

# 广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

## 2021 年中期报告

### 2021 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
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>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>52</b>

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	53
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>54</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8	其他重大事件 .....	56
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>56</b>
11.1	备查文件目录 .....	56
11.2	存放地点 .....	57
11.3	查阅方式 .....	57

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	广发小盘成长混合（LOF）	
基金主代码	162703	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2005年2月2日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,253,469,349.07 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	2005-04-29	
下属分级基金的基金简称	广发小盘成长混合(LOF)A	广发小盘成长混合 C
下属分级基金的交易代码	162703	009132
报告期末下属分级基金的份额总额	4,164,644,477.67 份	88,824,871.40 份

注：本基金的扩位证券简称为“广发小盘 LOF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于具有高成长性的小市值公司股票，以寻求资本的长期增值。
投资策略	<p>1.资产配置区间：股票资产配置比例为 60%-95%，债券资产配置比例为 0-15%，现金大于等于 5%。</p> <p>2.决策依据：以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。</p> <p>3.股票投资管理的方法与标准：本基金在投资策略上采取小市值成长导向型，主要投资于基本面良好，具有高成长性的小市值公司股票。</p> <p>4.债券投资策略：利率预测、收益率曲线模拟、资产配置和债券分析。</p>
业绩比较基准	天相小市值指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露	姓名	程才良	胡波

负责人	联系电话	020-83936666	021-61618888
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		95105828	95528
传真		020-89899158	021-63602540
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）	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		510308	200001
法定代表人		孙树明	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

## 2.5 其他相关资料

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

注：本基金的 A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为广发基金管理有限公司。

## 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	广发小盘成长混合 (LOF)A	广发小盘成长混合 C
本期已实现收益	2,489,827,202.64	56,427,175.80
本期利润	648,634,248.79	927,148.19
加权平均基金份额本期利润	0.1487	0.0092
本期加权平均净值利润率	4.43%	0.28%

本期基金份额净值增长率	4.30%	4.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	广发小盘成长混合(LOF)A	广发小盘成长混合 C
期末可供分配利润	2,378,031,091.53	50,013,660.34
期末可供分配基金份额利润	0.5710	0.5631
期末基金资产净值	14,419,100,326.99	306,762,369.26
期末基金份额净值	3.4623	3.4536
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	广发小盘成长混合(LOF)A	广发小盘成长混合 C
基金份额累计净值增长率	1,451.68%	51.86%

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

广发小盘成长混合(LOF)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
过去一个月	2.66%	1.30%	2.50%	0.87%	0.16%	0.43%
过去三个月	15.45%	1.34%	10.54%	0.79%	4.91%	0.55%
过去六个月	4.30%	1.90%	6.74%	1.08%	-2.44%	0.82%
过去一年	23.15%	1.88%	17.79%	1.30%	5.36%	0.58%
过去三年	174.00%	1.83%	33.52%	1.48%	140.48%	0.35%
自基金合同生效起至今	1,451.68%	1.76%	571.69%	1.89%	879.99%	-0.13%

广发小盘成长混合 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
过去一个月	2.63%	1.30%	2.50%	0.87%	0.13%	0.43%
过去三个月	15.33%	1.34%	10.54%	0.79%	4.79%	0.55%
过去六个月	4.09%	1.90%	6.74%	1.08%	-2.65%	0.82%

过去一年	22.65%	1.88%	17.79%	1.30%	4.86%	0.58%
自基金合同生效起至今	51.86%	1.83%	32.32%	1.30%	19.54%	0.53%

### 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

广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

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

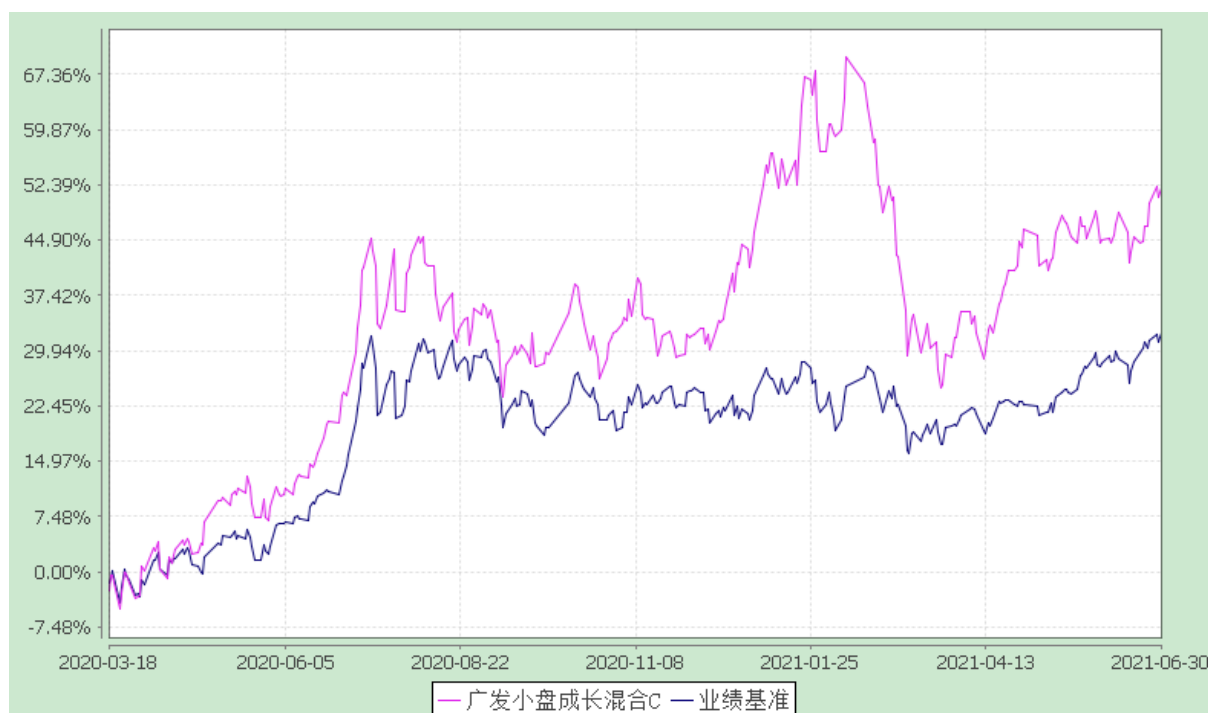
（2005 年 2 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日）

