

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

2017 年半年度报告

2017 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：二〇一七年八月二十五日

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 2017 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
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	15
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 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合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末投资目标基金明细	38
7.3 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.4 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	40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.13 投资组合报告附注	50

8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	52
9 开放式基金份额变动	53
10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	56
11.3 查阅方式	56

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发起式联接基金	
基金简称	广发可选消费联接	
基金主代码	001133	
交易代码	001133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 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	500,662,202.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	广发可选消费联接 A	广发可选消费联接 C
下属两级基金的交易代码	001133	002977
报告期末下属分级基金的份额总额	484,126,709.96 份	16,535,492.32 份

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金主代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日
基金份额上市的证券交易所	深圳交易所
上市日期	2015 年 6 月 25 日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，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	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。
业绩比较基准	95%×中证全指可选消费指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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，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。
--------	--

2.2.1 目标基金产品说明

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	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	广发可选消费联接 A	广发可选消费联接 C
本期已实现收益	-4,178,491.55	-82,285.08
本期利润	19,301,233.37	230,004.49
加权平均基金份额本期利润	0.0387	0.0199
本期加权平均净值利润率	4.75%	2.43%
本期基金份额净值增长率	4.83%	4.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	广发可选消费联接 A	广发可选消费联接 C
期末可供分配利润	-76,709,394.34	-3,907,827.51
期末可供分配基金份额利润	-0.1584	-0.2363
期末基金资产净值	407,417,315.62	13,930,757.28
期末基金份额净值	0.8416	0.8425
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	广发可选消费联接 A	广发可选消费联接 C
基金份额累计净值增长率	-15.84%	7.39%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发可选消费联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.50%	0.75%	5.93%	0.78%	0.57%	-0.03%
过去三个月	1.09%	0.71%	-0.50%	0.73%	1.59%	-0.02%
过去六个月	4.83%	0.70%	2.07%	0.72%	2.76%	-0.02%
过去一年	9.03%	0.77%	3.86%	0.79%	5.17%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-15.84%	1.92%	-14.48%	1.98%	-1.36%	-0.06%

广发可选消费联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.48%	0.75%	5.93%	0.78%	0.55%	-0.03%
过去三个月	1.01%	0.71%	-0.50%	0.73%	1.51%	-0.02%
过去六个月	4.67%	0.70%	2.07%	0.72%	2.60%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.39%	0.77%	2.21%	0.79%	5.18%	-0.02%

(1) 业绩比较基准为:95%×中证全指可选消费指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

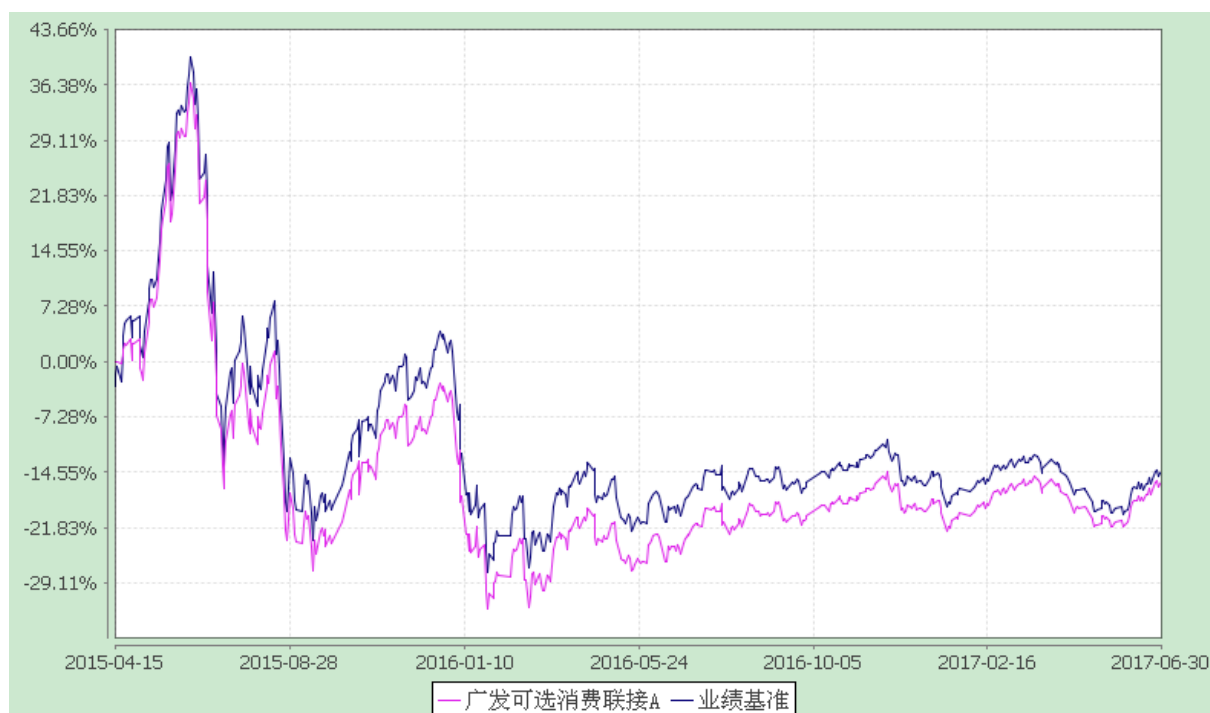
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中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

