

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券 投资基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	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	13
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
8 基金份额持有人信息	48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录	51
11.2 存放地点	52
11.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 6 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	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
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街 1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街 1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-12,694,480.37
本期利润	-98,189,601.38
加权平均基金份额本期利润	-0.3608
本期加权平均净值利润率	-24.94%
本期基金份额净值增长率	-19.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	72,626,491.59
期末可供分配基金份额利润	0.2669
期末基金资产净值	402,230,409.66
期末基金份额净值	1.4779
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	47.80%

注：（1）上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

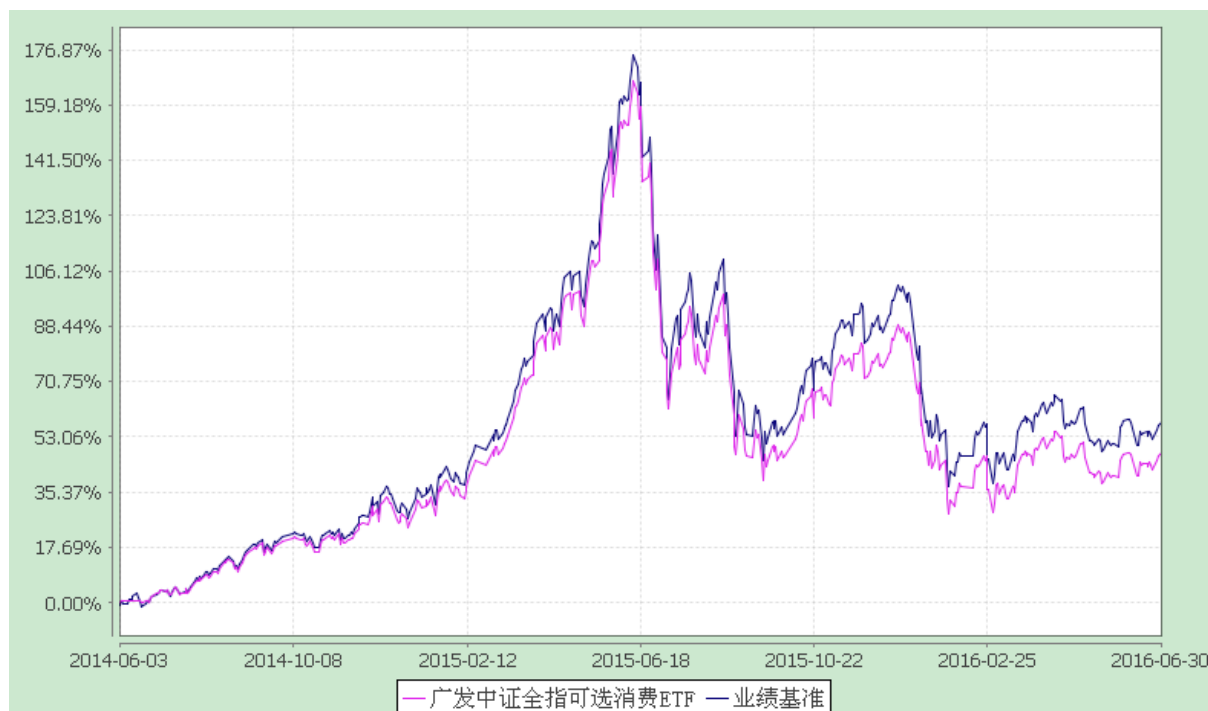
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.95%	1.40%	1.50%	1.43%	0.45%	-0.03%
过去三个月	-1.04%	1.46%	-1.75%	1.47%	0.71%	-0.01%
过去六个月	-19.62%	2.36%	-19.74%	2.38%	0.12%	-0.02%
过去一年	-29.57%	2.55%	-27.56%	2.67%	-2.01%	-0.12%
自基金合同生效起至今	47.80%	2.15%	57.61%	2.24%	-9.81%	-0.09%

注：业绩比较基准：中证全指可选消费指数收益率。

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历史走势对比图
 （2014年6月3日至2016年6月30日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金境内投资管理人、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25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、机构理财部、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2016年6月30日，本基金管理人管理九十八只开放式基金——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、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金，管理资产规模为 2341 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；广发中证全指信息技术 ETF 及联接基金的基金经理；广发中	2014-06-03	-	17 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 2016 年 5 月 29 日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

	<p>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；数量投资部副总经理</p>				<p>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，2016 年 5 月 30 日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理。</p>
季峰	<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</p>	2014-10-21	2016-05-26	7 年	<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 日至 2016 年 5 月 25 日任广发中证全指可选消费 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 日至 2016 年 5 月</p>

					25 日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 日至 2016 年 5 月 25 日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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中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 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%，未发现本基金存在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