广发小盘成长混合(LOF)A



广发小盘成长混合 C





## 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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、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、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、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘格菘	本基金的基金经理；广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广	2017-06-19	-	11 年	刘格菘先生，经济学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理，融通基金管理有限公

	<p>发双擎升级混合型证券投资基金的基金经理；广发多元新兴股票型证券投资基金的基金经理；广发科技先锋混合型证券投资基金的基金经理；高级董事总经理、成长投资部总经理</p>			<p>司权益投资部总经理、基金经理，广发基金管理有限公司权益投资一部研究员、权益投资一部副总经理、北京权益投资部总经理、广发行行业领先混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 19 日至 2019 年 5 月 31 日)、广发集嘉债券型证券投资基金基金经理(自 2018 年 12 月 25 日至 2020 年 7 月 23 日)、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 5 月 18 日)、广发科技创新混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 25 日至 2021 年 5 月 18 日)。</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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易

过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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% 的交易共有 13 次，其中 7 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，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间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，未发现本组合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

2021 年上半年，A 股市场大幅波动。一季度末，受美债收益率快速上行的影响，全球流动性预期发生较大变化，新兴市场股市普遍回调，以白酒、医药、新能源为代表的 A 股“核心资产”均有较大回撤，在此期间再通胀交易有明显的相对收益，商品价格快速上行，A 股资源类公司股价走势表现靓丽。二季度，市场从恐慌情绪中逐步走出，尽管美国通胀数据不断抬高，但美联储鸽派言论给了市场较为宽松的流动性环境，再通胀交易告一段落，以动力电池、CXO、医美等为代表的 A 股高景气资产大幅跑赢市场，同时美股的成长风格大幅跑赢价值风格。

上半年 A 股市场的重要结构特征是“强者恒强”，高景气赛道如新能源动力电池、医药行业的 CXO、医美、医疗服务等子行业、半导体等科技行业以及光伏板块，在反弹中创出新高，市场估值分化的矛盾进一步凸显，众多行业已突破历史最高估值百分位。这种估值体系的变化，反映了大部分投资人对于长期永续价值的重新审视，有其合理的地方。但不容忽视的是，在高景气板块盈利的中期增速和长期永续成长性比较合理的假设条件下，用潜在的估值水平倒推，前述高景气板块隐含的贴现水平有比较大的差异，某些板块已经体现了最乐观的预期。从长期资产配置角度，可能已经到了不得不考虑资产性价比的阶段。一旦宏观环境出现边际变化，风险偏好调整，估值、股价均处于高位的资产将会出现调整。

本基金在报告期内增加了光伏、新能源车、全球龙头化工等行业的配置，同时继续持有面板和部分性价比较好的医疗服务等行业标的。

#### 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 4.30%，C 类基金份额净值增长率为 4.09%，同期业绩比较基准收益率为 6.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，疫情对全球复苏的影响以及美国核心通胀的走势依然是值得关注的问题。新冠疫情是一次对全球合作的长期考验，疫情何时结束，在于世界范围内的组织短板国家以何种手段应对病毒。在未来相当长的一段时间内，人类可能需要与新冠病毒共存，后疫情时代可能是一个比较长的时期。同疫情首次爆发阶段相比，全球各国基本上已经适应了疫情控制与经济复苏同步的节奏，疫情后的经济复苏依然是隐含的主旋律。在这个过程中，从供需格局角度分析长期受益的板块，我们依然坚定看好 A 股具有“全球比较优势”的制造业资产。何谓全球比较优势，简单理解即供应链大部分在国内、需求面向全球的制造业，他们是需求具有不可替代性、受益于国内高效组织能力而供给可以快速响应全球复苏需求的资产。在一季报中，我们分析了中国制造业成长的三个阶段，处于发展第三阶段的制造业，通过自身的制造成本、产业链响应、工程师红利、研发优势、企业家精神等，构筑起自身强大的护城河，这些企业是未来全球复苏的重要供给力量，结合良好的性价比，未来依然是本基金配置的主要方向。

