

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 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

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

§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 2016 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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。

本报告期自 2015 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	广发中证全指可选消费 ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	272,156,094.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证全指可选消费指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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	段西军	王永民

	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566
传真		020-89899158	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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	2015 年	2014 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-9,005,623.71	29,199,921.09
本期利润	-9,652,656.99	31,325,003.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0446	0.1929
本期基金份额净值增长率	46.50%	25.51%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3135	0.2551
期末基金资产净值	500,420,011.04	20,277,409.17
期末基金份额净值	1.8387	1.2551

注：（1）上述基金财务指标不包括持有人认购和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	24.94%	1.79%	26.76%	1.84%	-1.82%	-0.05%
过去六个月	-12.38%	2.72%	-9.74%	2.93%	-2.64%	-0.21%
过去一年	46.50%	2.51%	52.61%	2.63%	-6.11%	-0.12%
自基金合同生效起至今	83.87%	2.08%	96.38%	2.19%	-12.51%	-0.11%

注：业绩比较基准：中证全指可选消费指数。

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

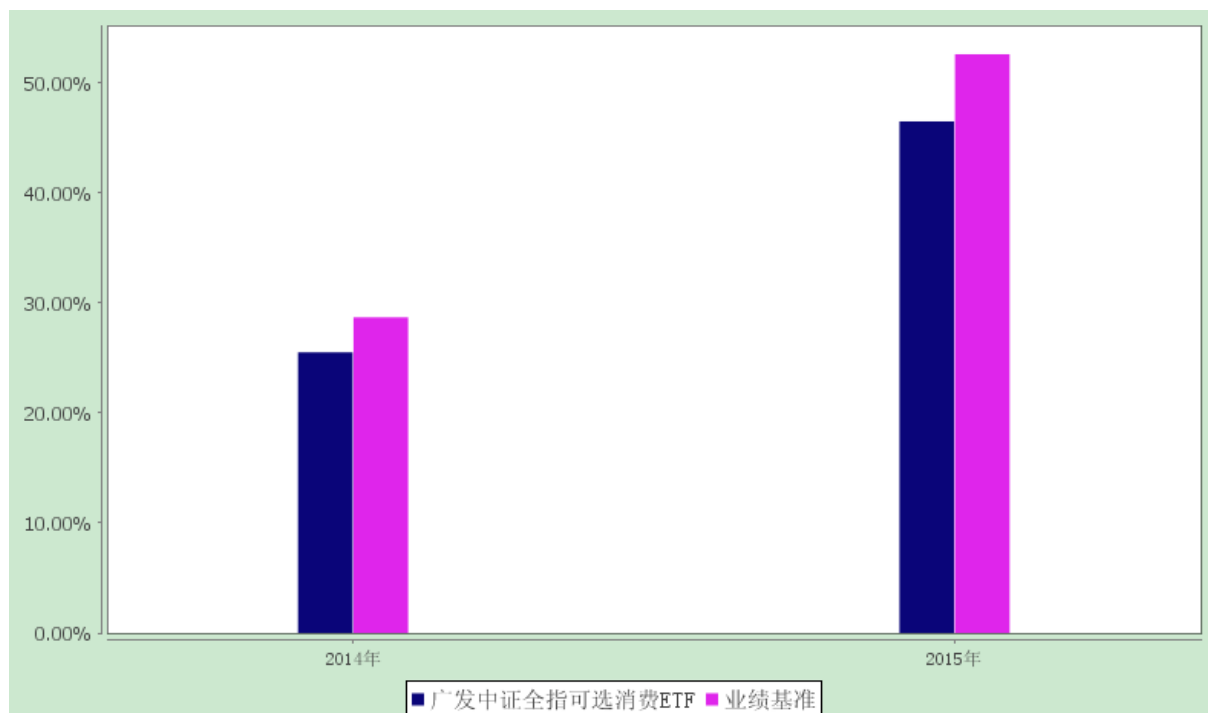
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2014年6月3日至2015年12月31日)



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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

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(2014 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（2014 年 6 月 3 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、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

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 24 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研

究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人管理八十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安

混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 3300.24 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中小板 300ETF 及联接基金的基金经理；广发深 100 指数分级基金的基金经理；广发百发 100 指数基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发	2014-06-03	-	16 年	男，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，1999 年 5 月至 2001 年 5 月在大鹏证券有限公司任研究员，2001 年 5 月至 2010 年 8 月在深圳证券信息有限公司任部门总监，2010 年 8 月 9 日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日起任广发中小板 300ETF 基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日起任广发中小板 300ETF 联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日起任广发深证 100 指数分级基金的基金经理，2014 年 6 月 3 日起任广发中证全