（1）投资策略

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

（2）运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素，作为 ETF 基金，由于本基金规模较小，申购赎回对本基金的跟踪效果有较大影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-19.62%，同期业绩基准收益率为-19.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1 季度受汇率波动、经济下滑、大股东减持等多重因素影响，市场遭遇了股汇双杀的局面，A 股市场在 1 月份与 2 月份下跌较多，投资者情绪极度悲观，随着外部环境的改善，汇率的稳定，各种经济指标的回暖，3 月份市场迎来了幅度较大的反弹。2 季度市场维持震荡格局，并随着英国脱欧、外汇贬值等风险的进一步释放，以及企业盈利增速符合预期，市场出现了震荡上行的走势。中国经济“L”走势成为共识，经济转型正有序进行，预计新兴产业的企业未来盈利也会逐步企稳。随着国内房地产的调控与劳动力成本提高的影响，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。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“基金的收益与分配”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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,390,780.48	1,805,969.66
结算备付金		-	-
存出保证金		3,177.27	62,118.74
交易性金融资产	6.4.7.2	400,995,976.15	499,277,255.06
其中：股票投资		400,691,039.55	499,094,355.06
基金投资		-	-
债券投资		304,936.60	182,900.00
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		103,097.18	-
应收利息	6.4.7.5	1,009.78	203.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		404,494,040.86	501,145,546.74
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
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		1,703,095.91	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		162,129.89	209,855.96
应付托管费		32,425.98	41,971.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	127,500.32	229,456.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	238,479.10	244,252.26
负债合计		2,263,631.20	725,535.70
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	272,156,094.00	272,156,094.00
未分配利润	6.4.7.1 0	130,074,315.66	228,263,917.04
所有者权益合计		402,230,409.66	500,420,011.04
负债和所有者权益总计		404,494,040.86	501,145,546.74

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4779 元，基金份额总额

272,156,094.00 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-96,486,027.46	83,757,454.01
1. 利息收入		7,920.17	33,440.94
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	7,479.22	33,440.94
债券利息收入		440.95	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,998,826.62	71,366,858.79
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-14,294,367.05	68,375,188.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	19,467.55	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	3,276,072.88	2,991,670.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-85,495,121.01	4,699,881.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-	7,657,272.43
减：二、费用		1,703,573.92	1,458,681.28
1. 管理人报酬		980,150.31	762,236.54
2. 托管费		196,029.99	152,447.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	109,081.67	361,544.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	418,311.95	182,452.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-98,189,601.38	82,298,772.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-98,189,601.38	82,298,772.73

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	272,156,094.00	228,263,917.04	500,420,011.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-98,189,601.38	-98,189,601.38
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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	130,074,315.66	402,230,409.66
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	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）	-	82,298,772.73	82,298,772.73
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）	284,000,000.00	243,315,534.98	527,315,534.98
其中：1. 基金申购款	512,000,000.00	545,526,741.12	1,057,526,741.12
2. 基金赎回款	-228,000,000.00	-302,211,206.14	-530,211,206.14
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）	300,156,094.00	329,735,622.88	629,891,716.88

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8月22日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
3. 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。
4. 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。

5. 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。

6. 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。

7. 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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3,390,780.48
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,390,780.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	484,739,148.24	400,691,039.55	-84,048,108.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	273,900.00	304,936.60
	银行间市场	-	-
	合计	273,900.00	304,936.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	485,013,048.24	400,995,976.15	-84,017,072.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	553.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1.26
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	454.67
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,009.78

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	127,500.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	127,500.32

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,850.46
应付指数使用费	29,628.64
合计	238,479.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	272,156,094.00	272,156,094.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	272,156,094.00	272,156,094.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	85,320,971.96	142,942,945.08	228,263,917.04
本期利润	-12,694,480.37	-85,495,121.01	-98,189,601.38
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,626,491.59	57,447,824.07	130,074,315.66

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	6,917.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	98.47
结算备付金利息收入	462.76
其他	-
合计	7,479.22

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	40,852,415.97
减：卖出股票成本总额	55,146,783.02
买卖股票差价收入	-14,294,367.05

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	76,381.89
减：卖出债券（、债转股及债券到期	56,900.00

兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	14.34
买卖债券差价收入	19,467.55

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,276,072.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,276,072.88

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-85,495,121.01
——股票投资	-85,526,157.61
——债券投资	31,036.60
——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	-
合计	-85,495,121.01

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	109,081.67
银行间市场交易费用	-
合计	109,081.67

6.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

审计费用	29,835.26
信息披露费	299,179.94
银行汇划费	652.44
上市费	29,835.26
指数使用费	58,809.05
合计	418,311.95

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发中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

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,552,304.00	1.87%	-	-

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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	1,445.67	2.37%	-	-

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	980,150.31	762,236.54
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	196,029.99	152,447.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	267,435,880.00	98.27%	267,600,580.00	98.33%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,390,780.48	6,917.99	5,976,015.76	24,292.75

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	002101	广东鸿图	配股认购	6,090.00	58,220.40
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-

注：截至本报告期末 2016 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债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000025	特力A	2016-06-29	重大事项停牌	73.92	2016-07-05	73.00	9,100.00	854,935.65	672,672.00	-
000524	岭南控股	2016-04-05	重大事项停牌	13.08	-	-	22,900.00	501,293.10	299,532.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	19.22	-	-	816,988.00	18,546,637.51	15,702,509.36	-
000757	浩物股份	2016-03-29	重大事项停牌	10.56	-	-	53,675.00	551,576.63	566,808.00	-