为什么中国的制造业会具备全球比较优势？从产业变迁角度看，一个制造企业的产品会从简单过渡到复杂，由于制造业的上下游比较多，自身产品的复杂程度提升会使得上下游同步跟进，形成产业聚集效应。在全球分工的背景下，不同国家的产业聚集效应差异很大。从德、美、英等欧美发达国家自 2001 年以来的产业升级趋势上看，欧美的制造业聚集效应在下降，显示了全球分工的影响。近几年，同样具备劳动成本优势的越南、印度、墨西哥等国的制造产业并没有出现产业聚集的趋势，也没有出现产品复杂度提升的情况，说明制造业的发展并不能够用劳动力成本这个单一要素解释。从中国自 2001 年以来的制造业产业变迁历史数据看，产品复杂程度不断提升的同时，产业链聚集效应不断增强。从中国与欧美、东南亚、拉美的制造业变迁数据中可以看到，除了劳动力成本优势之外，我们的工程师数量、组织能力、产业体系的完备性都是中国制造业的竞争优势，这种体系性的优势一旦建立就很难被颠覆，因此从供给角度分析，中国未来具备“全球比较优势”的制造业只会越来越多，竞争力势必越来越强。

本基金的资产布局思路大体如上所述。我们对 A 股市场未来 2 年到 3 年的表现非常乐观，制造业盈利能力的持续扩张将是我们主要的关注点，我们相信性价比较高的“全球比较优势制造业”将会在波动中显现出自身的优势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，2021年2月2日广发小盘成长混合(LOF)A类每10份基金份额分配2.377元，广发小盘成长混合C类每10份基金份额分配2.284元。截至2021年6月30日，广发小盘成长混合(LOF)A类可供分配利润为2,378,031,091.53元，广发小盘成长混合C类可供分配利润为50,013,660.34元，上述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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对广发小盘成长混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对广发小盘成长混合型证券投资基金(LOF)的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金本报告期内进行了 1 次利润分配，分配金额为 1,035,193,229.66 元。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由广发基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,142,787,594.78	1,119,963,681.78
结算备付金		3,097,291.17	4,509,560.37
存出保证金		3,470,333.46	2,623,339.83
交易性金融资产	6.4.7.2	13,822,273,582.37	15,328,497,707.65
其中：股票投资		13,810,557,882.37	15,328,497,707.65
基金投资		-	-
债券投资		11,715,700.00	-
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		-	172,739,034.12
应收利息	6.4.7.5	571,286.19	506,705.19

应收股利		-	-
应收申购款		22,905,399.36	24,852,192.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		14,995,105,487.33	16,653,692,221.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		90,409,430.84	172,993,145.96
应付赎回款		153,705,829.00	217,315,693.93
应付管理人报酬		18,062,602.44	20,123,036.90
应付托管费		3,010,433.74	3,353,839.50
应付销售服务费		105,908.02	129,016.78
应付交易费用	6.4.7.7	2,665,283.85	4,594,910.25
应交税费		20.07	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,283,283.12	1,475,832.33
负债合计		269,242,791.08	419,985,475.65
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	4,253,469,349.07	4,585,530,410.66
未分配利润	6.4.7.10	10,472,393,347.18	11,648,176,335.24
所有者权益合计		14,725,862,696.25	16,233,706,745.90
负债和所有者权益总计		14,995,105,487.33	16,653,692,221.55

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发小盘成长混合（LOF）A 基金份额净值人民币 3.4623 元，基金份额总额 4,164,644,477.67 份；广发小盘成长混合 C 基金份额净值人民币 3.4536 元，基金份额总额 88,824,871.40 份；总份额总额 4,253,469,349.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	-----	--	---

