益：	-	-
实收基金	443,551,778.40	126,047,500.84
未分配利润	127,220,637.65	-15,900,229.21
所有者权益合计	570,772,416.05	110,147,271.63
负债和所有者权益总计	579,209,315.09	112,442,053.76

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，广发沪深 300 指数增强 A 基金份额净值人民币 1.2886 元，基金份额总额 316,610,148.54 份；广发沪深 300 指数增强 C 基金份额净值人民币 1.2824 元，基金份额总额 126,941,629.86 份；总份额总额 443,551,778.40 份。

7.2 利润表

会计主体：广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 29 日（基金合 同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	97,264,639.68	-13,179,098.95
1.利息收入	386,088.62	180,984.58
其中：存款利息收入	119,441.87	80,559.95
债券利息收入	266,646.75	2.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	100,422.31
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	48,381,443.22	-7,285,618.34
其中：股票投资收益	40,968,990.75	-7,957,398.38

基金投资收益	-	-
债券投资收益	127,656.68	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	2,588,330.10	-
股利收益	4,696,465.69	671,780.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	48,372,618.26	-6,094,652.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	124,489.58	20,187.03
减：二、费用	5,937,097.86	1,624,496.66
1. 管理人报酬	2,519,560.32	617,270.93
2. 托管费	629,890.05	154,317.78
3. 销售服务费	394,988.94	73,349.11
4. 交易费用	2,161,531.81	600,509.99
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	9,318.40	0.01
7. 其他费用	221,808.34	179,048.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	91,327,541.82	-14,803,595.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	91,327,541.82	-14,803,595.61

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 29 日，上年度可比期间不完整。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	126,047,500.84	-15,900,229.21	110,147,271.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,327,541.82	91,327,541.82
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）	317,504,277.56	51,793,325.04	369,297,602.60
其中：1.基金申购款	773,179,131.47	120,353,504.56	893,532,636.03
2.基金赎回款	-455,674,853.91	-68,560,179.52	-524,235,033.43
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）	443,551,778.40	127,220,637.65	570,772,416.05
项目	上年度可比期间		
	2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 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）	150,731,763.33	-	150,731,763.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,803,595.61	-14,803,595.61
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）	-24,684,262.49	-1,096,633.60	-25,780,896.09

其中：1.基金申购款	52,601,592.41	-3,278,642.27	49,322,950.14
2.基金赎回款	-77,285,854.90	2,182,008.67	-75,103,846.23
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）	126,047,500.84	-15,900,229.21	110,147,271.63

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 29 日，上年度可比期间不完整。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2018]763 号《关于准予广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 6 月 4 日向社会公开发行募集并于 2018 年 6 月 29 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为自 2018 年 6 月 4 日至 2018 年 6 月 22 日止，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 150,731,763.33 元，有效认购户数为 4,569 户。其中广发沪深 300 指数增强 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 92,601,081.82 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 6,461.56 元；广发沪深 300 指数增强 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 58,120,715.40 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 3,504.55 元，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2020 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人控股子公司的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理（英国）有限公司)	基金管理人全资子公司的全资子公司
广发纳正（上海）资产管理有限公司	基金管理人全资子公司的全资子公司
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司

注：根据广发基金管理有限公司于 2019 年 11 月 14 日发布的公告，经股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1948 号文核准，广发基金管理有限公司原股东康美药业股份有限公司将其持有的公司 9.458% 股权转让给广发证券股份有限公司，康美药业股份有限公司不再持有广发基金管理有限公司的股权。广发纳正（上海）资产管理有限公司于 2019 年 11 月 28 日经上海市市场监督管理局批准注销登记。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同生效日） 至2018年12月31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	482,309,196.35	29.66%	29,931,288.30	6.05%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同生效日） 至2018年12月31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	2,480,336.68	10.70%	-	-

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同生效日） 至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的

		比例		比例
广发证券股份有限公司	-	-	116,000,000.00	34.94%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31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	449,105.41	34.93%	116,573.99	37.26%
关联方名称	上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同生效日）至2018年12月31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	27,875.35	7.58%	-	-

