

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券 投资基金

2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十四日

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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
8 基金份额持有人信息	49

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	49
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	49
9	开放式基金份额变动	50
10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	51
11	影响投资者决策的其他重要信息	52
12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	53

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	202,156,094.00 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华路6号105室-49848（集中办公区）	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	陈四清

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、北京市西城区复兴门内大街1号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

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（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-10,487,076.27
本期利润	-42,623,385.74
加权平均基金份额本期利润	-0.1996
本期加权平均净值利润率	-12.70%
本期基金份额净值增长率	-12.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	36,938,040.21
期末可供分配基金份额利润	0.1827
期末基金资产净值	287,501,711.61
期末基金份额净值	1.4222
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.22%

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

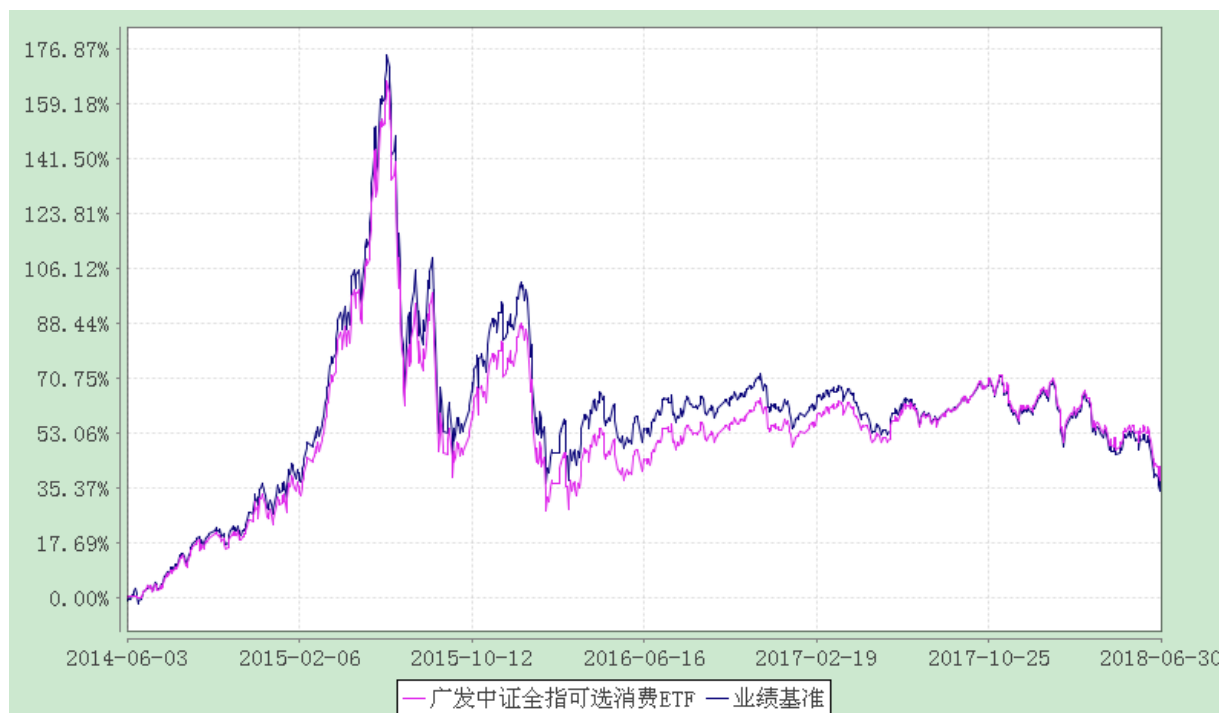
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.12%	1.48%	-8.90%	1.52%	0.78%	-0.04%
过去三个月	-9.34%	1.23%	-10.75%	1.25%	1.41%	-0.02%
过去六个月	-12.33%	1.22%	-13.91%	1.24%	1.58%	-0.02%
过去一年	-12.40%	1.02%	-15.40%	1.04%	3.00%	-0.02%
过去三年	-32.23%	1.65%	-36.23%	1.72%	4.00%	-0.07%
自基金合同生效起至今	42.22%	1.67%	38.74%	1.73%	3.48%	-0.06%

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历史走势对比图
 （2014 年 6 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、受托管理保险资金投资管理、保险保障基金委托资产管理投资管理、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30个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、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），参股了证通股份有限公司。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 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	2014-06-03	-	19 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理（自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理（自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日）。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、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（自 2014 年 6 月 3 日起任职）、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 12 月 1 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 1 月 8 日起任职）、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基金经理（自 2015 年 1 月 29 日起任职）、广发中证全指金融地产交易型开放式

	<p>基金经理；广发主要消费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；广发中证全指工业 ETF 联接基金的基金经理；量化投资部副总经理</p>			<p>指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 3 月 23 日起任职）、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经理（自 2015 年 4 月 15 日起任职）、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基金经理（自 2015 年 5 月 6 日起任职）、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 25 日起任职）、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 25 日起任职）、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 1 日起任职）、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基金经理（自 2015 年 7 月 9 日起任职）、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基金经理（自 2015 年 7 月 9 日起任职）、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基金经理（自 2015 年 8 月 18 日起任职）、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基金经理（自 2015 年 8 月 18 日起任职）、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 6 月 13 日起任职）、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基金经理（自 2017 年 6 月 13 日起任职）。</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基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚

实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本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需要进行反向交易的，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%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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-12.33%，同期业绩基准收益率为-13.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，A 股市场受中美贸易战的反复无常、金融去杠杆的严厉执行以及信用违约事件频发影响，权益市场有较大幅度的调整。从政府公告的经济数据来看，投资增速特别是基建投资出现了一定程度的下滑，消费增长也有一定的回落，中美贸易战也为出口的增长蒙上了阴影。下半年，政府针对外部环境的变化，将实施积极的财政政策和稳健的货币政策，保持经济运行在合理区间，要做好稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期的工作。经过上半年权益市场的大幅调整，风险得到释放，A 股的估值水平合理偏低，无论从破净的公司数量、公司的业绩增长、增持与回购的企业数量上进行判断，A 股是不错的投资标的之一。

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、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利