<b>一、收入</b>		<b>797,900,795.18</b>	<b>3,399,674,453.18</b>
1.利息收入		11,759,225.90	15,504,537.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,758,627.54	15,504,537.67
债券利息收入		598.36	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,671,201,071.60	299,650,285.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,585,804,154.79	262,280,582.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	85,396,916.81	37,369,702.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,896,692,981.46	3,060,967,001.90
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	11,633,479.14	23,552,627.88
<b>减：二、费用</b>		<b>148,339,398.20</b>	<b>118,125,992.53</b>
1. 管理人报酬		112,248,500.04	85,825,928.32
2. 托管费		18,708,083.32	14,304,321.33
3. 销售服务费		673,046.27	272,705.97
4. 交易费用	6.4.7.18	16,557,453.08	17,577,073.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.15	-
7. 其他费用	6.4.7.19	152,313.34	145,963.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>649,561,396.98</b>	<b>3,281,548,460.65</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>649,561,396.98</b>	<b>3,281,548,460.65</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	4,585,530,410.66	11,648,176,335.24	16,233,706,745.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	649,561,396.98	649,561,396.98
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）	-332,061,061.59	-790,151,155.38	-1,122,212,216.97
其中：1.基金申购款	2,056,643,963.43	5,135,741,762.79	7,192,385,726.22
2.基金赎回款	-2,388,705,025.02	-5,925,892,918.17	-8,314,597,943.19
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）	-	-1,035,193,229.66	-1,035,193,229.66
五、期末所有者权益（基金净值）	4,253,469,349.07	10,472,393,347.18	14,725,862,696.25
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,285,304,529.68	2,356,035,576.06	4,641,340,105.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,281,548,460.65	3,281,548,460.65
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）	2,891,265,277.10	4,707,875,660.93	7,599,140,938.03
其中：1.基金申购款	7,427,589,856.80	11,974,619,758.42	19,402,209,615.22
2.基金赎回款	-4,536,324,579.70	-7,266,744,097.49	-11,803,068,677.19
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）	5,176,569,806.78	10,345,459,697.64	15,522,029,504.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监基金字[2004]195 号文《关于同意广发小盘成长股票型证券投资基金募集的批复》批准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发小盘成长股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2005 年 2 月 2 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。本基金已向中国证监会备案，并获中国证监会基金部函（2005）27 号《关于广发小盘成长股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为 2004 年 12 月 20 日至 2005 年 1 月 25 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 1,175,436,171.10 元，有效认购户数为 12,393 户。其中，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 247,780.56 元，利息结转的基金份额 247,780.56 份，按照基金合同的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳天健信德会计师事务所验资。基金合同于 2005 年 2 月 2 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,175,436,171.10 份。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金自 2015 年 8 月 7 日起由股票型基金变更为混合型基金，基金名称由“广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”变更为“广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）”。

本基金自 2020 年 3 月 18 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### （1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

#### （2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,142,787,594.78
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
合计	1,142,787,594.78

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,851,874,015.11	13,810,557,882.37	3,958,683,867.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,715,700.00	11,715,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	11,715,700.00	11,715,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,863,589,715.11	13,822,273,582.37	3,958,683,867.26

#### 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

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	568,010.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,405.44
应收结算备付金利息	1,254.42
应收债券利息	616.28
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	-
合计	571,286.19

#### 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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,665,283.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,665,283.85

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	532,827.03
应付证券出借违约金	-
预提费用	250,456.09
合计	1,283,283.12

#### 6.4.7.9 实收基金

广发小盘成长混合(LOF)A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,486,293,806.70	4,486,293,806.70
本期申购	1,915,503,665.21	1,915,503,665.21
本期赎回（以“-”号填列）	-2,237,152,994.24	-2,237,152,994.24
本期末	4,164,644,477.67	4,164,644,477.67

广发小盘成长混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,236,603.96	99,236,603.96
本期申购	141,140,298.22	141,140,298.22
本期赎回（以“-”号填列）	-151,552,030.78	-151,552,030.78
本期末	88,824,871.40	88,824,871.40

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

广发小盘成长混合(LOF)A

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	1,066,373,797.69	10,330,705,836.45	11,397,079,634.14
本期利润	2,489,827,202.64	-1,841,192,953.85	648,634,248.79
本期基金份额交易产生的变动数	-167,149,599.44	-613,088,124.81	-780,237,724.25
其中：基金申购款	642,289,974.10	4,143,375,763.08	4,785,665,737.18
基金赎回款	-809,439,573.54	-4,756,463,887.89	-5,565,903,461.43
本期已分配利润	-1,011,020,309.36	-	-1,011,020,309.36
本期末	2,378,031,091.53	7,876,424,757.79	10,254,455,849.32

广发小盘成长混合 C

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	22,668,095.52	228,428,605.58	251,096,701.10
本期利润	56,427,175.80	-55,500,027.61	927,148.19
本期基金份额交易产生的变动数	-4,908,690.68	-5,004,740.45	-9,913,431.13
其中：基金申购款	48,378,182.73	301,697,842.88	350,076,025.61
基金赎回款	-53,286,873.41	-306,702,583.33	-359,989,456.74
本期已分配利润	-24,172,920.30	-	-24,172,920.30
本期末	50,013,660.34	167,923,837.52	217,937,497.86

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,667,569.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	28,041.42
结算备付金利息收入	58,763.55
其他	4,252.96

合计	11,758,627.54
----	---------------

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	6,503,861,337.19
减：卖出股票成本总额	3,918,057,182.40
买卖股票差价收入	2,585,804,154.79

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	85,396,916.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	85,396,916.81

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-1,896,692,981.46
——股票投资	-1,896,692,981.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,896,692,981.46

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元



项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	11,466,549.77
基金转换费收入	166,929.37
合计	11,633,479.14

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	16,557,453.08
银行间市场交易费用	-
合计	16,557,453.08

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	17,357.25
账户维护费	9,000.00
上市费	29,752.78
合计	152,313.34

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司	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
------------	----------------

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,946,197,983.09	18.52%	8,072,755,757.26	54.47%

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	11,715,700.00	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 2021年1月1日至2021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	1,601,159.94	17.60%	835,858.66	31.36%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券股份有限公司	6,551,026.55	53.46%	3,067,683.52	51.53%

