

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券 投资基金

2019 年半年度报告

2019 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

送出日期：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 8 月 26 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 2019 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遵规守信情况的说明.....	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.....	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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）	13
6.1 资产负债表.....	13
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	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
8 基金份额持有人信息	47

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末上市基金前十名持有人	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4	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	49
10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
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	51
12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指可选消费 ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	216,156,094.00 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	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	邱春杨	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	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	刘连舸

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
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	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（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-8,057,269.37
本期利润	40,811,525.32
加权平均基金份额本期利润	0.1910
本期加权平均净值利润率	14.96%
本期基金份额净值增长率	18.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	18,935,808.50
期末可供分配基金份额利润	0.0876
期末基金资产净值	276,460,497.22
期末基金份额净值	1.2790
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	27.90%

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

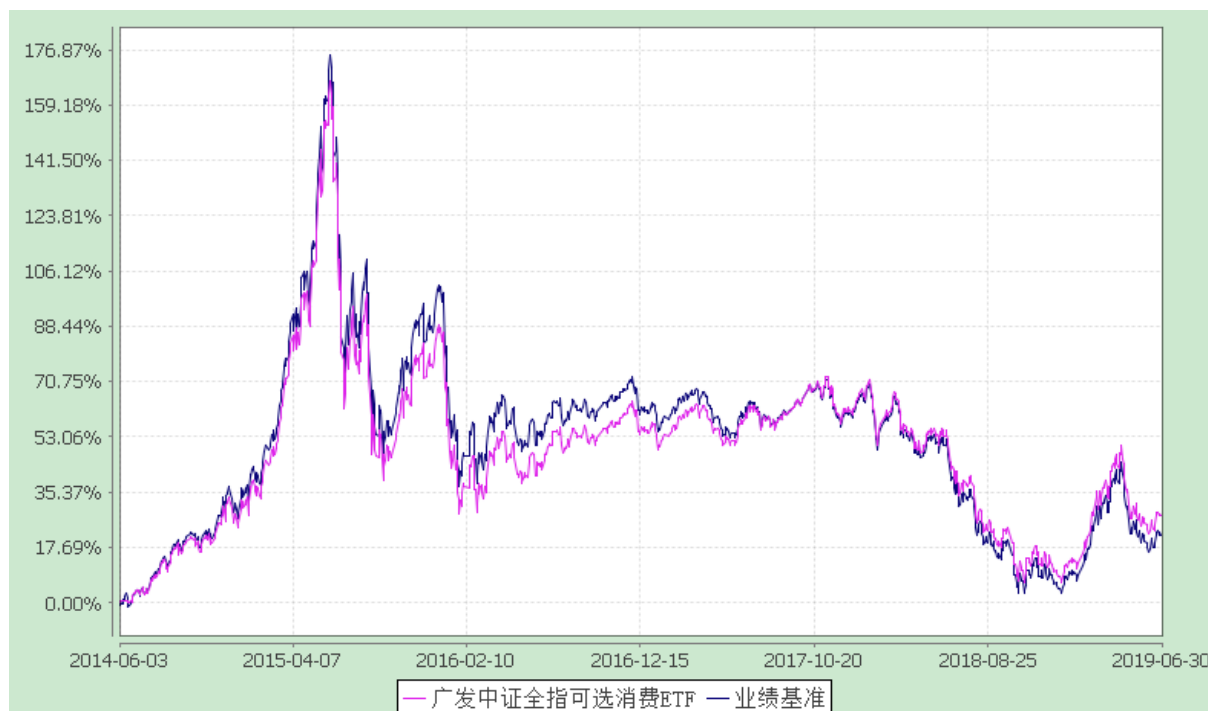
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.91%	1.12%	1.49%	1.14%	0.42%	-0.02%
过去三个月	-6.79%	1.71%	-8.11%	1.73%	1.32%	-0.02%
过去六个月	18.01%	1.64%	16.20%	1.66%	1.81%	-0.02%
过去一年	-10.07%	1.58%	-12.33%	1.60%	2.26%	-0.02%
过去三年	-13.46%	1.18%	-22.83%	1.20%	9.37%	-0.02%
自基金合同生效起至今	27.90%	1.65%	21.63%	1.70%	6.27%	-0.05%

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 2019 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32个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、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、养老金部、战略与创新业务部、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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 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交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；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	2014-06-03	-	20 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)、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 日至 2018 年 10 月 9 日)、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 日至 2018 年 12 月 20 日)、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 日至 2018 年 12 月 20 日)、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

	的基金经理； 广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；量化投资部副总经理				(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)。
--	--	--	--	--	-------------------------------------

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.2 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（完全复制指数组合及量化组合除外）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。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 4 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

报告期内，本基金主要采取完全复制法投资策略跟踪指数，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。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。

