

广发中小盘精选混合型证券投资基金
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	广发中小盘精选混合
基金主代码	005598
交易代码	005598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 4 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	284,646,310.33 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票，在深入研究的基础上，发掘被市场低估的中小市值公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为一只混合型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为 60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×35%+人民币计价的恒生综合中小型股指数收益率×35%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	邱春杨	许俊

负责人	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 5 月 4 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	49,409,952.56	-101,251,850.94
本期利润	160,133,594.61	-158,501,348.22
加权平均基金份额本期利润	0.2958	-0.2183
本期基金份额净值增长率	36.95%	-22.19%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0107	-0.2219
期末基金资产净值	303,309,592.88	522,238,633.81
期末基金份额净值	1.0656	0.7781

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

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

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额, 不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.87%	0.91%	5.58%	0.51%	6.29%	0.40%
过去六个月	21.74%	0.97%	4.73%	0.60%	17.01%	0.37%
过去一年	36.95%	1.29%	15.12%	0.77%	21.83%	0.52%
自基金合同生效起至今	6.56%	1.19%	-2.54%	0.85%	9.10%	0.34%

注: (1) 业绩比较基准: 中证 500 指数收益率×35%+人民币计价的恒生综合中小型股指数收益率×35%+中证全债指数收益率×30%。

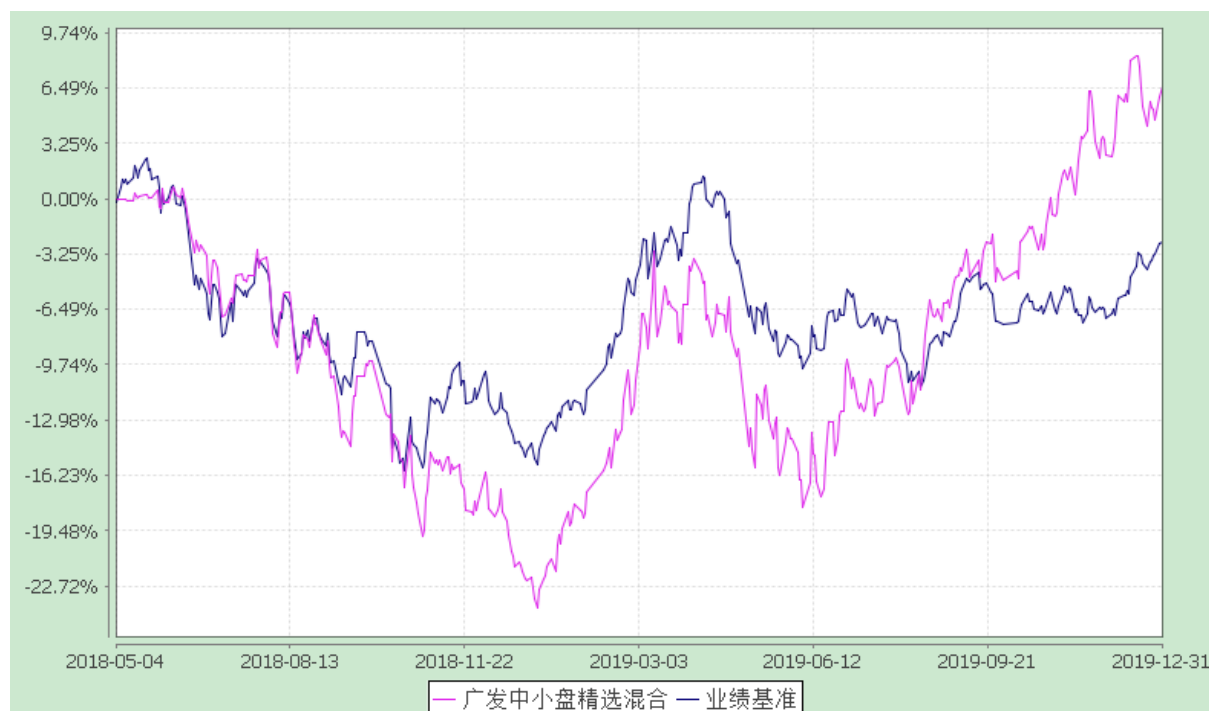
(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发中小盘精选混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