000802	北京文化	2016-06-01	重大事项停牌	23.52	2016-08-22	21.86	46,276.00	1,052,963.21	1,088,411.52	-
002071	长城影视	2016-06-16	重大事项停牌	13.64	-	-	51,900.00	1,012,138.40	707,916.00	-
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项停牌	21.62	-	-	26,390.00	572,014.67	570,551.80	-
002190	成飞集成	2016-04-21	重大事项停牌	35.44	2016-07-12	38.98	29,760.00	1,349,687.20	1,054,694.40	-
002283	天润曲轴	2016-03-23	重大事项停牌	17.15	-	-	66,300.00	1,183,608.98	1,137,045.00	-
002355	兴民钢圈	2016-05-12	重大事项停牌	19.35	-	-	52,711.00	461,183.58	1,019,957.85	-
002574	明牌珠宝	2016-06-27	重大事项停牌	13.04	-	-	43,462.00	653,719.27	566,744.48	-
002762	金发拉比	2016-01-18	重大事项停牌	52.44	2016-07-11	57.68	6,000.00	415,265.00	314,640.00	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事项停牌	34.99	2016-08-12	36.69	14,700.00	667,558.00	514,353.00	-
300413	快乐购	2016-06-20	重大事项停牌	24.35	-	-	19,800.00	871,531.18	482,130.00	-
600113	浙江东日	2016-03-25	重大事项停牌	12.05	2016-07-25	13.24	33,423.00	439,310.40	402,747.15	-
600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项停牌	5.52	2016-07-01	5.62	384,700.00	2,621,911.74	2,123,544.00	-
600358	国旅联合	2016-04-05	重大事项停牌	13.50	2016-08-05	12.57	57,400.00	876,613.28	774,900.00	-
600640	号百控股	2016-04-18	重大事项停牌	16.79	2016-08-22	18.44	36,370.00	842,552.73	610,652.30	-
600665	申华控股	2016-05-05	重大事项停牌	3.93	-	-	296,517.00	1,870,226.22	1,165,311.81	-
600738	兰州民百	2016-03-23	重大事项停牌	8.49	2016-07-11	9.34	43,900.00	404,964.31	372,711.00	-
600877	中国嘉陵	2016-03-03	重大事项停牌	7.38	2016-08-12	7.03	93,400.00	1,011,360.28	689,292.00	-
601599	鹿港文化	2016-04-11	重大事项停牌	11.34	2016-07-06	10.21	77,492.00	619,552.01	878,759.28	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	3,025.00	10,496.75	63,283.00	-
603398	邦宝益智	2016-06-28	重大事项停牌	36.94	2016-07-08	39.00	10,400.00	404,442.00	384,176.00	-
603519	立霸股份	2016-03-21	重大事项停牌	21.90	2016-08-04	23.44	8,000.00	208,178.00	175,200.00	-
603808	歌力思	2016-04-20	重大事项停牌	29.13	2016-07-20	31.50	12,600.00	409,119.00	367,038.00	-

603838	四通股份	2016-03-24	重大事项停牌	16.20	-	-	13,400.00	255,948.00	217,080.00	-
--------	------	------------	--------	-------	---	---	-----------	------------	------------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，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。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核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 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	107,953.30	-

AAA 以下	196,983.30	182,900.00
未评级	-	-
合计	304,936.60	182,900.00

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剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债及央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会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，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

本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。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,390,780.48	-	-	-	3,390,780.48
存出保证金	3,177.27	-	-	-	3,177.27
交易性金融资产	304,936.60	-	-	400,691,039.55	400,995,976.15
应收证券清算款	-	-	-	103,097.18	103,097.18
应收利息	-	-	-	1,009.78	1,009.78

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,698,894.35	-	-	400,795,146.51	404,494,040.86
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,703,095.91	1,703,095.91
应付管理人报酬	-	-	-	162,129.89	162,129.89
应付托管费	-	-	-	32,425.98	32,425.98
应付交易费用	-	-	-	127,500.32	127,500.32
其他负债	-	-	-	238,479.10	238,479.10
负债总计	-	-	-	2,263,631.20	2,263,631.20
利率敏感度缺口	3,698,894.35	-	-	398,531,515.31	402,230,409.66
上年度末					
2015 年 12 月	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
31 日					
资产					
银行存款	1,805,969.66	-	-	-	1,805,969.66
存出保证金	62,118.74	-	-	-	62,118.74
交易性金融资产	182,900.00	-	-	499,094,355.06	499,277,255.06
应收利息	-	-	-	203.28	203.28
资产总计	2,050,988.40	-	-	499,094,558.34	501,145,546.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	209,855.96	209,855.96
应付托管费	-	-	-	41,971.18	41,971.18
应付交易费用	-	-	-	229,456.30	229,456.30
其他负债	-	-	-	244,252.26	244,252.26
负债总计	-	-	-	725,535.70	725,535.70
利率敏感度缺口	2,050,988.40	-	-	498,369,022.64	500,420,011.04

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

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-4, 107. 75	-2, 463. 82
	市场利率下降 25 个基点	4, 107. 75	2, 463. 82

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. 3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	400, 691, 039. 55	99. 62	499, 094, 355. 06	99. 74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	304, 936. 60	0. 08	182, 900. 00	0. 04
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	400, 995, 976. 15	99. 69	499, 277, 255. 06	99. 77

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	18,375,687.67	24,333,345.28
	业绩比较基准下降 5%	-18,375,687.67	-24,333,345.28

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参考最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 368,044,777.12 元，第二层级的余额为 32,922,659.95 元，第三层级的余额为 28,539.08 元（2015 年 12 月 31 日：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）。

(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。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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	400,691,039.55	99.06
	其中：股票	400,691,039.55	99.06
2	固定收益投资	304,936.60	0.08

	其中：债券	304,936.60	0.08
	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	3,390,780.48	0.84
7	其他各项资产	107,284.23	0.03
8	合计	404,494,040.86	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 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