	<p>中证全指信息技术 ETF 及联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源 ETF 基金的基金经理；广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理；广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理；广发能源联接基金的基金经理；广发金融地产联接基金的基金经理；广发医疗指数分级基金的基金经理；广发原材料联接基金的基金经理；广发主要消费联接基金的基金经理；数量投资部总经理</p>				<p>指可选消费 ETF 基金的基金经理，2014 年 10 月 30 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2014 年 12 月 1 日起任广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 8 日起任广发中证全指信息技术 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 29 日起任广发中证全指信息技术 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 3 月 23 日起任广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理，2015 年 4 月 15 日起任广发可选消费联接基金的基金经理，2015 年 5 月 6 日起任广发医药卫生联接基金的基金经理，2015 年 6 月 25 日起任广发中证全指能源 ETF 和广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理，2015 年 7 月 1 日起任广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理，2015 年 7 月 9 日起任广发能源联接和广发金融地产联接基金的基金经理，2015 年 7 月 23 日起任广发医疗指数分级基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日起任广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理。</p>
<p>季峰</p>	<p>本基金的基金经理；广发百发 100 指数基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基</p>	<p>2014-10-21</p>	<p>-</p>	<p>6 年</p>	<p>男，中国籍，管理学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2009 年 8 月至 2011 年 8 月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作，2011 年 9 月至 2014 年 10 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员，2014 年 10 月 21 日任广发中</p>

	金经理；广发百发大数据精选混合基金的基金经理；广发百发大数据成长混合基金的基金经理；数据策略投资部副总经理				证全指可选消费 ETF 的基金经理，2014 年 11 月 24 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2015 年 2 月 13 日起任广发养老指数基金的基金经理，2015 年 3 月 18 日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理，2015 年 3 月 25 日起任广发环保指数基金的基金经理，2015 年 9 月 14 日起任广发百发大数据精选混合基金的基金经理，2015 年 11 月 18 日起任广发百发大数据成长混合基金的基金经理。
--	---	--	--	--	---

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金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，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；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。

公司监察稽核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,未发现本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

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。报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1) 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金跟踪误差来源主要有两个:一是基金成份股调整因素,报告期内的两次成份股调整策略合理,较好的控制了该因素带来的误差;二是申购和赎回因素,由于本基金规模较小,容易形成较大比例的申购和赎回,但日常申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2) 简要展望

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金净值增长率为46.50%,业绩基准收益率为52.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年,A股市场波澜壮阔,虽然下半年呈现暴跌状态,但全年沪深两市总体涨幅较大。2016年初,政府出台了“供给侧改革”的政策,说明政府不仅通过刺激需求的方式来激活经济,而且

是通过更多样的手段实现经济的有效升级，相信随着更多强有力措施的实施，中国会实现经济的稳步增长。随着国内房地产的调控与人民币升值的影响，投资与出口在我国经济增长的作用逐步减弱。经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动，这是大势所趋。而随着居民收入的提高，改善型消费品的需求旺盛，可选消费品增速明显高于必需消费品。结合政府的宏观政策，可以预见，未来可选消费的发展速度应该高于全市场的发展速度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2015 年 1 月 5 日起至 2015 年 4 月 24 日，本基金连续 74 个工作日出现资产净值低于五千万。

§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”）在对广发中证全指可选消费广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金（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德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第 P0765 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：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

资产：	-	-
银行存款	1,805,969.66	268,511.05
结算备付金	-	3,542.11
存出保证金	62,118.74	473,037.42
交易性金融资产	499,277,255.06	19,788,123.18
其中：股票投资	499,094,355.06	19,788,123.18
基金投资	-	-
债券投资	182,900.00	-
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	203.28	269.30
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	501,145,546.74	20,533,483.06
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	209,855.96	8,954.45

应付托管费	41,971.18	1,790.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	229,456.30	25,328.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	244,252.26	220,000.00
负债合计	725,535.70	256,073.89
所有者权益：	-	-
实收基金	272,156,094.00	16,156,094.00
未分配利润	228,263,917.04	4,121,315.17
所有者权益合计	500,420,011.04	20,277,409.17
负债和所有者权益总计	501,145,546.74	20,533,483.06

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.8387 元，基金份额总额 272,156,094.00 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 6 月 3 日（基金合 同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	-6,155,268.29	33,127,049.62
1.利息收入	70,746.55	522,203.97
其中：存款利息收入	70,718.49	412,660.60
债券利息收入	28.06	-
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	-	109,543.37
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-14,412,540.74	30,483,435.42
其中：股票投资收益	-19,985,188.15	29,388,517.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	5,572,647.41	1,094,917.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-647,033.28	2,125,082.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,833,559.18	-3,671.97
减：二、费用	3,497,388.70	1,802,046.33
1. 管理人报酬	1,999,774.49	452,319.26
2. 托管费	399,954.90	90,463.83
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	711,376.58	910,067.62
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	386,282.73	349,195.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-9,652,656.99	31,325,003.29
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-9,652,656.99	31,325,003.29

注：本基金合同生效日为 2014 年 6 月 3 日，上年度可比区间不完整。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	16,156,094.00	4,121,315.17	20,277,409.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,652,656.99	-9,652,656.99
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)	256,000,000.00	233,795,258.86	489,795,258.86
其中：1.基金申购款	664,000,000.00	654,748,413.00	1,318,748,413.00
2.基金赎回款	-408,000,000.00	-420,953,154.14	-828,953,154.14
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)	272,156,094.00	228,263,917.04	500,420,011.04
项目	上年度可比期间 2014 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 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)	838,156,094.00	-	838,156,094.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本	-	31,325,003.29	31,325,003.29