益为准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,562,079.22	2,430,338.98
结算备付金		-	57,842.18
存出保证金		4,976.77	5,826.36
交易性金融资产	6.4.7.2	284,337,553.74	342,202,119.67
其中：股票投资		284,337,553.74	342,202,119.67
基金投资		-	-
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		-	45,846.97
应收利息	6.4.7.5	606.94	476.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		287,905,216.67	344,742,450.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		-	-
应付管理人报酬		122,303.49	144,850.72
应付托管费		24,460.69	28,970.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,619.88	55,814.27

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	222,121.00	347,077.52
负债合计		403,505.06	576,712.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	202,156,094.00	212,156,094.00
未分配利润	6.4.7.10	85,345,617.61	132,009,643.71
所有者权益合计		287,501,711.61	344,165,737.71
负债和所有者权益总计		287,905,216.67	344,742,450.37

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4222 元，基金份额总额 202,156,094.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-41,310,008.92	21,447,161.84
1.利息收入		14,850.85	23,738.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,850.85	23,731.05
债券利息收入		-	7.46
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）		-9,214,812.07	2,247,697.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-12,034,949.40	-1,640,534.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	5,770.54
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,820,137.33	3,882,461.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-32,136,309.47	19,175,725.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,261.77	-

减：二、费用		1,313,376.82	1,521,215.87
1. 管理人报酬		832,675.82	961,709.81
2. 托管费		166,535.15	192,341.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	64,792.93	109,042.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	249,372.92	258,121.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,623,385.74	19,925,945.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,623,385.74	19,925,945.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	212,156,094.00	132,009,643.71	344,165,737.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,623,385.74	-42,623,385.74
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）	-10,000,000.00	-4,040,640.36	-14,040,640.36
其中：1.基金申购款	26,000,000.00	16,418,029.18	42,418,029.18
2.基金赎回款	-36,000,000.00	-20,458,669.54	-56,458,669.54
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）	202,156,094.00	85,345,617.61	287,501,711.61
项目	上年度可比期间 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	254,156,094.00	137,887,131.34	392,043,225.34

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,925,945.97	19,925,945.97
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)	-12,000,000.00	-6,827,079.62	-18,827,079.62
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-6,827,079.62	-18,827,079.62
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)	242,156,094.00	150,985,997.69	393,142,091.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 孙树明, 主管会计工作负责人: 窦刚, 会计机构负责人: 张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2013]1265 号《关于核准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准, 由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，基金管理人将在履行适当程序后，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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，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。

6.4.7 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	3,562,079.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,562,079.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		355,217,548.95	284,337,553.74	-70,879,995.21
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		355,217,548.95	284,337,553.74	-70,879,995.21

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	565.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1.98
应收结算备付金利息	39.54
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	606.94

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	34,619.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,619.88

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	198,354.28
应付指数使用费	23,766.72
合计	222,121.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,156,094.00	212,156,094.00
本期申购	26,000,000.00	26,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-36,000,000.00	-36,000,000.00
本期末	202,156,094.00	202,156,094.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,297,998.66	81,711,645.05	132,009,643.71
本期利润	-10,487,076.27	-32,136,309.47	-42,623,385.74
本期基金份额交易产生的变动数	-2,872,882.18	-1,167,758.18	-4,040,640.36
其中：基金申购款	5,835,104.68	10,582,924.50	16,418,029.18
基金赎回款	-8,707,986.86	-11,750,682.68	-20,458,669.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,938,040.21	48,407,577.40	85,345,617.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,015.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	44.96
结算备付金利息收入	790.06
其他	-
合计	14,850.85

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,794,823.26
股票投资收益——赎回差价收入	-7,240,126.14
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-12,034,949.40

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,987,228.32
减：卖出股票成本总额	29,782,051.58
买卖股票差价收入	-4,794,823.26

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	56,458,669.54
减：现金支付赎回款总额	1,601,546.54
减：赎回股票成本总额	62,097,249.14
赎回差价收入	-7,240,126.14

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,820,137.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,820,137.33

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
------	---------------------------------------

1.交易性金融资产	-32,136,309.47
——股票投资	-32,136,309.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-32,136,309.47

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	26,261.77
其他	-
合计	26,261.77

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	64,792.93
银行间市场交易费用	-
合计	64,792.93

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	19,835.79

信息披露费	148,765.71
银行汇划费	1,058.05
上市费	29,752.78
指数使用费	49,960.59
合计	249,372.92

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	0.00	0.00%	547,304.03	0.67%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 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	509.72	0.86%	509.72	0.39%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	832,675.82	961,709.81
其中：支付销售机构的客户维护费	414.12	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	166,535.15	192,341.96

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	198,594,095.00	98.24%	209,179,595.00	98.60%

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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,562,079.22	14,015.83	5,402,668.84	22,914.47

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-

注：截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603838	四通股份	2018-05-24	重大事项停牌	10.03	-	-	11,800.00	212,103.30	118,354.00	-
600232	金鹰股份	2018-06-06	重大事项停牌	5.87	-	-	24,400.00	284,564.86	143,228.00	-
600148	长春一东	2018-02-13	重大事项停牌	19.40	2018-07-06	20.90	9,000.00	222,319.52	174,600.00	-
603997	继峰股份	2018-05-30	重大事项停牌	10.87	-	-	20,900.00	310,036.94	227,183.00	-
000038	深大通	2018-02-26	重大事项停牌	18.10	-	-	12,980.00	366,015.32	234,938.00	-
002265	摩登大道	2018-06-19	重大事项停牌	9.61	-	-	26,280.00	375,865.98	252,550.80	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项停牌	4.78	2018-07-20	4.29	53,200.00	468,239.76	254,296.00	-
300247	乐金健康	2018-06-19	重大事项停牌	5.06	2018-07-03	5.57	51,400.00	353,510.30	260,084.00	-
002205	云南旅游	2018-03-26	重大事项停牌	7.28	-	-	36,300.00	338,220.55	264,264.00	-
002250	骅威文化	2018-06-05	重大事项停牌	5.82	-	-	47,268.00	657,626.14	275,099.76	-
300343	联创互联	2018-06-19	重大事项停牌	10.00	-	-	31,800.00	575,320.78	318,000.00	-
000796	凯撒旅游	2018-01-19	重大事项停牌	12.90	2018-07-19	11.61	27,500.00	438,340.63	354,750.00	-

