

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 年年度报告

2016 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：二〇一七年三月二十八日

§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 2017 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	17
6.1 管理层对财务报表的责任.....	17
6.2 注册会计师的责任.....	17
6.3 审计意见.....	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50

8.2	期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3	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	51
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
8.7	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	62
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	62
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	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12	投资组合报告附注	63
§9	基金份额持有人信息	63
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2	期末上市基金前十名持有人	64
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	64
§10	开放式基金份额变动	64
§11	重大事件揭示	65
11.1	基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4	基金投资策略的改变	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8	其他重大事件	67
§12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	68

§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	254,156,094.00 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国·上海
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

§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	2016 年	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	-15,097,021.10	-9,005,623.71	29,199,921.09
本期利润	-79,530,535.14	-9,652,656.99	31,325,003.29
加权平均基金份额本期利润	-0.2944	-0.0446	0.1929
本期加权平均净值利润率	-19.63%	-2.35%	18.69%
本期基金份额净值增长率	-16.11%	46.50%	25.51%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	65,348,981.32	85,320,971.96	4,121,315.17
期末可供分配基金份额利润	0.2571	0.3135	0.2551
期末基金资产净值	392,043,225.34	500,420,011.04	20,277,409.17
期末基金份额净值	1.5425	1.8387	1.2551
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	54.25%	83.87%	25.51%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	0.87%	0.82%	-0.28%	0.84%	1.15%	-0.02%
过去六个月	4.37%	0.88%	1.84%	0.90%	2.53%	-0.02%
过去一年	-16.11%	1.77%	-18.27%	1.79%	2.16%	-0.02%
自基金合同生效起至今	54.25%	1.97%	60.51%	2.04%	-6.26%	-0.07%

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 2016 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、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和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、资产配置部、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，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管

理有限公司（香港子公司）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理一百二十五只开放式基金---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、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 3048 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；广发中证全指可选消费 ETF 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 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；广发原材料联接基金的基金经理；广发主要消费联接基	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 日至 2016 年 7 月 27 日任广发中小板 300ETF 基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 27 日任广发中小板 300ETF 联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 27 日任广发深证 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 日至 2016 年 7 月 27 日任广发百发 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

	金的基金经理；数量投资部副总经理				的基金经理,2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 27 日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。
季峰	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	2014-11-24	2016-05-25	7 年	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 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 公平交易制度和控制方法

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

在投资决策的内部控制方面，公司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）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-16.11%，同期业绩基准收益率为-18.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，保险机构逐渐认识到大盘蓝筹低的估值较低，对大盘蓝筹股纷纷举牌，引发了市场一波涨幅较大的行情，但随着政府为防范风险，规范了保险资金的投资，行情逐渐冷却。目前，中国经济“L”走势已经成为共识，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，预计 2017 年，市场行情继续稳重求进。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发中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

德师报(审)字(17)第 P00537 号

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“广发中证全指可选消费 ETF”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表，以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发中证全指可选消费 ETF 的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，广发中证全指可选消费 ETF 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了广发中证全指可选消费 ETF 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

中国·上海

2017 年 3 月 22 日

§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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	4,399,376.27	1,805,969.66
结算备付金		37,090.68	-
存出保证金		12,726.54	62,118.74
交易性金融资产	7.4.7.2	388,229,646.72	499,277,255.06
其中：股票投资		388,229,646.72	499,094,355.06
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	841.38	203.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		392,679,681.59	501,145,546.74
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		169,631.92	209,855.96
应付托管费		33,926.41	41,971.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	71,794.78	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	7.4.7.8	361,103.14	244,252.26
负债合计		636,456.25	725,535.70
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	254,156,094.00	272,156,094.00
未分配利润	7.4.7.10	137,887,131.34	228,263,917.04
所有者权益合计		392,043,225.34	500,420,011.04
负债和所有者权益总计		392,679,681.59	501,145,546.74

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.5425 元，基金份额总额 254,156,094.00 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-76,162,285.94	-6,155,268.29
1.利息收入		28,159.33	70,746.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	27,336.25	70,718.49
债券利息收入		823.08	28.06
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）		-11,756,931.23	-14,412,540.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-17,755,792.71	-19,985,188.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	58,868.66	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,939,992.82	5,572,647.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-64,433,514.04	-647,033.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	8,833,559.18
减：二、费用		3,368,249.20	3,497,388.70
1. 管理人报酬		2,026,843.92	1,999,774.49
2. 托管费		405,368.76	399,954.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	241,964.32	711,376.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7.4.7.19	694,072.20	386,282.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-79,530,535.14	-9,652,656.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-79,530,535.14	-9,652,656.99

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	-79,530,535.14	-79,530,535.14
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）	-18,000,000.00	-10,846,250.56	-28,846,250.56
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	6,035,502.54	18,035,502.54
2.基金赎回款	-30,000,000.00	-16,881,753.10	-46,881,753.10
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）	254,156,094.00	137,887,131.34	392,043,225.34

项目	上年度可比期间		
	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

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发中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 2017 年 3 月 22 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了

对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

4. 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的证监会公告 [2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量

公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同时一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同时一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同时一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同时一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

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次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时

本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购及赎回等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购及赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的