2019 年上半年，政府采取措施排解上市企业质押问题、采用基建补短板的方式拉动经济增长、实施减税降费等政策来稳定经济增长预期，一季度市场呈现出上涨行情。但二季度，受中美贸易问题反复、上市公司年报和一季报的财报数据偏弱以及预期流动性不再宽松等因素的影响，市场出现了一定程度下跌。上半年，市场最终以红盘结束，上证综指上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，创业板指上涨 20.87%，中小板指上涨 20.75%，而中证全指可选消费指数上涨 16.20%。政府公告的数据显示，1-5 月份社会消费品零售总额同比增长 8.1%，这反映出居民的消费意愿依然维持在高位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 18.01%，同期业绩比较基准收益率为 16.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，贸易保护政策对全球经济的负面影响逐渐显现，全球经济可能已经触及本轮增长周期的顶点，预计逐渐进入下行阶段。在全球经济增长普遍放缓的大背景下，中国经济仍有不错表现。随着国内稳基建、减税增加企业活力等政策的推进，国内经济有望继续稳步前进。目前 A 股的估值水平合理偏低，考虑到国内经济的稳速增长，A 股是不错的长期投资标的之一。从国家经济发展的角度看，受国内房地产调控与劳动力成本提高的影响，投资与出口对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，消费升级是不可逆转的。预计下半年，可选消费行业的家用电器板块随着地产产业链的预期稳定而将逐渐被投资者认可；新能源汽车的崛起，或将成为汽车板块上市企业新的盈利增长点。

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、估值的公司领导、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,972,269.18	2,128,277.24
结算备付金		19,595.61	100,844.16
存出保证金		2,542.69	5,615.39
交易性金融资产	6.4.7.2	272,846,954.02	223,859,224.39

其中：股票投资		272,846,954.02	223,859,224.39
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	706.39	462.50
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		276,842,067.89	226,094,423.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		111,405.02	97,715.27
应付托管费		22,281.01	19,543.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	24,864.87	16,312.23
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	223,019.77	366,045.95
负债合计		381,570.67	499,616.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	216,156,094.00	208,156,094.00
未分配利润	6.4.7.10	60,304,403.22	17,438,713.18
所有者权益合计		276,460,497.22	225,594,807.18
负债和所有者权益总计		276,842,067.89	226,094,423.68

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.2790 元，基金份额总额 216,156,094.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		41,810,256.20	-41,310,008.92
1.利息收入		12,536.12	14,850.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,536.12	14,850.85
债券利息收入		-	-
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）		-7,082,277.96	-9,214,812.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,487,590.48	-12,034,949.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	3,405,312.52	2,820,137.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	48,868,794.69	-32,136,309.47
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	11,203.35	26,261.77
减：二、费用		998,730.88	1,313,376.82
1. 管理人报酬		673,739.91	832,675.82
2. 托管费		134,748.00	166,535.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	47,237.83	64,792.93
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	143,005.14	249,372.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,811,525.32	-42,623,385.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,811,525.32	-42,623,385.74

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	208,156,094.00	17,438,713.18	225,594,807.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,811,525.32	40,811,525.32
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）	8,000,000.00	2,054,164.72	10,054,164.72
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	3,285,689.77	15,285,689.77
2.基金赎回款	-4,000,000.00	-1,231,525.05	-5,231,525.05
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）	216,156,094.00	60,304,403.22	276,460,497.22
项目	上年度可比期间 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

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。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本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

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	3,972,269.18
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,972,269.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	350,247,950.37	272,846,954.02	-77,400,996.35
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	350,247,950.37	272,846,954.02	-77,400,996.35

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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	660.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.99
应收结算备付金利息	44.58
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	706.39

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	24,864.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,864.87

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 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	201,598.66
应付指数使用费	21,421.11
合计	223,019.77

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	208,156,094.00	208,156,094.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,000,000.00	-4,000,000.00
本期末	216,156,094.00	216,156,094.00

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	26,001,028.23	-8,562,315.05	17,438,713.18
本期利润	-8,057,269.37	48,868,794.69	40,811,525.32
本期基金份额交易产生的变动数	992,049.64	1,062,115.08	2,054,164.72
其中：基金申购款	1,427,913.66	1,857,776.11	3,285,689.77
基金赎回款	-435,864.02	-795,661.03	-1,231,525.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,935,808.50	41,368,594.72	60,304,403.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,190.12
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15.14
结算备付金利息收入	330.86
其他	-
合计	12,536.12

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,071,082.87
股票投资收益——赎回差价收入	-1,416,507.61
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-10,487,590.48

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,571,027.24
减：卖出股票成本总额	28,642,110.11
买卖股票差价收入	-9,071,082.87

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	5,231,525.05
减：现金支付赎回款总额	-27,485.95
减：赎回股票成本总额	6,675,518.61
赎回差价收入	-1,416,507.61

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
----	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,405,312.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,405,312.52

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	48,867,817.49
——股票投资	48,867,817.49
——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	977.20
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	48,868,794.69

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,203.35
合计	11,203.35

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 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	47,237.83

银行间市场交易费用	-
合计	47,237.83

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	16,860.15
信息披露费	54,985.73
银行汇划费	982.08
上市费	29,752.78
指数使用费	40,424.40
合计	143,005.14

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

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股票交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	673,739.91	832,675.82
其中：支付销售机构的客户维护费	520.64	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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	134,748.00	166,535.15

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自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自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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	209,388,968.00	96.87%	202,631,244.00	97.35%