002098	浔兴股份	2017-11-13	重大事项停牌	16.33	-	-	25,200.00	344,063.47	411,516.00	-
002445	中南文化	2018-06-13	重大事项停牌	8.44	-	-	49,900.00	605,721.23	421,156.00	-
002239	奥特佳	2018-04-02	重大事项停牌	3.62	-	-	117,436.00	632,644.77	425,118.32	-
600687	刚泰控股	2018-06-11	重大事项停牌	9.09	2018-08-20	8.18	49,160.00	801,773.49	446,864.40	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项停牌	4.96	2018-07-02	4.46	93,200.00	1,062,538.22	462,272.00	-
002721	金一文化	2018-05-29	重大事项停牌	8.99	2018-07-09	8.35	53,153.00	1,124,319.90	477,845.47	-
600335	国机汽车	2018-04-03	重大事项停牌	10.43	-	-	51,570.00	805,833.80	537,875.10	-
002005	德豪润达	2018-01-02	重大事项停牌	4.36	2018-07-02	3.92	124,870.00	1,366,197.98	544,433.20	-
600146	商赢环球	2018-06-19	重大事项停牌	22.22	2018-08-15	20.00	24,900.00	614,129.00	553,278.00	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项停牌	18.76	2018-07-02	16.88	33,993.00	635,136.87	637,708.68	-
002512	达华智能	2018-06-19	重大事项停牌	9.70	-	-	65,900.00	1,006,322.81	639,230.00	-
600122	宏图高科	2018-06-19	重大事项停牌	7.40	-	-	98,037.00	1,462,767.16	725,473.80	-
600086	东方金钰	2018-01-19	重大事项停牌	10.04	-	-	77,300.00	1,134,968.38	776,092.00	-
002426	胜利精密	2018-06-19	重大事项停牌	3.60	2018-07-03	3.26	222,950.00	1,723,875.14	802,620.00	-
002668	奥马电器	2018-06-15	重大事项停牌	20.10	-	-	40,400.00	647,333.73	812,040.00	-
000673	当代东方	2018-05-23	重大事项停牌	18.34	2018-08-02	16.51	46,100.00	572,959.90	845,474.00	-
600158	中体产业	2018-03-27	重大事项停牌	11.64	2018-07-16	11.61	84,500.00	1,474,479.74	983,580.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	31,050.00	988,859.42	1,009,125.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项停牌	8.40	2018-07-16	7.56	249,800.00	3,779,587.00	2,098,320.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	67,732.00	5,509,977.66	3,524,773.28	-

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 2018 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 2018 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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总裁负责。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、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券，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。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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,562,079.22	-	-	-	3,562,079.22
存出保证金	4,976.77	-	-	-	4,976.77
交易性金融资产	-	-	-	284,337,553.74	284,337,553.74
应收利息	-	-	-	606.94	606.94

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,567,055.99	-	-	284,338,160.68	287,905,216.67
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	122,303.49	122,303.49
应付托管费	-	-	-	24,460.69	24,460.69
应付交易费用	-	-	-	34,619.88	34,619.88
其他负债	-	-	-	222,121.00	222,121.00
负债总计	-	-	-	403,505.06	403,505.06
利率敏感度缺口	3,567,055.99	-	-	283,934,655.62	287,501,711.61
上年度末 2017 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	2,430,338.98	-	-	-	2,430,338.98
结算备付金	57,842.18	-	-	-	57,842.18
存出保证金	5,826.36	-	-	-	5,826.36
交易性金融资产	-	-	-	342,202,119.67	342,202,119.67
应收证券清算款	-	-	-	45,846.97	45,846.97
应收利息	-	-	-	476.21	476.21
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,494,007.52	-	-	342,248,442.85	344,742,450.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	144,850.72	144,850.72
应付托管费	-	-	-	28,970.15	28,970.15
应付交易费用	-	-	-	55,814.27	55,814.27
其他负债	-	-	-	347,077.52	347,077.52
负债总计	-	-	-	576,712.66	576,712.66
利率敏感度缺口	2,494,007.52	-	-	341,671,730.19	344,165,737.71

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交易性债券投资，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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	284,337,553.74	98.90	342,202,119.67	99.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	284,337,553.74	98.90	342,202,119.67	99.43

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
		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	14,375,085.58	16,845,621.51

	业绩比较基准下降 5%	-14,375,085.58	-16,845,621.51
--	-------------	----------------	----------------

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见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 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 264,253,851.08 元，属于第二层级的余额为 20,083,702.66 元，无属于第三层级的金额（2017 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 328,243,202.66 元，属于第二层级的余额为 13,958,917.01 元，无属于第三层级的金额）。

(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。

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	284,337,553.74	98.76
	其中：股票	284,337,553.74	98.76
2	基金投资	-	-
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	3,562,079.22	1.24
8	其他各项资产	5,583.71	0.00
9	合计	287,905,216.67	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	191,649,759.66	66.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	90,678.00	0.03
F	批发和零售业	25,712,939.39	8.94
G	交通运输、仓储和邮政业	304,636.15	0.11
H	住宿和餐饮业	2,227,445.03	0.77
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,985,298.36	3.47
J	金融业	312,099.90	0.11
K	房地产业	4,305,279.10	1.50
L	租赁和商务服务业	19,944,635.07	6.94
M	科学研究和技术服务业	286,909.50	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	2,109,487.93	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	642,316.00	0.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	26,694,509.80	9.28
S	综合	-	-

	合计	284,337,553.74	98.90
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	498,252	26,018,719.44	9.05
2	000651	格力电器	519,788	24,508,004.20	8.52
3	600104	上汽集团	378,634	13,248,403.66	4.61
4	600690	青岛海尔	395,046	7,608,585.96	2.65
5	002027	分众传媒	792,696	7,586,100.72	2.64
6	601888	中国国旅	105,350	6,785,593.50	2.36
7	002024	苏宁易购	402,142	5,662,159.36	1.97
8	002594	比亚迪	97,919	4,668,777.92	1.62
9	600741	华域汽车	170,291	4,039,302.52	1.40
10	600660	福耀玻璃	151,436	3,893,419.56	1.35
11	002739	万达电影	67,732	3,524,773.28	1.23
12	000100	TCL 集团	1,170,555	3,394,609.50	1.18
13	600066	宇通客车	143,426	2,752,344.94	0.96
14	600398	海澜之家	194,004	2,471,610.96	0.86
15	002572	索菲亚	69,782	2,245,584.76	0.78
16	600637	东方明珠	142,621	2,147,872.26	0.75
17	000793	华闻传媒	249,800	2,098,320.00	0.73
18	600177	雅戈尔	270,796	2,085,129.20	0.73
19	000625	长安汽车	210,600	1,895,400.00	0.66
20	300144	宋城演艺	78,465	1,843,927.50	0.64
21	600699	均胜电子	71,700	1,841,973.00	0.64
22	603833	欧派家居	13,505	1,722,292.65	0.60
23	000418	小天鹅 A	23,725	1,645,328.75	0.57
24	002508	老板电器	51,243	1,569,060.66	0.55
25	300176	鸿特科技	17,660	1,464,543.80	0.51
26	600297	广汇汽车	248,650	1,457,089.00	0.51
27	600258	首旅酒店	52,768	1,433,706.56	0.50
28	000839	中信国安	296,200	1,401,026.00	0.49
29	000581	威孚高科	63,186	1,397,042.46	0.49