个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

当本基金申购对价中包含可以现金替代时，在本基金补足可以现金替代成分股票(或采取强制退款)之前，该股票估值日与申购日估值的差额确认为公允价值变动收益，并于补入被替代股票的实际买入日或强制退款计算日转出计入其他收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率逐日计提。
2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率逐日计提。
3. 本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值×0.03%的年费率逐日计提。
4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。
5. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 每一基金份额享有同等分配权；
2. 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
3. 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；标的指数同期增长率为收益评价日的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%；
4. 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；
5. 本基金的收益分配采取现金分红的方式；
6. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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. 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、债券免征营业税或增值税。

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，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，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，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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,399,376.27	1,805,969.66
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	4,399,376.27	1,805,969.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	451,185,111.84	388,229,646.72	-62,955,465.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	451,185,111.84	388,229,646.72	-62,955,465.12
项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	497,616,306.14	499,094,355.06	1,478,048.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	182,900.00	182,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	182,900.00	182,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	497,799,206.14	499,277,255.06	1,478,048.92

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	819.08	147.22
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	5.70	28.00
应收结算备付金利息	16.60	-
应收债券利息	-	28.06

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	841.38	203.28

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	71,794.78	229,456.30
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	71,794.78	229,456.30

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	330,000.00	170,000.00
应付指数使用费	31,103.14	74,252.26
合计	361,103.14	244,252.26

7.4.7.9 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 12 月 31 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	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-30,000,000.00	-30,000,000.00
本期末	254,156,094.00	254,156,094.00

7.4.7.10 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	-15,097,021.10	-64,433,514.04	-79,530,535.14
本期基金份额交易产生的变动数	-4,874,969.54	-5,971,281.02	-10,846,250.56
其中：基金申购款	3,275,340.38	2,760,162.16	6,035,502.54
基金赎回款	-8,150,309.92	-8,731,443.18	-16,881,753.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,348,981.32	72,538,150.02	137,887,131.34

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	25,969.79	53,854.12
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	186.90	948.68
结算备付金利息收入	1,179.56	15,915.69
其他	-	-
合计	27,336.25	70,718.49

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,254,908.21	-11,451,499.19
股票投资收益——赎回差价收入	-6,500,884.50	-8,533,688.96
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-17,755,792.71	-19,985,188.15

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
卖出股票成交总额	93,221,898.35	248,167,468.15
减：卖出股票成本总额	104,476,806.56	259,618,967.34
买卖股票差价收入	-11,254,908.21	-11,451,499.19

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
赎回基金份额对价总额	46,881,753.10	828,953,154.14
减：现金支付赎回款总额	2,662,311.10	162,273,606.14
减：赎回股票成本总额	50,720,326.50	675,213,236.96
赎回差价收入	-6,500,884.50	-8,533,688.96

7.4.7.13 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12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	390,519.80	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	330,800.00	-
减：应收利息总额	851.14	-
买卖债券差价收入	58,868.66	-

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,939,992.82	5,572,647.41
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,939,992.82	5,572,647.41

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-64,433,514.04	-647,033.28
——股票投资	-64,433,514.04	-647,033.28
——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	-	-
合计	-64,433,514.04	-647,033.28

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
手续费返还	-	-
基金转换费收入	-	-
印花税返还	-	-
替代损益	-	8,833,559.18
其他	-	-
合计	-	8,833,559.18

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	241,964.32	711,376.58
银行间市场交易费用	-	-
合计	241,964.32	711,376.58

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	40,000.00
信息披露费	450,000.00	150,000.00
银行汇划费	2,461.57	7,475.40
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	121,610.63	128,807.33
其他	-	-
合计	694,072.20	386,282.73

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	1,552,304.00	0.86%	90,766,826.13	16.52%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券股份有限公司	1,445.67	1.09%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,026,843.92
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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	405,368.76	399,954.90

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。

7.4.10.3 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交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		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	250,472,095.00	98.55%	267,600,580.00	98.33%

7.4.10.5 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12月31日		2015年1月1日至2015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	4,399,376.27	25,969.79	1,805,969.66	53,854.12

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。

7.4.10.6 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12月31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12月31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	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股流通受限	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	15.28	15.28	681.00	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-

				受限						
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	23.16	23.16	1,766.00	40,900.56	40,900.56	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股流通受限	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000516	国际医学	2016-12-05	重大事项停牌	7.90	-	-	212,022.00	2,195,772.73	1,674,973.80	-
000533	万家乐	2016-12-29	重大事项停牌	12.82	2017-01-12	11.54	73,600.00	608,443.04	943,552.00	-
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项停牌	11.28	-	-	96,900.00	1,438,855.38	1,093,032.00	-
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大事项停牌	25.94	2017-02-15	23.99	93,350.00	2,542,898.93	2,421,499.00	-
000987	越秀金控	2016-08-29	重大事项停牌	14.49	2017-01-09	15.94	45,226.00	803,253.76	655,324.74	-
002071	长城影视	2016-06-15	重大事项停牌	13.64	2017-01-03	15.00	51,900.00	1,012,138.40	707,916.00	-
002239	奥特佳	2016-10-18	重大事项停牌	15.69	2017-02-07	14.12	54,270.00	842,748.98	851,496.30	-
002226	德奥通	2016-12	重大事	23.10	-	-	33,230.00	1,278,523.67	767,613.00	-