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	1,086,416.50	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	247,969,495.82	61.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	63,283.00	0.02
F	批发和零售业	49,689,142.92	12.35
G	交通运输、仓储和邮政业	634,878.35	0.16
H	住宿和餐饮业	2,963,397.90	0.74
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,453,487.77	5.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,101,578.54	1.52
L	租赁和商务服务业	19,327,273.96	4.81
M	科学研究和技术服务业	389,950.10	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	6,585,584.17	1.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	600,484.00	0.15
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	44,826,066.52	11.14
S	综合	-	-
	合计	400,691,039.55	99.62

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	816,988	15,702,509.36	3.90
2	000333	美的集团	527,352	12,508,789.44	3.11
3	600104	上汽集团	545,034	11,058,739.86	2.75
4	002024	苏宁云商	613,642	6,664,152.12	1.66
5	002594	比亚迪	102,819	6,272,987.19	1.56
6	600637	东方明珠	216,421	5,252,537.67	1.31
7	002739	万达院线	64,232	5,132,136.80	1.28
8	000625	长安汽车	371,800	5,082,506.00	1.26
9	600690	青岛海尔	503,046	4,467,048.48	1.11
10	300027	华谊兄弟	321,140	4,348,235.60	1.08
11	600066	宇通客车	218,826	4,332,754.80	1.08
12	000100	TCL 集团	1,207,655	3,973,184.95	0.99
13	000839	中信国安	180,800	3,852,848.00	0.96
14	601888	中国国旅	80,375	3,534,892.50	0.88
15	600177	雅戈尔	252,926	3,487,849.54	0.87
16	000069	华侨城 A	540,900	3,461,760.00	0.86
17	000793	华闻传媒	338,000	3,339,440.00	0.83
18	600660	福耀玻璃	231,036	3,234,504.00	0.80
19	000917	电广传媒	186,800	3,087,804.00	0.77
20	000559	万向钱潮	189,041	2,949,039.60	0.73
21	600741	华域汽车	207,791	2,911,151.91	0.72
22	600839	四川长虹	608,531	2,689,707.02	0.67
23	002292	奥飞娱乐	86,200	2,581,690.00	0.64
24	002085	万丰奥威	150,146	2,581,009.74	0.64

25	600398	海澜之家	222,103	2,509,763.90	0.62
26	002572	索菲亚	43,541	2,439,166.82	0.61
27	300144	宋城演艺	95,665	2,383,015.15	0.59
28	002426	胜利精密	240,250	2,366,462.50	0.59
29	600682	南京新百	81,852	2,330,326.44	0.58
30	600060	海信电器	129,378	2,287,403.04	0.57
31	300058	蓝色光标	230,566	2,238,795.86	0.56
32	002508	老板电器	60,187	2,213,075.99	0.55
33	000887	中鼎股份	100,050	2,212,105.50	0.55
34	002400	省广股份	155,032	2,190,602.16	0.54
35	600978	宜华生活	195,424	2,177,023.36	0.54
36	600699	均胜电子	56,800	2,175,440.00	0.54
37	601098	中南传媒	118,300	2,142,413.00	0.53
38	600166	福田汽车	384,700	2,123,544.00	0.53
39	601238	广汽集团	90,356	2,122,462.44	0.53
40	002070	众和股份	83,734	2,114,283.50	0.53
41	600482	中国动力	63,600	2,084,172.00	0.52
42	600122	宏图高科	155,637	2,082,423.06	0.52
43	601258	庞大集团	747,500	2,055,625.00	0.51
44	600158	中体产业	111,000	1,970,250.00	0.49
45	601718	际华集团	254,200	1,942,088.00	0.48
46	600373	中文传媒	90,798	1,884,058.50	0.47
47	600138	中青旅	95,353	1,842,219.96	0.46
48	600418	江淮汽车	144,650	1,834,162.00	0.46
49	600655	豫园商城	165,800	1,797,272.00	0.45
50	300133	华策影视	115,096	1,792,044.72	0.45
51	002224	三力士	75,700	1,752,455.00	0.44
52	600037	歌华有线	114,600	1,743,066.00	0.43
53	002131	利欧股份	98,600	1,685,074.00	0.42
54	300251	光线传媒	145,016	1,676,384.96	0.42
55	601633	长城汽车	198,590	1,676,099.60	0.42
56	000581	威孚高科	82,686	1,666,949.76	0.41
57	002027	分众传媒	100,600	1,660,906.00	0.41
58	002048	宁波华翔	69,846	1,597,378.02	0.40
59	600687	刚泰控股	98,060	1,594,455.60	0.40
60	000957	中通客车	34,100	1,548,140.00	0.38
61	002343	慈文传媒	31,000	1,503,500.00	0.37
62	300043	互动娱乐	105,360	1,492,951.20	0.37
63	600633	浙报传媒	97,900	1,472,416.00	0.37
64	000800	一汽轿车	134,048	1,458,442.24	0.36
65	601929	吉视传媒	358,790	1,445,923.70	0.36
66	600651	飞乐音响	113,579	1,437,910.14	0.36
67	002489	浙江永强	179,251	1,419,667.92	0.35
68	603766	隆鑫通用	69,000	1,395,180.00	0.35