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)	-822,000,000.00	-27,203,688.12	-849,203,688.12
其中：1.基金申购款	22,000,000.00	4,652,889.23	26,652,889.23
2.基金赎回款	-844,000,000.00	-31,856,577.35	-875,856,577.35
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)	16,156,094.00	4,121,315.17	20,277,409.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 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: 王志伟, 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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2013]1265号《关于核准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准, 由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起, 于 2014 年 6 月 3 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 5 月 5 日至 2014 年 5 月 23 日, 本基金为交易型开放式基金, 存续期限不定, 募集资金总额为人民币 838,156,094.00 元, 有效认购户数为 7,064 户。其中, 认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 40,743.00 元, 折合基金份额 40,743.00 份, 按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：标的指数成份股、备选成份股。可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券、权证、股指期货、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。本基金的业绩比较基准：中证全指可选消费指数。

本基金的财务报表于 2016 年 3 月 23 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及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及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。

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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小

组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，估值处理标准另有规定的除外。于 2015 年 3 月 17 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- 4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- 6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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	基金管理人母公司、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
康美药业股份有限公司	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
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
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年6月3日（基金合同生效日） 至2014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	90,766,826.13	16.52%	378,221,918.22	43.39%

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 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年6月3日（基金合同生效日） 至2014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	-	-	190,700,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	82,965.42	20.20%	3,364.76	1.47%
关联方名称	上年度可比期间 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014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	344,331.30	49.55%	571.30	2.26%

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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年6月3日（基金合同 生效日）至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,999,774.49	452,319.26
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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前 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、公休假等，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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年6月3日（基金合同 生效日）至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	399,954.90	90,463.83

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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前 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。

7.4.8.3 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交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	267,600,580.00	98.33%	-	-

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年6月3日（基金合同生效日） 至2014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	1,805,969.66	53,854.12	268,511.05	395,742.55

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2015 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：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
123001	蓝标转债	2015-12-21	2016-01-08	新债流通受限	100.00	100.00	1,829.00	182,900.00	182,900.00	-

注：截至本报告期末 2015 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的股票和权证。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000058	深赛格	2015-11-04	重大事项	11.85	2016-02-25	13.04	59,400.00	838,090.52	703,890.00	-
000430	张家界	2015-12-15	重大事项	15.56	2016-01-14	14.00	32,200.00	410,577.64	501,032.00	-
000599	青岛双星	2015-12-29	重大事项	9.96	2016-01-19	8.96	80,183.00	837,519.19	798,622.68	-
000810	创维数字	2015-10-22	重大事项	12.67	2016-01-22	12.50	57,400.00	1,512,502.96	727,258.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项	12.22	-	-	118,300.00	1,765,067.16	1,445,626.00	-
000980	金马股份	2015-09-29	重大事项	6.20	-	-	108,400.00	1,003,219.99	672,080.00	-
000982	中银绒业	2014-08-25	重大事项	4.64	2016-02-25	5.10	10,540.00	46,037.64	48,905.60	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项	17.40	-	-	73,046.00	1,496,394.14	1,271,000.40	-

002084	海鸥卫浴	2015-12-18	重大事项	13.27	2016-01-15	11.94	46,375.00	631,490.96	615,396.25	-
002239	奥特佳	2015-05-25	重大事项	18.32	2016-01-05	16.49	122,870.00	1,907,652.54	2,250,978.40	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项	22.68	2016-01-11	20.41	52,155.00	969,167.54	1,182,875.40	-
002434	万里扬	2015-11-25	重大事项	23.05	-	-	34,643.00	539,646.80	798,521.15	-
002473	圣莱达	2015-05-19	重大事项	33.00	2016-02-04	29.70	24,684.00	768,934.78	814,572.00	-
002502	骅威股份	2015-08-20	重大事项	25.50	2016-01-14	23.35	27,084.00	860,780.33	690,642.00	-
002575	群兴玩具	2015-06-01	重大事项	16.56	2016-01-06	15.18	101,500.00	1,190,495.09	1,680,840.00	-
002612	朗姿股份	2015-12-23	重大事项	75.46	-	-	13,751.00	953,190.49	1,037,650.46	-
002664	信质电机	2015-12-30	重大事项	31.77	2016-03-08	28.59	33,872.00	1,050,797.37	1,076,113.44	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事项	17.21	2016-01-19	15.49	31,898.00	537,343.55	548,964.58	-
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事项	52.62	2016-03-15	47.36	30,820.00	1,647,513.28	1,621,748.40	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	15.80	-	-	105,360.00	1,662,244.49	1,664,688.00	-
300063	天龙集团	2015-12-22	重大事项	43.33	-	-	19,700.00	767,947.00	853,601.00	-
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项	49.96	2016-01-22	44.96	14,700.00	667,558.00	734,412.00	-
300247	乐金健康	2015-11-09	重大事项	20.75	2016-03-22	19.17	32,600.00	453,404.09	676,450.00	-
300336	新文化	2015-12-24	重大事项	42.00	-	-	36,522.00	1,031,514.59	1,533,924.00	-
600070	浙江富润	2015-10-08	重大事项	9.50	2016-02-18	10.45	53,900.00	661,115.46	512,050.00	-
600122	宏图高科	2015-12-25	重大事项	19.42	-	-	155,637.00	2,457,668.49	3,022,470.54	-
600156	华升股份	2015-12-08	重大事项	13.89	2016-01-12	12.50	44,149.00	522,959.10	613,229.61	-
600469	风神股份	2015-12-28	重大事项	17.19	-	-	38,450.00	641,589.00	660,955.50	-
600682	南京新百	2015-07-01	重大事项	37.53	2016-01-27	33.78	85,752.00	2,631,689.01	3,218,272.56	-
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大事项	9.92	2016-02-01	8.93	550,946.00	7,115,482.62	5,465,384.32	-