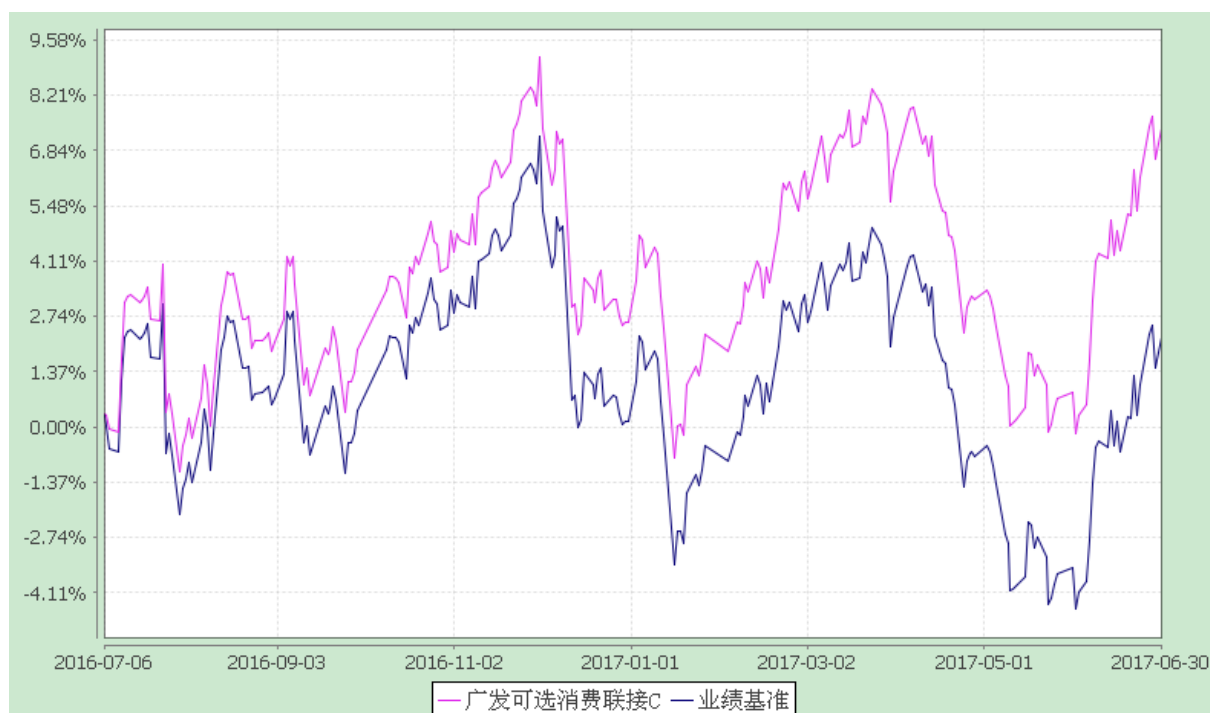
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年4月15日至2017年6月30日)

广发可选消费联接 A



广发可选消费联接 C



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 26 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、渠道管理总部、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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百四十四只开放式基金——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、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF)、广发景祥纯债债券型证券投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2015-04-15	-	18 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

	<p>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；广发信息技术联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发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；广发金融地产联接基金的基金经理；广发能源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金的基金经理；广发全指工业 ETF 联接基金的基金经理；广发中证全指工业 ETF 基金的基金经理；数量投资部副总经理</p>				<p>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,2017 年 6 月 13 日起任广发中证全指工业 ETF 和广发全指工业 ETF 联接基金基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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发起式联接基金基金合同》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，为基金份额持有人谋求最大利益。

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 联接基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证全指可选消费 ETF 及指数成份股等，间接复制指数，同时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，本基金跟踪误差来源主要是建仓、申购、赎回和成份股调整因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 4.83%，C 类份额净值增长率为 4.67%，同期业绩基准收益率为 2.07%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年，市场的结构严重分化，代表大盘的沪深 300 指数创新高，而代表小盘的中证 1000 指数表现偏弱。根据统计局公告的数据，二季度 GDP 增速为 6.9%，经济内生增长较强，宏观经济端的超预期表现使得近期周期行业股票表现强势。另外，6 月工业增加值同比增速 7.6%；6 月单月固定资产投资增速同比回升至 8.8%，其中制造业投资同比从上月的 5.9% 上升到 6 月的 6.6%，基建从上月的 13.1% 大幅上升到 6 月的 17.3%；社会消费品零售总额 6 月同比上升 11%。众多经济数据预示着未来经济逐步走入正轨。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发起式联接基金（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发起式联接基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	23,896,341.29	23,521,152.32
结算备付金		-	-
存出保证金		7,164.11	18,046.72
交易性金融资产	6.4.7.2	399,138,107.81	392,149,868.64
其中：股票投资		10,216,352.33	5,796,662.10
基金投资		388,921,755.48	386,353,206.54
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,196.93	4,870.95
应收股利		-	-
应收申购款		206,886.25	238,237.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		423,252,696.39	415,932,175.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		1,681,696.59	1,043,027.42
应付管理人报酬		13,168.00	12,683.74
应付托管费		2,633.63	2,536.75

应付销售服务费		4,117.65	611.08
应付交易费用	6.4.7.7	33,692.23	21,839.34
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	169,315.39	332,378.31
负债合计		1,904,623.49	1,413,076.64
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	500,662,202.28	516,308,507.64
未分配利润	6.4.7.1 0	-79,314,129.38	-101,789,408.58
所有者权益合计		421,348,072.90	414,519,099.06
负债和所有者权益总计		423,252,696.39	415,932,175.70

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，广发可选消费联接 A 基金份额净值人民币 0.8416 元，基金份额总额 484,126,709.96 份；广发可选消费联接 C 基金份额净值人民币 0.8425 元，基金份额总额 16,535,492.32 份；总份额总额 500,662,202.28 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发起式联接基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		19,856,387.10	-98,284,382.32
1. 利息收入		84,592.35	91,341.86
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	84,592.07	91,336.35
债券利息收入		0.28	5.51
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）		-4,041,035.45	-856,267.46
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-186,026.72	-792,015.10
基金投资收益	6.4.7.1 3	-3,964,700.40	-91,995.34
债券投资收益	6.4.7.1 4	213.72	1,855.01

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 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 6	109,477.95	25,887.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	23,792,014.49	-97,552,823.76
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 8	20,815.71	33,367.04
减：二、费用		325,149.24	323,111.76
1. 管理人报酬		82,159.03	82,605.73
2. 托管费		16,431.88	16,521.20
3. 销售服务费		18,390.08	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	37,705.26	43,363.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.2 0	170,462.99	180,621.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,531,237.86	-98,607,494.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,531,237.86	-98,607,494.08

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发起式联接基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	516,308,507.64	-101,789,408.58	414,519,099.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,531,237.86	19,531,237.86
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）	-15,646,305.36	2,944,041.34	-12,702,264.02

其中：1. 基金申购款	53,539,432.88	-9,264,569.81	44,274,863.07
2. 基金赎回款	-69,185,738.24	12,208,611.15	-56,977,127.09
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）	500,662,202.28	-79,314,129.38	421,348,072.90
项目	上年度可比期间 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）	559,303,895.75	-28,867,423.78	530,436,471.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-98,607,494.08	-98,607,494.08
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）	-14,407,337.28	3,208,459.33	-11,198,877.95
其中：1. 基金申购款	56,401,214.59	-13,388,910.33	43,012,304.26
2. 基金赎回款	-70,808,551.87	16,597,369.66	-54,211,182.21
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）	544,896,558.47	-124,266,458.53	420,630,099.94