69	601311	骆驼股份	70,100	1,391,485.00	0.35
70	002284	亚太股份	72,835	1,390,420.15	0.35
71	300291	华录百纳	58,435	1,374,975.55	0.34
72	600959	江苏有线	98,400	1,373,664.00	0.34
73	000516	国际医学	227,322	1,329,833.70	0.33
74	601928	凤凰传媒	125,800	1,325,932.00	0.33
75	000829	天音控股	94,800	1,265,580.00	0.31
76	601058	赛轮金宇	377,986	1,262,473.24	0.31
77	001696	宗申动力	113,200	1,236,144.00	0.31
78	000156	华数传媒	66,037	1,224,986.35	0.30
79	002699	美盛文化	36,663	1,224,177.57	0.30
80	601777	力帆股份	103,486	1,218,030.22	0.30
81	600303	曙光股份	81,778	1,214,403.30	0.30
82	000810	创维数字	65,800	1,189,006.00	0.30
83	000418	小天鹅A	36,325	1,184,921.50	0.29
84	002448	中原内配	77,550	1,182,637.50	0.29
85	600006	东风汽车	131,800	1,169,066.00	0.29
86	600653	申华控股	296,517	1,165,311.81	0.29
87	600707	彩虹股份	97,100	1,145,780.00	0.28
88	002283	天润曲轴	66,300	1,137,045.00	0.28
89	002707	众信旅游	55,640	1,129,492.00	0.28
90	002664	信质电机	33,072	1,125,109.44	0.28
91	002640	跨境通	63,650	1,121,513.00	0.28
92	600694	大商股份	29,064	1,119,545.28	0.28
93	601010	文峰股份	213,120	1,106,092.80	0.27
94	300336	新文化	44,222	1,104,665.56	0.27
95	002625	龙生股份	24,800	1,090,704.00	0.27
96	000681	视觉中国	46,100	1,090,265.00	0.27
97	000802	北京文化	46,276	1,088,411.52	0.27
98	601118	海南橡胶	194,350	1,086,416.50	0.27
99	000587	金洲慈航	70,000	1,080,100.00	0.27
100	600086	东方金钰	111,200	1,076,416.00	0.27
101	600754	锦江股份	32,100	1,074,066.00	0.27
102	600220	江苏阳光	235,100	1,072,056.00	0.27
103	002488	金固股份	50,230	1,055,834.60	0.26
104	002190	成飞集成	29,760	1,054,694.40	0.26
105	601689	拓普集团	32,000	1,054,400.00	0.26
106	300178	腾邦国际	54,845	1,053,024.00	0.26
107	000801	四川九洲	84,234	1,037,762.88	0.26
108	002721	金一文化	53,353	1,031,313.49	0.26
109	002681	奋达科技	61,080	1,031,030.40	0.26
110	002355	兴民钢圈	52,711	1,019,957.85	0.25
111	002035	华帝股份	41,483	1,015,503.84	0.25
112	600261	阳光照明	143,508	1,013,166.48	0.25

113	000851	高鸿股份	77,880	1,003,873.20	0.25
114	002668	奥马电器	16,400	998,268.00	0.25
115	000541	佛山照明	96,760	995,660.40	0.25
116	600729	重庆百货	40,126	995,124.80	0.25
117	002418	康盛股份	93,580	988,204.80	0.25
118	000572	海马汽车	189,700	984,543.00	0.24
119	002416	爱施德	48,952	972,186.72	0.24
120	600337	美克家居	74,500	969,245.00	0.24
121	000980	金马股份	87,000	969,180.00	0.24
122	002563	森马服饰	88,800	961,704.00	0.24
123	002005	德豪润达	161,070	951,923.70	0.24
124	600107	美尔雅	47,500	950,475.00	0.24
125	000760	斯太尔	64,925	925,181.25	0.23
126	002242	九阳股份	50,555	919,089.90	0.23
127	002269	美邦服饰	208,050	915,420.00	0.23
128	002260	德奥通航	35,030	909,028.50	0.23
129	600859	王府井	59,459	906,155.16	0.23
130	002510	天汽模	108,500	902,720.00	0.22
131	000016	深康佳 A	184,112	885,578.72	0.22
132	002429	兆驰股份	105,500	884,090.00	0.22
133	601599	鹿港文化	77,492	878,759.28	0.22
134	000158	常山股份	62,800	872,292.00	0.22
135	002188	巴士在线	29,600	856,328.00	0.21
136	002239	奥特佳	53,070	854,957.70	0.21
137	300100	双林股份	19,500	854,295.00	0.21
138	600831	广电网络	65,000	842,400.00	0.21
139	600757	长江传媒	99,971	838,756.69	0.21
140	000700	模塑科技	82,600	836,738.00	0.21
141	000550	江铃汽车	34,328	836,230.08	0.21
142	300005	探路者	48,858	833,028.90	0.21
143	000533	万家乐	79,700	827,286.00	0.21
144	002503	搜于特	66,605	827,234.10	0.21
145	600628	新世界	70,055	826,649.00	0.21
146	000726	鲁泰 A	74,078	823,006.58	0.20
147	000673	当代东方	65,300	818,209.00	0.20
148	002676	顺威股份	32,900	808,682.00	0.20
149	600630	龙头股份	48,986	803,860.26	0.20
150	600693	东百集团	118,400	795,648.00	0.20
151	002045	国光电器	54,953	784,728.84	0.20
152	000996	中国中期	37,909	783,958.12	0.19
153	600358	国旅联合	57,400	774,900.00	0.19
154	002540	亚太科技	88,747	773,873.84	0.19
155	000501	鄂武商 A	48,743	764,777.67	0.19
156	002454	松芝股份	41,873	761,251.14	0.19