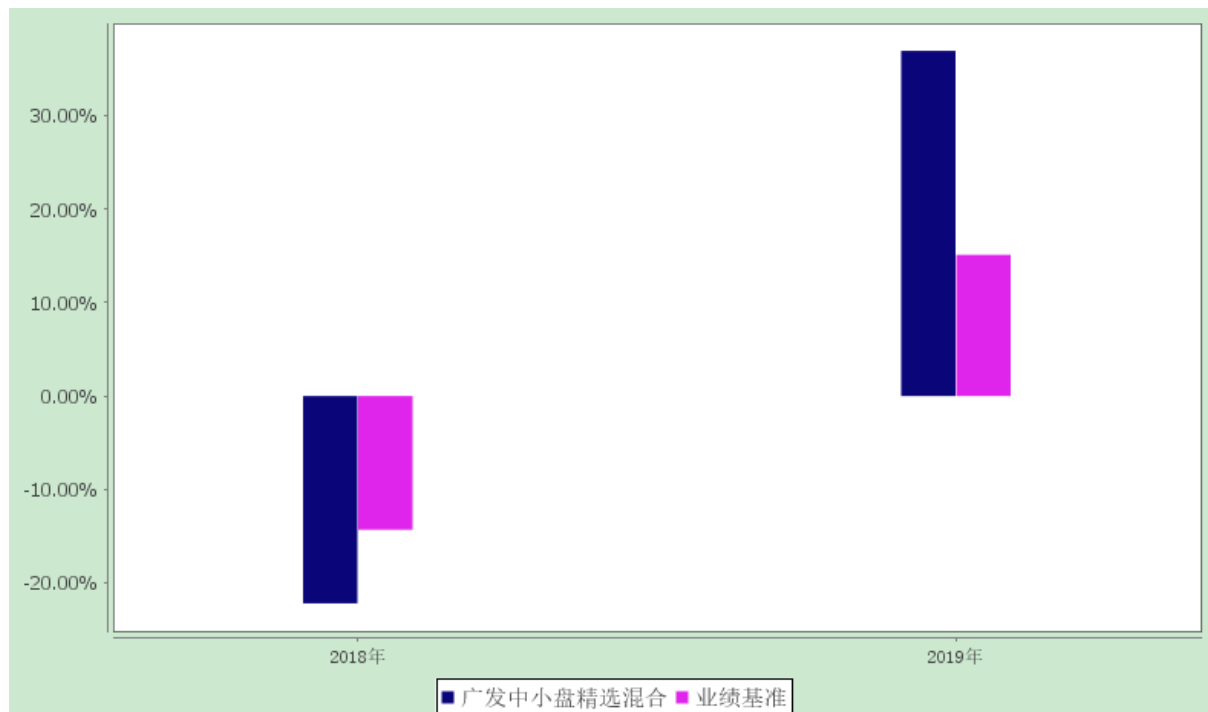
(2018 年 5 月 4 日至 2019 年 12 月 31 日)



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

广发中小盘精选混合型证券投资基金

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



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 5 月 4 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		
张东一	本基金的基金经理；广发聚优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发估值优势混合型证券投资基金的基金经理；广发消费升级股票型证券投资基金的基金经理	2018-05-23	-	11 年	张东一女士，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、投资经理、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 6 月 25 日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 3 月 20 日至 2019 年 5 月 21 日)。
余昊	本基金的基金经理；广发沪港深新机遇股票型证券投资基金的基金经理；广发全球精选股票型证	2018-05-04	2019-09-10	9 年	余昊先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、国际业务部研究员、基金经理助理、投资经理、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经

	券投资基金的基金经理；广发沪港深行业龙头混合型证券投资基金的基金经理；广发国际资产管理有限公司权益投资总监				理(自 2017 年 2 月 28 日至 2018 年 4 月 18 日)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 5 月 4 日至 2019 年 9 月 10 日)。
--	-------------------------------------------------------	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.根据本基金管理人发布的《广发基金管理有限公司广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2020 年 2 月 14 日起，张东一女士不再担任本基金基金经理。

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分析评估，保证公平交易原则的实现。

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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