600693	东百集团	2015-12-23	重大事项	13.52	2016-01-07	12.19	30,400.00	415,857.00	411,008.00	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项	31.25	2016-03-10	29.00	39,100.00	1,362,538.87	1,221,875.00	-
600729	重庆百货	2015-07-24	重大事项	32.39	2016-01-04	29.90	37,526.00	1,150,665.42	1,215,467.14	-
600851	海欣股份	2015-12-21	重大事项	14.70	2016-01-19	13.23	125,400.00	1,403,028.22	1,843,380.00	-
600859	王府井	2015-12-21	重大事项	27.22	2016-01-04	27.22	46,353.00	1,213,393.85	1,261,728.66	-
600960	渤海活塞	2015-10-30	重大事项	10.90	2016-03-04	9.81	37,900.00	603,726.12	413,110.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	22.33	2016-01-21	20.10	351,924.00	5,587,803.09	7,858,462.92	-
601058	赛轮金宇	2015-12-28	重大事项	9.00	2016-01-12	8.10	140,539.00	1,315,527.45	1,264,851.00	-
603889	新澳股份	2015-12-01	重大事项	31.55	-	-	8,500.00	251,839.71	268,175.00	-

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 2015 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 2015 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。

7.4.10 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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

(ii)各层级金融工具公允价值

于 2015 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 445,894,143.05 元，第二层级的余额为 53,200,212.01 元，属于第三层级的余额为 182,900.00 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的债券。(2014 年 12 月 31 日：第一层级 18,931,994.58 元，第二层级 856,128.60 元，无第三层级的余额)

(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。

如附注 7.4.5.2 所述，本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层级。

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	499,094,355.06	99.59
	其中：股票	499,094,355.06	99.59
2	固定收益投资	182,900.00	0.04
	其中：债券	182,900.00	0.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	1,805,969.66	0.36
7	其他各项资产	62,322.02	0.01
8	合计	501,145,546.74	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,513,890.00	0.30
B	采矿业	-	-
C	制造业	304,330,052.43	60.81
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	65,736,622.52	13.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,034,192.45	0.21
H	住宿和餐饮业	4,541,586.29	0.91
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,162,352.89	5.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,351,725.28	1.07
L	租赁和商务服务业	28,868,692.76	5.77
M	科学研究和技术服务业	407,040.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	9,569,129.40	1.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	880,308.00	0.18
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	47,698,763.04	9.53
S	综合	-	-

	合计	499,094,355.06	99.74
--	----	----------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	000651	格力电器	816,988	18,259,681.80	3.65
2	600104	上汽集团	561,534	11,915,751.48	2.38
3	000333	美的集团	362,168	11,886,353.76	2.38
4	600637	东方明珠	280,221	10,617,573.69	2.12
5	002024	苏宁云商	752,042	10,114,964.90	2.02
6	600978	宜华木业	351,924	7,858,462.92	1.57
7	300027	华谊兄弟	160,937	6,675,666.76	1.33
8	000625	长安汽车	383,100	6,501,207.00	1.30
9	002594	比亚迪	97,419	6,273,783.60	1.25
10	000100	TCL 集团	1,450,155	6,177,660.30	1.23

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	600637	东方明珠	25,395,528.73	125.24
2	000625	长安汽车	22,327,368.46	110.11
3	600655	豫园商城	8,684,930.71	42.83
4	601888	中国国旅	8,183,591.26	40.36
5	002594	比亚迪	6,526,924.11	32.19
6	000651	格力电器	6,496,907.65	32.04
7	600177	雅戈尔	6,408,026.07	31.60
8	600741	华域汽车	6,144,998.71	30.30
9	002344	海宁皮城	5,622,346.65	27.73
10	000587	金叶珠宝	4,383,588.12	21.62
11	600398	海澜之家	3,862,206.99	19.05