0	航	-05	项停牌							
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项停牌	13.79	-	-	144,432.00	2,772,343.62	1,991,717.28	-
002571	德力股份	2016-08-02	重大事项停牌	15.33	2017-02-28	15.44	39,097.00	668,816.37	599,357.01	-
002602	世纪华通	2016-12-15	重大事项停牌	46.89	2017-01-09	50.00	46,950.00	1,473,680.09	2,201,485.50	-
002664	信质电机	2016-12-16	重大事项停牌	25.39	-	-	30,472.00	941,409.78	773,684.08	-
002681	奋达科技	2016-12-19	重大事项停牌	12.93	-	-	56,980.00	989,749.65	736,751.40	-
300005	探路者	2016-11-28	重大事项停牌	16.69	2017-02-06	15.02	45,258.00	1,271,029.42	755,356.02	-
300100	双林股份	2016-11-07	重大事项停牌	34.00	2017-01-25	30.60	19,200.00	827,609.43	652,800.00	-
300473	德尔股份	2016-11-01	重大事项停牌	78.12	2017-02-10	71.00	4,200.00	362,997.50	328,104.00	-
600303	曙光股份	2016-12-15	重大事项停牌	9.02	2017-01-17	9.92	82,278.00	712,853.65	742,147.56	-
600480	凌云股份	2016-07-22	重大事项停牌	15.01	2017-01-13	16.51	43,900.00	762,389.88	658,939.00	-
600551	时代出版	2016-11-28	重大事项停牌	20.32	-	-	31,465.00	664,937.86	639,368.80	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项停牌	11.42	-	-	153,200.00	2,731,333.15	1,749,544.00	-
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大事项停牌	16.42	2017-01-18	16.38	96,660.00	1,635,789.25	1,587,157.20	-
600814	杭州解百	2016-12-26	重大事项停牌	11.37	2017-01-09	10.70	43,600.00	583,801.89	495,732.00	-
600859	王府井	2016-09-27	重大事项停牌	16.28	-	-	60,659.00	1,212,790.32	987,528.52	-
603555	贵人鸟	2016-12-12	重大事项停牌	30.76	-	-	6,387.00	260,022.55	196,464.12	-
603838	四通股份	2016-03-24	重大事项停牌	16.20	2017-02-15	17.82	13,400.00	255,948.00	217,080.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项停牌	177.97	2017-03-13	195.77	1,133.00	26,353.58	201,640.01	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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12月31日	上年末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	182,900.00
未评级	-	-
合计	-	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、政策性金融债和央行票据。

7.4.13.3 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 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,399,376.27	-	-	-	4,399,376.27
结算备付金	37,090.68	-	-	-	37,090.68
存出保证金	12,726.54	-	-	-	12,726.54
交易性金融资产	-	-	-	388,229,646.72	388,229,646.72
应收利息	-	-	-	841.38	841.38
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,449,193.49	-	-	388,230,488.10	392,679,681.59
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	169,631.92	169,631.92
应付托管费	-	-	-	33,926.41	33,926.41
应付交易费用	-	-	-	71,794.78	71,794.78
其他负债	-	-	-	361,103.14	361,103.14
负债总计	-	-	-	636,456.25	636,456.25
利率敏感度缺口	4,449,193.49	-	-	387,594,031.85	392,043,225.34
上年度末 2015 年 12 月 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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，本基金上年度末持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	388,229,646.72	99.03	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	-	-	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	388,229,646.72	99.03	499,277,255.06	99.77

7.4.13.4.3.2 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	上年度末
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	19,430,853.71	24,333,345.28
	业绩比较基准下降 5%	-19,430,853.71	-24,333,345.28

7.4.14 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见附注 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 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 363,159,005.67 元，第二层级的余额为 24,630,263.34 元，属于第三层级的余额为 440,377.71 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票。(2015 年 12 月 31 日：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)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	388,229,646.72	98.87
	其中：股票	388,229,646.72	98.87
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,436,466.95	1.13
7	其他各项资产	13,567.92	0.00
8	合计	392,679,681.59	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	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	242,368,961.62	61.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	118,924.74	0.03
F	批发和零售业	46,237,623.42	11.79
G	交通运输、仓储和邮政业	711,764.83	0.18
H	住宿和餐饮业	3,260,390.85	0.83
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,749,638.10	5.29
J	金融业	106,780.00	0.03
K	房地产业	6,339,235.48	1.62
L	租赁和商务服务业	18,696,680.81	4.77
M	科学研究和技术服务业	419,020.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	6,911,490.95	1.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	870,920.00	0.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41,400,298.26	10.56
S	综合	-	-
	合计	388,229,646.72	99.03

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	000333	美的集团	684,952	19,295,097.84	4.92
2	000651	格力电器	732,988	18,046,164.56	4.60
3	600104	上汽集团	503,734	11,812,562.30	3.01
4	002024	苏宁云商	567,142	6,493,775.90	1.66