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,519,560.32

其中：支付销售机构的客户维护费	388,279.26	81,963.57
-----------------	------------	-----------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	629,890.05	154,317.78

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C	合计
广发基金管理有限公司	-	225,027.72	225,027.72

广发证券股份有限公司	-	2,211.83	2,211.83
合计	-	227,239.55	227,239.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C	合计
广发基金管理有限公司	-	28,242.89	28,242.89
广发证券股份有限公司	-	103.89	103.89
合计	-	28,346.78	28,346.78

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.8.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月29日(基金合同生效日)至2018 年12月31日	
	广发沪深300指数 增强A	广发沪深300指数增 强C	广发沪深300指数增 强A	广发沪深300指数增 强C
	基金合同生效日 (2018年6月29日) 持有的基金份额	-	-	10,000,800.08
报告期初持有的基 金份额	10,000,800.08	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	3.16%	-	10.72%	-

注：基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.8.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发沪深 300 指数增强 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发沪深 300 指数增强 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月29日（基金合同生效日） 至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	15,196,556.01	100,628.26	8,423,560.20	74,221.04

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

7.4.8.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

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

7.4.9 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
688008	澜起科技	2019-07-10	2020-01-22	新股流通受限	24.80	69.91	24,046.00	596,340.80	1,681,055.86	-
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	新股流通受限	4.94	4.66	294,195.00	1,453,323.30	1,370,948.70	-

688016	心脉医疗	2019-07-15	2020-01-22	新股流通受限	46.23	145.64	6,799.00	314,317.77	990,206.36	-
601077	渝农商行	2019-10-16	2020-04-29	新股流通受限	7.36	6.26	147,778.00	1,087,646.08	925,090.28	-
688020	方邦股份	2019-07-16	2020-01-22	新股流通受限	53.88	88.80	7,643.00	411,804.84	678,698.40	-
688030	山石网科	2019-09-20	2020-03-30	新股流通受限	21.06	37.90	7,957.00	167,574.42	301,570.30	-
688366	昊海生科	2019-10-23	2020-04-30	新股流通受限	89.23	79.78	2,711.00	241,902.53	216,283.58	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	新股流通受限	43.98	43.98	4,306.00	189,377.88	189,377.88	-
688300	联瑞新材	2019-11-07	2020-05-15	新股流通受限	27.28	39.84	3,164.00	86,313.92	126,053.76	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新股流通受限	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股流通受限	5.74	5.74	1,146.00	6,578.04	6,578.04	-

注：截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 534,107,439.86 元，属于第二层级的余额为人民币 25,675,509.29 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为人民币 100,317,591.46 元，属于第二层级的余额为人民币 2,754,234.80 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	540,682,249.15	93.35
	其中：股票	540,682,249.15	93.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,100,700.00	3.30
	其中：债券	19,100,700.00	3.30
	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	17,279,292.61	2.98
8	其他各项资产	2,147,073.33	0.37
9	合计	579,209,315.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	8,694,185.00	1.52
B	采矿业	19,210,309.00	3.37
C	制造业	227,199,619.34	39.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,338,994.00	1.99
E	建筑业	14,226,340.00	2.49
F	批发和零售业	3,371,047.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	15,773,557.25	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,517,272.30	2.89
J	金融业	184,429,066.22	32.31
K	房地产业	25,313,700.00	4.43
L	租赁和商务服务业	6,743,319.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	3,417,652.00	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,440,610.00	0.78
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	540,682,249.15	94.73