30	002085	万丰奥威	141,655	1,331,557.00	0.46
31	600977	中国电影	80,600	1,292,824.00	0.45
32	601633	长城汽车	130,190	1,278,465.80	0.44
33	600138	中青旅	62,473	1,245,086.89	0.43
34	002035	华帝股份	50,213	1,226,703.59	0.43
35	600839	四川长虹	398,931	1,140,942.66	0.40
36	600060	海信电器	84,678	1,133,838.42	0.39
37	300027	华谊兄弟	179,840	1,107,814.40	0.39
38	000681	视觉中国	37,900	1,087,730.00	0.38
39	300182	捷成股份	136,300	1,033,154.00	0.36
40	600166	福田汽车	504,200	1,023,526.00	0.36
41	603816	顾家家居	13,800	1,014,438.00	0.35
42	000559	万向钱潮	148,749	1,011,493.20	0.35
43	002602	世纪华通	31,050	1,009,125.00	0.35
44	600655	豫园股份	104,800	990,360.00	0.34
45	300413	快乐购	26,100	990,234.00	0.34
46	600682	南京新百	60,052	987,254.88	0.34
47	600158	中体产业	84,500	983,580.00	0.34
48	601098	中南传媒	77,600	980,864.00	0.34
49	002640	跨境通	65,050	977,051.00	0.34
50	300251	光线传媒	94,916	966,244.88	0.34
51	000981	银亿股份	127,802	952,124.90	0.33
52	300616	尚品宅配	8,640	941,760.00	0.33
53	600418	江淮汽车	143,050	931,255.50	0.32
54	601258	庞大集团	504,600	923,418.00	0.32
55	002032	苏泊尔	17,800	916,700.00	0.32
56	600978	宜华生活	128,124	875,086.92	0.30
57	601799	星宇股份	14,600	874,394.00	0.30
58	600729	重庆百货	26,426	870,736.70	0.30
59	000673	当代东方	46,100	845,474.00	0.29
60	600959	江苏有线	162,000	826,200.00	0.29
61	601966	玲珑轮胎	51,800	816,886.00	0.28
62	300133	华策影视	76,496	814,682.40	0.28
63	002563	森马服饰	56,900	813,670.00	0.28
64	002668	奥马电器	40,400	812,040.00	0.28
65	300058	蓝色光标	141,366	805,786.20	0.28
66	002426	胜利精密	222,950	802,620.00	0.28
67	600086	东方金钰	77,300	776,092.00	0.27
68	600037	歌华有线	75,100	775,032.00	0.27
69	600373	中文传媒	59,498	764,549.30	0.27
70	002131	利欧股份	362,126	760,464.60	0.26
71	002419	天虹股份	51,800	756,280.00	0.26
72	002343	慈文传媒	39,760	746,295.20	0.26
73	002042	华孚时尚	98,450	732,468.00	0.25

74	600122	宏图高科	98,037	725,473.80	0.25
75	601238	广汽集团	64,618	719,844.52	0.25
76	600859	王府井	33,459	711,672.93	0.25
77	000917	电广传媒	122,400	705,024.00	0.25
78	601718	际华集团	164,900	662,898.00	0.23
79	000800	一汽轿车	87,948	657,851.04	0.23
80	000156	华数传媒	67,637	652,020.68	0.23
81	600754	锦江股份	17,400	643,104.00	0.22
82	002512	达华智能	65,900	639,230.00	0.22
83	002537	海联金汇	67,600	638,144.00	0.22
84	002699	美盛文化	33,993	637,708.68	0.22
85	000016	深康佳 A	120,712	633,738.00	0.22
86	002614	奥佳华	30,287	626,638.03	0.22
87	603766	隆鑫通用	114,050	619,291.50	0.22
88	002400	省广集团	188,362	608,409.26	0.21
89	600623	华谊集团	60,700	605,786.00	0.21
90	600936	广西广电	126,400	601,664.00	0.21
91	002242	九阳股份	33,055	584,742.95	0.20
92	603515	欧普照明	12,500	584,250.00	0.20
93	601058	赛轮金宇	233,386	567,127.98	0.20
94	600337	美克家居	96,300	564,318.00	0.20
95	600146	商赢环球	24,900	553,278.00	0.19
96	002126	银轮股份	60,600	546,612.00	0.19
97	002625	光启技术	46,660	546,388.60	0.19
98	002607	亚夏汽车	52,082	545,819.36	0.19
99	002005	德豪润达	124,870	544,433.20	0.19
100	002664	长鹰信质	21,572	541,457.20	0.19
101	600280	中央商场	61,968	540,360.96	0.19
102	600335	国机汽车	51,570	537,875.10	0.19
103	600742	一汽富维	43,809	535,784.07	0.19
104	002925	盈趣科技	9,600	531,648.00	0.18
105	601929	吉视传媒	235,090	528,952.50	0.18
106	601311	骆驼股份	45,900	526,473.00	0.18
107	002292	奥飞娱乐	58,700	524,191.00	0.18
108	000726	鲁泰 A	48,578	524,156.62	0.18
109	600633	浙数文化	62,700	522,918.00	0.18
110	600694	大商股份	15,964	518,989.64	0.18
111	002434	万里扬	58,386	512,629.08	0.18
112	002327	富安娜	47,100	510,564.00	0.18
113	002707	众信旅游	53,142	510,163.20	0.18
114	000501	鄂武商 A	41,506	510,108.74	0.18
115	000921	海信科龙	48,751	505,060.36	0.18
116	601928	凤凰传媒	82,400	500,992.00	0.17
117	002048	宁波华翔	40,546	499,932.18	0.17