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发起式联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2014]1381 号文核准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发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基金合同》发起，于 2015 年 4 月 15 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 2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 10 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 1,415,595,322.66 元，有效认购户数为 20,582 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 218,315.61 元，折合基金份额 218,315.61 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。基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,415,595,322.66 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股。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）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准： $95 \times \text{中证全指可选消费指数收益率} + 5 \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

本基金的财务报表于 2017 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（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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，暂免于缴纳印花税、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 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	23,896,341.29
定期存款	-
其他存款	-
合计	23,896,341.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,631,444.89	10,216,352.33	-415,092.56
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	456,011,834.22	388,921,755.48	-67,090,078.74
其他	-	-	-
合计	466,643,279.11	399,138,107.81	-67,505,171.30

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	4,192.11
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2.88
应收结算备付金利息	1.94
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	4,196.93

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	33,692.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,692.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	712.08
预提费用	168,603.31
合计	169,315.39

6.4.7.9 实收基金

广发可选消费联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	513,864,143.82	513,864,143.82
本期申购	22,846,794.00	22,846,794.00
本期赎回（以“-”号填列）	-52,584,227.86	-52,584,227.86
本期末	484,126,709.96	484,126,709.96

广发可选消费联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,444,363.82	2,444,363.82
本期申购	30,692,638.88	30,692,638.88
本期赎回（以“-”号填列）	-16,601,510.38	-16,601,510.38

本期末	16,535,492.32	16,535,492.32
-----	---------------	---------------

注：申购含转换转入、红利再投资份(金)额，赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

广发可选消费联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,598,786.32	-120,911,255.94	-101,312,469.62
本期利润	-4,178,491.55	23,479,724.92	19,301,233.37
本期基金份额交易产生的变动数	-988,043.93	6,289,885.84	5,301,841.91
其中：基金申购款	740,821.75	-4,790,207.66	-4,049,385.91
基金赎回款	-1,728,865.68	11,080,093.50	9,351,227.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,432,250.84	-91,141,645.18	-76,709,394.34

广发可选消费联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-554,402.28	77,463.32	-476,938.96
本期利润	-82,285.08	312,289.57	230,004.49
本期基金份额交易产生的变动数	-3,271,140.15	913,339.58	-2,357,800.57
其中：基金申购款	-7,133,583.43	1,918,399.53	-5,215,183.90
基金赎回款	3,862,443.28	-1,005,059.95	2,857,383.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,907,827.51	1,303,092.47	-2,604,735.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	83,893.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	119.56
结算备付金利息收入	579.03
其他	-
合计	84,592.07

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	16,302,567.11

减：卖出股票成本总额	16,488,593.83
买卖股票差价收入	-186,026.72

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	18,896,982.59
减：卖出/赎回基金成本总额	22,861,682.99
基金投资收益	-3,964,700.40

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,214.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00
减：应收利息总额	0.28
买卖债券差价收入	213.72

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	109,477.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	109,477.95

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	23,792,014.49
——股票投资	91,710.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	23,700,304.43
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	23,792,014.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	17,188.55
手续费返还	-
基金转换费收入	3,627.16
印花税返还	-
替代损益	-
其他	-
合计	20,815.71

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	37,705.26
银行间市场交易费用	-
合计	37,705.26

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	1,859.68
合计	170,462.99

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	本基金是该基金的联接基金

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	-	-	4,024,444.84	13.95%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	2,458.40	22.84%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	3,748.05	17.12%	-	-

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月 30日	2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	82,159.03	82,605.73
其中：支付销售机构的客户维护费	353,980.85	357,236.75

注：基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月 30日	2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,431.88	16,521.20

注：基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发可选消费联接A	广发可选消费联接C	合计
广发证券股份有限公司	-	450.47	450.47
广发基金管理有限公司	-	15,240.58	15,240.58
合计	-	15,691.05	15,691.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发可选消费联接A	广发可选消费联接C	合计
广发证券股份有限公司	-	-	-
广发基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下:

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经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划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	广发可选消费联接A	广发可选消费联接C	广发可选消费联接A

期初持有的基金份额	65,821,345.49	-	65,821,345.49
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	65,821,345.49	-	65,821,345.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.60%	-	12.08%

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

广发可选消费联接 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发可选消费联接 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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	23,896,341.29	83,893.48	24,466,653.12	90,623.08

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 2017年1月1日至2017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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

				股/张)	
广发证券股份有限公司	002101	广东鸿图	配股认购	150.00	1,434.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有 239,557,595.00 份目标 ETF 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份额，占其总份额的比例为 98.93%。

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（2017 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

截至本报告期末 2017 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证券。

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
002486	嘉麟杰	2017-02-28	重大事项停牌	8.64	-	-	400.00	3,444.94	3,456.00	-
002076	雪莱特	2017-03-20	重大事项停牌	7.07	-	-	602.00	4,569.30	4,256.14	-
300364	中文在线	2017-02-13	重大事项停牌	33.43	-	-	200.00	9,570.67	6,686.00	-
000673	当代东方	2017-01-18	重大事项停牌	13.53	-	-	503.00	6,630.63	6,805.59	-
603608	天创时尚	2017-04-05	重大事项停牌	13.91	2017-07-21	13.99	560.00	8,128.80	7,789.60	-
000613	*ST 东海 A	2017-02-15	重大事项停牌	15.04	2017-08-17	14.29	600.00	9,054.00	9,024.00	-
300148	天舟文化	2017-01-25	重大事项停牌	15.57	2017-08-01	14.01	629.00	9,979.42	9,793.53	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项停牌	8.07	-	-	1,300.00	13,115.11	10,491.00	-
002260	德奥通航	2016-12-05	重大事项停牌	23.10	-	-	505.00	12,861.53	11,665.50	-
600136	当代明诚	2017-02-13	重大事项停牌	16.79	-	-	700.00	12,129.00	11,753.00	-
600358	国旅联合	2017-06-05	重大事项停牌	7.00	-	-	1,701.00	16,365.13	11,907.00	-
300101	双林股	2017-0	重大事	25.96	-	-	501.00	14,563.83	13,005.96	-