本基金严格遵守中小盘风格配置策略。一季度本基金仓位前低后逐步提升，在市场区域方面，主要配置的是 A 股，辅以港股；在行业方面，主要关注计算机、软件、通讯、医药、农业和化工等行业里的中小市值企业。二季度，组合提升仓位至 90%，A 股和港股的比例约为 7：3，主要的配置板块覆盖了主要的中小市值成长性板块，比如：云计算、自主可控、5G、医疗信息化、电子硬件、药房、疫苗、生物药、CRO、养殖、白酒、光伏。三季度开始，本基金进行了较大的仓位调整，提高了个股的集中度，卖出了受益于 3 季度风险偏好提升、估值扩张明显的个股，整体降低了仓位。四季度本基金降低了部分估值偏高的计算机及电子行业的配置，增加了偏周期性的中小市值个股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 36.95%，同期业绩比较基准收益率为 15.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年前三季度宏观经济整体呈现增速稳步下台阶的态势，一方面受到 2018 年金融去杠杆带来的冲击，另一方面中美之间的贸易摩擦也为外需带来不确定性。我们当前已经看到积极的信号，始自 2019 年初的金融扩张已经开始见到成效，而中美双方在 2020 年伊始达成的第一阶段贸易协议也有望降低外部不确定性。向前看，我们预计 2020 年国内和海外流动性环境仍将保持充裕，金融条件收紧概率不大。1 月下旬开始，受到中国新型冠状病毒影响，全球金融市场出现调整，避险情绪提升。如果经济增长压力过大，预计全球主要货币当局都将通过对冲型政策提振经济增长。当前美国 10 年期国债收益率已经下探到 1.5% 附近，收益率曲线再度倒挂，市场对美联储降息预期再次升温。从境内市场看，3 月开始，存量浮动利率贷款的定价基准转换为 LPR 将逐步推进，这也将有利于广谱利率的降低。如果新冠疫情使得经济增长压力加大，预计央行货币政策也有望进一步宽松。整体看，如果金融条件能够维持扩张，对于中小盘成长股的估值将提供支撑，预计全年仍将提供较好的投资机会。

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、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未

进行利润分配，符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发中小盘精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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_G99 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：广发中小盘精选混合型证券投资基金

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	57,383,156.64	46,680,367.79
结算备付金	280,353.53	470,318.27
存出保证金	70,952.72	124,938.39
交易性金融资产	255,423,899.04	344,475,629.59
其中：股票投资	255,423,899.04	344,475,629.59
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	150,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	13,324.71	173,571.11
应收股利	-	94,236.80
应收申购款	155,590.83	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	313,327,277.47	542,019,061.95
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	34.53	18,211,386.78
应付赎回款	9,014,380.67	-
应付管理人报酬	445,620.89	691,465.96

应付托管费	74,270.14	115,244.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	287,617.73	509,330.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	195,760.63	253,001.00
负债合计	10,017,684.59	19,780,428.14
所有者权益：	-	-
实收基金	284,646,310.33	671,155,482.03
未分配利润	18,663,282.55	-148,916,848.22
所有者权益合计	303,309,592.88	522,238,633.81
负债和所有者权益总计	313,327,277.47	542,019,061.95

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0656 元，基金份额总额 284,646,310.33 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 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 5 月 4 日（基金合同 生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	173,270,640.02	-147,010,454.18
1.利息收入	977,153.16	2,626,114.57
其中：存款利息收入	512,201.84	1,406,873.40
债券利息收入	216,585.39	-
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	248,365.93	1,219,241.17
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	61,235,496.99	-92,575,312.04
其中：股票投资收益	56,969,012.63	-94,923,992.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	136,257.71	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,130,226.65	2,348,680.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	110,723,642.05	-57,249,497.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	334,347.82	188,240.57
减：二、费用	13,137,045.41	11,490,894.04
1. 管理人报酬	7,404,676.86	6,528,293.87
2. 托管费	1,234,112.79	1,088,048.92
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,293,409.37	3,599,934.23
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	2.97	-
7. 其他费用	204,843.42	274,617.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	160,133,594.61	-158,501,348.22
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	160,133,594.61	-158,501,348.22