118	002277	友阿股份	107,200	494,192.00	0.17
119	000158	常山北明	71,390	490,449.30	0.17
120	601801	皖新传媒	64,386	489,977.46	0.17
121	600612	老凤祥	13,616	489,359.04	0.17
122	002429	兆驰股份	195,500	484,840.00	0.17
123	002721	金一文化	53,153	477,845.47	0.17
124	600986	科达股份	50,600	473,616.00	0.16
125	002293	罗莱生活	31,500	473,445.00	0.16
126	000980	众泰汽车	66,100	469,971.00	0.16
127	300178	腾邦国际	33,245	467,424.70	0.16
128	600693	东百集团	77,700	465,423.00	0.16
129	000587	金洲慈航	93,200	462,272.00	0.16
130	601689	拓普集团	23,500	456,840.00	0.16
131	600687	刚泰控股	49,160	446,864.40	0.16
132	002489	浙江永强	117,551	427,885.64	0.15
133	000572	海马汽车	124,300	426,349.00	0.15
134	002239	奥特佳	117,436	425,118.32	0.15
135	603008	喜临门	21,296	421,234.88	0.15
136	002445	中南文化	49,900	421,156.00	0.15
137	000810	创维数字	46,300	420,404.00	0.15
138	000829	天音控股	57,300	420,009.00	0.15
139	000541	佛山照明	69,836	418,317.64	0.15
140	002681	奋达科技	47,980	415,506.80	0.14
141	002472	双环传动	48,352	414,376.64	0.14
142	002345	潮宏基	48,100	413,660.00	0.14
143	002098	浔兴股份	25,200	411,516.00	0.14
144	600707	彩虹股份	58,200	410,892.00	0.14
145	600400	红豆股份	109,480	410,550.00	0.14
146	002503	搜于特	117,210	410,235.00	0.14
147	600686	金龙汽车	32,710	408,547.90	0.14
148	002251	步步高	35,538	404,422.44	0.14
149	000030	富奥股份	54,285	402,794.70	0.14
150	002488	金固股份	36,430	393,079.70	0.14
151	002029	七匹狼	49,000	391,510.00	0.14
152	600987	航民股份	41,114	388,527.30	0.14
153	002083	孚日股份	68,700	385,407.00	0.13
154	002031	巨轮智能	176,700	385,206.00	0.13
155	600661	新南洋	15,600	378,612.00	0.13
156	600757	长江传媒	65,671	373,667.99	0.13
157	601777	力帆股份	70,586	369,164.78	0.13
158	002154	报喜鸟	109,144	366,723.84	0.13
159	002510	天汽模	77,500	366,575.00	0.13
160	002448	中原内配	52,350	364,879.50	0.13
161	002677	浙江美大	20,880	363,312.00	0.13

162	001696	宗申动力	74,100	363,090.00	0.13
163	603096	新经典	4,300	360,254.00	0.13
164	000996	中国中期	37,313	356,712.28	0.12
165	000796	凯撒旅游	27,500	354,750.00	0.12
166	600006	东风汽车	86,500	353,785.00	0.12
167	600261	阳光照明	94,000	353,440.00	0.12
168	600609	金杯汽车	70,775	351,751.75	0.12
169	601965	中国汽研	41,905	351,163.90	0.12
170	000888	峨眉山 A	39,800	349,842.00	0.12
171	601163	三角轮胎	26,000	347,360.00	0.12
172	000417	合肥百货	58,992	339,204.00	0.12
173	601127	小康股份	19,600	338,884.00	0.12
174	002283	天润曲轴	84,900	336,204.00	0.12
175	002362	汉王科技	16,502	332,020.24	0.12
176	002190	成飞集成	19,360	330,862.40	0.12
177	002867	周大生	10,500	330,645.00	0.12
178	600220	江苏阳光	154,000	326,480.00	0.11
179	000802	北京文化	31,176	325,477.44	0.11
180	600653	申华控股	168,217	324,658.81	0.11
181	600054	黄山旅游	27,800	323,870.00	0.11
182	603808	歌力思	14,295	321,780.45	0.11
183	600136	当代明诚	26,400	319,440.00	0.11
184	600303	曙光股份	58,378	318,743.88	0.11
185	300343	联创互联	31,800	318,000.00	0.11
186	002087	新野纺织	70,520	316,634.80	0.11
187	603579	荣泰健康	4,500	314,820.00	0.11
188	002003	伟星股份	36,580	309,832.60	0.11
189	300291	华录百纳	43,835	309,036.75	0.11
190	300336	新文化	37,822	308,249.30	0.11
191	000957	中通客车	44,700	305,748.00	0.11
192	600676	交运股份	61,295	304,636.15	0.11
193	600715	文投控股	40,078	304,192.02	0.11
194	000868	安凯客车	52,524	304,113.96	0.11
195	000599	青岛双星	61,183	301,632.19	0.10
196	600229	城市传媒	37,202	300,592.16	0.10
197	600628	新世界	41,855	300,518.90	0.10
198	300258	精锻科技	21,800	299,750.00	0.10
199	000801	四川九洲	66,334	296,512.98	0.10
200	002193	如意集团	19,800	290,862.00	0.10
201	300242	佳云科技	41,200	290,048.00	0.10
202	300342	天银机电	23,306	286,896.86	0.10
203	600555	海航创新	73,500	284,445.00	0.10
204	600480	凌云股份	29,500	283,790.00	0.10
205	002284	亚太股份	47,835	277,443.00	0.10