5	600637	东方明珠	200,021	4,660,489.30	1.19
6	600690	青岛海尔	464,346	4,587,738.48	1.17
7	000625	长安汽车	297,000	4,437,180.00	1.13
8	002594	比亚迪	82,819	4,114,447.92	1.05
9	000100	TCL 集团	1,243,855	4,104,721.50	1.05
10	600660	福耀玻璃	213,536	3,978,175.68	1.01
11	600066	宇通客车	202,326	3,963,566.34	1.01
12	002739	万达院线	71,532	3,867,735.24	0.99
13	000839	中信国安	417,900	3,836,322.00	0.98
14	000069	华侨城 A	499,900	3,474,305.00	0.89
15	000793	华闻传媒	307,200	3,468,288.00	0.88
16	600177	雅戈尔	233,726	3,267,489.48	0.83
17	601888	中国国旅	74,375	3,227,875.00	0.82
18	600741	华域汽车	192,091	3,063,851.45	0.78
19	600398	海澜之家	273,703	2,953,255.37	0.75
20	600682	南京新百	75,652	2,819,550.04	0.72
21	300027	华谊兄弟	254,440	2,798,840.00	0.71
22	002085	万丰奥威	138,746	2,741,620.96	0.70
23	600959	江苏有线	236,600	2,673,580.00	0.68
24	000917	电广传媒	172,700	2,485,153.00	0.63
25	600158	中体产业	102,800	2,422,996.00	0.62
26	000887	中鼎股份	93,350	2,421,499.00	0.62
27	600839	四川长虹	562,431	2,350,961.58	0.60
28	000559	万向钱潮	174,741	2,317,065.66	0.59
29	002572	索菲亚	42,241	2,287,772.56	0.58
30	002602	世纪华通	46,950	2,201,485.50	0.56
31	600166	福田汽车	711,100	2,197,299.00	0.56
32	300058	蓝色光标	213,066	2,166,881.22	0.55
33	601718	际华集团	235,000	2,164,350.00	0.55
34	002426	胜利精密	260,550	2,154,748.50	0.55
35	600297	广汇汽车	251,300	2,151,128.00	0.55
36	600699	均胜电子	63,000	2,084,670.00	0.53
37	600060	海信电器	119,578	2,047,175.36	0.52
38	002508	老板电器	55,587	2,045,601.60	0.52
39	601633	长城汽车	183,590	2,030,505.40	0.52
40	000581	威孚高科	89,186	2,001,333.84	0.51
41	002400	省广股份	144,432	1,991,717.28	0.51
42	601258	庞大集团	711,600	1,971,132.00	0.50
43	600978	宜华生活	180,724	1,924,710.60	0.49
44	300144	宋城演艺	88,465	1,852,457.10	0.47
45	600138	中青旅	88,153	1,848,568.41	0.47
46	601098	中南传媒	109,400	1,822,604.00	0.46
47	002292	奥飞娱乐	79,700	1,809,190.00	0.46
48	600655	豫园商城	153,200	1,749,544.00	0.45

49	002343	慈文传媒	38,300	1,730,011.00	0.44
50	600122	宏图高科	140,137	1,712,474.14	0.44
51	600373	中文传媒	83,898	1,694,739.60	0.43
52	000516	国际医学	212,022	1,674,973.80	0.43
53	600418	江淮汽车	144,150	1,666,374.00	0.43
54	600715	文投控股	75,378	1,662,084.90	0.42
55	600037	歌华有线	106,000	1,623,920.00	0.41
56	600633	浙报传媒	90,500	1,598,230.00	0.41
57	600687	刚泰控股	96,660	1,587,157.20	0.40
58	000156	华数传媒	87,337	1,564,205.67	0.40
59	002131	利欧股份	97,900	1,561,505.00	0.40
60	002048	宁波华翔	64,546	1,429,048.44	0.36
61	601058	赛轮金宇	349,386	1,422,001.02	0.36
62	601929	吉视传媒	331,690	1,389,781.10	0.35
63	000800	一汽轿车	123,948	1,347,314.76	0.34
64	603766	隆鑫通用	64,800	1,346,544.00	0.34
65	002027	分众传媒	93,100	1,328,537.00	0.34
66	300251	光线传媒	134,016	1,307,996.16	0.33
67	002489	浙江永强	165,651	1,253,978.07	0.32
68	002668	奥马电器	17,600	1,248,720.00	0.32
69	601928	凤凰传媒	116,300	1,217,661.00	0.31
70	300133	华策影视	106,396	1,207,594.60	0.31
71	601238	广汽集团	51,656	1,196,869.52	0.31
72	002640	跨境通	65,150	1,192,245.00	0.30
73	000980	金马股份	80,400	1,160,172.00	0.30
74	600086	东方金钰	102,800	1,118,464.00	0.29
75	000810	创维数字	78,800	1,108,716.00	0.28
76	600693	东百集团	109,400	1,107,128.00	0.28
77	300291	华录百纳	49,535	1,103,639.80	0.28
78	002429	兆驰股份	110,300	1,098,588.00	0.28
79	000829	天音控股	96,900	1,093,032.00	0.28
80	002512	达华智能	66,700	1,089,211.00	0.28
81	000418	小天鹅 A	33,625	1,086,760.00	0.28
82	300269	联建光电	46,700	1,079,704.00	0.28
83	002070	众和股份	77,434	1,074,783.92	0.27
84	600694	大商股份	26,864	1,072,679.52	0.27
85	601801	皖新传媒	60,586	1,064,496.02	0.27
86	601311	骆驼股份	64,600	1,054,918.00	0.27
87	601010	文峰股份	197,020	1,036,325.20	0.26
88	300148	天舟文化	49,465	1,031,839.90	0.26
89	002625	龙生股份	27,500	1,030,150.00	0.26
90	002503	搜于特	70,605	1,016,005.95	0.26
91	002035	华帝股份	38,883	1,009,013.85	0.26
92	000957	中通客车	63,200	1,002,984.00	0.26