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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	3,972,269.18	12,190.12	3,562,079.22	14,015.83

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（2019 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

600480	凌云股份	2019-06-20	2019-07-03	配股 流通受限	8.74	8.75	9,480.00	82,855.20	82,950.00	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股 流通受限	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股 流通受限	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-

注：截至本报告期末 2019 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002193	如意集团	2019-06-25	重大事项停牌	8.81	2019-07-09	9.12	17,800.00	266,253.80	156,818.00	-

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 2019 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 2019 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经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、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投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其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 2019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	3,972,269.18	-	-	-	3,972,269.18
结算备付金	19,595.61	-	-	-	19,595.61
存出保证金	2,542.69	-	-	-	2,542.69
交易性金融资产	-	-	-	272,846,954.02	272,846,954.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	706.39	706.39
资产总计	3,994,407.48	-	-	272,847,660.41	276,842,067.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	111,405.02	111,405.02
应付托管费	-	-	-	22,281.01	22,281.01
应付交易费用	-	-	-	24,864.87	24,864.87
其他负债	-	-	-	223,019.77	223,019.77
负债总计	-	-	-	381,570.67	381,570.67
利率敏感度缺口	3,994,407.48	-	-	272,466,089.74	276,460,497.22
上年度末 2018年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	2,128,277.24	-	-	-	2,128,277.24
结算备付金	100,844.16	-	-	-	100,844.16
存出保证金	5,615.39	-	-	-	5,615.39
交易性金融资产	-	-	-	223,859,224.39	223,859,224.39
应收利息	-	-	-	462.50	462.50
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,234,736.79	-	-	223,859,686.89	226,094,423.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	97,715.27	97,715.27
应付托管费	-	-	-	19,543.05	19,543.05
应付交易费用	-	-	-	16,312.23	16,312.23
其他负债	-	-	-	366,045.95	366,045.95
负债总计	-	-	-	499,616.50	499,616.50
利率敏感度缺口	2,234,736.79	-	-	223,360,070.39	225,594,807.18

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

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	272,846,954.02	98.69	223,859,224.39	99.23
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	272,846,954.02	98.69	223,859,224.39	99.23

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	15,179,643.32	10,602,955.94
业绩比较基准下降 5%	-15,179,643.32	-10,602,955.94	

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

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 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人民币 272,633,159.48 元，属于第二层级的余额为人民币 213,794.54 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 223,809,078.59 元，属于第二层级的余额为人民币 50,145.80 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	272,846,954.02	98.56
	其中：股票	272,846,954.02	98.56
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	3,991,864.79	1.44
8	其他各项资产	3,249.08	0.00
9	合计	276,842,067.89	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	153,757.60	0.06
C	制造业	187,592,889.01	67.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	65,655.00	0.02
F	批发和零售业	21,411,595.67	7.74
G	交通运输、仓储和邮政业	354,286.80	0.13
H	住宿和餐饮业	1,725,201.64	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,602,446.70	4.20
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	3,068,308.25	1.11
L	租赁和商务服务业	20,385,564.58	7.37
M	科学研究和技术服务业	336,041.55	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,556,074.91	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,048,265.06	0.74
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,512,997.31	8.14
S	综合	-	-
	合计	272,846,954.02	98.69

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	540,652	28,038,212.72	10.14
2	000651	格力电器	502,288	27,625,840.00	9.99
3	600104	上汽集团	398,534	10,162,617.00	3.68
4	601888	中国国旅	111,050	9,844,582.50	3.56
5	600690	海尔智家	416,046	7,193,435.34	2.60
6	002027	分众传媒	1,164,196	6,158,596.84	2.23
7	002594	比亚迪	103,219	5,235,267.68	1.89
8	002024	苏宁易购	421,843	4,842,757.64	1.75
9	000100	TCL 集团	1,232,655	4,104,741.15	1.48
10	600741	华域汽车	179,391	3,874,845.60	1.40
11	600660	福耀玻璃	159,536	3,626,253.28	1.31
12	600177	雅戈尔	399,215	2,535,015.25	0.92
13	600637	东方明珠	235,547	2,482,665.38	0.90
14	600066	宇通客车	151,126	1,967,660.52	0.71
15	300144	宋城演艺	82,765	1,915,182.10	0.69
16	600398	海澜之家	204,404	1,853,944.28	0.67
17	002602	世纪华通	167,848	1,832,900.16	0.66
18	002739	万达电影	93,300	1,720,452.00	0.62
19	600297	广汇汽车	370,950	1,654,437.00	0.60
20	603833	欧派家居	14,205	1,528,742.10	0.55
21	000625	长安汽车	221,900	1,471,197.00	0.53
22	002508	老板电器	53,943	1,464,013.02	0.53
23	002032	苏泊尔	18,900	1,433,187.00	0.52
24	600699	均胜电子	64,800	1,384,128.00	0.50
25	002572	索菲亚	73,582	1,365,681.92	0.49
26	600977	中国电影	85,000	1,331,100.00	0.48
27	600166	福田汽车	530,800	1,257,996.00	0.46
28	000839	中信国安	312,000	1,254,240.00	0.45
29	601799	星宇股份	15,700	1,239,672.00	0.45
30	600839	四川长虹	419,831	1,238,501.45	0.45
31	000581	威孚高科	66,586	1,235,836.16	0.45
32	601238	广汽集团	105,318	1,151,125.74	0.42
33	600037	歌华有线	111,400	1,141,850.00	0.41
34	601633	长城汽车	137,190	1,134,561.30	0.41
35	600959	江苏有线	251,700	1,120,065.00	0.41
36	300027	华谊兄弟	223,640	1,098,072.40	0.40
37	002085	万丰奥威	149,355	1,087,304.40	0.39
38	600655	豫园股份	132,300	1,083,537.00	0.39
39	601098	中南传媒	81,100	1,025,104.00	0.37
40	002131	利欧股份	532,026	1,016,169.66	0.37
41	002563	森马服饰	91,800	1,015,308.00	0.37