157	300160	秀强股份	59,060	760,102.20	0.19
158	002029	七匹狼	74,700	758,205.00	0.19
159	002277	友阿股份	65,300	752,256.00	0.19
160	300217	东方电热	167,805	746,732.25	0.19
161	002154	报喜鸟	154,444	745,964.52	0.19
162	600136	当代明诚	32,100	743,115.00	0.18
163	002590	万安科技	23,700	737,781.00	0.18
164	002425	凯撒股份	33,525	737,550.00	0.18
165	002126	银轮股份	83,400	735,588.00	0.18
166	600686	金龙汽车	49,910	735,174.30	0.18
167	002434	万里扬	67,286	732,071.68	0.18
168	000888	峨眉山A	60,800	732,032.00	0.18
169	000417	合肥百货	89,892	727,226.28	0.18
170	600824	益民集团	121,570	725,772.90	0.18
171	601799	星宇股份	15,700	719,374.00	0.18
172	300295	三六五网	22,126	719,095.00	0.18
173	300426	唐德影视	10,500	716,100.00	0.18
174	600297	广汇汽车	81,600	710,736.00	0.18
175	002042	华孚色纺	68,600	709,324.00	0.18
176	002071	长城影视	51,900	707,916.00	0.18
177	600070	浙江富润	47,100	700,377.00	0.17
178	601801	皖新传媒	59,986	700,036.62	0.17
179	600742	一汽富维	55,874	697,866.26	0.17
180	002502	骅威文化	28,284	695,786.40	0.17
181	600877	中国嘉陵	93,400	689,292.00	0.17
182	002612	朗姿股份	27,502	685,624.86	0.17
183	600825	新华传媒	86,110	684,574.50	0.17
184	002345	潮宏基	69,600	680,688.00	0.17
185	000025	特力A	9,100	672,672.00	0.17
186	600551	时代出版	33,365	665,965.40	0.17
187	002251	步步高	51,338	665,853.86	0.17
188	600712	南宁百货	62,800	660,656.00	0.16
189	002575	群兴玩具	58,200	660,570.00	0.16
190	002083	孚日股份	104,714	659,698.20	0.16
191	002516	旷达科技	109,100	657,873.00	0.16
192	300342	天银机电	21,589	657,600.94	0.16
193	002137	麦达数字	38,000	644,480.00	0.16
194	600555	海航创新	112,300	643,479.00	0.16
195	300432	富临精工	17,900	642,073.00	0.16
196	600280	中央商场	94,568	639,279.68	0.16
197	600987	航民股份	52,414	635,257.68	0.16
198	002003	伟星股份	40,629	635,031.27	0.16
199	002293	罗莱生活	46,347	634,953.90	0.16
200	600676	交运股份	71,095	634,878.35	0.16

201	300148	天舟文化	41,665	633,724.65	0.16
202	600515	海航基础	48,800	629,520.00	0.16
203	600838	上海九百	52,900	629,510.00	0.16
204	002181	粤传媒	76,443	627,597.03	0.16
205	600480	凌云股份	44,500	627,450.00	0.16
206	002602	世纪华通	33,850	627,240.50	0.16
207	600135	乐凯胶片	36,838	626,982.76	0.16
208	002571	德力股份	38,797	624,631.70	0.16
209	603008	喜临门	36,296	623,928.24	0.16
210	002670	华声股份	23,100	623,007.00	0.15
211	002494	华斯股份	40,250	621,862.50	0.15
212	000665	湖北广电	41,853	620,261.46	0.15
213	600386	北巴传媒	33,212	619,735.92	0.15
214	300364	中文在线	11,914	619,528.00	0.15
215	002033	丽江旅游	48,694	617,439.92	0.15
216	002348	高乐股份	93,600	614,952.00	0.15
217	600818	中路股份	19,664	611,747.04	0.15
218	000599	青岛双星	88,883	611,515.04	0.15
219	600640	号百控股	36,370	610,652.30	0.15
220	000868	安凯客车	80,224	610,504.64	0.15
221	601965	中国汽研	63,305	608,361.05	0.15
222	600960	渤海活塞	60,500	607,420.00	0.15
223	002102	冠福股份	48,000	600,960.00	0.15
224	600661	新南洋	21,400	600,484.00	0.15
225	000030	富奥股份	82,992	595,052.64	0.15
226	600469	风神股份	55,575	591,318.00	0.15
227	300247	乐金健康	71,000	589,300.00	0.15
228	002327	富安娜	68,650	584,211.50	0.15
229	002362	汉王科技	21,202	582,842.98	0.14
230	002290	禾盛新材	20,900	581,647.00	0.14
231	002536	西泵股份	38,414	579,667.26	0.14
232	600785	新华百货	22,274	577,119.34	0.14
233	300063	天龙集团	19,300	574,754.00	0.14
234	000058	深赛格	53,200	572,432.00	0.14
235	002101	广东鸿图	26,390	570,551.80	0.14
236	000987	广州友谊	44,026	567,935.40	0.14
237	000757	浩物股份	53,675	566,808.00	0.14
238	002574	明牌珠宝	43,462	566,744.48	0.14
239	600229	城市传媒	46,300	564,860.00	0.14
240	000607	华媒控股	67,000	564,810.00	0.14
241	603001	奥康国际	26,372	560,668.72	0.14
242	002662	京威股份	37,000	559,070.00	0.14
243	002406	远东传动	64,700	554,479.00	0.14
244	600336	澳柯玛	78,600	554,130.00	0.14