93	002707	众信旅游	64,240	998,932.00	0.25
94	002434	万里扬	62,186	994,976.00	0.25
95	000801	四川九洲	93,434	993,203.42	0.25
96	600859	王府井	60,659	987,528.52	0.25
97	001696	宗申动力	104,600	983,240.00	0.25
98	000158	常山股份	77,500	968,750.00	0.25
99	002269	美邦服饰	192,350	963,673.50	0.25
100	000587	金洲慈航	64,700	962,736.00	0.25
101	600261	阳光照明	132,708	958,151.76	0.24
102	002284	亚太股份	67,435	948,810.45	0.24
103	000533	万 家 乐	73,600	943,552.00	0.24
104	600220	江苏阳光	217,300	943,082.00	0.24
105	600653	申华控股	237,117	941,354.49	0.24
106	000572	海马汽车	175,300	939,608.00	0.24
107	002277	友阿股份	64,700	929,092.00	0.24
108	002283	天润曲轴	119,400	927,738.00	0.24
109	601777	力帆股份	95,686	914,758.16	0.23
110	002721	金一文化	54,553	909,944.04	0.23
111	600838	上海九百	48,800	890,600.00	0.23
112	002418	康盛股份	86,580	885,713.40	0.23
113	000541	佛山照明	89,460	880,286.40	0.22
114	000501	鄂武商 A	45,043	879,239.36	0.22
115	000726	鲁 泰 A	68,478	877,203.18	0.22
116	601689	拓普集团	29,700	873,774.00	0.22
117	600729	重庆百货	37,126	869,862.18	0.22
118	000802	北京文化	44,376	858,231.84	0.22
119	002005	德豪润达	148,870	856,002.50	0.22
120	002126	银轮股份	87,900	851,751.00	0.22
121	002239	奥特佳	54,270	851,496.30	0.22
122	000996	中国中期	35,009	847,217.80	0.22
123	002242	九阳股份	46,755	842,992.65	0.22
124	000851	高鸿股份	72,080	840,452.80	0.21
125	002190	成飞集成	26,260	839,794.80	0.21
126	600006	东风汽车	121,800	837,984.00	0.21
127	000673	当代东方	60,400	837,144.00	0.21
128	600628	新世界	59,155	835,860.15	0.21
129	600742	一汽富维	51,574	831,888.62	0.21
130	600107	美尔雅	43,900	830,588.00	0.21
131	300178	腾邦国际	51,245	827,094.30	0.21
132	000681	视觉中国	42,700	813,862.00	0.21
133	600824	益民集团	112,370	813,558.80	0.21
134	600707	彩虹股份	89,800	807,302.00	0.21
135	002188	巴士在线	27,400	804,190.00	0.21
136	300336	新文化	40,922	804,117.30	0.21

137	002031	巨轮智能	234,500	799,645.00	0.20
138	600609	金杯汽车	99,875	795,005.00	0.20
139	002448	中原内配	71,650	791,016.00	0.20
140	600877	中国嘉陵	83,700	783,432.00	0.20
141	002699	美盛文化	23,063	779,529.40	0.20
142	002345	潮宏基	64,400	777,952.00	0.20
143	002154	报喜鸟	142,844	774,214.48	0.20
144	002664	信质电机	30,472	773,684.08	0.20
145	002510	天汽模	110,900	770,755.00	0.20
146	002488	金固股份	46,430	770,738.00	0.20
147	300043	星辉娱乐	75,760	768,206.40	0.20
148	000016	深康佳 A	170,212	767,656.12	0.20
149	002260	德奥通航	33,230	767,613.00	0.20
150	600757	长江传媒	92,371	767,603.01	0.20
151	300005	探路者	45,258	755,356.02	0.19
152	002575	群兴玩具	53,800	754,814.00	0.19
153	600280	中央商场	87,468	753,099.48	0.19
154	601599	鹿港文化	81,792	749,214.72	0.19
155	002355	兴民智通	54,811	744,881.49	0.19
156	002251	步步高	45,238	744,165.10	0.19
157	600303	曙光股份	82,278	742,147.56	0.19
158	002681	奋达科技	56,980	736,751.40	0.19
159	000607	华媒控股	62,000	732,840.00	0.19
160	300089	文化长城	39,700	730,877.00	0.19
161	002042	华孚色纺	63,400	726,564.00	0.19
162	600831	广电网络	55,300	722,218.00	0.18
163	002670	国盛金控	21,400	719,040.00	0.18
164	600754	锦江股份	24,400	718,824.00	0.18
165	000417	合肥百货	83,192	717,946.96	0.18
166	002071	长城影视	51,900	707,916.00	0.18
167	002425	凯撒文化	31,025	705,818.75	0.18
168	002029	七匹狼	69,100	705,511.00	0.18
169	600676	交运股份	78,295	702,306.15	0.18
170	300426	唐德影视	24,600	701,100.00	0.18
171	300413	快乐购	30,500	700,890.00	0.18
172	600630	龙头股份	45,286	699,215.84	0.18
173	002416	爱施德	47,252	696,021.96	0.18
174	600825	新华传媒	79,610	691,810.90	0.18
175	002120	韵达股份	13,700	690,480.00	0.18
176	002083	孚日股份	96,814	684,474.98	0.17
177	002502	骅威文化	52,368	676,594.56	0.17
178	002213	特尔佳	25,100	671,425.00	0.17
179	000888	峨眉山 A	56,200	671,028.00	0.17
180	300217	东方电热	155,205	661,173.30	0.17