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

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 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）	671,155,482.03	-148,916,848.22	522,238,633.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	160,133,594.61	160,133,594.61
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）	-386,509,171.70	7,446,536.16	-379,062,635.54
其中：1.基金申购款	33,553,009.46	-1,207,873.65	32,345,135.81
2.基金赎回款	-420,062,181.16	8,654,409.81	-411,407,771.35
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）	284,646,310.33	18,663,282.55	303,309,592.88
项目	上年度可比期间		
	2018 年 5 月 4 日（基金合同生效日）至 2018 年 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）	811,802,111.33	-	811,802,111.33
二、本期经营活动产生	-	-158,501,348.22	-158,501,348.22

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-140,646,629.30	9,584,500.00	-131,062,129.30
其中：1.基金申购款	18,358,880.30	-1,776,375.55	16,582,504.75
2.基金赎回款	-159,005,509.60	11,360,875.55	-147,644,634.05
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）	671,155,482.03	-148,916,848.22	522,238,633.81

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

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

广发中小盘精选混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2018]53 号《关于准予广发中小盘精选混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2018 年 4 月 9 日向社会公开发行人募集并于 2018 年 5 月 4 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 4 月 9 日至 2018 年 4 月 27 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 811,802,111.33 元，有效认购户数为 14,126 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 137,396.10 元；折合基金份额 137,396.10 份，按照基金合同的有关约定计入基金份

额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 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。

(5) 境外投资

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

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

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5月4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	1,272,556,558.60	48.48%	1,425,731,146.74	67.39%

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5月4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	1,134,900.00	47.03%	-	-

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5月4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比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	1,107,100,000.00	68.61%

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	1,221,793.89	55.27%	66,180.56	23.03%
关联方名称	上年度可比期间 2018年5月4日（基金合同生效日）至2018年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	1,397,725.44	73.48%	410,997.88	80.69%

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5月4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	7,404,676.86	6,528,293.87
其中：支付销售机构的客户维护费	3,270,339.24	3,285,975.78

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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5月4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	1,234,112.79	1,088,048.92

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人

应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年5月4日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
基金合同生效日（2018年5月4日）持有的基金份额	-	10,000,200.02
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.51%	1.49%

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

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

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5月4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	57,383,156.64	459,260.61	46,680,367.79	1,327,529.50

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。

7.4.9 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
688012	中微公司	2019-07-12	2020-01-22	新股流通受限	29.01	89.16	23,850.00	691,888.50	2,126,466.00	-
688388	嘉元科技	2019-07-16	2020-01-22	新股流通受限	28.26	54.90	24,307.00	686,915.82	1,334,454.30	-
688006	杭可科技	2019-07-05	2020-01-22	新股流通受限	27.43	38.78	27,915.00	765,708.45	1,082,543.70	-
68801	新光	2019-0	2020-0	新股	38.09	41.05	8,807.	335,45	361,52	-

1	光电	7-12	1-22	流通受限			00	8.63	7.35	
688181	八亿时空	2019-1 2-27	2020-0 1-06	新股流通受限	43.98	43.98	3,827.00	168,311.46	168,311.46	-
688218	江苏北人	2019-1 1-29	2020-0 6-11	新股流通受限	17.36	23.48	5,790.00	100,514.40	135,949.20	-
688198	佰仁医疗	2019-1 1-29	2020-0 6-09	新股流通受限	23.68	37.58	3,213.00	76,083.84	120,744.54	-
688081	兴图新科	2019-1 2-26	2020-0 1-06	新股流通受限	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-1 2-27	2020-0 1-06	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 249,998,378.32 元，属于第二层级的余额为人民币 5,425,520.72 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为人民币 331,887,010.09 元，属于第二层级的余额为人民币 12,588,619.50 元，无属于第三层级的金额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	255,423,899.04	81.52
	其中：股票	255,423,899.04	81.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,663,510.17	18.40
8	其他各项资产	239,868.26	0.08
9	合计	313,327,277.47	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 39,462,208.40 元，占基金资产净值比例 13.01%。

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	1,065,480.00	0.35
B	采矿业	-	-
C	制造业	144,206,163.20	47.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,225,717.40	10.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,166,380.00	4.67
M	科学研究和技术服务业	24,291,372.00	8.01
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	215,961,690.64	71.20

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
日常消费品	-	-
公用事业	-	-
医疗保健	-	-
通信服务	-	-
工业	-	-
金融	-	-
非日常生活消费品	24,472,422.95	8.07
信息技术	14,989,785.45	4.94
合计	39,462,208.40	13.01