12	000062	深圳华强	3,695,046.02	18.22
13	000333	美的集团	3,609,425.88	17.80
14	002625	龙生股份	3,590,399.82	17.71
15	600066	宇通客车	3,396,911.90	16.75
16	600104	上汽集团	3,388,326.00	16.71
17	002707	众信旅游	3,078,581.25	15.18
18	000607	华媒控股	2,762,345.88	13.62
19	600712	南宁百货	2,508,940.00	12.37
20	000810	创维数字	2,415,744.00	11.91
21	600877	中国嘉陵	2,382,556.00	11.75
22	002612	朗姿股份	2,148,992.90	10.60
23	600086	东方金钰	2,133,472.98	10.52
24	600858	银座股份	2,123,622.60	10.47
25	600959	江苏有线	2,110,037.59	10.41
26	002739	万达院线	2,107,625.00	10.39
27	002345	潮宏基	1,961,927.00	9.68
28	600690	青岛海尔	1,909,617.00	9.42
29	002494	华斯股份	1,905,772.52	9.40
30	300178	腾邦国际	1,879,118.00	9.27
31	002572	索菲亚	1,864,880.80	9.20
32	000516	国际医学	1,856,716.00	9.16
33	600037	歌华有线	1,840,043.99	9.07
34	002413	雷科防务	1,828,553.10	9.02
35	002563	森马服饰	1,813,643.66	8.94
36	600107	美尔雅	1,807,261.00	8.91
37	603600	永艺股份	1,732,248.50	8.54
38	603766	隆鑫通用	1,727,570.00	8.52
39	000888	峨眉山 A	1,714,073.00	8.45
40	000889	茂业通信	1,694,893.97	8.36
41	300413	快乐购	1,692,628.00	8.35
42	000560	昆百大 A	1,624,688.53	8.01
43	300364	中文在线	1,563,087.92	7.71
44	600814	杭州解百	1,536,742.00	7.58
45	002418	康盛股份	1,493,384.00	7.36
46	002502	骅威股份	1,482,721.00	7.31
47	000719	大地传媒	1,406,235.00	6.93
48	000100	TCL 集团	1,403,455.00	6.92
49	002101	广东鸿图	1,367,867.36	6.75
50	000801	四川九洲	1,321,064.36	6.51
51	000008	神州高铁	1,308,622.80	6.45
52	600628	新世界	1,300,325.00	6.41
53	600633	浙报传媒	1,272,127.36	6.27
54	600960	渤海活塞	1,259,626.00	6.21
55	002420	毅昌股份	1,230,060.98	6.07

56	002076	雪 莱 特	1,197,635.35	5.91
57	300148	天舟文化	1,195,711.00	5.90
58	600448	华纺股份	1,176,371.00	5.80
59	300291	华录百纳	1,176,247.40	5.80
60	000996	中国中期	1,167,459.54	5.76
61	000927	*ST 夏利	1,126,015.79	5.55
62	600687	刚泰控股	1,101,569.35	5.43
63	002543	万和电气	1,085,415.10	5.35
64	000524	岭南控股	1,082,400.00	5.34
65	002616	长青集团	1,074,992.00	5.30
66	600694	大商股份	1,057,583.00	5.22
67	600839	四川长虹	1,048,729.00	5.17
68	000156	华数传媒	1,040,950.45	5.13
69	300336	新文化	1,028,560.60	5.07
70	000980	金马股份	1,000,847.00	4.94
71	300403	地尔汉宇	994,515.80	4.90
72	000559	万向钱潮	993,698.70	4.90
73	600054	黄山旅游	978,499.00	4.83
74	002085	万丰奥威	948,761.00	4.68
75	002426	胜利精密	932,546.96	4.60
76	600660	福耀玻璃	928,596.02	4.58
77	600138	中青旅	928,496.00	4.58
78	600704	物产中大	893,881.00	4.41
79	000430	张家界	885,896.00	4.37
80	600358	国旅联合	876,613.28	4.32
81	000025	特 力 A	857,077.65	4.23
82	300027	华谊兄弟	855,786.00	4.22
83	603306	华懋科技	853,930.00	4.21
84	002593	日上集团	851,074.00	4.20
85	002721	金一文化	850,802.00	4.20
86	600303	曙光股份	836,537.00	4.13
87	600729	重庆百货	831,701.00	4.10
88	002290	禾盛新材	829,775.00	4.09
89	000850	华茂股份	824,369.00	4.07
90	600693	东百集团	803,610.00	3.96
91	002071	长城影视	793,305.00	3.91
92	002154	报 喜 鸟	780,004.00	3.85
93	603166	福达股份	774,786.00	3.82
94	002731	萃华珠宝	773,884.00	3.82
95	601098	中南传媒	767,961.01	3.79
96	300063	天龙集团	767,947.00	3.79
97	600229	城市传媒	767,528.00	3.79
98	000700	模塑科技	743,084.00	3.66
99	603788	宁波高发	742,890.20	3.66