0	份	4-05	项停牌								
603598	引力传媒	2017-05-10	重大事项停牌	16.21	-	-	806.00	16,672.17	13,065.26	-	
000887	中鼎股份	2017-04-27	重大事项停牌	22.09	2017-07-14	19.88	597.00	14,288.11	13,187.73	-	
000700	模塑科技	2017-06-28	重大事项停牌	8.09	2017-08-16	8.00	1,704.00	14,201.42	13,785.36	-	
002098	浔兴股份	2017-04-24	重大事项停牌	14.09	2017-07-24	14.48	1,002.00	14,871.70	14,118.18	-	
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项停牌	12.59	2017-07-03	12.70	1,202.00	17,046.77	15,133.18	-	
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项停牌	11.32	-	-	1,500.00	16,799.59	16,980.00	-	
002348	高乐股份	2017-05-11	重大事项停牌	7.01	2017-07-27	6.70	2,504.00	19,098.17	17,553.04	-	
002356	赫美集团	2017-06-14	重大事项停牌	25.41	-	-	700.00	17,842.42	17,787.00	-	
000038	深大通	2017-05-12	重大事项停牌	31.74	-	-	600.00	24,930.80	19,044.00	-	
300413	快乐购	2017-04-05	重大事项停牌	20.29	-	-	1,001.00	22,969.11	20,310.29	-	
300089	文化长城	2017-04-19	重大事项停牌	14.93	-	-	1,401.00	22,456.43	20,916.93	-	
600653	申华控股	2017-05-08	重大事项停牌	3.26	-	-	7,200.00	27,321.79	23,472.00	-	
002676	顺威股份	2017-06-30	重大事项停牌	15.98	-	-	1,509.00	23,500.34	24,113.82	-	
002418	康盛股份	2017-03-20	重大事项停牌	9.31	2017-07-10	9.30	2,600.00	25,170.76	24,206.00	-	
600609	金杯汽车	2017-03-20	重大事项停牌	8.08	-	-	3,000.00	22,425.41	24,240.00	-	
002625	光启技术	2017-04-13	重大事项停牌	36.36	-	-	704.00	27,168.01	25,597.44	-	
002070	*ST 众和	2017-05-02	重大事项停牌	10.17	-	-	2,539.00	34,739.06	25,821.63	-	
300291	华录百纳	2017-04-19	重大事项停牌	20.02	-	-	1,705.00	34,350.21	34,134.10	-	
600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项停牌	10.57	-	-	5,561.00	59,258.78	58,779.77	-	
000100	TCL 集团	2017-04-21	重大事项停牌	3.43	2017-07-26	3.72	34,900.00	124,764.14	119,707.00	-	

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 2017 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 2017 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。

本基金本报告期末未持有债券投资，因此与债券相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分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。

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 2017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	23,896,341.29	-	-	-	23,896,341.29
存出保证金	7,164.11	-	-	-	7,164.11
交易性金融资产	-	-	-	399,138,107.81	399,138,107.81
应收利息	-	-	-	4,196.93	4,196.93
应收申购款	-	-	-	206,886.25	206,886.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,903,505.40	-	-	399,349,190.99	423,252,696.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,681,696.59	1,681,696.59
应付管理人报酬	-	-	-	13,168.00	13,168.00
应付托管费	-	-	-	2,633.63	2,633.63
应付交易费用	-	-	-	33,692.23	33,692.23
应付销售服务费	-	-	-	4,117.65	4,117.65
其他负债	-	-	-	169,315.39	169,315.39
负债总计	-	-	-	1,904,623.49	1,904,623.49
利率敏感度缺口	23,903,505.40	-	-	-397,444,567.50	421,348,072.90
上年度末 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	23,521,152.32	-	-	-	23,521,152.32
存出保证金	18,046.72	-	-	-	18,046.72
交易性金融资产	-	-	-	392,149,868.64	392,149,868.64
应收利息	-	-	-	4,870.95	4,870.95
应收申购款	-	-	-	238,237.07	238,237.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,539,199.04	-	-	392,392,976.66	415,932,175.70
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,043,027.42	1,043,027.42
应付管理人报酬	-	-	-	12,683.74	12,683.74
应付托管费	-	-	-	2,536.75	2,536.75
应付交易费用	-	-	-	21,839.34	21,839.34
应付销售服务费	-	-	-	611.08	611.08
其他负债	-	-	-	332,378.31	332,378.31
负债总计	-	-	-	1,413,076.64	1,413,076.64
利率敏感度缺口	23,539,199.04	-	-	390,979,900.02	414,519,099.06

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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	10,216,352.33	2.42	5,796,662.10	1.40
交易性金融资产—基金投资	388,921,755.48	92.30	386,353,206.54	93.21
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	399,138,107.81	94.73	392,149,868.64	94.60

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	上年度末
		2017年6月30日	2016年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	562,688.59	20,474,909.75
	业绩比较基准下降 5%	-562,688.59	-20,474,909.75

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 2017 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 398,489,521.76 元，属于第二层级的余额为 648,586.05 元，无属于第三层级的余额（2016 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 391,805,418.51 元，第二层级的余额为 344,450.13 元，无属于第三层级的余额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，

本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(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	10,216,352.33	2.41
	其中：股票	10,216,352.33	2.41
2	基金投资	388,921,755.48	91.89
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,896,341.29	5.65
8	其他各项资产	218,247.29	0.05
9	合计	423,252,696.39	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	------	-----	------	-----------

						(%)
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	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	388,921,755.48	92.30

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	6,310,211.36	1.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,028,250.08	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	12,665.00	0.00
H	住宿和餐饮业	90,009.33	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,059,279.03	0.25
J	金融业	13,038.00	0.00
K	房地产业	110,528.00	0.03
L	租赁和商务服务业	471,406.22	0.11
M	科学研究和技术服务业	16,226.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	199,424.50	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	39,815.88	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	865,498.93	0.21
S	综合	-	-
	合计	10,216,352.33	2.42