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	112,248,500.04	85,825,928.32
其中：支付销售机构的客户维护费	30,334,222.04	23,035,157.10

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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，基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	18,708,083.32	14,304,321.33

注：基金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：

$$H = E \times 0.25\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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，基金

托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.3 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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发小盘成长混合(LOF)A	广发小盘成长混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	170,682.25	170,682.25
合计	-	170,682.25	170,682.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发小盘成长混合(LOF)A	广发小盘成长混合C	合计
广发基金管理有限公司	-	219,180.09	219,180.09
合计	-	219,180.09	219,180.09

注：本基金自 2020 年 3 月 18 日起增设 C 类份额。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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金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，基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

的证券出借业务。

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

##### 6.4.10.5.2 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

#### 广发小盘成长混合(LOF)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。

#### 广发小盘成长混合 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
上海浦东发展银行股份有限公司	1,142,787,594.78	11,667,569.61	1,093,372,015.52	15,334,533.61

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

#### 广发小盘成长混合(LOF)A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					

1	2021-02-02	2021-02-03	2021-02-02	2.377	620,909,454.48	390,110,854.88	1,011,020,309.36	-
合计				2.377	620,909,454.48	390,110,854.88	1,011,020,309.36	-

广发小盘成长混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021-02-02	2021-02-03	2021-02-02	2.284	18,300,102.54	5,872,817.76	24,172,920.30	-
合计				2.284	18,300,102.54	5,872,817.76	24,172,920.30	-

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601127	小康股份	2021-06-30	2021-12-28	非公开发行流通受限	46.00	56.88	4,347,826.00	199,999,996.00	247,304,342.88	-
600584	长电科技	2021-04-29	2021-10-26	非公开发行流通受限	28.30	35.44	2,650,177.00	75,000,009.10	93,922,272.88	-
000063	中兴通讯	2020-02-03	2022-02-04	非公开发行流通受限	30.21	31.16	827,541.00	25,000,013.61	25,786,177.56	20200812 除权除息,派

				限						息比例 0.2000 (含税)
30068 6	智动力	2021-0 1-06	2021-0 7-22	非公开发 行流通受 限	17.59	16.25	568,50 4.00	9,999, 985.36	9,238, 190.00	20210 528 除 权除 息,派 息比 例 0.0400 (含税)
30095 7	贝泰 妮	2021-0 3-18	2021-0 9-27	新股 流通 受限	47.33	251.96	853.00	40,372 .49	214,92 1.88	20210 624 除 权除 息,派 息比 例 0.4500 (含税)
68861 3	奥精 医疗	2021-0 5-13	2021-1 1-22	新股 流通 受限	16.43	63.50	2,617. 00	42,997 .31	166,17 9.50	-
68865 6	浩欧 博	2021-0 1-06	2021-0 7-13	新股 流通 受限	35.26	72.60	1,371. 00	48,341 .46	99,534 .60	20210 610 除 权除 息,派 息比 例 0.3000 (含税)
30091 9	中伟 股份	2020-1 2-15	2021-0 7-02	新股 流通 受限	24.60	163.00	610.00	15,006 .00	99,430 .00	-
68849 9	利元 亨	2021-0 6-23	2021-0 7-01	新股 流通 受限	38.85	38.85	2,149. 00	83,488 .65	83,488 .65	-
30097 9	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	33.22	87.50	925.00	30,728 .50	80,937 .50	-
68846 8	科美 诊断	2021-0 3-31	2021-1 0-11	新股 流通 受限	7.15	16.50	3,919. 00	28,020 .85	64,663 .50	-
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 流通	8.29	8.29	7,029. 00	58,270 .41	58,270 .41	-

				受限						
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	20210622 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股流通受限	14.71	24.83	1,259.00	18,519.89	31,260.97	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	20210617 除权除息,派息比例 0.1400 (含税)
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	20210629 除权除息,派息比例 0.3000 (含税)
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-



				受限						
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	20210618 除权除息,派息比例 0.0790 (含税)
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	20210521 除权除息,派息比例 0.2000 (含税)
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	20210602 除权除息,派息比例 0.0450 (含税)
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	20210618 除权除

										息,派 息比 例 0.0300 (含税)
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	31.56	31.56	349.00	11,014 .44	11,014 .44	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 流通 受限	16.53	46.07	232.00	3,834. 96	10,688 .24	20210 628 除 权除 息,派 息比 例 0.4100 (含税)
30099 6	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	新股 流通 受限	20.81	42.23	241.00	5,015. 21	10,177 .43	-
30095 6	英力 股份	2021-0 3-16	2021-0 9-27	新股 流通 受限	12.85	25.80	371.00	4,767. 35	9,571. 80	20210 527 除 权除 息,派 息比 例 0.3000 (含税)
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 流通 受限	3.40	16.37	576.00	1,958. 40	9,429. 12	20210 610 除 权除 息,派 息比 例 0.1600 (含税)
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	20210 603 除 权除 息,派 息比 例 0.2200 (含税)
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 流通	13.75	32.98	275.00	3,781. 25	9,069. 50	-