100	600859	王府井	737,420.35	3.64
101	300217	东方电热	729,198.91	3.60
102	002260	德奥通航	707,375.60	3.49
103	601010	文峰股份	704,897.00	3.48
104	000541	佛山照明	700,516.00	3.45
105	603099	长白山	687,826.00	3.39
106	600609	金杯汽车	677,068.94	3.34
107	300133	华策影视	667,899.00	3.29
108	300242	明家科技	667,558.00	3.29
109	000030	富奥股份	659,737.00	3.25
110	002033	丽江旅游	657,219.50	3.24
111	603889	新澳股份	654,505.20	3.23
112	600148	长春一东	654,295.37	3.23
113	002284	亚太股份	653,277.98	3.22
114	601258	庞大集团	649,567.00	3.20
115	000800	一汽轿车	641,681.00	3.16
116	002419	天虹商场	638,627.99	3.15
117	600599	熊猫金控	630,227.00	3.11
118	600851	海欣股份	602,719.00	2.97
119	600088	中视传媒	595,267.00	2.94
120	600821	津劝业	590,617.00	2.91
121	600493	凤竹纺织	589,307.00	2.91
122	000017	深中华 A	586,580.00	2.89
123	000069	华侨城 A	584,182.00	2.88
124	300329	海伦钢琴	579,716.00	2.86
125	600551	时代出版	563,771.00	2.78
126	603555	贵人鸟	540,787.00	2.67
127	600373	中文传媒	540,435.80	2.67
128	300043	互动娱乐	537,590.00	2.65
129	000158	常山股份	530,576.00	2.62
130	000581	威孚高科	526,302.00	2.60
131	002763	汇洁股份	517,887.00	2.55
132	002048	宁波华翔	515,387.00	2.54
133	600166	福田汽车	513,556.62	2.53
134	603558	健盛集团	508,366.00	2.51
135	002394	联发股份	504,812.48	2.49
136	601689	拓普集团	503,606.00	2.48
137	002035	华帝股份	502,832.00	2.48
138	600006	东风汽车	499,919.68	2.47
139	603818	曲美家居	496,592.00	2.45
140	002087	新野纺织	496,273.00	2.45
141	002705	新宝股份	491,421.46	2.42
142	002699	美盛文化	491,172.55	2.42
143	002508	老板电器	486,232.00	2.40

144	601718	际华集团	482,047.00	2.38
145	300160	秀强股份	479,657.00	2.37
146	002406	远东传动	479,607.00	2.37
147	002213	特 尔 佳	473,714.00	2.34
148	300022	吉峰农机	471,545.00	2.33
149	603898	好莱客	466,681.00	2.30
150	600220	江苏阳光	466,477.00	2.30
151	600060	海信电器	465,206.00	2.29
152	300432	富临精工	464,923.00	2.29
153	000622	恒立实业	462,702.00	2.28
154	300473	德尔股份	460,728.00	2.27
155	002664	信质电机	455,605.60	2.25
156	300058	蓝色光标	453,966.76	2.24
157	600653	申华控股	451,512.00	2.23
158	601633	长城汽车	450,511.20	2.22
159	002712	思美传媒	441,228.00	2.18
160	000726	鲁 泰 A	436,041.00	2.15
161	000572	海马汽车	435,559.00	2.15
162	300251	光线传媒	433,439.00	2.14
163	002404	嘉欣丝绸	427,694.50	2.11
164	000593	大通燃气	426,507.00	2.10
165	002715	登云股份	426,333.00	2.10
166	600418	江淮汽车	425,443.00	2.10
167	002283	天润曲轴	421,171.00	2.08
168	000802	北京文化	420,950.00	2.08
169	601311	骆驼股份	420,781.00	2.08
170	300237	美晨科技	418,591.00	2.06
171	601801	皖新传媒	416,520.98	2.05
172	002762	金发拉比	415,265.00	2.05
173	002400	省广股份	412,200.00	2.03
174	603808	歌力思	409,119.00	2.02
175	300320	海达股份	407,493.60	2.01

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	000651	格力电器	12,362,209.38	60.97
2	600104	上汽集团	7,453,513.00	36.76
3	000333	美的集团	5,967,057.92	29.43
4	600832	大华农	5,897,010.24	29.08
5	002024	苏宁云商	3,934,268.98	19.40
6	002594	比亚迪	3,695,913.85	18.23
7	600690	青岛海尔	3,367,727.39	16.61
8	000625	长安汽车	3,329,233.90	16.42
9	000100	TCL 集团	3,079,255.64	15.19
10	600704	物产中大	3,073,943.00	15.16
11	601633	长城汽车	2,689,557.00	13.26
12	600482	风帆股份	2,661,451.44	13.13
13	600637	东方明珠	2,608,527.68	12.86
14	300251	光线传媒	2,587,228.00	12.76
15	600177	雅戈尔	2,462,887.00	12.15
16	600839	四川长虹	2,258,384.00	11.14
17	000679	大连友谊	2,109,790.00	10.40
18	300144	宋城演艺	2,047,424.00	10.10
19	300295	三六五网	2,028,362.60	10.00
20	300027	华谊兄弟	1,953,528.34	9.63
21	000917	电广传媒	1,935,924.00	9.55
22	601718	际华集团	1,913,181.00	9.44
23	000017	深中华 A	1,880,868.69	9.28
24	600415	小商品城	1,848,780.00	9.12
25	600400	红豆股份	1,783,551.52	8.80
26	002269	美邦服饰	1,782,011.50	8.79
27	600066	宇通客车	1,775,706.48	8.76
28	002488	金固股份	1,669,660.00	8.23
29	600660	福耀玻璃	1,664,661.40	8.21
30	000927	*ST 夏利	1,662,219.23	8.20
31	000581	威孚高科	1,621,813.21	8.00
32	000793	华闻传媒	1,498,894.26	7.39
33	300005	探路者	1,484,674.00	7.32
34	600741	华域汽车	1,471,762.00	7.26
35	600676	交运股份	1,465,140.18	7.23
36	601098	中南传媒	1,456,533.74	7.18
37	000008	神州高铁	1,450,438.56	7.15
38	000069	华侨城 A	1,412,957.00	6.97
39	000559	万向钱潮	1,401,925.38	6.91
40	600398	海澜之家	1,351,344.93	6.66
41	600694	大商股份	1,343,565.73	6.63