181	600480	凌云股份	43,900	658,939.00	0.17
182	600686	金龙汽车	46,210	656,644.10	0.17
183	002676	顺威股份	24,400	656,116.00	0.17
184	000987	越秀金控	45,226	655,324.74	0.17
185	000760	斯太尔	60,025	653,672.25	0.17
186	300100	双林股份	19,200	652,800.00	0.17
187	000599	青岛双星	82,183	652,533.02	0.17
188	600640	号百控股	32,570	650,748.60	0.17
189	002033	丽江旅游	45,094	649,353.60	0.17
190	600555	海航创新	103,800	648,750.00	0.17
191	300343	联创互联	27,000	645,300.00	0.16
192	603008	喜临门	34,996	640,426.80	0.16
193	600551	时代出版	31,465	639,368.80	0.16
194	000700	模塑科技	76,500	638,775.00	0.16
195	600070	浙江富润	43,400	637,546.00	0.16
196	300304	云意电气	13,776	632,318.40	0.16
197	002045	国光电器	50,753	631,874.85	0.16
198	600054	黄山旅游	39,100	627,555.00	0.16
199	601965	中国汽研	58,605	624,143.25	0.16
200	002540	亚太科技	79,147	621,303.95	0.16
201	600358	国旅联合	61,500	619,920.00	0.16
202	000679	大连友谊	43,400	611,940.00	0.16
203	600469	风神股份	51,375	611,362.50	0.16
204	600229	城市传媒	53,500	608,830.00	0.16
205	600818	中路股份	18,164	606,314.32	0.15
206	002516	旷达科技	91,600	600,896.00	0.15
207	002571	德力股份	39,097	599,357.01	0.15
208	600987	航民股份	48,414	597,428.76	0.15
209	002590	万安科技	29,200	593,344.00	0.15
210	600712	南宁百货	58,100	587,972.00	0.15
211	002003	伟星股份	41,029	587,945.57	0.15
212	002472	双环传动	51,552	584,599.68	0.15
213	600336	澳柯玛	72,700	584,508.00	0.15
214	002327	富安娜	65,050	572,440.00	0.15
215	600335	国机汽车	47,070	571,900.50	0.15
216	002662	京威股份	34,300	564,235.00	0.14
217	000589	黔轮胎 A	94,500	564,165.00	0.14
218	603355	莱克电气	12,200	563,274.00	0.14
219	000921	海信科龙	55,051	562,070.71	0.14
220	603001	奥康国际	24,472	560,408.80	0.14
221	002537	海立美达	17,300	560,174.00	0.14
222	600661	新南洋	19,700	560,071.00	0.14
223	600493	凤竹纺织	33,100	558,728.00	0.14
224	000796	凯撒旅游	36,700	556,005.00	0.14

225	002348	高乐股份	72,100	555,891.00	0.14
226	000665	湖北广电	38,753	553,392.84	0.14
227	300081	恒信移动	35,700	550,494.00	0.14
228	002098	浔兴股份	28,400	547,836.00	0.14
229	300160	秀强股份	45,560	547,631.20	0.14
230	600785	新华百货	20,574	547,268.40	0.14
231	600865	百大集团	40,151	546,455.11	0.14
232	600135	乐凯胶片	39,738	545,205.36	0.14
233	000058	深赛格	49,200	542,676.00	0.14
234	000564	西安民生	63,900	541,872.00	0.14
235	000719	大地传媒	46,770	538,322.70	0.14
236	300432	富临精工	21,900	534,360.00	0.14
237	300279	和晶科技	12,200	530,700.00	0.14
238	002101	广东鸿图	22,690	527,542.50	0.13
239	002454	松芝股份	38,573	525,749.99	0.13
240	000757	浩物股份	48,175	524,144.00	0.13
241	600861	北京城乡	33,775	523,174.75	0.13
242	002087	新野纺织	74,620	522,340.00	0.13
243	002759	天际股份	20,900	521,037.00	0.13
244	600960	渤海活塞	58,700	520,082.00	0.13
245	300063	天龙集团	17,700	515,601.00	0.13
246	002362	汉王科技	22,802	514,413.12	0.13
247	600870	厦华电子	55,800	513,918.00	0.13
248	300071	华谊嘉信	52,000	512,720.00	0.13
249	002328	新朋股份	47,752	512,378.96	0.13
250	300403	地尔汉宇	8,200	510,614.00	0.13
251	000613	大东海 A	33,600	510,048.00	0.13
252	600523	贵航股份	21,975	504,106.50	0.13
253	002536	西泵股份	35,614	502,869.68	0.13
254	002404	嘉欣丝绸	55,500	501,720.00	0.13
255	300247	乐金健康	61,300	501,434.00	0.13
256	300392	腾信股份	29,200	496,108.00	0.13
257	600814	杭州解百	43,600	495,732.00	0.13
258	000868	安凯客车	74,124	492,924.60	0.13
259	000721	西安饮食	53,253	490,992.66	0.13
260	600136	当代明诚	29,700	487,971.00	0.12
261	002494	华斯股份	35,250	487,860.00	0.12
262	601799	星宇股份	12,600	485,100.00	0.12
263	603808	歌力思	15,100	484,559.00	0.12
264	600515	海航基础	41,700	483,720.00	0.12
265	002762	金发拉比	12,300	475,026.00	0.12
266	603306	华懋科技	13,000	473,070.00	0.12
267	000753	漳州发展	94,299	469,609.02	0.12
268	002543	万和电气	26,800	466,320.00	0.12