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.4 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	600637	东方明珠	34,781	753,704.27	0.18
2	000651	格力电器	14,501	597,006.17	0.14
3	000333	美的集团	13,355	574,799.20	0.14
4	600104	上汽集团	10,399	322,888.95	0.08
5	600690	青岛海尔	9,201	138,475.05	0.03
6	002024	苏宁云商	11,101	124,886.25	0.03
7	000100	TCL 集团	34,900	119,707.00	0.03
8	600660	福耀玻璃	4,404	114,680.16	0.03
9	002594	比亚迪	2,202	109,989.90	0.03
10	601888	中国国旅	3,404	102,596.56	0.02
11	600741	华域汽车	4,201	101,832.24	0.02
12	000069	华侨城 A	9,700	97,582.00	0.02
13	600066	宇通客车	4,201	92,295.97	0.02
14	002739	万达电影	1,700	86,649.00	0.02
15	002572	索菲亚	2,104	86,264.00	0.02
16	000625	长安汽车	5,901	85,092.42	0.02
17	002508	老板电器	1,932	84,003.36	0.02
18	000839	中信国安	8,250	82,417.50	0.02
19	002085	万丰奥威	3,601	70,039.45	0.02
20	600177	雅戈尔	6,640	67,196.80	0.02
21	000793	华闻传媒	6,200	62,744.00	0.01
22	000581	威孚高科	2,302	59,621.80	0.01
23	600682	南京新百	1,601	59,076.90	0.01
24	600959	江苏有线	5,561	58,779.77	0.01
25	601633	长城汽车	3,901	51,844.29	0.01
26	000418	小天鹅 A	1,107	51,796.53	0.01
27	600373	中文传媒	2,200	51,722.00	0.01
28	600398	海澜之家	5,401	51,255.49	0.01
29	600297	广汇汽车	6,651	50,082.03	0.01
30	600699	均胜电子	1,505	48,295.45	0.01
31	603729	龙韵股份	703	48,162.53	0.01
32	600138	中青旅	2,200	46,332.00	0.01
33	601098	中南传媒	2,400	44,736.00	0.01
34	002035	华帝股份	1,841	44,552.20	0.01
35	300144	宋城演艺	2,100	43,827.00	0.01

36	002602	世纪华通	1,203	43,620.78	0.01
37	300027	华谊兄弟	5,299	42,868.91	0.01
38	600060	海信电器	2,801	42,491.17	0.01
39	601718	际华集团	4,801	42,200.79	0.01
40	000917	电广传媒	3,686	41,651.80	0.01
41	603355	莱克电气	702	41,256.54	0.01
42	000559	万向钱潮	3,720	39,506.40	0.01
43	002668	奥马电器	2,004	39,478.80	0.01
44	600839	四川长虹	10,903	39,468.86	0.01
45	600166	福田汽车	13,700	38,908.00	0.01
46	600978	宜华生活	3,820	38,391.00	0.01
47	601258	庞大集团	13,705	38,374.00	0.01
48	600715	文投控股	1,700	38,352.00	0.01
49	603868	飞科电器	600	37,104.00	0.01
50	000025	特力A	700	36,218.00	0.01
51	600418	江淮汽车	3,401	35,880.55	0.01
52	600037	歌华有线	2,401	34,958.56	0.01
53	002343	慈文传媒	904	34,225.44	0.01
54	300291	华录百纳	1,705	34,134.10	0.01
55	300473	德尔股份	704	33,510.40	0.01
56	600122	宏图高科	3,000	33,300.00	0.01
57	002027	分众传媒	2,402	33,051.52	0.01
58	300058	蓝色光标	4,201	32,851.82	0.01
59	600158	中体产业	1,901	32,507.10	0.01
60	002292	奥飞娱乐	1,901	32,126.90	0.01
61	002640	跨境通	1,500	31,875.00	0.01
62	600694	大商股份	806	31,409.82	0.01
63	601238	广汽集团	1,202	31,324.12	0.01
64	002048	宁波华翔	1,499	31,269.14	0.01
65	601799	星宇股份	700	30,954.00	0.01
66	603788	宁波高发	702	30,200.04	0.01
67	000156	华数传媒	2,003	29,864.73	0.01
68	600729	重庆百货	1,111	29,819.24	0.01
69	000501	鄂武商A	1,614	29,794.44	0.01
70	600687	刚泰控股	2,301	29,636.88	0.01
71	600693	东百集团	2,400	29,568.00	0.01
72	300133	华策影视	2,546	28,515.20	0.01
73	000800	一汽轿车	2,801	28,486.17	0.01
74	000158	常山股份	1,802	28,471.60	0.01
75	603766	隆鑫通用	3,708	26,994.24	0.01
76	601689	拓普集团	802	26,858.98	0.01
77	002070	*ST 众和	2,539	25,821.63	0.01
78	002625	光启技术	704	25,597.44	0.01
79	002131	利欧股份	7,767	25,553.43	0.01

80	000980	众泰汽车	2,110	25,446.60	0.01
81	600086	东方金钰	2,302	24,884.62	0.01
82	002503	搜于特	3,504	24,633.12	0.01
83	603898	好莱客	700	24,465.00	0.01
84	002512	达华智能	1,501	24,241.15	0.01
85	600609	金杯汽车	3,000	24,240.00	0.01
86	300507	苏奥传感	540	24,235.20	0.01
87	002418	康盛股份	2,600	24,206.00	0.01
88	002676	顺威股份	1,509	24,113.82	0.01
89	300269	联建光电	1,201	24,056.03	0.01
90	002722	金轮股份	700	24,052.00	0.01
91	601058	赛轮金宇	7,019	24,004.98	0.01
92	002434	万里扬	1,502	23,911.84	0.01
93	300251	光线传媒	2,901	23,759.19	0.01
94	002242	九阳股份	1,204	23,682.68	0.01
95	600653	申华控股	7,200	23,472.00	0.01
96	601928	凤凰传媒	2,400	23,424.00	0.01
97	600480	凌云股份	1,103	23,262.27	0.01
98	600633	浙数文化	1,200	23,184.00	0.01
99	002699	美盛文化	1,669	23,032.20	0.01
100	600742	一汽富维	1,203	22,989.33	0.01
101	601929	吉视传媒	6,600	22,836.00	0.01
102	000587	金洲慈航	1,531	22,811.90	0.01
103	300403	地尔汉宇	1,252	22,761.36	0.01
104	603377	东方时尚	600	22,554.00	0.01
105	600303	曙光股份	2,201	22,494.22	0.01
106	000921	海信科龙	1,305	22,459.05	0.01
107	600754	锦江股份	803	21,761.30	0.01
108	603726	朗迪集团	600	21,714.00	0.01
109	002489	浙江永强	3,401	21,698.38	0.01
110	000726	鲁泰A	1,808	21,442.88	0.01
111	002190	成飞集成	800	21,440.00	0.01
112	601311	骆驼股份	1,506	21,324.96	0.01
113	002126	银轮股份	2,106	21,186.36	0.01
114	000801	四川九洲	2,206	21,111.42	0.01
115	300089	文化长城	1,401	20,916.93	0.00
116	002592	八菱科技	702	20,842.38	0.00
117	000996	中国中期	1,104	20,788.32	0.00
118	002045	国光电器	1,303	20,704.67	0.00
119	002188	巴士在线	805	20,688.50	0.00
120	000810	创维数字	1,705	20,681.65	0.00
121	603808	歌力思	700	20,664.00	0.00
122	603600	永艺股份	1,253	20,624.38	0.00
123	300279	和晶科技	1,480	20,601.60	0.00