206	300577	开润股份	6,700	276,174.00	0.10
207	601566	九牧王	18,694	275,736.50	0.10
208	601599	鹿港文化	67,692	275,506.44	0.10
209	002502	骅威文化	47,268	275,099.76	0.10
210	603898	好莱客	10,400	272,896.00	0.09
211	000550	江铃汽车	22,400	271,264.00	0.09
212	000913	钱江摩托	21,700	270,382.00	0.09
213	002543	万和电气	13,900	268,548.00	0.09
214	000927	一汽夏利	68,900	268,021.00	0.09
215	002059	云南旅游	36,300	264,264.00	0.09
216	603377	东方时尚	19,040	263,704.00	0.09
217	002712	思美传媒	14,100	262,119.00	0.09
218	300005	探路者	67,487	261,849.56	0.09
219	603355	莱克电气	8,700	261,435.00	0.09
220	002355	兴民智通	33,611	260,821.36	0.09
221	002920	德赛西威	8,700	260,130.00	0.09
222	300247	乐金健康	51,400	260,084.00	0.09
223	002418	康盛股份	61,380	259,023.60	0.09
224	601366	利群股份	27,900	258,633.00	0.09
225	002516	旷达科技	72,500	258,100.00	0.09
226	002705	新宝股份	26,400	257,928.00	0.09
227	002045	国光电器	36,053	257,778.95	0.09
228	000564	供销大集	53,200	254,296.00	0.09
229	002033	丽江旅游	34,762	252,719.74	0.09
230	002656	摩登大道	26,280	252,550.80	0.09
231	603868	飞科电器	5,200	251,524.00	0.09
232	300279	和晶科技	31,040	250,803.20	0.09
233	300081	恒信东方	22,900	250,068.00	0.09
234	600996	贵广网络	33,700	250,054.00	0.09
235	002213	特尔佳	17,800	249,734.00	0.09
236	000521	美菱电器	64,301	246,915.84	0.09
237	603869	北部湾旅	14,945	246,443.05	0.09
238	000955	欣龙控股	58,200	245,022.00	0.09
239	002561	徐家汇	27,000	244,350.00	0.08
240	600630	龙头股份	32,086	241,607.58	0.08
241	600838	上海九百	34,500	241,500.00	0.08
242	002454	松芝股份	41,009	240,722.83	0.08
243	300304	云意电气	56,609	237,757.80	0.08
244	601500	通用股份	23,500	237,350.00	0.08
245	002536	西泵股份	21,614	237,105.58	0.08
246	603839	安正时尚	13,060	236,516.60	0.08
247	603801	志邦股份	5,200	236,496.00	0.08
248	600831	广电网络	39,200	235,984.00	0.08
249	002416	爱施德	40,182	235,868.34	0.08

250	000038	深大通	12,980	234,938.00	0.08
251	000665	湖北广电	26,905	234,611.60	0.08
252	600070	浙江富润	30,200	233,748.00	0.08
253	002406	远东传动	42,400	232,776.00	0.08
254	300148	天舟文化	51,705	232,672.50	0.08
255	300217	东方电热	96,405	231,372.00	0.08
256	600825	新华传媒	55,300	230,048.00	0.08
257	601019	山东出版	28,700	229,887.00	0.08
258	603997	继峰股份	20,900	227,183.00	0.08
259	603306	华懋科技	13,190	224,889.50	0.08
260	600698	湖南天雁	48,100	224,627.00	0.08
261	300269	联建光电	34,100	222,673.00	0.08
262	603900	莱绅通灵	11,040	222,345.60	0.08
263	002494	华斯股份	26,550	221,161.50	0.08
264	000753	漳州发展	74,899	220,952.05	0.08
265	000589	黔轮胎 A	67,100	220,759.00	0.08
266	600697	欧亚集团	10,300	219,287.00	0.08
267	002175	东方网络	57,100	217,551.00	0.08
268	600821	津劝业	44,100	215,649.00	0.08
269	603180	金牌厨柜	2,100	214,221.00	0.07
270	300426	唐德影视	17,300	213,655.00	0.07
271	002590	万安科技	26,000	213,200.00	0.07
272	002394	联发股份	21,000	212,730.00	0.07
273	300392	腾信股份	23,300	212,263.00	0.07
274	600336	澳柯玛	53,900	211,827.00	0.07
275	002540	亚太科技	40,700	211,640.00	0.07
275	300625	三雄极光	10,400	211,640.00	0.07
276	603877	太平鸟	6,300	209,979.00	0.07
277	002761	多喜爱	10,880	208,787.20	0.07
278	002776	柏堡龙	12,700	207,518.00	0.07
279	603001	奥康国际	17,372	206,900.52	0.07
280	603788	宁波高发	8,340	205,497.60	0.07
281	002662	京威股份	48,600	204,120.00	0.07
282	000026	飞亚达 A	23,125	203,962.50	0.07
283	600135	乐凯胶片	28,238	203,031.22	0.07
284	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.07
285	002486	嘉麟杰	53,500	200,090.00	0.07
286	000757	浩物股份	34,075	199,338.75	0.07
287	000892	欢瑞世纪	42,300	199,233.00	0.07
288	002356	赫美集团	16,400	198,276.00	0.07
289	002612	朗姿股份	17,302	196,550.72	0.07
290	000700	模塑科技	53,500	196,345.00	0.07
291	600818	中路股份	12,764	195,416.84	0.07
292	601595	上海电影	12,100	195,173.00	0.07

293	002101	广东鸿图	22,885	194,064.80	0.07
294	002348	高乐股份	61,400	193,410.00	0.07
295	600551	时代出版	21,865	193,286.60	0.07
296	600107	美尔雅	31,100	192,198.00	0.07
297	600814	杭州解百	30,900	191,580.00	0.07
298	000025	特力 A	5,900	189,803.00	0.07
299	300507	苏奥传感	8,000	188,640.00	0.07
300	603179	新泉股份	8,520	187,014.00	0.07
301	002071	长城影视	34,000	186,320.00	0.06
302	600523	贵航股份	21,765	185,002.50	0.06
303	002798	帝欧家居	6,200	183,520.00	0.06
304	601900	南方传媒	19,400	183,136.00	0.06
305	300089	文化长城	26,500	182,585.00	0.06
306	300528	幸福蓝海	16,200	182,250.00	0.06
307	000607	华媒控股	43,900	180,429.00	0.06
308	600891	秋林集团	33,200	179,944.00	0.06
309	002328	新朋股份	33,752	179,898.16	0.06
310	603889	新澳股份	17,100	178,011.00	0.06
311	603555	贵人鸟	16,900	177,788.00	0.06
312	603116	红蜻蜓	13,400	175,808.00	0.06
313	600712	南宁百货	41,200	175,100.00	0.06
314	600148	长春一东	9,000	174,600.00	0.06
315	300473	德尔股份	4,500	170,775.00	0.06
316	002616	长青集团	32,000	170,560.00	0.06
317	300403	地尔汉宇	26,090	170,106.80	0.06
318	600386	北巴传媒	43,524	169,308.36	0.06
319	603035	常熟汽饰	11,800	168,740.00	0.06
320	002159	三特索道	8,900	168,032.00	0.06
321	002351	漫步者	25,834	167,662.66	0.06
322	601811	新华文轩	17,200	167,184.00	0.06
323	603366	日出东方	33,900	165,771.00	0.06
324	600854	春兰股份	39,300	165,453.00	0.06
325	002722	金轮股份	9,500	163,875.00	0.06
326	002765	蓝黛传动	23,100	163,548.00	0.06
327	000760	斯太尔	50,025	162,581.25	0.06
328	601858	中国科传	17,100	161,937.00	0.06
329	000978	桂林旅游	27,300	161,889.00	0.06
330	002574	明牌珠宝	28,562	158,233.48	0.06
331	002265	西仪股份	13,700	156,865.00	0.05
332	600933	爱柯迪	13,500	155,520.00	0.05
333	002181	粤传媒	37,200	152,892.00	0.05
334	603313	梦百合	7,800	151,710.00	0.05
335	002575	群兴玩具	38,200	151,654.00	0.05
336	600088	中视传媒	15,965	151,028.90	0.05