				受限						
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	20210609 除权除息,派息比例 0.0950 (含税)
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-24	新股流通受限	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	20210604 除权除息,派息比例 0.0800 (含税),转增比例 0.5000
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	20210611 除权除息,派息比例 0.0530 (含税)
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	20210601 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股流通	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-

				受限						
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	20210519 除权除息,派息比例 0.0500 (含税)
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	20210528 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股流通受限	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	20210611 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	20210621 除权除息,派息比例 0.2100 (含税)
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-

300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	20210608 除权除息,派息比例 0.0360 (含税)
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	20210611 除权除息,派息比例 0.1500 (含税)
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	20210617 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	20210618 除权除息,派息比例 0.1200 (含税)
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	20210623 除权除息,派息比例 0.4000 (含税)
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-

				受限						
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191.00	2,811. 52	4,454. 12	-
30100 7	德迈 仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股 流通 受限	5.29	14.44	303.00	1,602. 87	4,375. 32	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	201.00	1,210. 02	4,285. 32	-
30101 2	扬电 科技	2021-0 6-15	2021-1 2-22	新股 流通 受限	8.05	24.26	170.00	1,368. 50	4,124. 20	-
30099 2	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.36	20.32	200.00	1,872. 00	4,064. 00	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	290.00	2,743. 40	2,743. 40	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
12311 7	健帆 转债	2021-0 6-23	2021-0 7-12	新债 流通 受限	100.00	100.00	117,15 7.00	11,715 ,700.0 0	11,715 ,700.0 0	-

注：截至本报告期末 2021 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权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	11,715,700.00	-
未评级	-	-
合计	11,715,700.00	-

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，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计



<b>2021 年 6 月 30 日</b>					
<b>资产：</b>					
银行存款	1,142,787,594.78	-	-	-	1,142,787,594.78
结算备付金	3,097,291.17	-	-	-	3,097,291.17
存出保证金	3,470,333.46	-	-	-	3,470,333.46
交易性金融资产	11,715,700.00	-	-	13,810,557,882.37	13,822,273,582.37
应收利息	-	-	-	571,286.19	571,286.19
应收申购款	817,526.59	-	-	22,087,872.77	22,905,399.36
资产总计	1,161,888,446.00	-	-	13,833,217,041.33	14,995,105,487.33
<b>负债：</b>					
应付证券清算款	-	-	-	90,409,430.84	90,409,430.84
应付赎回款	-	-	-	153,705,829.00	153,705,829.00
应付管理人报酬	-	-	-	18,062,602.44	18,062,602.44
应付托管费	-	-	-	3,010,433.74	3,010,433.74
应付销售服务费	-	-	-	105,908.02	105,908.02
应付交易费用	-	-	-	2,665,283.85	2,665,283.85
应交税费	-	-	-	20.07	20.07
其他负债	-	-	-	1,283,283.12	1,283,283.12
负债总计	-	-	-	269,242,791.08	269,242,791.08
利率敏感度缺口	1,161,888,446.00	-	-	13,563,974,250.25	14,725,862,696.25
<b>上年度末</b>					
<b>2020 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>
<b>资产：</b>					
银行存款	1,119,963,681.78	-	-	-	1,119,963,681.78
结算备付金	4,509,560.37	-	-	-	4,509,560.37
存出保证金	2,623,339.83	-	-	-	2,623,339.83
交易性金融资产	-	-	-	15,328,497,707.65	15,328,497,707.65
应收证券清算款	-	-	-	172,739,034.12	172,739,034.12

应收利息	-	-	-	506,705.19	506,705.19
应收申购款	739,604.66	-	-	24,112,587.95	24,852,192.61
资产总计	1,127,836,186.64	-	-	15,525,856,034.91	16,653,692,221.55
<b>负债：</b>					
应付证券清算款	-	-	-	172,993,145.96	172,993,145.96
应付赎回款	-	-	-	217,315,693.93	217,315,693.93
应付管理人报酬	-	-	-	20,123,036.90	20,123,036.90
应付托管费	-	-	-	3,353,839.50	3,353,839.50
应付销售服务费	-	-	-	129,016.78	129,016.78
应付交易费用	-	-	-	4,594,910.25	4,594,910.25
其他负债	-	-	-	1,475,832.33	1,475,832.33
负债总计	-	-	-	419,985,475.65	419,985,475.65
利率敏感度缺口	1,127,836,186.64	-	-	15,105,870,559.26	16,233,706,745.90

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	13,810,557,882.37	93.78	15,328,497,707.65	94.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	11,715,700.00	0.08	-	-
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	13,822,273,582.37	93.86	15,328,497,707.65	94.42

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	875,505,896.46	804,837,854.30
	下降 5%	-875,505,896.46	-804,837,854.30

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 13,432,846,991.04 元，属于第二层次的余额为人民币 389,426,591.33 元，无属于第三层次的金  
额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 15,101,006,292.02 元，属于第二层次的余额为人民币 227,491,415.63 元，无属于第三层次的金  
额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	13,810,557,882.37	92.10
	其中：股票	13,810,557,882.37	92.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,715,700.00	0.08
	其中：债券	11,715,700.00	0.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,145,884,885.95	7.64
8	其他各项资产	26,947,019.01	0.18