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	401,700	34,329,282.00	6.01
2	600519	贵州茅台	19,500	23,068,500.00	4.04
3	600036	招商银行	432,132	16,239,520.56	2.85
4	000002	万科 A	483,000	15,542,940.00	2.72
5	000333	美的集团	233,400	13,595,550.00	2.38
6	000651	格力电器	196,000	12,853,680.00	2.25
7	000001	平安银行	744,400	12,245,380.00	2.15
8	601166	兴业银行	610,300	12,083,940.00	2.12
9	600030	中信证券	475,400	12,027,620.00	2.11
10	601818	光大银行	2,650,100	11,686,941.00	2.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	38,697,290.71	35.13
2	600519	贵州茅台	23,165,807.00	21.03
3	600036	招商银行	17,331,149.00	15.73
4	000333	美的集团	16,097,788.59	14.61
5	000002	万 科 A	14,804,819.02	13.44
6	601607	上海医药	13,959,322.00	12.67
7	002415	海康威视	13,922,307.35	12.64
8	000651	格力电器	13,547,398.39	12.30
9	601288	农业银行	12,988,023.00	11.79
10	601166	兴业银行	12,780,027.98	11.60
11	000001	平安银行	12,318,720.30	11.18
12	601328	交通银行	12,291,648.00	11.16
13	000858	五 粮 液	12,121,597.67	11.00
14	600031	三一重工	11,994,929.00	10.89
15	600030	中信证券	11,990,078.99	10.89
16	601818	光大银行	11,934,023.00	10.83
17	601899	紫金矿业	11,841,782.57	10.75
18	000338	潍柴动力	11,582,824.60	10.52
19	600048	保利地产	11,561,789.00	10.50
20	600104	上汽集团	11,403,838.62	10.35
21	600276	恒瑞医药	11,342,359.50	10.30
22	601668	中国建筑	11,142,215.40	10.12
23	002120	韵达股份	10,783,560.56	9.79
24	600606	绿地控股	10,737,699.00	9.75
25	600887	伊利股份	9,924,853.19	9.01
26	600900	长江电力	9,511,619.79	8.64
27	002142	宁波银行	9,503,758.58	8.63
28	002304	洋河股份	9,407,521.79	8.54
29	002475	立讯精密	9,203,370.06	8.36
30	601688	华泰证券	9,064,071.80	8.23
31	600309	万华化学	9,054,314.04	8.22
32	002179	中航光电	9,000,344.28	8.17
33	600028	中国石化	8,943,329.00	8.12
34	600062	华润双鹤	8,700,210.26	7.90
35	600153	建发股份	8,467,813.85	7.69
36	601186	中国铁建	8,426,212.00	7.65
37	300498	温氏股份	8,293,085.56	7.53
38	600837	海通证券	7,895,778.21	7.17
39	601009	南京银行	7,889,092.05	7.16

40	601601	中国太保	7,879,464.00	7.15
41	600566	济川药业	7,796,490.66	7.08
42	600585	海螺水泥	7,542,082.31	6.85
43	000063	中兴通讯	7,526,411.98	6.83
44	601336	新华保险	7,441,256.84	6.76
45	601138	工业富联	7,409,101.85	6.73
46	600271	航天信息	7,286,174.00	6.61
47	600522	中天科技	7,200,518.86	6.54
48	002311	海大集团	7,120,930.83	6.46
49	600958	东方证券	7,027,426.07	6.38
50	000596	古井贡酒	6,982,256.88	6.34
51	600741	华域汽车	6,888,463.15	6.25
52	600066	宇通客车	6,615,186.02	6.01
53	601211	国泰君安	6,318,911.00	5.74
54	000661	长春高新	6,244,375.00	5.67
55	600760	中航沈飞	6,164,903.40	5.60
56	601088	中国神华	6,124,983.00	5.56
57	002202	金风科技	6,053,741.36	5.50
58	300015	爱尔眼科	5,971,341.50	5.42
59	600089	特变电工	5,865,666.64	5.33
60	601229	上海银行	5,785,683.14	5.25
61	600570	恒生电子	5,778,287.80	5.25
62	601933	永辉超市	5,775,922.00	5.24
63	600999	招商证券	5,711,024.43	5.18
64	002714	牧原股份	5,692,317.21	5.17
65	000963	华东医药	5,679,198.30	5.16
66	002422	科伦药业	5,648,428.76	5.13
67	000100	TCL 科技	5,622,472.98	5.10
68	000895	双汇发展	5,622,373.80	5.10
69	601111	中国国航	5,547,315.00	5.04
70	600011	华能国际	5,414,775.91	4.92
71	001979	招商蛇口	5,388,238.78	4.89
72	002555	三七互娱	5,376,664.26	4.88
73	600637	东方明珠	5,354,602.41	4.86
74	600019	宝钢股份	5,348,944.44	4.86
75	600845	宝信软件	5,224,406.00	4.74
76	603288	海天味业	5,146,228.57	4.67
77	001965	招商公路	5,106,401.36	4.64
78	002146	荣盛发展	5,029,983.00	4.57
79	600438	通威股份	5,001,332.67	4.54
80	600009	上海机场	4,993,002.00	4.53
81	600038	中直股份	4,968,307.00	4.51
82	300413	芒果超媒	4,966,841.00	4.51
83	601006	大秦铁路	4,948,175.96	4.49