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	06169	宇华教育	5,184,000	24,472,422.95	8.07
2	300012	华测检测	1,629,200	24,291,372.00	8.01
3	002410	广联达	688,692	23,401,754.16	7.72
4	000860	顺鑫农业	400,521	21,099,446.28	6.96
5	002938	鹏鼎控股	445,348	19,996,125.20	6.59
6	000568	泸州老窖	205,100	17,778,068.00	5.86
7	002643	万润股份	1,035,800	15,733,802.00	5.19
8	00968	信义光能	3,026,000	14,989,785.45	4.94
9	002027	分众传媒	2,263,000	14,166,380.00	4.67
10	603737	三棵树	159,844	12,891,418.60	4.25

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	06886	HTSC	45,105,436.31	8.64
2	300383	光环新网	33,676,486.19	6.45
3	03808	中国重汽	27,697,081.87	5.30
4	000860	顺鑫农业	26,614,257.36	5.10
5	603019	中科曙光	24,436,044.45	4.68
6	06169	宇华教育	21,541,985.59	4.12
7	300012	华测检测	20,306,023.06	3.89
8	002643	万润股份	19,577,478.59	3.75
9	603589	口子窖	18,769,549.00	3.59
10	002938	鹏鼎控股	18,766,652.00	3.59
11	002049	紫光国微	18,026,339.64	3.45
12	002777	久远银海	18,011,257.00	3.45
13	300037	新宙邦	17,467,930.00	3.34
14	002812	恩捷股份	17,370,234.09	3.33
15	300601	康泰生物	17,331,093.66	3.32
16	002727	一心堂	16,877,818.36	3.23
17	002912	中新赛克	16,340,986.01	3.13
18	603259	药明康德	16,325,123.44	3.13
19	01610	中粮肉食	16,144,630.47	3.09
20	000802	北京文化	16,116,433.66	3.09
21	601100	恒立液压	15,949,591.18	3.05
22	002821	凯莱英	15,890,459.00	3.04
23	000568	泸州老窖	15,785,548.00	3.02
24	000333	美的集团	15,551,015.36	2.98
25	600690	海尔智家	15,502,180.00	2.97
26	600025	华能水电	15,196,613.70	2.91
27	02238	广汽集团	15,101,291.78	2.89
28	00175	吉利汽车	15,095,431.58	2.89
29	00921	海信家电	14,532,137.98	2.78
30	01128	永利澳门	14,498,731.01	2.78
31	03888	金山软件	14,360,295.62	2.75
32	300498	温氏股份	14,301,990.83	2.74
33	002027	分众传媒	14,293,539.00	2.74
34	000708	中信特钢	14,169,483.62	2.71
35	600132	重庆啤酒	13,052,602.91	2.50

36	002402	和而泰	12,989,378.50	2.49
37	000651	格力电器	12,959,818.00	2.48
38	300357	我武生物	12,340,523.60	2.36
39	002234	民和股份	11,890,756.00	2.28
40	002458	益生股份	11,886,254.00	2.28
41	002371	北方华创	11,836,848.50	2.27
42	600718	东软集团	11,819,753.84	2.26
43	300253	卫宁健康	11,742,786.00	2.25
44	01478	丘钛科技	11,714,401.65	2.24
45	002439	启明星辰	11,709,564.54	2.24
46	603737	三棵树	11,695,166.94	2.24
47	000661	长春高新	11,464,487.00	2.20
48	300394	天孚通信	11,156,373.00	2.14
49	300628	亿联网络	11,154,142.76	2.14
50	01788	国泰君安国际	11,046,005.63	2.12
51	00780	同程艺龙	10,641,363.78	2.04
52	002157	正邦科技	10,593,177.00	2.03

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	06886	HTSC	39,759,378.02	7.61
2	300383	光环新网	39,625,454.84	7.59
3	300357	我武生物	34,968,006.32	6.70
4	00135	昆仑能源	28,303,200.04	5.42
5	300601	康泰生物	24,955,093.84	4.78
6	002912	中新赛克	24,801,215.08	4.75
7	002821	凯莱英	22,621,491.56	4.33
8	01610	中粮肉食	22,501,293.75	4.31
9	601100	恒立液压	22,283,325.04	4.27
10	603019	中科曙光	22,282,384.05	4.27
11	01478	丘钛科技	22,090,908.74	4.23
12	03808	中国重汽	21,875,411.74	4.19