9	合计	14,995,105,487.33	100.00
---	----	-------------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,609,619,081.03	85.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	222,900.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	77,638.12	0.00
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	989,886,789.04	6.72
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	61,328,664.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	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	149,321,005.49	1.01
S	综合	-	-
	合计	13,810,557,882.37	93.78

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	601012	隆基股份	18,001,541	1,599,256,902.44	10.86
2	300014	亿纬锂能	13,678,063	1,421,561,087.59	9.65
3	002601	龙佰集团	37,058,471	1,281,481,927.18	8.70
4	000725	京东方 A	194,482,547	1,213,571,093.28	8.24
5	300601	康泰生物	7,940,572	1,183,145,228.00	8.03
6	300661	圣邦股份	4,497,069	1,136,544,248.37	7.72
7	300529	健帆生物	9,432,185	814,563,496.60	5.53
8	002414	高德红外	26,827,520	739,903,001.60	5.02
9	601127	小康股份	10,757,894	674,663,576.44	4.58
10	600346	恒力石化	19,756,372	518,407,201.28	3.52
11	002803	吉宏股份	13,612,908	386,334,329.04	2.62
12	300212	易华录	13,550,607	364,646,834.37	2.48
13	002324	普利特	28,175,678	329,655,432.60	2.24
14	603613	国联股份	2,389,269	238,855,221.93	1.62
15	002493	荣盛石化	13,450,200	232,284,954.00	1.58
16	600584	长电科技	5,634,971	206,389,310.80	1.40
17	300548	博创科技	4,592,144	163,434,404.96	1.11
18	300251	光线传媒	13,813,229	149,321,005.49	1.01
19	601233	桐昆股份	5,662,300	136,404,807.00	0.93
20	002459	晶澳科技	2,655,400	130,114,600.00	0.88
21	002301	齐心集团	12,506,511	125,565,370.44	0.85
22	601865	福莱特	2,999,914	118,586,600.42	0.81
23	600176	中国巨石	5,714,977	88,639,293.27	0.60
24	002488	金固股份	14,007,404	85,585,238.44	0.58
25	300331	苏大维格	3,038,520	77,664,571.20	0.53
26	000301	东方盛虹	2,999,906	62,698,035.40	0.43
27	605168	三人行	399,900	61,328,664.00	0.42
28	300455	康拓红外	4,181,723	42,109,950.61	0.29
29	000915	华特达因	1,515,071	40,497,847.83	0.28
30	688567	孚能科技	1,000,000	34,270,000.00	0.23
31	002444	巨星科技	1,000,000	34,080,000.00	0.23
32	688065	凯赛生物	300,000	31,467,000.00	0.21
33	002078	太阳纸业	2,000,000	26,700,000.00	0.18
34	000063	中兴通讯	827,541	25,786,177.56	0.18
35	603915	国茂股份	576,177	22,758,991.50	0.15
36	300686	智动力	568,504	9,238,190.00	0.06
37	300896	爱美客	852	672,125.76	0.00
38	688606	奥泰生物	2,703	402,747.00	0.00
39	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
40	600905	三峡能源	33,000	209,880.00	0.00
41	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.00
42	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.00
43	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
44	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.00

45	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
46	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
47	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
48	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
49	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
50	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
51	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
52	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
53	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
54	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
55	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
56	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
57	300936	中英科技	500	23,060.00	0.00
58	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
59	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
60	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
61	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
62	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
63	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
64	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
65	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
66	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
67	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
68	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
69	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
70	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
71	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
74	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
75	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
76	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
77	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
78	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
79	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
80	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
81	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
82	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
83	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
84	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
85	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
86	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
87	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
88	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00

89	688538	和辉光电-U	2,000	7,620.00	0.00
90	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
91	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
92	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
93	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
94	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
95	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
96	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
97	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
98	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
99	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
100	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
101	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
102	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
103	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
104	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002601	龙佰集团	1,444,157,659.91	8.90
2	600346	恒力石化	721,173,506.83	4.44
3	601127	小康股份	581,883,459.31	3.58
4	603613	国联股份	211,274,358.28	1.30
5	002493	荣盛石化	203,038,247.43	1.25
6	300601	康泰生物	136,584,737.42	0.84
7	002459	晶澳科技	124,330,539.10	0.77
8	601865	福莱特	118,010,220.62	0.73
9	600176	中国巨石	110,516,711.57	0.68
10	601233	桐昆股份	81,282,919.56	0.50
11	000703	恒逸石化	79,607,943.15	0.49
12	002414	高德红外	76,107,253.31	0.47
13	600584	长电科技	75,000,009.10	0.46
14	300331	苏大维格	69,727,386.00	0.43
15	605168	三人行	56,509,106.00	0.35
16	000301	东方盛虹	45,514,154.18	0.28
17	688567	孚能科技	33,289,021.32	0.21
18	002078	太阳纸业	31,927,137.45	0.20