124	002759	天际股份	803	20,532.71	0.00
125	002101	广东鸿图	851	20,330.39	0.00
126	300413	快乐购	1,001	20,310.29	0.00
127	002763	汇洁股份	702	20,182.50	0.00
128	002005	德豪润达	4,210	20,081.70	0.00
129	002614	奥佳华	1,101	20,016.18	0.00
130	002707	众信旅游	1,502	19,721.26	0.00
131	600697	欧亚集团	700	19,712.00	0.00
132	002543	万和电气	802	19,705.14	0.00
133	603008	喜临门	1,104	19,662.24	0.00
134	002510	天汽模	2,708	19,660.08	0.00
135	002790	瑞尔特	600	19,446.00	0.00
136	000829	天音控股	1,800	19,440.00	0.00
137	002761	多喜爱	504	19,197.36	0.00
138	300432	富临精工	803	19,191.70	0.00
139	600261	阳光照明	2,911	19,125.27	0.00
140	000888	峨眉山 A	1,502	19,075.40	0.00
141	603869	北部湾旅	700	19,047.00	0.00
142	000038	深大通	600	19,044.00	0.00
143	002429	兆驰股份	6,202	19,040.14	0.00
144	300426	唐德影视	803	18,998.98	0.00
145	603306	华懋科技	600	18,984.00	0.00
146	600785	新华百货	811	18,969.29	0.00
147	600135	乐凯胶片	1,206	18,801.54	0.00
148	002277	友阿股份	2,912	18,782.40	0.00
149	600640	号百控股	1,104	18,657.60	0.00
150	601777	力帆股份	2,303	18,516.12	0.00
151	000541	佛山照明	2,000	18,220.00	0.00
152	002283	天润曲轴	2,804	17,945.60	0.00
153	002721	金一文化	1,201	17,930.93	0.00
154	600054	黄山旅游	1,048	17,920.80	0.00
155	002356	赫美集团	700	17,787.00	0.00
156	000957	中通客车	1,510	17,667.00	0.00
157	000016	深康佳 A	3,600	17,604.00	0.00
158	002213	特 尔 佳	800	17,592.00	0.00
159	603997	继峰股份	1,204	17,590.44	0.00
160	002083	孚日股份	2,300	17,572.00	0.00
161	002348	高乐股份	2,504	17,553.04	0.00
162	000802	北京文化	1,203	17,515.68	0.00
163	600698	湖南天雁	1,803	17,471.07	0.00
164	001696	宗申动力	2,300	17,411.00	0.00
165	600628	新世界	1,500	17,325.00	0.00
166	600258	首旅酒店	740	17,286.40	0.00
167	600661	新南洋	804	17,261.88	0.00

168	601010	文峰股份	4,100	17,261.00	0.00
169	000681	视觉中国	1,102	17,257.32	0.00
170	002448	中原内配	1,700	17,221.00	0.00
171	300336	新文化	1,106	17,098.76	0.00
172	000572	海马汽车	3,301	17,066.17	0.00
173	600655	豫园商城	1,500	16,980.00	0.00
174	600987	航民股份	1,303	16,886.88	0.00
175	002284	亚太股份	1,505	16,705.50	0.00
176	600107	美尔雅	1,204	16,687.44	0.00
177	601801	皖新传媒	1,203	16,625.46	0.00
178	000417	合肥百货	2,000	16,500.00	0.00
179	002042	华孚色纺	1,542	16,483.98	0.00
180	002703	浙江世宝	600	16,434.00	0.00
181	600757	长江传媒	2,200	16,434.00	0.00
182	600280	中央商场	2,070	16,415.10	0.00
183	002345	潮宏基	1,501	16,315.87	0.00
184	002362	汉王科技	802	16,288.62	0.00
185	002033	丽江旅游	1,593	16,280.46	0.00
186	002029	七匹狼	1,700	16,269.00	0.00
187	002776	柏堡龙	700	16,226.00	0.00
188	300178	腾邦国际	1,263	16,166.40	0.00
189	002494	华斯股份	1,104	16,096.32	0.00
190	600686	金龙汽车	1,203	15,999.90	0.00
191	600707	彩虹股份	2,002	15,855.84	0.00
192	600006	东风汽车	2,701	15,800.85	0.00
193	600838	上海九百	1,301	15,729.09	0.00
194	300343	联创互联	802	15,558.80	0.00
195	000851	高鸿股份	1,700	15,453.00	0.00
196	600220	江苏阳光	4,500	15,435.00	0.00
197	300005	探路者	1,951	15,373.88	0.00
198	603958	哈森股份	600	15,312.00	0.00
199	002400	省广股份	1,905	15,297.15	0.00
200	002269	美邦服饰	4,100	15,293.00	0.00
201	300342	天银机电	1,001	15,275.26	0.00
202	002681	奋达科技	1,202	15,133.18	0.00
203	603001	奥康国际	800	15,032.00	0.00
204	300258	精锻科技	900	14,859.00	0.00
205	600523	贵航股份	801	14,826.51	0.00
206	000599	青岛双星	2,200	14,806.00	0.00
207	600818	中路股份	702	14,798.16	0.00
208	603116	红蜻蜓	804	14,777.52	0.00
209	002265	西仪股份	801	14,730.39	0.00
210	300063	天龙集团	1,750	14,612.50	0.00
211	002425	凯撒文化	1,594	14,569.16	0.00