269	002574	明牌珠宝	40,162	464,674.34	0.12
270	600697	欧亚集团	14,500	464,435.00	0.12
271	000521	美菱电器	67,100	464,332.00	0.12
272	000025	特力A	8,400	464,268.00	0.12
273	000678	襄阳轴承	35,000	460,600.00	0.12
274	300342	天银机电	19,989	459,747.00	0.12
275	600698	湖南天雁	67,800	454,938.00	0.12
276	603869	北部湾旅	15,945	453,316.35	0.12
277	300258	精锻科技	30,800	451,528.00	0.12
278	601007	金陵饭店	32,031	451,316.79	0.12
279	000428	华天酒店	62,090	450,773.40	0.11
280	002614	蒙发利	33,787	450,718.58	0.11
281	603898	好莱客	13,800	446,706.00	0.11
282	002137	麦达数字	35,100	444,015.00	0.11
283	002634	棒杰股份	42,100	443,313.00	0.11
284	600088	中视传媒	20,195	442,674.40	0.11
285	002612	朗姿股份	24,402	442,164.24	0.11
286	002363	隆基机械	35,250	440,625.00	0.11
287	002406	远东传动	51,300	437,076.00	0.11
288	000978	桂林旅游	38,400	436,608.00	0.11
289	002678	珠江钢琴	29,098	432,978.24	0.11
290	002351	漫步者	35,834	426,424.60	0.11
291	002144	宏达高科	18,850	426,387.00	0.11
292	600232	金鹰股份	33,300	424,242.00	0.11
293	002776	柏堡龙	14,600	419,020.00	0.11
294	002290	禾盛新材	18,500	417,730.00	0.11
295	600370	三房巷	60,700	416,402.00	0.11
296	002238	天威视讯	28,230	413,569.50	0.11
297	603116	红蜻蜓	18,700	412,522.00	0.11
298	600386	北巴传媒	30,712	410,005.20	0.10
299	002605	姚记扑克	24,207	408,614.16	0.10
300	002592	八菱科技	13,133	398,849.21	0.10
301	002593	日上集团	53,300	392,288.00	0.10
302	000419	通程控股	49,700	392,133.00	0.10
303	002403	爱仕达	26,700	390,354.00	0.10
304	603999	读者传媒	13,300	389,956.00	0.10
305	002722	金轮股份	8,100	388,881.00	0.10
306	600178	东安动力	35,200	388,608.00	0.10
307	603818	曲美家居	22,100	385,645.00	0.10
308	603729	龙韵股份	5,100	378,471.00	0.10
309	601999	出版传媒	33,566	376,610.52	0.10
310	603997	继峰股份	19,200	375,552.00	0.10
311	002084	海鸥卫浴	34,775	373,831.25	0.10
312	000026	飞亚达A	27,225	372,982.50	0.10

313	300329	海伦钢琴	23,000	370,300.00	0.09
314	300272	开能环保	25,252	369,689.28	0.09
315	603598	引力传媒	16,500	368,940.00	0.09
316	002708	光洋股份	28,620	366,622.20	0.09
317	603788	宁波高发	8,600	366,188.00	0.09
318	002615	哈尔斯	20,800	365,040.00	0.09
319	002765	蓝黛传动	13,000	364,000.00	0.09
320	000430	张家界	29,300	357,753.00	0.09
321	603006	黎明股份	11,800	357,304.00	0.09
322	002740	爱迪尔	22,800	352,488.00	0.09
323	002790	瑞尔特	7,300	351,130.00	0.09
324	600891	秋林集团	37,600	350,432.00	0.09
325	002677	浙江美大	29,480	344,916.00	0.09
326	002356	赫美集团	14,200	343,640.00	0.09
327	603868	飞科电器	7,300	342,078.00	0.09
328	002763	汇洁股份	10,000	341,500.00	0.09
329	002265	西仪股份	17,700	338,070.00	0.09
330	603268	松发股份	6,700	338,015.00	0.09
331	603398	邦宝益智	9,800	328,496.00	0.08
332	300473	德尔股份	4,200	328,104.00	0.08
333	002553	南方轴承	26,500	325,950.00	0.08
334	002703	浙江世宝	10,500	323,610.00	0.08
335	600258	首旅酒店	14,100	322,326.00	0.08
336	300507	苏奥传感	3,000	316,500.00	0.08
337	000524	岭南控股	20,500	316,110.00	0.08
338	603377	东方时尚	7,700	310,849.00	0.08
339	002761	多喜爱	7,300	298,278.00	0.08
340	002607	亚夏汽车	27,800	296,070.00	0.08
341	603958	哈森股份	9,900	294,822.00	0.08
342	603608	天创时尚	12,800	294,400.00	0.08
343	002723	金莱特	11,400	287,850.00	0.07
344	600081	东风科技	19,100	287,455.00	0.07
345	002731	萃华珠宝	9,200	278,116.00	0.07
346	000038	深大通	6,000	278,100.00	0.07
347	603101	汇嘉时代	11,000	277,090.00	0.07
348	603996	中新科技	13,700	272,904.00	0.07
349	600828	茂业商业	29,000	245,050.00	0.06
350	603099	长白山	12,300	241,572.00	0.06
351	603023	威帝股份	16,400	239,932.00	0.06
352	603600	永艺股份	4,600	239,844.00	0.06
353	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.06
354	600623	华谊集团	17,100	229,824.00	0.06
355	603701	德宏股份	3,600	222,228.00	0.06
356	603726	朗迪集团	4,300	220,289.00	0.06