19	688065	凯赛生物	30,391,955.18	0.19
20	603915	国茂股份	23,242,211.66	0.14

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600438	通威股份	1,352,565,778.08	8.33
2	300347	泰格医药	812,906,227.89	5.01
3	300014	亿纬锂能	740,790,148.33	4.56
4	601012	隆基股份	516,611,093.89	3.18
5	603986	兆易创新	324,922,685.48	2.00
6	300357	我武生物	296,865,021.07	1.83
7	000725	京东方 A	274,467,040.60	1.69
8	300253	卫宁健康	266,869,193.46	1.64
9	600588	用友网络	261,138,937.75	1.61
10	600584	长电科技	256,408,154.39	1.58
11	002129	中环股份	220,537,335.31	1.36
12	300896	爱美客	215,368,025.46	1.33
13	300601	康泰生物	179,439,501.00	1.11
14	002371	北方华创	176,655,799.22	1.09
15	688012	中微公司	153,991,049.53	0.95
16	300457	赢合科技	111,877,492.25	0.69
17	688981	中芯国际	107,606,046.53	0.66
18	300455	康拓红外	93,550,478.42	0.58
19	000703	恒逸石化	51,453,160.33	0.32
20	000063	中兴通讯	25,674,683.97	0.16

#### 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	4,296,810,338.58
卖出股票收入（成交）总额	6,503,861,337.19

#### 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）	11,715,700.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,715,700.00	0.08

#### 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	123117	健帆转债	117,157	11,715,700.00	0.08

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，龙麟佰利联集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到焦作市应急管理局、青岛大港海关、青岛黄岛海关等监管机构的处罚。深圳康泰生物制品股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市住房和建设局的处罚。

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

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,470,333.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	571,286.19
5	应收申购款	22,905,399.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,947,019.01

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	601127	小康股份	247,304,342.88	1.68	非公开发行 流通受限

## 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

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
广发小盘成长 混合(LOF)A	1,025,312	4,061.83	344,595,5 17.39	8.27%	3,820,048, 960.28	91.73%
广发小盘成长 混合 C	45,826	1,938.31	0.00	0.00%	88,824,87 1.40	100.00%
合计	1,071,138	3,970.98	344,595,5 17.39	8.10%	3,908,873, 831.68	91.90%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

广发小盘成长混合(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	尹瑛姬	5,984,341.00	1.73%
2	刘健生	5,245,500.00	1.52%
3	方晨	3,386,303.00	0.98%
4	王平	2,603,056.00	0.75%

5	冯学正	2,451,663.00	0.71%
6	中国人寿保险股份有限公司	2,357,195.00	0.68%
7	潘变青	2,028,635.00	0.59%
8	陈蕾	1,583,600.00	0.46%
9	郭小丹	1,561,700.00	0.45%
10	陈乃靖	1,531,238.00	0.44%

### 8.3 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	广发小盘成长混合 (LOF)A	72,184.14	0.0017%
	广发小盘成长混合 C	85,022.37	0.0957%
	合计	157,206.51	0.0037%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	广发小盘成长混合 (LOF)A	0
	广发小盘成长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发小盘成长混合 (LOF)A	0
	广发小盘成长混合 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发小盘成长混合(LOF)A	广发小盘成长混合 C
基金合同生效日（2005 年 2 月 2 日）基金份额总额	1,175,436,171.10	-
本报告期期初基金份额总额	4,486,293,806.70	99,236,603.96
本报告期基金总申购份额	1,915,503,665.21	141,140,298.22

减：本报告期基金总赎回份额	2,237,152,994.24	151,552,030.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,164,644,477.67	88,824,871.40

## 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、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	97,884,622.23	0.93%	71,582.33	0.79%	-
中金公司	1	558,630,011.60	5.32%	520,252.92	5.72%	-
财通证券	1	574,087,467.37	5.46%	534,647.63	5.88%	-
西部证券	3	720,962,439.25	6.86%	527,240.90	5.80%	-
中金财富证券	1	742,135,736.85	7.06%	542,722.95	5.97%	-
中银国际	1	830,461,578.40	7.90%	607,255.17	6.68%	-
申万宏源	1	1,114,502,343.95	10.61%	1,037,932.68	11.41%	-
渤海证券	1	1,644,547,037.43	15.65%	1,531,568.90	16.84%	-

广发证券	3	1,946,197,983.09	18.52%	1,601,159.94	17.60%	-
国信证券	1	2,277,311,114.99	21.67%	2,120,870.04	23.32%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (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、交易单元选择流程：

(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		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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	11,715,700.00	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金投资智动力（300686）非公开发行股票的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-07
2	关于广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）暂停机构投资者大额申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-11
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
4	关于广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-29
5	关于广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）恢复机构投资者大额申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-02-02
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
8	关于旗下基金投资长电科技（600584）非公开发行股票的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发小盘成长股票型证券投资基金募集的文件
2. 《广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
3. 《广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》



- 4.《广发小盘成长混合型证券投资基金（LOF）登记结算服务协议》
- 5.《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》
- 6.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 7.法律意见书
- 8.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 9.基金托管人业务资格批件和营业执照

## 11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 11.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十日