42	600258	首旅酒店	55,768	1,002,708.64	0.36
43	601718	际华集团	251,000	981,410.00	0.35
44	002035	华帝股份	80,180	976,592.40	0.35
45	300413	芒果超媒	23,701	972,926.05	0.35
46	000559	万向钱潮	156,649	936,761.02	0.34
47	601966	玲珑轮胎	54,800	931,600.00	0.34
48	000681	视觉中国	48,000	930,240.00	0.34
49	000800	一汽轿车	92,648	911,656.32	0.33
50	002607	中公教育	66,382	911,424.86	0.33
51	000917	电广传媒	129,000	906,870.00	0.33
52	600373	中文传媒	70,498	885,454.88	0.32
53	600729	重庆百货	28,026	847,506.24	0.31
54	300182	捷成股份	191,100	842,751.00	0.30
55	600138	中青旅	65,873	835,928.37	0.30
56	600682	南京新百	73,853	835,277.43	0.30
57	300058	蓝色光标	192,166	820,548.82	0.30
58	000887	中鼎股份	82,200	788,298.00	0.29
59	600418	江淮汽车	150,750	777,870.00	0.28
60	600060	海信电器	88,879	766,136.98	0.28
61	002042	华孚时尚	103,850	753,951.00	0.27
62	002242	九阳股份	34,955	727,413.55	0.26
63	000156	华数传媒	65,237	718,259.37	0.26
64	002419	天虹股份	54,800	715,688.00	0.26
65	601928	凤凰传媒	86,800	700,476.00	0.25
66	300616	尚品宅配	9,140	691,166.80	0.25
67	300251	光线传媒	100,016	680,108.80	0.25
68	300133	华策影视	100,896	679,030.08	0.25
69	002126	银轮股份	90,806	675,596.64	0.24
70	002488	金固股份	80,545	670,939.85	0.24
71	002640	跨境通	79,750	664,317.50	0.24
72	603816	顾家家居	20,480	653,721.60	0.24
73	002426	胜利精密	254,250	650,880.00	0.24
74	000921	海信家电	51,451	642,108.48	0.23
75	600612	老凤祥	14,316	639,925.20	0.23
76	600936	广西广电	131,300	636,805.00	0.23
77	601058	赛轮轮胎	214,286	636,429.42	0.23
78	000793	华闻传媒	181,700	610,512.00	0.22
79	000901	航天科技	48,800	607,072.00	0.22
80	600859	王府井	39,659	602,420.21	0.22
81	601929	吉视传媒	247,590	601,643.70	0.22
82	002400	省广集团	198,362	591,118.76	0.21
83	600831	广电网络	54,000	583,200.00	0.21
84	600337	美克家居	140,100	577,212.00	0.21
85	600754	锦江股份	23,000	566,720.00	0.20

86	002429	兆驰股份	205,900	564,166.00	0.20
87	603515	欧普照明	17,460	563,085.00	0.20
88	000158	常山北明	103,790	562,541.80	0.20
89	601019	山东出版	70,800	550,824.00	0.20
90	000996	中国中期	39,313	535,836.19	0.19
91	000016	深康佳 A	127,112	533,870.40	0.19
92	002537	海联金汇	70,500	531,570.00	0.19
93	601311	骆驼股份	48,900	530,565.00	0.19
94	000564	供销大集	203,200	530,352.00	0.19
95	000980	众泰汽车	125,810	529,660.10	0.19
96	002614	奥佳华	32,087	523,659.84	0.19
97	300176	派生科技	35,294	518,821.80	0.19
98	600978	宜华生活	135,124	508,066.24	0.18
99	002925	盈趣科技	13,000	507,130.00	0.18
100	601689	拓普集团	33,100	507,092.00	0.18
101	002048	宁波华翔	46,346	501,463.72	0.18
102	601010	文峰股份	145,200	499,488.00	0.18
103	002292	奥飞娱乐	77,600	497,416.00	0.18
104	600742	一汽富维	46,609	497,318.03	0.18
105	000726	鲁泰 A	51,778	494,997.68	0.18
106	603766	隆鑫通用	116,850	489,601.50	0.18
107	002832	比音勒芬	10,250	488,617.50	0.18
108	001696	宗申动力	78,100	486,563.00	0.18
109	600623	华谊集团	63,200	482,848.00	0.17
110	600006	东风汽车	90,400	481,832.00	0.17
111	600986	科达股份	112,840	477,313.20	0.17
112	600757	长江传媒	69,471	473,097.51	0.17
113	000501	鄂武商 A	43,906	471,989.50	0.17
114	002867	周大生	13,800	471,822.00	0.17
115	600694	大商股份	16,664	465,092.24	0.17
116	002625	光启技术	49,260	457,625.40	0.17
117	000550	江铃汽车	23,600	457,604.00	0.17
118	600653	申华控股	177,317	450,385.18	0.16
119	000810	创维数字	49,200	434,928.00	0.16
120	002503	搜于特	158,010	434,527.50	0.16
121	002621	美吉姆	33,200	434,256.00	0.16
122	000801	四川九洲	70,534	426,730.70	0.15
123	002705	新宝股份	36,600	420,900.00	0.15
124	600400	红豆股份	115,280	420,772.00	0.15
125	601127	小康股份	32,100	420,510.00	0.15
126	002031	巨轮智能	200,100	420,210.00	0.15
127	002434	万里扬	61,286	416,131.94	0.15
128	002489	浙江永强	123,951	413,996.34	0.15
129	600987	航民股份	62,375	412,298.75	0.15