13	002410	广联达	21,004,918.00	4.02
14	300662	科锐国际	20,628,924.00	3.95
15	600132	重庆啤酒	20,609,740.00	3.95
16	600025	华能水电	20,372,769.80	3.90
17	000651	格力电器	19,428,571.46	3.72
18	000333	美的集团	19,035,303.58	3.64
19	000708	中信特钢	18,507,428.00	3.54
20	300750	宁德时代	18,484,343.00	3.54
21	600690	海尔智家	18,391,987.07	3.52
22	002812	恩捷股份	18,117,563.00	3.47
23	002049	紫光国微	17,768,353.00	3.40
24	02238	广汽集团	17,519,849.95	3.35
25	00175	吉利汽车	17,389,510.75	3.33
26	603259	药明康德	17,107,773.00	3.28
27	000802	北京文化	17,072,819.64	3.27
28	603589	口子窖	16,715,857.60	3.20
29	01211	比亚迪股份	15,891,455.01	3.04
30	300498	温氏股份	15,711,241.16	3.01
31	300037	新宙邦	15,623,040.46	2.99
32	002777	久远银海	15,395,699.70	2.95
33	000681	视觉中国	15,386,767.94	2.95
34	002157	正邦科技	15,308,667.00	2.93
35	01128	永利澳门	15,054,810.56	2.88
36	01066	威高股份	14,759,750.70	2.83
37	300628	亿联网络	14,483,255.02	2.77
38	002727	一心堂	14,299,904.67	2.74
39	00392	北京控股	14,026,112.46	2.69
40	601231	环旭电子	13,487,697.00	2.58
41	300253	卫宁健康	13,107,163.80	2.51
42	600309	万华化学	13,001,513.06	2.49
43	002402	和而泰	12,943,460.50	2.48
44	00966	中国太平	12,649,117.15	2.42
45	00368	中外运航运	12,495,536.55	2.39
46	002439	启明星辰	12,410,832.16	2.38
47	00921	海信家电	12,071,226.85	2.31
48	002371	北方华创	11,970,962.00	2.29
49	300394	天孚通信	11,689,843.63	2.24
50	601888	中国国旅	11,553,832.40	2.21
51	002234	民和股份	11,332,479.20	2.17
52	002007	华兰生物	11,146,233.25	2.13
53	01788	国泰君安国际	10,864,667.03	2.08
54	002458	益生股份	10,856,108.00	2.08

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	1,188,292,086.42
卖出股票收入（成交）总额	1,445,036,471.65

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

- (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。

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	70,952.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,324.71
5	应收申购款	155,590.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239,868.26

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

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
6,629	42,939.56	10,790,907.86	3.79%	273,855,402.47	96.21%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,209.10	0.0004%

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	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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年5月4日)基金份额总额	811,802,111.33
本报告期期初基金份额总额	671,155,482.03
本报告期基金总申购份额	33,553,009.46
减：本报告期基金总赎回份额	420,062,181.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	284,646,310.33

§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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东莞证券	1	23,844,604.67	0.91%	17,437.53	0.79%	-
恒泰证券	1	46,908,791.46	1.79%	34,304.46	1.55%	-
华金证券	1	54,948,862.01	2.09%	40,184.27	1.82%	-
招商证券	2	58,477,484.93	2.23%	42,764.28	1.93%	-
华西证券	1	68,243,480.51	2.60%	49,907.26	2.26%	-
华创证券	1	89,699,885.26	3.42%	65,597.36	2.97%	-
中信证券	3	145,229,634.03	5.53%	106,205.46	4.80%	-
国融证券	1	175,657,370.69	6.69%	128,441.12	5.81%	-
海通证券	2	195,437,821.64	7.45%	142,919.09	6.46%	-
安信证券	1	493,887,265.31	18.82%	361,181.95	16.34%	-
广发证券	3	1,272,556,558.60	48.48%	1,221,793.89	55.27%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	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
东莞证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	133,500,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	1,278,482.73	52.97%	-	-	-	-
广发证券	1,134,900.00	47.03%	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-

广发基金管理有限公司

二〇二〇年三月二十七日