337	603365	水星家纺	6,200	150,722.00	0.05
338	000721	西安饮食	37,753	150,634.47	0.05
339	002363	隆基机械	26,550	150,538.50	0.05
340	600071	凤凰光学	13,300	150,024.00	0.05
341	002397	梦洁股份	31,300	149,927.00	0.05
342	603999	读者传媒	24,800	147,808.00	0.05
343	600865	百大集团	24,251	146,476.04	0.05
344	300432	富临精工	16,600	145,416.00	0.05
345	300071	华谊嘉信	36,700	144,965.00	0.05
346	600828	茂业商业	28,096	143,289.60	0.05
347	600232	金鹰股份	24,400	143,228.00	0.05
348	603358	华达科技	7,200	143,136.00	0.05
349	603730	岱美股份	5,300	142,782.00	0.05
350	002906	华阳集团	7,600	142,120.00	0.05
351	300681	英搏尔	2,400	142,080.00	0.05
352	300660	江苏雷利	5,440	141,929.60	0.05
353	601949	中国出版	29,300	141,519.00	0.05
354	600358	国旅联合	25,500	141,270.00	0.05
355	300100	双林股份	12,900	141,255.00	0.05
356	000678	襄阳轴承	24,700	140,790.00	0.05
357	603305	旭升股份	4,700	140,671.00	0.05
358	603729	龙韵股份	3,500	140,455.00	0.05
359	002553	南方轴承	22,500	140,175.00	0.05
360	002759	天际股份	14,500	139,200.00	0.05
361	603197	保隆科技	5,180	137,529.00	0.05
362	002763	汇洁股份	12,500	136,625.00	0.05
363	603303	得邦照明	13,200	135,696.00	0.05
364	300063	天龙集团	39,200	135,632.00	0.05
365	300160	秀强股份	32,260	135,492.00	0.05
366	603598	引力传媒	11,700	133,965.00	0.05
367	601086	国芳集团	16,000	133,920.00	0.05
368	600469	风神股份	36,475	133,498.50	0.05
369	603385	惠达卫浴	11,890	133,286.90	0.05
370	002853	皮阿诺	5,800	132,414.00	0.05
371	603103	横店影视	4,300	132,096.00	0.05
372	002084	海鸥住工	27,375	130,305.00	0.05
373	002260	*ST 德奥	27,230	129,070.20	0.04
374	603661	恒林股份	3,200	128,672.00	0.04
375	603398	邦宝益智	7,400	127,354.00	0.04
376	002605	姚记扑克	17,207	126,471.45	0.04
377	603608	天创时尚	13,880	126,169.20	0.04
378	603166	福达股份	19,400	125,518.00	0.04
379	600178	东安动力	24,900	125,496.00	0.04
380	603996	中新科技	12,900	125,259.00	0.04

381	002905	金逸影视	6,400	124,800.00	0.04
382	603040	新坐标	2,960	124,290.40	0.04
383	603009	北特科技	14,150	124,095.50	0.04
384	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.04
385	002740	爱迪尔	16,001	122,407.65	0.04
386	002703	浙江世宝	24,700	122,265.00	0.04
387	002676	顺威股份	38,920	121,041.20	0.04
388	603838	四通股份	11,800	118,354.00	0.04
389	002290	中科新材	10,500	117,495.00	0.04
390	600679	上海凤凰	10,000	114,100.00	0.04
391	300375	鹏翎股份	17,400	113,970.00	0.04
392	603586	金麒麟	6,900	113,091.00	0.04
393	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.04
394	600706	曲江文旅	9,700	109,610.00	0.04
395	603677	奇精机械	6,440	109,608.80	0.04
396	300580	贝斯特	6,600	108,702.00	0.04
397	000663	永安林业	14,600	108,332.00	0.04
398	002762	金发拉比	15,050	107,457.00	0.04
399	603239	浙江仙通	8,800	107,448.00	0.04
400	002863	今飞凯达	12,180	106,209.60	0.04
401	300695	兆丰股份	1,600	105,552.00	0.04
402	300707	威唐工业	3,700	104,525.00	0.04
403	603615	茶花股份	8,500	104,040.00	0.04
404	002708	光洋股份	20,220	103,930.80	0.04
405	002634	棒杰股份	24,800	103,168.00	0.04
406	300547	川环科技	4,400	102,212.00	0.04
407	002238	天威视讯	14,900	100,277.00	0.03
408	603477	振静股份	5,700	98,781.00	0.03
409	603037	凯众股份	4,120	96,655.20	0.03
410	603006	联明股份	8,300	95,284.00	0.03
411	603768	常青股份	6,700	95,140.00	0.03
412	603958	哈森股份	9,500	95,000.00	0.03
413	600137	浪莎股份	6,400	94,080.00	0.03
414	603101	汇嘉时代	7,800	93,288.00	0.03
415	603157	拉夏贝尔	5,400	92,610.00	0.03
416	300612	宣亚国际	3,800	92,264.00	0.03
417	002830	名雕股份	4,200	90,678.00	0.03
418	603199	九华旅游	3,500	90,545.00	0.03
419	603023	威帝股份	15,600	90,012.00	0.03
420	603667	五洲新春	9,080	89,438.00	0.03
421	603558	健盛集团	10,100	88,981.00	0.03
422	300585	奥联电子	6,200	88,102.00	0.03
423	603767	中马传动	9,720	87,771.60	0.03
424	603081	大丰实业	5,700	85,329.00	0.03