130	002083	孚日股份	72,400	409,060.00	0.15
131	601801	皖新传媒	67,886	407,994.86	0.15
132	601949	中国出版	62,000	403,000.00	0.15
133	600146	商赢环球	26,800	402,536.00	0.15
134	600733	北汽蓝谷	47,100	389,046.00	0.14
135	002707	众信旅游	64,042	388,734.94	0.14
136	002677	浙江美大	29,380	386,640.80	0.14
137	002668	奥马电器	74,480	385,806.40	0.14
138	000541	佛山照明	73,536	385,328.64	0.14
139	600996	贵广网络	35,600	383,768.00	0.14
140	002721	金一文化	61,453	382,237.66	0.14
141	002003	伟星股份	56,080	379,100.80	0.14
142	002277	友阿股份	112,100	378,898.00	0.14
143	600593	大连圣亚	10,100	378,649.00	0.14
144	000829	天音控股	65,000	378,300.00	0.14
145	000957	中通客车	50,400	378,000.00	0.14
146	000030	富奥股份	80,399	375,463.33	0.14
147	002293	罗莱生活	37,640	373,012.40	0.13
148	002327	富安娜	49,800	372,006.00	0.13
149	002154	报喜鸟	110,344	367,445.52	0.13
150	002512	达华智能	80,601	364,316.52	0.13
151	600261	阳光照明	99,100	363,697.00	0.13
152	603377	东方时尚	23,440	358,163.20	0.13
153	600707	彩虹股份	71,400	357,714.00	0.13
154	600480	凌云股份	40,680	355,950.00	0.13
155	601858	中国科传	27,100	355,281.00	0.13
156	002355	兴民智通	42,711	354,928.41	0.13
157	600676	交运股份	70,295	354,286.80	0.13
158	002251	步步高	44,238	352,576.86	0.13
159	002283	天润曲轴	88,900	349,377.00	0.13
160	002681	奋达科技	82,162	348,366.88	0.13
161	002920	德赛西威	15,500	347,200.00	0.13
162	601163	三角轮胎	27,600	346,104.00	0.13
163	600335	国机汽车	49,970	345,792.40	0.13
164	600448	华纺股份	59,000	345,150.00	0.12
165	600661	昂立教育	14,700	344,421.00	0.12
166	600220	江苏阳光	141,900	341,979.00	0.12
167	600122	宏图高科	105,437	338,452.77	0.12
168	002776	柏堡龙	20,553	336,041.55	0.12
169	600086	东方金钰	76,302	335,728.80	0.12
170	002029	七匹狼	51,700	333,982.00	0.12
171	002510	天汽模	82,300	333,315.00	0.12
172	601965	中国汽研	44,305	329,186.15	0.12
173	600523	贵航股份	23,065	328,676.25	0.12