42	600699	均胜电子	1,319,870.41	6.51
43	600831	广电网络	1,305,163.00	6.44
44	601311	骆驼股份	1,300,961.00	6.42
45	002292	奥飞动漫	1,274,318.00	6.28
46	600037	歌华有线	1,264,143.00	6.23
47	300178	腾邦国际	1,249,107.00	6.16
48	600418	江淮汽车	1,207,378.90	5.95
49	002640	跨境通	1,182,533.00	5.83
50	600655	豫园商城	1,157,183.65	5.71
51	002681	奋达科技	1,155,398.60	5.70
52	601888	中国国旅	1,149,430.00	5.67
53	600060	海信电器	1,147,602.00	5.66
54	002489	浙江永强	1,140,182.00	5.62
55	600790	轻纺城	1,137,791.00	5.61
56	002190	成飞集成	1,116,434.00	5.51
57	601799	星宇股份	1,113,706.72	5.49
58	600166	福田汽车	1,078,893.00	5.32
59	002005	德豪润达	1,074,004.56	5.30
60	002715	登云股份	1,062,096.75	5.24
61	002265	西仪股份	1,050,051.77	5.18
62	002616	长青集团	1,028,791.76	5.07
63	002293	罗莱生活	1,018,393.00	5.02
64	000593	大通燃气	1,015,799.50	5.01
65	002516	旷达科技	1,002,542.00	4.94
66	002429	兆驰股份	989,377.00	4.88
67	002213	特尔佳	977,762.00	4.82
68	002723	金莱特	962,355.14	4.75
69	600653	申华控股	955,638.00	4.71
70	000800	一汽轿车	955,145.91	4.71
71	300133	华策影视	950,929.00	4.69
72	600651	飞乐音响	931,107.29	4.59
73	002400	省广股份	922,502.58	4.55
74	002615	哈尔斯	893,453.12	4.41
75	002674	兴业科技	879,137.48	4.34
76	600138	中青旅	869,634.00	4.29
77	300258	精锻科技	869,134.80	4.29
78	002048	宁波华翔	864,880.00	4.27
79	002687	乔治白	862,038.43	4.25
80	000541	佛山照明	860,915.00	4.25
81	603766	隆鑫通用	855,073.00	4.22
82	600373	中文传媒	851,282.70	4.20
83	600742	一汽富维	848,466.00	4.18
84	600006	东风汽车	840,241.00	4.14
85	600327	大东方	831,467.00	4.10

86	600220	江苏阳光	829,395.00	4.09
87	000560	昆百大 A	812,165.58	4.01
88	000829	天音控股	806,316.00	3.98
89	002662	京威股份	801,707.00	3.95
90	000016	深康佳 A	793,319.00	3.91
91	000802	北京文化	781,692.50	3.85
92	600261	阳光照明	777,372.00	3.83
93	600633	浙报传媒	776,966.00	3.83
94	002070	众和股份	769,468.40	3.79
95	600858	银座股份	769,140.00	3.79
96	603009	北特科技	761,190.00	3.75
97	600555	九龙山	760,094.00	3.75
98	300100	双林股份	745,360.35	3.68
99	600135	乐凯胶片	743,756.00	3.67
100	002242	九阳股份	742,244.50	3.66
101	002574	明牌珠宝	740,195.00	3.65
102	603001	奥康国际	734,057.00	3.62
103	601566	九牧王	718,948.00	3.55
104	002508	老板电器	713,247.00	3.52
105	000887	中鼎股份	709,355.00	3.50
106	000665	湖北广电	704,023.70	3.47
107	000158	常山股份	703,269.00	3.47
108	601928	凤凰传媒	696,241.00	3.43
109	002102	冠福股份	691,115.00	3.41
110	002721	金一文化	689,849.00	3.40
111	000726	鲁 泰 A	689,636.08	3.40
112	002345	潮宏基	687,274.00	3.39
113	600818	中路股份	682,614.00	3.37
114	000987	广州友谊	676,416.00	3.34
115	601801	皖新传媒	667,455.00	3.29
116	002448	中原内配	657,297.00	3.24
117	600891	秋林集团	656,078.08	3.24
118	600682	南京新百	651,750.00	3.21
119	002590	万安科技	645,674.94	3.18
120	002712	思美传媒	636,535.80	3.14
121	600280	中央商场	632,615.41	3.12
122	600612	老凤祥	630,662.00	3.11
123	002426	胜利精密	630,201.00	3.11
124	001696	宗申动力	629,327.00	3.10
125	002251	步步高	627,160.00	3.09
126	600122	宏图高科	615,282.10	3.03
127	002003	伟星股份	609,572.00	3.01
128	601118	海南橡胶	598,495.00	2.95
129	002561	徐家汇	597,248.00	2.95