84	603939	益丰药房	4,835,535.86	4.39
85	600170	上海建工	4,721,558.00	4.29
86	601888	中国国旅	4,665,446.82	4.24
87	601012	隆基股份	4,576,688.91	4.16
88	300628	亿联网络	4,308,378.76	3.91
89	600406	国电南瑞	4,302,768.45	3.91
90	601857	中国石油	4,271,712.00	3.88
91	601628	中国人寿	4,139,979.39	3.76
92	600346	恒力石化	3,962,896.11	3.60
93	600233	圆通速递	3,882,430.05	3.52
94	002294	信立泰	3,873,693.96	3.52
95	600436	片仔癀	3,719,977.00	3.38
96	600188	兖州煤业	3,647,836.00	3.31
97	002027	分众传媒	3,629,489.00	3.30
98	603259	药明康德	3,607,915.60	3.28
99	000301	东方盛虹	3,577,124.65	3.25
100	600673	东阳光	3,553,052.73	3.23
101	603659	璞泰来	3,471,766.48	3.15
102	603260	合盛硅业	3,416,123.72	3.10
103	000513	丽珠集团	3,406,173.00	3.09
104	601390	中国中铁	3,402,125.00	3.09
105	601766	中国中车	3,390,697.00	3.08
106	600703	三安光电	3,299,530.65	3.00
107	603160	汇顶科技	3,200,425.00	2.91
108	002241	歌尔股份	3,173,563.00	2.88
109	000977	浪潮信息	3,153,097.00	2.86
110	000028	国药一致	3,121,216.00	2.83
111	002624	完美世界	3,033,999.25	2.75
112	002841	视源股份	3,033,115.00	2.75
113	600690	海尔智家	2,976,438.31	2.70
114	600252	中恒集团	2,949,149.00	2.68
115	601021	春秋航空	2,890,657.90	2.62
116	600871	石化油服	2,871,674.51	2.61
117	002912	中新赛克	2,840,237.00	2.58
118	601877	正泰电器	2,753,109.67	2.50
119	600886	国投电力	2,725,283.02	2.47
120	601717	郑煤机	2,704,125.00	2.46
121	601225	陕西煤业	2,695,181.00	2.45
122	603156	养元饮品	2,510,948.71	2.28
123	300618	寒锐钴业	2,504,291.60	2.27
124	600025	华能水电	2,499,481.00	2.27
125	600018	上港集团	2,464,220.00	2.24
126	000157	中联重科	2,456,573.00	2.23
127	000630	铜陵有色	2,362,979.00	2.15