212	002239	奥特佳	3,363	14,561.79	0.00
213	002662	京威股份	2,004	14,428.80	0.00
214	600335	国机汽车	1,206	14,423.76	0.00
215	002762	金发拉比	600	14,250.00	0.00
216	002502	骅威文化	1,512	14,197.68	0.00
217	600861	北京城乡	1,103	14,173.55	0.00
218	601965	中国汽研	1,507	14,150.73	0.00
219	002098	浔兴股份	1,002	14,118.18	0.00
220	600088	中视传媒	804	14,086.08	0.00
221	002031	巨轮智能	4,500	13,995.00	0.00
222	300043	星辉娱乐	1,702	13,973.42	0.00
223	600630	龙头股份	1,203	13,930.74	0.00
224	002488	金固股份	1,204	13,930.28	0.00
225	600831	广电网络	1,400	13,930.00	0.00
226	002454	松芝股份	1,103	13,897.80	0.00
227	002003	伟星股份	1,323	13,825.35	0.00
228	000700	模塑科技	1,704	13,785.36	0.00
229	600824	益民集团	2,402	13,739.44	0.00
230	002536	西泵股份	1,105	13,679.90	0.00
231	002251	步步高	1,102	13,653.78	0.00
232	600877	*ST 嘉陵	2,101	13,635.49	0.00
233	002144	宏达高科	802	13,634.00	0.00
234	300081	恒信东方	1,102	13,620.72	0.00
235	002615	哈尔斯	1,201	13,571.30	0.00
236	300304	云意电气	1,521	13,491.27	0.00
237	600825	新华传媒	1,900	13,471.00	0.00
238	603006	联明股份	602	13,448.68	0.00
239	000665	湖北广电	1,105	13,425.75	0.00
240	000796	凯撒旅游	1,100	13,332.00	0.00
241	002327	富安娜	1,603	13,320.93	0.00
242	000887	中鼎股份	597	13,187.73	0.00
243	002472	双环传动	1,202	13,185.94	0.00
244	002290	中科新材	800	13,128.00	0.00
245	600070	浙江富润	1,104	13,115.52	0.00
246	603598	引力传媒	806	13,065.26	0.00
247	002670	国盛金控	820	13,038.00	0.00
248	300100	双林股份	501	13,005.96	0.00
249	002416	爱施德	1,203	12,980.37	0.00
250	600865	百大集团	1,104	12,960.96	0.00
251	603398	邦宝益智	601	12,885.44	0.00
252	601007	金陵饭店	1,103	12,872.01	0.00
253	603818	曲美家居	804	12,807.72	0.00
254	000987	越秀金控	1,101	12,804.63	0.00
255	002731	萃华珠宝	600	12,780.00	0.00

256	000589	黔轮胎 A	2,300	12,765.00	0.00
257	600676	交运股份	1,700	12,665.00	0.00
258	601599	鹿港文化	2,004	12,545.04	0.00
259	000719	大地传媒	1,193	12,442.99	0.00
260	002537	海立美达	1,020	12,423.60	0.00
261	002355	兴民智通	1,202	12,296.46	0.00
262	002351	漫步者	1,108	12,265.56	0.00
263	002723	金莱特	600	12,174.00	0.00
264	600386	北巴传媒	915	12,169.50	0.00
265	002780	三夫户外	450	12,100.50	0.00
266	002765	蓝黛传动	1,108	12,066.12	0.00
267	600493	凤竹纺织	1,102	12,033.84	0.00
268	002540	亚太科技	1,700	12,002.00	0.00
269	603996	中新科技	701	11,987.10	0.00
270	002071	长城影视	1,201	11,961.96	0.00
271	300160	秀强股份	1,331	11,939.07	0.00
272	300217	东方电热	3,279	11,935.56	0.00
273	600358	国旅联合	1,701	11,907.00	0.00
274	000679	大连友谊	1,200	11,880.00	0.00
275	600136	当代明诚	700	11,753.00	0.00
276	002260	德奥通航	505	11,665.50	0.00
277	002664	信质电机	405	11,591.10	0.00
278	603701	德宏股份	375	11,572.50	0.00
279	002516	旷达科技	2,100	11,529.00	0.00
280	002154	报喜鸟	3,101	11,504.71	0.00
281	600960	渤海活塞	1,500	11,445.00	0.00
282	002677	浙江美大	820	11,422.60	0.00
283	000607	华媒控股	1,505	11,377.80	0.00
284	000058	深赛格	1,401	11,334.09	0.00
285	600515	海航基础	1,100	11,297.00	0.00
286	600229	城市传媒	1,202	11,262.74	0.00
287	002590	万安科技	801	11,222.01	0.00
288	002363	隆基机械	1,184	11,188.80	0.00
289	603999	读者传媒	501	11,182.32	0.00
290	002605	姚记扑克	802	11,179.88	0.00
291	000753	漳州发展	2,401	11,164.65	0.00
292	600870	厦华电子	1,400	11,060.00	0.00
293	600814	杭州解百	1,204	10,860.08	0.00
294	000524	岭南控股	804	10,837.92	0.00
295	002404	嘉欣丝绸	1,405	10,832.55	0.00
296	002612	朗姿股份	800	10,832.00	0.00
297	600555	海航创新	2,303	10,824.10	0.00
298	603099	长白山	700	10,731.00	0.00
299	002403	爱仕达	813	10,715.34	0.00

300	600178	东安动力	1,103	10,566.74	0.00
301	000721	西安饮食	1,304	10,562.40	0.00
302	600859	王府井	653	10,545.95	0.00
303	300071	华谊嘉信	1,300	10,530.00	0.00
304	002426	胜利精密	1,300	10,491.00	0.00
305	600336	澳柯玛	1,802	10,469.62	0.00
306	600712	南宁百货	1,500	10,365.00	0.00
307	002678	珠江钢琴	809	10,258.12	0.00
308	000978	桂林旅游	1,104	10,223.04	0.00
309	300272	开能环保	1,011	10,180.77	0.00
310	601999	出版传媒	1,103	10,059.36	0.00
311	300247	乐金健康	1,509	10,049.94	0.00
312	002137	麦达数字	1,104	10,013.28	0.00
313	600081	东风科技	804	10,009.80	0.00
314	603101	汇嘉时代	600	9,960.00	0.00
315	000026	飞亚达 A	800	9,952.00	0.00
316	002328	新朋股份	1,203	9,948.81	0.00
317	002238	天威视讯	831	9,888.90	0.00
318	002084	海鸥卫浴	1,104	9,814.56	0.00
319	300148	天舟文化	629	9,793.53	0.00
320	000564	供销大集	1,500	9,765.00	0.00
321	002406	远东传动	1,205	9,748.45	0.00
322	000678	襄阳轴承	1,107	9,719.46	0.00
323	603268	松发股份	300	9,702.00	0.00
324	002574	明牌珠宝	1,109	9,648.30	0.00
325	000521	美菱电器	1,501	9,606.40	0.00
326	600551	时代出版	604	9,537.16	0.00
327	002087	新野纺织	1,671	9,441.15	0.00
328	300329	海伦钢琴	801	9,427.77	0.00
329	002634	棒杰股份	1,103	9,088.72	0.00
330	000868	安凯客车	1,700	9,044.00	0.00
331	000613	*ST 东海 A	600	9,024.00	0.00
332	600232	金鹰股份	1,100	8,899.00	0.00
333	002571	*ST 德力	1,200	8,712.00	0.00
334	000757	浩物股份	1,202	8,678.44	0.00
335	600891	秋林集团	1,102	8,584.58	0.00
336	000430	张家界	808	8,564.80	0.00
337	000419	通程控股	1,206	8,538.48	0.00
338	000516	国际医学	1,500	8,355.00	0.00
339	603838	四通股份	606	8,344.62	0.00
340	002553	南方轴承	700	8,176.00	0.00
341	603608	天创时尚	560	7,789.60	0.00
342	000760	斯太尔	960	7,718.40	0.00
343	000428	华天酒店	1,503	7,665.30	0.00