174	000802	北京文化	32,576	328,040.32	0.12
175	603096	新经典	6,100	327,082.00	0.12
176	000417	合肥百货	62,792	325,890.48	0.12
177	300343	联创股份	45,100	324,720.00	0.12
178	600715	文投控股	83,778	324,220.86	0.12
179	000665	湖北广电	38,905	323,689.60	0.12
180	002343	慈文传媒	42,760	323,265.60	0.12
181	600824	益民集团	82,800	322,092.00	0.12
182	600628	新世界	44,255	321,291.30	0.12
183	601777	力帆股份	74,886	321,260.94	0.12
184	002798	帝欧家居	17,489	320,223.59	0.12
185	000599	青岛双星	71,083	319,873.50	0.12
186	000913	钱江摩托	31,000	319,300.00	0.12
187	000587	金洲慈航	120,800	311,664.00	0.11
188	600609	金杯汽车	74,675	309,154.50	0.11
189	002540	亚太科技	65,000	308,100.00	0.11
190	600730	中国高科	52,700	307,768.00	0.11
191	002448	中原内配	55,350	307,746.00	0.11
192	002575	群兴玩具	43,700	307,648.00	0.11
193	000927	一汽夏利	72,600	307,098.00	0.11
194	600088	中视传媒	22,565	306,658.35	0.11
195	601366	利群股份	48,800	305,976.00	0.11
196	002239	奥特佳	159,099	305,470.08	0.11
197	600825	新华传媒	59,600	303,960.00	0.11
198	600303	曙光股份	61,578	302,347.98	0.11
199	600229	城市传媒	40,002	300,415.02	0.11
200	002664	长鹰信质	22,772	298,085.48	0.11
201	600136	当代明诚	27,800	297,460.00	0.11
202	000589	贵州轮胎	69,700	292,043.00	0.11
203	002087	新野纺织	74,420	288,749.60	0.10
204	300291	华录百纳	46,235	286,657.00	0.10
205	600070	浙江富润	35,230	286,067.60	0.10
206	000850	华茂股份	63,300	283,584.00	0.10
207	300258	精锻科技	23,100	279,741.00	0.10
208	600630	龙头股份	33,886	274,815.46	0.10
209	600054	黄山旅游	29,500	274,055.00	0.10
210	002592	八菱科技	17,602	271,950.90	0.10
211	002284	亚太股份	50,435	271,844.65	0.10
212	002486	嘉麟杰	75,700	271,006.00	0.10
213	000025	特力 A	13,385	270,644.70	0.10
214	002406	远东传动	44,600	267,600.00	0.10
215	300336	新文化	64,042	267,055.14	0.10
216	002416	爱施德	42,482	265,512.50	0.10
217	600693	东百集团	51,200	264,704.00	0.10

218	002362	汉王科技	17,502	264,280.20	0.10
219	300577	开润股份	7,500	264,225.00	0.10
220	002543	万和电气	19,610	263,166.20	0.10
221	600686	金龙汽车	34,510	259,515.20	0.09
222	300178	腾邦国际	42,145	259,191.75	0.09
223	600838	上海九百	36,400	257,712.00	0.09
224	002328	新朋股份	60,548	253,696.12	0.09
225	000888	峨眉山 A	42,100	253,442.00	0.09
226	002472	双环传动	46,652	252,853.84	0.09
227	002181	粤传媒	52,900	252,333.00	0.09
228	000521	长虹美菱	70,401	250,627.56	0.09
229	002516	旷达科技	85,500	250,515.00	0.09
230	300148	天舟文化	62,305	250,466.10	0.09
231	002699	美盛文化	41,493	248,958.00	0.09
232	603008	喜临门	22,496	248,130.88	0.09
233	300217	东方电热	86,905	247,679.25	0.09
234	600960	渤海汽车	63,700	247,156.00	0.09
235	002616	长青集团	33,800	245,050.00	0.09
236	002418	康盛股份	64,580	244,758.20	0.09
237	600336	澳柯玛	55,100	244,644.00	0.09
238	300342	天银机电	24,606	244,091.52	0.09
239	601566	九牧王	19,794	243,862.08	0.09
240	601599	鹿港文化	76,092	238,928.88	0.09
241	300304	云意电气	59,609	237,243.82	0.09
242	603898	好莱客	14,300	236,522.00	0.09
243	002345	潮宏基	51,600	234,780.00	0.08
244	600280	中央商场	65,268	234,312.12	0.08
245	002662	京威股份	68,000	233,240.00	0.08
246	002101	广东鸿图	30,385	232,445.25	0.08
247	300651	金陵体育	5,820	230,763.00	0.08
248	603808	歌力思	15,095	230,500.65	0.08
249	600107	美尔雅	32,900	228,326.00	0.08
250	600135	乐凯胶片	29,638	228,212.60	0.08
251	002348	高乐股份	64,700	225,803.00	0.08
252	600555	海航创新	77,500	225,525.00	0.08
253	002033	丽江旅游	37,662	225,218.76	0.08
254	600327	大东方	59,400	225,126.00	0.08
255	002454	松芝股份	43,209	224,254.71	0.08
256	601811	新华文轩	18,300	223,443.00	0.08
257	000796	凯撒旅游	32,100	222,774.00	0.08
258	002590	万安科技	27,400	220,570.00	0.08
259	603313	梦百合	12,750	220,447.50	0.08
260	600712	南宁百货	43,500	219,675.00	0.08
261	603197	保隆科技	11,380	218,837.40	0.08