128	600023	浙能电力	2,295,669.99	2.08
129	002938	鹏鼎控股	2,226,791.82	2.02

注：本项及下项8.4.2、8.4.3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。

8.4.2 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	601607	上海医药	14,088,060.83	12.79
2	601318	中国平安	11,516,534.00	10.46
3	600606	绿地控股	10,489,197.42	9.52
4	600153	建发股份	8,706,508.75	7.90
5	000338	潍柴动力	8,658,949.03	7.86
6	600062	华润双鹤	8,539,878.42	7.75
7	600741	华域汽车	8,389,829.69	7.62
8	600104	上汽集团	8,295,789.48	7.53
9	000063	中兴通讯	7,895,516.00	7.17
10	000895	双汇发展	7,101,007.51	6.45
11	002475	立讯精密	7,098,355.70	6.44
12	600522	中天科技	7,011,299.38	6.37
13	600566	济川药业	6,887,524.11	6.25
14	600028	中国石化	6,834,954.00	6.21
15	601288	农业银行	6,827,426.00	6.20
16	601006	大秦铁路	6,817,475.00	6.19
17	600048	保利地产	6,655,946.00	6.04
18	002304	洋河股份	6,650,352.24	6.04
19	600271	航天信息	6,649,604.00	6.04
20	600760	中航沈飞	6,514,747.55	5.91
21	600519	贵州茅台	6,413,732.00	5.82
22	001979	招商蛇口	6,116,627.00	5.55
23	600036	招商银行	6,049,501.01	5.49
24	002422	科伦药业	5,810,047.00	5.27
25	002311	海大集团	5,804,965.00	5.27
26	300413	芒果超媒	5,728,563.33	5.20
27	000963	华东医药	5,691,305.80	5.17

28	000651	格力电器	5,688,876.00	5.16
29	600089	特变电工	5,651,858.98	5.13
30	000100	TCL 科技	5,561,024.00	5.05
31	000333	美的集团	5,559,113.06	5.05
32	601899	紫金矿业	5,475,486.00	4.97
33	002415	海康威视	5,441,467.75	4.94
34	002179	中航光电	5,319,201.10	4.83
35	600276	恒瑞医药	5,298,670.47	4.81
36	603939	益丰药房	5,227,946.00	4.75
37	601111	中国国航	5,122,927.00	4.65
38	600030	中信证券	5,113,263.99	4.64
39	601012	隆基股份	5,104,039.00	4.63
40	601328	交通银行	4,997,972.00	4.54
41	600637	东方明珠	4,972,328.40	4.51
42	601668	中国建筑	4,838,983.00	4.39
43	000858	五 粮 液	4,834,530.00	4.39
44	300628	亿联网络	4,816,313.00	4.37
45	600031	三一重工	4,770,292.93	4.33
46	002120	韵达股份	4,674,280.00	4.24
47	600406	国电南瑞	4,627,978.00	4.20
48	601800	中国交建	4,362,586.00	3.96
49	600170	上海建工	4,251,035.00	3.86
50	601088	中国神华	4,212,764.44	3.82
51	603659	璞泰来	4,186,094.00	3.80
52	601166	兴业银行	4,121,356.00	3.74
53	600886	国投电力	4,119,854.00	3.74
54	000001	平安银行	4,078,304.00	3.70
55	002555	三七互娱	4,058,384.04	3.68
56	600900	长江电力	4,039,520.00	3.67
57	600570	恒生电子	4,028,444.57	3.66
58	002294	信立泰	3,943,606.00	3.58
59	601688	华泰证券	3,807,152.00	3.46
60	002714	牧原股份	3,798,841.00	3.45
61	600233	圆通速递	3,775,014.37	3.43
62	600352	浙江龙盛	3,753,081.00	3.41
63	600309	万华化学	3,703,743.40	3.36
64	002241	歌尔股份	3,628,194.00	3.29
65	000002	万 科 A	3,622,530.00	3.29
66	000301	东方盛虹	3,579,331.26	3.25
67	601398	工商银行	3,538,542.00	3.21
68	600887	伊利股份	3,502,873.53	3.18
69	600188	兖州煤业	3,468,963.90	3.15
70	600673	东阳光	3,467,708.86	3.15
71	601766	中国中车	3,463,851.00	3.14