344	603023	威帝股份	600	7,560.00	0.00
345	603166	福达股份	700	7,560.00	0.00
346	002708	光洋股份	805	7,397.95	0.00
347	002740	爱迪尔	701	7,367.51	0.00
348	002607	亚夏汽车	1,522	6,955.54	0.00
349	600370	三房巷	1,501	6,829.55	0.00
350	000673	当代东方	503	6,805.59	0.00
351	600623	华谊集团	600	6,774.00	0.00
352	300364	中文在线	200	6,686.00	0.00
353	600828	茂业商业	800	6,656.00	0.00
354	002593	日上集团	1,200	6,312.00	0.00
355	002076	雪莱特	602	4,256.14	0.00
356	002486	嘉麟杰	400	3,456.00	0.00
357	002575	群兴玩具	400	3,424.00	0.00
358	600469	风神股份	401	3,011.51	0.00
359	601900	南方传媒	200	2,488.00	0.00
360	000622	恒立实业	107	677.31	0.00
361	002413	雷科防务	29	324.80	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	523,625.00	0.13
2	000651	格力电器	487,653.00	0.12
3	600104	上汽集团	329,506.00	0.08
4	002024	苏宁云商	154,652.00	0.04
5	600690	青岛海尔	121,824.00	0.03
6	000625	长安汽车	116,880.00	0.03
7	600637	东方明珠	112,584.00	0.03
8	000839	中信国安	112,197.00	0.03
9	002594	比亚迪	105,072.00	0.03
10	002739	万达电影	100,802.00	0.02
11	600660	福耀玻璃	98,770.00	0.02
12	000100	TCL 集团	98,370.00	0.02
13	600066	宇通客车	97,919.00	0.02
14	000069	华侨城 A	88,640.00	0.02
15	601888	中国国旅	87,019.00	0.02
16	000793	华闻传媒	82,570.00	0.02

17	600741	华域汽车	80,608.00	0.02
18	600177	雅戈尔	80,389.00	0.02
19	600398	海澜之家	69,212.00	0.02
20	300027	华谊兄弟	66,750.00	0.02

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	1,146,738.12	0.28
2	000333	美的集团	1,009,405.55	0.24
3	600104	上汽集团	632,437.00	0.15
4	600637	东方明珠	594,895.00	0.14
5	002024	苏宁云商	286,583.00	0.07
6	600690	青岛海尔	253,237.74	0.06
7	000100	TCL 集团	224,634.00	0.05
8	000625	长安汽车	215,664.47	0.05
9	600660	福耀玻璃	204,060.58	0.05
10	002739	万达电影	196,803.00	0.05
11	000839	中信国安	194,037.00	0.05
12	600066	宇通客车	184,567.45	0.04
13	601888	中国国旅	181,699.68	0.04
14	000069	华侨城 A	180,710.00	0.04
15	002594	比亚迪	180,289.38	0.04
16	600741	华域汽车	157,540.51	0.04
17	000793	华闻传媒	153,816.00	0.04
18	600177	雅戈尔	152,624.00	0.04
19	300027	华谊兄弟	131,585.00	0.03
20	600398	海澜之家	124,423.46	0.03

7.5.3 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	9,058,562.00
卖出股票的收入（成交）总额	16,302,567.11

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 2016 年 9 月 24 日，上海东方明珠新媒体股份有限公司（600637）因未及时披露重大事项，被中国证监会予以行政处罚。本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 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。

7.13.3 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	7,164.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,196.93
5	应收申购款	206,886.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	218,247.29

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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	000100	TCL 集团	119,707.00	0.03	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

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
广发可选消费联	9,759	49,608.23	66,019,413.29	13.64%	418,107,296.67	86.36%

接 A						
广发可选消费联接 C	1,188	13,918.76	13,225,508.78	79.98%	3,309,983.54	20.02%
合计	10,947	45,735.11	79,244,922.07	15.83%	421,417,280.21	84.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发可选消费联接 A	99.05	0.0000%
	广发可选消费联接 C	69.68	0.0004%
	合计	168.73	0.0000%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发可选消费联接 A	0
	广发可选消费联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发可选消费联接 A	0
	广发可选消费联接 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	65,821,345.49	13.15%	10,000,200.02	2.00%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	65,821,345	13.15%	10,000,200	2.00%	三年

	.49		.02	
--	-----	--	-----	--

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发可选消费联接 A	广发可选消费联接 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 15 日）基金份额总额	1,415,595,322.66	-
本报告期期初基金份额总额	513,864,143.82	2,444,363.82
本报告期基金总申购份额	22,846,794.00	30,692,638.88
减：本报告期基金总赎回份额	52,584,227.86	16,601,510.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	484,126,709.96	16,535,492.32

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、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

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一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

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

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
招商证券	2	813,670.00	3.21%	595.11	3.21%	-
华创证券	1	14,077,378.44	55.53%	10,294.87	55.53%	-
银河证券	2	10,457,640.67	41.26%	7,648.04	41.26%	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	2,214.00	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关于增加中信期货为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-06-02
2	广发基金管理有限公司关于增加华宝证券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》	2017-05-24

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发起式联接基金募集的文件

(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发起式联接基金基金合同》

(三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四) 《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托管协议》

(五) 法律意见书

(六) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(七) 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>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日