262	002502	鼎龙文化	63,468	218,329.92	0.08
263	603305	旭升股份	9,100	217,581.00	0.08
264	000955	欣龙控股	49,200	217,464.00	0.08
265	002397	梦洁股份	39,800	216,910.00	0.08
266	002708	光洋股份	24,020	216,180.00	0.08
267	002656	摩登大道	40,480	215,353.60	0.08
268	002605	姚记扑克	20,507	215,323.50	0.08
269	000700	模塑科技	56,500	213,570.00	0.08
270	603486	科沃斯	7,040	212,960.00	0.08
271	002761	多喜爱	21,656	212,228.80	0.08
272	603868	飞科电器	5,400	211,410.00	0.08
273	601500	通用股份	29,900	211,393.00	0.08
274	300247	融捷健康	64,100	210,889.00	0.08
275	600551	时代出版	23,065	209,199.55	0.08
276	600071	凤凰光学	19,200	207,360.00	0.08
277	002759	天际股份	15,400	207,130.00	0.07
278	000892	欢瑞世纪	55,700	206,090.00	0.07
279	603587	地素时尚	9,000	204,660.00	0.07
280	002045	国光电器	37,353	202,826.79	0.07
281	300279	和晶科技	35,620	201,609.20	0.07
282	600358	国旅联合	45,900	201,042.00	0.07
283	000678	襄阳轴承	26,000	200,720.00	0.07
284	002536	飞龙股份	33,921	200,473.11	0.07
285	603355	莱克电气	9,100	195,832.00	0.07
286	603365	水星家纺	10,600	191,754.00	0.07
287	000026	飞亚达 A	24,525	190,559.25	0.07
288	300375	鹏翎股份	45,550	187,666.00	0.07
289	300272	开能健康	33,015	187,195.05	0.07
290	600386	北巴传媒	45,924	186,910.68	0.07
291	603035	常熟汽饰	19,200	185,856.00	0.07
292	603586	金麒麟	11,500	184,000.00	0.07
293	002612	朗姿股份	18,402	183,651.96	0.07
294	002238	天威视讯	21,100	182,093.00	0.07
295	002712	思美传媒	26,230	182,036.20	0.07
296	601595	上海电影	12,700	181,610.00	0.07
297	002159	三特索道	11,100	181,596.00	0.07
298	603801	志邦家居	9,160	181,001.60	0.07
299	300242	佳云科技	43,300	179,262.00	0.06
300	300269	联建光电	40,900	179,142.00	0.06
301	002574	明牌珠宝	30,262	177,637.94	0.06
302	300507	苏奥传感	17,620	177,257.20	0.06
303	300625	三雄极光	12,700	175,895.00	0.06
304	603788	宁波高发	12,940	175,725.20	0.06
305	000673	当代东方	45,000	172,800.00	0.06

306	000757	浩物股份	35,875	172,558.75	0.06
307	603385	惠达卫浴	18,990	171,859.50	0.06
308	603839	安正时尚	13,760	169,248.00	0.06
309	603997	继峰股份	21,900	169,068.00	0.06
310	603579	荣泰健康	5,700	167,010.00	0.06
311	002878	元隆雅图	6,020	166,874.40	0.06
312	002485	希努尔	24,500	166,845.00	0.06
313	002494	华斯股份	30,750	166,665.00	0.06
314	002905	金逸影视	9,300	165,075.00	0.06
315	002722	金轮股份	11,000	163,680.00	0.06
316	300100	双林股份	21,200	161,120.00	0.06
317	000663	永安林业	21,200	160,484.00	0.06
318	600818	中路股份	13,464	159,683.04	0.06
319	002703	浙江世宝	26,100	158,949.00	0.06
320	002193	如意集团	17,800	156,818.00	0.06
321	002351	漫步者	27,234	156,050.82	0.06
322	300432	富临精工	22,700	155,495.00	0.06
323	300403	汉宇集团	27,690	155,064.00	0.06
324	002265	西仪股份	14,400	154,800.00	0.06
325	600968	海油发展	43,312	153,757.60	0.06
326	002634	棒杰股份	26,200	153,532.00	0.06
327	600933	爱柯迪	19,400	152,290.00	0.06
328	603303	得邦照明	16,580	148,225.20	0.05
329	600679	上海凤凰	10,600	147,976.00	0.05
330	603730	岱美股份	6,300	147,672.00	0.05
331	603999	读者传媒	26,300	147,017.00	0.05
332	603129	春风动力	7,000	145,810.00	0.05
333	603557	起步股份	16,300	145,722.00	0.05
334	300426	唐德影视	22,900	145,186.00	0.05
335	002103	广博股份	30,700	144,290.00	0.05
336	603900	莱绅通灵	11,640	143,986.80	0.05
337	603366	日出东方	36,300	140,118.00	0.05
338	300547	川环科技	12,620	139,955.80	0.05
339	002071	长城影视	35,900	138,933.00	0.05
340	002553	南方轴承	23,800	138,754.00	0.05
341	300473	德尔股份	4,800	138,624.00	0.05
342	600828	茂业商业	27,484	137,969.68	0.05
343	603348	文灿股份	7,500	137,850.00	0.05
344	002740	爱迪尔	20,601	137,408.67	0.05
345	600178	东安动力	26,300	137,023.00	0.05
346	603103	横店影视	8,580	135,907.20	0.05
347	603179	新泉股份	10,420	134,939.00	0.05
348	000607	华媒控股	22,600	134,922.00	0.05
349	300160	秀强股份	37,060	134,898.40	0.05