245	002614	蒙发利	45,687	548,700.87	0.14
246	002472	双环传动	22,326	542,968.32	0.13
247	000589	黔轮胎A	102,200	536,550.00	0.13
248	600857	宁波中百	36,927	536,180.04	0.13
249	000719	大地传媒	50,570	534,019.20	0.13
250	600609	金杯汽车	107,975	530,157.25	0.13
251	600088	中视传媒	21,995	521,721.40	0.13
252	600335	国机汽车	46,520	521,489.20	0.13
253	600891	秋林集团	40,700	519,739.00	0.13
254	002328	新朋股份	51,652	515,486.96	0.13
255	300242	明家联合	14,700	514,353.00	0.13
256	600865	百大集团	43,451	513,156.31	0.13
257	002486	嘉麟杰	109,648	513,152.64	0.13
258	603555	贵人鸟	20,287	505,754.91	0.13
259	002351	漫步者	38,934	504,584.64	0.13
260	002076	雪莱特	30,200	504,340.00	0.13
261	600814	杭州解百	47,200	499,848.00	0.12
262	002561	徐家汇	41,100	499,776.00	0.12
263	002363	隆基机械	38,250	498,015.00	0.12
264	600861	北京城乡	36,575	489,739.25	0.12
265	600723	首商股份	54,201	484,014.93	0.12
266	600493	凤竹纺织	35,900	483,932.00	0.12
267	002394	联发股份	31,997	483,154.70	0.12
268	300413	快乐购	19,800	482,130.00	0.12
269	002634	棒杰股份	45,500	481,845.00	0.12
270	600821	津劝业	54,800	481,692.00	0.12
271	300304	云意电气	14,876	477,222.08	0.12
272	000564	西安民生	49,600	476,160.00	0.12
273	002419	天虹商场	39,600	473,616.00	0.12
274	002404	嘉欣丝绸	60,000	473,400.00	0.12
275	002087	新野纺织	59,900	472,611.00	0.12
276	000921	海信科龙	59,451	471,446.43	0.12
277	600983	惠而浦	37,981	470,964.40	0.12
278	601339	百隆东方	74,158	470,903.30	0.12
279	002592	八菱科技	14,133	466,389.00	0.12
280	600697	欧亚集团	15,700	465,662.00	0.12
281	002381	双箭股份	35,408	465,615.20	0.12
282	600327	大东方	51,548	459,808.16	0.11
283	603898	好莱客	14,700	457,023.00	0.11
284	300089	文化长城	37,000	455,840.00	0.11
285	000753	漳州发展	101,899	455,488.53	0.11
286	603996	中新科技	14,800	451,548.00	0.11
287	600854	春兰股份	59,884	447,333.48	0.11
288	000889	茂业通信	41,100	445,935.00	0.11

289	600523	贵航股份	23,875	443,597.50	0.11
290	002705	新宝股份	28,363	443,030.06	0.11
291	603366	日出东方	52,700	442,680.00	0.11
292	002238	天威视讯	30,530	441,769.10	0.11
293	000428	华天酒店	67,190	440,766.40	0.11
294	603999	读者传媒	14,200	439,206.00	0.11
295	601566	九牧王	28,385	438,264.40	0.11
296	000978	桂林旅游	41,600	437,216.00	0.11
297	601007	金陵饭店	34,731	435,179.43	0.11
298	600698	湖南天雁	73,300	433,936.00	0.11
299	000017	深中华 A	39,900	423,339.00	0.11
300	603729	龙韵股份	5,400	421,308.00	0.10
301	600858	银座股份	51,387	420,859.53	0.10
302	300272	开能环保	27,252	420,498.36	0.10
303	000521	美菱电器	69,300	417,879.00	0.10
304	002708	光洋股份	31,520	416,694.40	0.10
305	600898	三联商社	33,200	415,332.00	0.10
306	000721	西安饮食	57,553	413,806.07	0.10
307	300329	海伦钢琴	20,700	413,793.00	0.10
308	002084	海鸥卫浴	37,575	406,561.50	0.10
309	002615	哈尔斯	22,500	406,350.00	0.10
310	002543	万和电气	21,900	404,931.00	0.10
311	600156	华升股份	39,849	402,873.39	0.10
312	600113	浙江东日	33,423	402,747.15	0.10
313	002144	宏达高科	20,350	400,081.00	0.10
314	603869	北部湾旅	14,245	396,723.25	0.10
315	000419	通程控股	53,700	390,936.00	0.10
316	002356	赫美集团	15,300	387,702.00	0.10
317	002740	爱迪尔	24,700	386,802.00	0.10
318	002678	珠江钢琴	31,498	386,480.46	0.10
319	603398	邦宝益智	10,400	384,176.00	0.10
320	603818	曲美家居	24,000	384,000.00	0.10
321	002403	爱仕达	23,200	374,680.00	0.09
322	600738	兰州民百	43,900	372,711.00	0.09
323	002776	柏堡龙	10,400	369,824.00	0.09
324	002763	汇洁股份	10,800	368,280.00	0.09
325	603808	歌力思	12,600	367,038.00	0.09
326	002397	梦洁股份	44,281	364,432.63	0.09
327	000430	张家界	31,800	360,930.00	0.09
328	300022	吉峰农机	43,900	359,541.00	0.09
329	002593	日上集团	46,100	351,282.00	0.09
330	300473	德尔股份	5,000	349,750.00	0.09
331	002187	广百股份	28,278	348,384.96	0.09
332	601999	出版传媒	36,366	346,204.32	0.09