72	601336	新华保险	3,433,459.00	3.12
73	002142	宁波银行	3,334,919.00	3.03
74	601229	上海银行	3,309,997.64	3.01
75	601818	光大银行	3,298,906.00	2.99
76	603260	合盛硅业	3,280,422.96	2.98
77	300003	乐普医疗	3,224,321.00	2.93
78	600837	海通证券	3,168,812.00	2.88
79	603288	海天味业	3,156,730.29	2.87
80	600845	宝信软件	3,105,219.00	2.82
81	601877	正泰电器	3,100,722.76	2.82
82	601601	中国太保	3,070,438.00	2.79
83	000028	国药一致	2,977,719.00	2.70
84	600066	宇通客车	2,852,546.00	2.59
85	600871	石化油服	2,839,957.00	2.58
86	600588	用友网络	2,819,606.10	2.56
87	600690	海尔智家	2,692,679.00	2.44
88	002223	鱼跃医疗	2,686,250.32	2.44
89	601021	春秋航空	2,664,650.00	2.42
90	600346	恒力石化	2,633,025.00	2.39
91	000630	铜陵有色	2,612,662.00	2.37
92	002938	鹏鼎控股	2,575,991.00	2.34
93	601717	郑煤机	2,473,102.00	2.25
94	600585	海螺水泥	2,378,541.20	2.16
95	601211	国泰君安	2,349,691.00	2.13
96	600025	华能水电	2,344,954.00	2.13
97	601989	中国重工	2,294,486.00	2.08
98	300124	汇川技术	2,290,368.29	2.08
99	000157	中联重科	2,283,470.00	2.07
100	603156	养元饮品	2,268,866.20	2.06

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	998,411,372.91
卖出股票收入（成交）总额	650,131,316.48

8.5 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	19,100,700.00	3.35
	其中：政策性金融债	19,100,700.00	3.35
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,100,700.00	3.35

8.6 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	108602	国开 1704	190,000	19,100,700.00	3.35

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明

IF2001	IF2001	1.00	1,231,500.00	15,960.00	买入股指期货多头合约是为了更有效地进行流动性管理。
公允价值变动总额合计					15,960.00
股指期货投资本期收益					2,588,330.10
股指期货投资本期公允价值变动					15,960.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，旨在配合基金日常投资管理需要，以更有效地跟踪标的指数和进行流动性管理，实现投资目标。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 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	289,836.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	527,355.59
5	应收申购款	1,329,881.29
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,147,073.33

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
广发沪深 300 指数增强 A	5,918	53,499.52	247,975,914.71	78.32%	68,634,233.83	21.68%
广发沪深 300 指数增强 C	8,968	14,154.95	60,457,361.51	47.63%	66,484,268.35	52.37%
合计	14,886	29,796.57	308,433,276.22	69.54%	135,118,502.18	30.46%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发沪深 300 指数增强 A	9,003.82	0.0028%
	广发沪深 300 指数增强	54,594.75	0.0430%

	C		
	合计	63,598.57	0.0143%

9.3 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	份额级别	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	广发沪深 300 指数增强 A	0
	广发沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发沪深 300 指数增强 A	0
	广发沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.0 8	2.25%	10,000,800.0 8	2.25%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.0 8	2.25%	10,000,800.0 8	2.25%	三年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 29 日）基金份额总额	92,607,543.38	58,124,219.95

本报告期期初基金份额总额	93,283,228.26	32,764,272.58
本报告期基金总申购份额	375,315,052.28	397,864,079.19
减：本报告期基金总赎回份额	151,988,132.00	303,686,721.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	316,610,148.54	126,941,629.86

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
招商证券	2	4,176,381.19	0.26%	3,054.22	0.24%	-
华西证券	1	16,024,594.78	0.99%	11,719.37	0.91%	-
华创证券	1	34,859,394.93	2.14%	25,492.44	1.98%	-
海通证券	2	82,001,623.27	5.04%	59,962.62	4.66%	-
安信证券	1	210,125,006.44	12.92%	153,666.26	11.95%	-
中信证券	3	390,722,545.74	24.02%	285,727.68	22.22%	-
国融证券	1	406,178,812.02	24.97%	297,016.95	23.10%	-
广发证券	3	482,309,196.35	29.66%	449,105.41	34.93%	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	2,007,440.00	8.66%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	8,246,088.47	35.56%	-	-	-	-
中信证券	8,397,096.10	36.21%	-	-	-	-
国融证券	2,056,308.90	8.87%	-	-	-	-
广发证券	2,480,336.68	10.70%	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
机构	1	20191023-20191125	-	67,911,129.10	-	67,911,129.10	15.31%
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>							

广发基金管理有限公司

二〇二〇年三月二十七日