425	603518	维格娜丝	4,300	84,667.00	0.03
426	603055	台华新材	5,700	84,075.00	0.03
427	603665	康隆达	3,500	84,000.00	0.03
428	603600	永艺股份	8,850	83,544.00	0.03
429	603848	好太太	3,500	82,915.00	0.03
430	002291	星期六	17,300	82,694.00	0.03
431	603726	朗迪集团	4,400	82,236.00	0.03
432	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.03
433	603196	日播时尚	7,800	80,964.00	0.03
434	603389	亚振家居	7,200	80,424.00	0.03
435	002615	哈尔斯	12,901	79,470.16	0.03
436	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.03
437	603178	圣龙股份	6,600	79,002.00	0.03
438	300526	中潜股份	5,500	78,650.00	0.03
439	002899	英派斯	3,800	78,242.00	0.03
440	300591	万里马	11,190	76,539.60	0.03
441	603277	银都股份	6,178	75,742.28	0.03
442	300733	西菱动力	3,800	74,556.00	0.03
443	603809	豪能股份	3,500	71,470.00	0.02
444	603926	铁流股份	3,800	70,224.00	0.02
445	603161	科华控股	3,200	69,408.00	0.02
446	300611	美力科技	5,800	69,020.00	0.02
447	603089	正裕工业	3,300	67,848.00	0.02
448	603787	新日股份	6,700	66,665.00	0.02
449	603129	春风动力	3,200	66,240.00	0.02
450	002878	元隆雅图	2,720	61,417.60	0.02
451	603266	天龙股份	4,080	61,159.20	0.02
452	603578	三星新材	2,800	61,068.00	0.02
453	603136	天目湖	1,700	61,047.00	0.02
454	603922	金鸿顺	2,700	59,832.00	0.02
455	603758	秦安股份	6,100	54,290.00	0.02
456	603335	迪生力	6,900	53,958.00	0.02
457	603326	我乐家居	4,800	52,368.00	0.02
458	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
459	603685	晨丰科技	2,700	50,895.00	0.02
460	002875	安奈儿	3,200	48,896.00	0.02
461	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
462	603238	诺邦股份	2,400	46,896.00	0.02
463	603557	起步股份	3,500	46,865.00	0.02
464	603701	德宏股份	2,736	36,990.72	0.01
465	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	1,352,605.00	0.39
2	603833	欧派家居	1,285,716.05	0.37
3	300182	捷成股份	1,164,563.00	0.34
4	000981	银亿股份	1,141,779.12	0.33
5	600690	青岛海尔	1,056,172.00	0.31
6	600258	首旅酒店	982,808.20	0.29
7	601799	星宇股份	852,275.00	0.25
8	002563	森马服饰	759,291.00	0.22
9	600699	均胜电子	738,495.00	0.21
10	000100	TCL 集团	640,968.00	0.19
11	002925	盈趣科技	632,890.00	0.18
12	600146	商赢环球	614,129.00	0.18
13	600986	科达股份	543,437.00	0.16
14	002293	罗莱生活	521,071.00	0.15
15	002356	赫美集团	384,659.00	0.11
16	603808	歌力思	359,071.00	0.10
17	002003	伟星股份	337,705.40	0.10
18	600229	城市传媒	320,467.00	0.09
19	000913	钱江摩托	319,155.00	0.09
20	300616	尚品宅配	308,459.20	0.09

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000069	华侨城 A	2,833,819.00	0.82
2	000651	格力电器	1,005,910.00	0.29
3	000516	国际医学	946,524.08	0.28
4	000333	美的集团	834,770.00	0.24
5	603259	药明康德	613,978.50	0.18

6	600104	上汽集团	496,641.00	0.14
7	002926	华西证券	492,223.00	0.14
8	300750	宁德时代	453,544.60	0.13
9	000851	高鸿股份	443,980.48	0.13
10	002269	美邦服饰	427,753.00	0.12
11	600824	益民集团	322,705.50	0.09
12	000560	我爱我家	306,204.00	0.09
13	600640	号百控股	304,533.40	0.09
14	600960	渤海汽车	295,127.00	0.09
15	002916	深南电路	288,552.60	0.08
16	600901	江苏租赁	267,288.15	0.08
17	000850	华茂股份	265,269.00	0.08
18	601888	中国国旅	262,710.00	0.08
19	002404	嘉欣丝绸	258,942.00	0.08
20	601007	金陵饭店	250,457.25	0.07

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	25,672,387.34
卖出股票收入（成交）总额	24,987,228.32

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,976.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	606.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,583.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
241	838,821.97	198,898,406.00	98.39%	3,257,688.00	1.61%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	郑淑芬	471,298.00	0.23%
2	朱益	384,200.00	0.19%
3	芜湖歌斐资产管理有限公司—歌斐诺亚家族专享组合 5 号联接基金	302,382.00	0.15%
4	高洁	150,400.00	0.07%
5	王浩	149,919.00	0.07%
6	朱晓晔	107,000.00	0.05%
7	苑桂花	100,006.00	0.05%
8	许国根	100,000.00	0.05%
9	李桂青	100,000.00	0.05%
10	叶敖大	91,205.00	0.05%
11	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	198,594,095.00	98.24%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 6 月 3 日）基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	212,156,094.00
本报告期基金总申购份额	26,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期末基金份额总额	202,156,094.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总	佣金	占当期佣 金总量的	

			额的比例		比例	
招商证券	2	27,672,708.32	57.01%	20,237.44	57.01%	-
银河证券	2	20,869,741.23	42.99%	15,262.40	42.99%	-
山西证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于广发中证全指可选消费交易型开放式指	《中国证券报》、《证券时	2018-03-22

数证券投资基金修改基金合同的公告	报》、《上海证券报》
------------------	------------

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
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	1	20180101-20180630	209,179,595.00	26,000,000.00	36,585,500.00	198,594,095.00	98.24%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

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
二〇一八年八月二十四日