333	002420	毅昌股份	39,700	345,390.00	0.09
334	002607	亚夏汽车	30,000	344,700.00	0.09
335	002677	浙江美大	31,680	344,044.80	0.09
336	600370	三房巷	65,600	342,432.00	0.09
337	002098	浔兴股份	29,400	341,628.00	0.08
338	603199	九华旅游	7,200	341,280.00	0.08
339	000026	飞亚达A	29,425	336,327.75	0.08
340	000678	襄阳轴承	42,400	334,960.00	0.08
341	600081	东风科技	20,700	334,719.00	0.08
342	600178	东安动力	38,000	331,360.00	0.08
343	002722	金轮股份	8,600	326,456.00	0.08
344	603598	引力传媒	13,400	322,270.00	0.08
345	002762	金发拉比	6,000	314,640.00	0.08
346	603889	新澳股份	21,300	308,424.00	0.08
347	002605	姚记扑克	18,607	303,480.17	0.08
348	600258	首旅酒店	15,200	300,048.00	0.07
349	603600	永艺股份	5,000	300,000.00	0.07
350	000524	岭南控股	22,900	299,532.00	0.07
351	000663	永安林业	22,400	288,512.00	0.07
352	603355	莱克电气	7,400	281,940.00	0.07
353	603997	继峰股份	13,800	272,412.00	0.07
354	002765	蓝黛传动	10,300	271,405.00	0.07
355	002780	三夫户外	3,300	262,350.00	0.07
356	002761	多喜爱	6,100	246,318.00	0.06
357	603116	红蜻蜓	10,200	241,536.00	0.06
358	603099	长白山	13,300	238,203.00	0.06
359	603838	四通股份	13,400	217,080.00	0.05
360	603166	福达股份	11,700	206,973.00	0.05
361	002759	天际股份	12,000	190,320.00	0.05
362	603519	立霸股份	8,000	175,200.00	0.04
363	601127	小康股份	5,210	124,362.70	0.03
364	601611	中国核建	3,025	63,283.00	0.02
365	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
366	603958	哈森股份	2,183	31,653.50	0.01
367	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
368	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
369	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
370	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
371	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	002739	万达院线	3,429,396.65	0.69
2	600158	中体产业	2,031,511.00	0.41
3	002131	利欧股份	1,633,503.35	0.33
4	002027	分众传媒	1,532,643.00	0.31
5	002343	慈文传媒	1,485,176.00	0.30
6	600297	广汇汽车	1,283,160.00	0.26
7	600707	彩虹股份	1,186,994.67	0.24
8	002512	达华智能	1,111,162.00	0.22
9	000681	视觉中国	1,050,199.00	0.21
10	002188	巴士在线	877,263.00	0.18
11	002602	世纪华通	852,311.00	0.17
12	300100	双林股份	849,204.82	0.17
13	000156	华数传媒	833,028.76	0.17
14	000673	当代东方	808,100.00	0.16
15	600136	当代明诚	778,000.00	0.16
16	002676	顺威股份	764,705.00	0.15
17	002590	万安科技	716,872.00	0.14
18	601799	星宇股份	713,479.00	0.14
19	000793	华闻传媒	687,178.00	0.14
20	600699	均胜电子	630,699.00	0.13

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	600415	小商品城	2,921,928.98	0.58
2	600851	海欣股份	1,772,694.00	0.35
3	600978	宜华生活	1,693,158.00	0.34
4	600637	东方明珠	1,600,628.37	0.32
5	002024	苏宁云商	1,567,420.15	0.31
6	002512	达华智能	964,291.00	0.19
7	002413	雷科防务	955,675.00	0.19
8	000062	深圳华强	917,089.38	0.18
9	002344	海宁皮城	901,751.50	0.18
10	600612	老凤祥	835,986.83	0.17

11	000100	TCL 集团	819,525.00	0.16
12	600694	大商股份	796,906.00	0.16
13	002239	奥特佳	737,244.00	0.15
14	600790	轻纺城	722,980.33	0.14
15	600093	禾嘉股份	691,862.15	0.14
16	000069	华侨城 A	583,867.00	0.12
17	600054	黄山旅游	563,762.00	0.11
18	000850	华茂股份	515,892.00	0.10
19	002186	全聚德	507,557.35	0.10
20	002575	群兴玩具	507,540.00	0.10

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

买入股票的成本（成交）总额	42,269,625.12
卖出股票的收入（成交）总额	40,852,415.97

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）	304,936.60	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	304,936.60	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	123001	蓝标转债	1,829	196,983.30	0.05
2	113009	广汽转债	910	107,953.30	0.03

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 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未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。

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	3,177.27
2	应收证券清算款	103,097.18
3	应收股利	-
4	应收利息	1,009.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,284.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	196,983.30	0.05

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	000651	格力电器	15,702,509.36	3.90	重大事项停牌

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
255	1,067,278.80	267,437,841.00	98.27%	4,718,253.00	1.73%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	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	267,435,880.00	98.27%
2	何凤珍	1,016,000.00	0.37%
3	王浩	860,019.00	0.32%
4	许国根	100,000.00	0.04%
5	陈金华	87,011.00	0.03%
6	朱益	384,600.00	0.14%
7	朱晓晔	107,000.00	0.04%
8	陈翠云	100,006.00	0.04%
9	苑桂花	100,006.00	0.04%
10	李桂青	100,000.00	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	272,156,094.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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

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

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。 本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书

（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内，本基金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	
银河证券	2	81,270,598.88	98.13%	59,433.19	97.63%	-
广发证券	3	1,552,304.00	1.87%	1,445.67	2.37%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
银河证券	76,381.89	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司旗下基金（除 QDII 基金）资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-30
2	广发基金管理有限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基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-25

注：无

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批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文件
- (二) 《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》
- (三) 《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、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：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；
2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇一六年八月二十六日