130	000839	中信国安	596,864.00	2.94
131	601238	广汽集团	595,518.00	2.94
132	000516	国际医学	589,587.00	2.91
133	002344	海宁皮城	587,415.00	2.90
134	000587	金叶珠宝	586,815.30	2.89
135	600825	新华传媒	586,263.00	2.89
136	000889	茂业通信	583,898.14	2.88
137	600088	中视传媒	568,316.00	2.80
138	000025	特力A	567,495.00	2.80
139	002571	德力股份	567,469.42	2.80
140	600838	上海九百	557,914.00	2.75
141	002029	七匹狼	557,331.00	2.75
142	002277	友阿股份	557,197.00	2.75
143	600757	长江传媒	555,208.00	2.74
144	600337	美克家居	547,335.00	2.70
145	002355	兴民钢圈	546,848.00	2.70
146	002126	银轮股份	540,891.03	2.67
147	600335	国机汽车	538,851.00	2.66
148	002381	双箭股份	538,332.00	2.65
149	002045	国光电器	534,307.00	2.63
150	600515	海岛建设	528,000.00	2.60
151	002540	亚太科技	521,616.00	2.57
152	300291	华录百纳	520,552.00	2.57
153	601929	吉视传媒	509,946.34	2.51
154	300375	鹏翎股份	506,735.00	2.50
155	000550	江铃汽车	504,722.28	2.49
156	600857	宁波中百	503,903.67	2.49
157	600824	益民集团	497,548.20	2.45
158	601007	金陵饭店	496,611.35	2.45
159	002284	亚太股份	494,818.00	2.44
160	603123	翠微股份	485,861.20	2.40
161	600706	曲江文旅	485,631.34	2.39
162	600686	金龙汽车	482,795.00	2.38
163	600480	凌云股份	482,413.00	2.38
164	002187	广百股份	482,194.00	2.38
165	300058	蓝色光标	477,527.00	2.35
166	002536	西泵股份	475,981.00	2.35
167	000501	鄂武商A	455,806.00	2.25
168	002181	粤传媒	455,143.40	2.24
169	600113	浙江东日	448,663.19	2.21
170	000417	合肥百货	447,136.50	2.21
171	600303	曙光股份	445,918.00	2.20
172	002699	美盛文化	439,731.00	2.17
173	002085	万丰奥威	439,247.00	2.17

174	000058	深 赛 格	437,474.60	2.16
175	601777	力帆股份	436,922.00	2.15
176	002238	天威视讯	435,578.00	2.15
177	000062	深圳华强	425,612.15	2.10
178	000521	美菱电器	422,053.00	2.08
179	601599	鹿港科技	421,800.34	2.08
180	000851	高鸿股份	418,208.00	2.06
181	603600	永艺股份	417,095.00	2.06
182	600851	海欣股份	416,980.20	2.06
183	000801	四川九洲	413,432.00	2.04
184	002725	跃岭股份	412,359.60	2.03
185	002154	报 喜 鸟	409,621.00	2.02
186	600987	航民股份	407,040.00	2.01

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

买入股票的成本（成交）总额	313,054,907.48
卖出股票的收入（成交）总额	248,167,468.15

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	-	-
	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）	182,900.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	182,900.00	0.04
----	----	------------	------

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	123001	蓝标转债	1,829	182,900.00	0.04

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

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	62,118.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,322.02

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

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	600978	宜华木业	7,858,462.92	1.57	重大事项

§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
255	1,067,278.80	267,608,842.00	98.33%	4,547,252.00	1.67%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	267,600,580.00	98.33%
2	王浩	860,019.00	0.32%
3	朱益	384,600.00	0.14%
4	邝少吟	100,001.00	0.04%
5	李桂青	100,000.00	0.04%
6	何凤珍	340,248.00	0.13%
7	张建国	142,800.00	0.05%
8	朱晓晔	107,000.00	0.04%
9	陈翠云	100,006.00	0.04%
10	苑桂花	100,006.00	0.04%

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(2014年6月3日)基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	16,156,094.00
本报告期基金总申购份额	664,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	408,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	272,156,094.00

§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

2015 年 4 月 30 日，包林生不再担任本基金管理人的副总经理。2015 年 5 月 23 日，肖雯不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。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

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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	
广发证券	3	90,766,826.13	16.52%	82,965.42	20.20%	新增 1 个
安信证券	1	87,878,144.65	15.99%	62,428.26	15.20%	-
海通证券	2	22,491.00	0.00%	15.98	0.00%	新增 1 个
招商证券	1	22,294,531.69	4.06%	16,282.30	3.96%	新增 1 个
银河证券	2	208,957,850.22	38.03%	149,778.34	36.47%	-
东莞证券	1	139,508,316.46	25.39%	99,261.49	24.17%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
大同证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
民族证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

注：1、交易席位选择标准：

(1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

(2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

(4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

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

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

广发基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日