357	603838	四通股份	13,400	217,080.00	0.06
358	002780	三夫户外	3,100	209,250.00	0.05
359	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.05
360	603555	贵人鸟	6,387	196,464.12	0.05
361	603166	福达股份	11,000	178,310.00	0.05
362	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.03
363	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.03
364	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.03
365	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
366	603878	武进不锈	1,815	72,600.00	0.02
367	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
368	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.02
369	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02
370	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.02
371	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
372	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.01
373	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
374	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.01
375	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
376	603228	景旺电子	1,766	40,900.56	0.01
377	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
378	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
379	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
380	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
381	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
382	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
383	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
384	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
385	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
386	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
387	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
388	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
389	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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	000333	美的集团	6,601,500.07	1.32

2	002739	万达院线	4,537,797.65	0.91
3	600297	广汇汽车	2,769,197.14	0.55
4	002131	利欧股份	2,283,957.35	0.46
5	002512	达华智能	2,159,040.00	0.43
6	600158	中体产业	2,031,511.00	0.41
7	002343	慈文传媒	1,888,698.00	0.38
8	600715	文投控股	1,677,139.36	0.34
9	002027	分众传媒	1,569,845.00	0.31
10	002602	世纪华通	1,542,207.00	0.31
11	000156	华数传媒	1,320,438.80	0.26
12	600959	江苏有线	1,257,223.10	0.25
13	600707	彩虹股份	1,186,994.67	0.24
14	000681	视觉中国	1,070,611.00	0.21
15	300269	联建光电	1,064,495.00	0.21
16	300116	坚瑞沃能	1,062,939.00	0.21
17	600699	均胜电子	968,656.00	0.19
18	002188	巴士在线	877,263.00	0.18
19	300100	双林股份	866,924.82	0.17
20	002590	万安科技	866,374.00	0.17

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	600415	小商品城	2,921,928.98	0.58
2	600482	中国动力	1,969,614.00	0.39
3	600851	海欣股份	1,772,694.00	0.35
4	600978	宜华生活	1,750,334.00	0.35
5	600637	东方明珠	1,647,328.37	0.33
6	002024	苏宁云商	1,631,740.15	0.33
7	601118	海南橡胶	1,337,197.50	0.27
8	600651	飞乐音响	1,335,193.19	0.27
9	000333	美的集团	1,252,256.00	0.25
10	002102	冠福股份	1,126,416.00	0.23

11	002224	三力士	1,121,070.00	0.22
12	002486	嘉麟杰	1,111,298.08	0.22
13	300116	坚瑞沃能	1,110,409.00	0.22
14	600337	美克家居	1,052,598.00	0.21
15	601238	广汽集团	1,019,297.32	0.20
16	002512	达华智能	964,291.00	0.19
17	000625	长安汽车	960,056.00	0.19
18	002413	雷科防务	955,675.00	0.19
19	000550	江铃汽车	952,358.00	0.19
20	002563	森马服饰	939,012.00	0.19

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	92,000,390.76
卖出股票的收入（成交）总额	93,221,898.35

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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。

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	12,726.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	841.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,567.92

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
217	1,171,226.24	250,474,056.00	98.55%	3,682,038.00	1.45%

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	250,472,095.00	98.55%
2	何凤珍	1,168,410.00	0.46%
3	朱益	384,200.00	0.15%
4	王浩	149,919.00	0.06%
5	朱晓晔	107,000.00	0.04%
6	苑桂花	100,006.00	0.04%
7	李桂青	100,000.00	0.04%
8	许国根	100,000.00	0.04%
9	陈金华	87,011.00	0.03%
10	叶敖大	70,405.00	0.03%

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	272,156,094.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	30,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	254,156,094.00
-------------	----------------

§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

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。自 2016 年 10 月 13 日起，本基金管理人聘任张敬晗为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

2016 年 12 月，郭德秋先生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，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。该案经浙江省义乌市人民法院审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。

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。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

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	
银河证券	2	179,445,277.18	99.14%	131,227.97	98.91%	-
广发证券	3	1,552,304.00	0.86%	1,445.67	1.09%	-
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	-	-	-	-	-
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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	390,519.80	100.00%	-	-	-	-

11.8 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关于增加中泰证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-11-11
2	广发基金管理有限公司关于增加广源达信为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-18
3	广发基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-14
4	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
5	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

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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

二〇一七年三月二十八日