350	300755	华致酒行	3,800	133,798.00	0.05
351	603055	台华新材	17,360	132,456.80	0.05
352	603398	邦宝益智	8,500	132,175.00	0.05
353	300660	江苏雷利	8,836	131,833.12	0.05
354	300528	幸福蓝海	17,200	131,064.00	0.05
355	002853	皮阿诺	7,000	130,340.00	0.05
356	601086	国芳集团	22,900	128,011.00	0.05
357	603180	金牌厨柜	2,300	127,052.00	0.05
358	603818	曲美家居	16,704	126,950.40	0.05
359	600738	兰州民百	17,400	126,324.00	0.05
360	000038	深大通	17,880	126,054.00	0.05
361	603608	天创时尚	16,980	125,991.60	0.05
362	603214	爱婴室	3,400	124,678.00	0.05
363	600148	长春一东	8,000	123,200.00	0.04
364	300695	兆丰股份	2,300	122,682.00	0.04
365	002906	华阳集团	10,800	121,932.00	0.04
366	603518	锦泓集团	12,960	119,620.80	0.04
367	002098	浔兴股份	20,400	118,116.00	0.04
368	603358	华达科技	10,700	117,700.00	0.04
369	300707	威唐工业	7,400	116,920.00	0.04
370	603838	四通股份	12,200	116,632.00	0.04
371	603081	大丰实业	9,200	115,460.00	0.04
372	300526	中潜股份	7,900	115,261.00	0.04
373	603615	茶花股份	11,000	113,960.00	0.04
374	603239	浙江仙通	12,300	113,652.00	0.04
375	603006	联明股份	8,700	113,013.00	0.04
376	601339	百隆东方	24,900	112,797.00	0.04
377	603661	恒林股份	3,400	111,758.00	0.04
378	603555	贵人鸟	21,500	111,585.00	0.04
379	603667	五洲新春	13,180	110,053.00	0.04
380	300612	宣亚国际	5,500	109,670.00	0.04
381	603013	亚普股份	6,900	109,572.00	0.04
382	603009	北特科技	16,550	109,395.50	0.04
383	002863	今飞凯达	17,220	106,247.40	0.04
384	000753	漳州发展	33,000	104,940.00	0.04
385	603040	新坐标	3,650	104,937.50	0.04
386	300580	贝斯特	6,800	104,720.00	0.04
387	002059	云南旅游	16,200	104,328.00	0.04
388	603335	迪生力	19,370	103,823.20	0.04
389	603598	引力传媒	12,300	103,689.00	0.04
390	002865	钧达股份	5,600	103,600.00	0.04
391	300745	欣锐科技	3,900	102,843.00	0.04
392	603809	豪能股份	9,880	102,455.60	0.04
393	603787	新日股份	6,900	101,775.00	0.04

394	603877	太平鸟	6,500	100,880.00	0.04
395	603558	健盛集团	11,500	99,475.00	0.04
396	002674	兴业科技	6,700	96,480.00	0.03
397	002762	金发拉比	16,350	94,503.00	0.03
398	300654	世纪天鸿	7,200	92,520.00	0.03
399	603326	我乐家居	7,700	91,245.00	0.03
400	603277	银都股份	9,378	90,966.60	0.03
401	002731	萃华珠宝	5,100	89,709.00	0.03
402	002875	安奈儿	4,500	86,400.00	0.03
403	300733	西菱动力	6,600	85,470.00	0.03
404	002899	英派斯	6,200	84,754.00	0.03
405	603477	振静股份	11,000	84,260.00	0.03
406	603596	伯特利	5,100	84,201.00	0.03
407	600081	东风科技	7,000	83,300.00	0.03
408	000721	西安饮食	19,300	83,183.00	0.03
409	603161	科华控股	5,597	81,604.26	0.03
410	002363	隆基机械	13,800	81,144.00	0.03
411	603136	天目湖	4,015	81,143.15	0.03
412	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
413	603768	常青股份	6,900	80,385.00	0.03
414	603848	好太太	5,500	80,355.00	0.03
415	603101	汇嘉时代	11,400	79,344.00	0.03
416	603767	中马传动	10,320	78,328.80	0.03
417	603677	奇精机械	6,540	77,695.20	0.03
418	000622	恒立实业	14,100	76,845.00	0.03
419	300742	越博动力	2,600	75,270.00	0.03
420	603726	朗迪集团	6,200	74,276.00	0.03
421	002921	联诚精密	3,600	74,088.00	0.03
422	600139	西部资源	22,000	73,700.00	0.03
423	603157	拉夏贝尔	11,400	73,530.00	0.03
424	002725	跃岭股份	7,100	73,414.00	0.03
425	000613	大东海 A	12,200	72,590.00	0.03
426	603196	日播时尚	8,300	72,542.00	0.03
427	603922	金鸿顺	4,400	71,896.00	0.03
428	603825	华扬联众	5,200	71,136.00	0.03
429	603238	诺邦股份	4,100	70,930.00	0.03
430	300716	国立科技	5,500	70,675.00	0.03
431	300681	英搏尔	2,600	70,642.00	0.03
432	603685	晨丰科技	5,700	69,882.00	0.03
433	603389	亚振家居	8,980	69,505.20	0.03
434	300694	蠡湖股份	3,600	69,120.00	0.03
435	300729	乐歌股份	3,000	68,970.00	0.02
436	002676	顺威股份	19,900	67,660.00	0.02
437	002403	爱仕达	7,800	66,612.00	0.02

438	002830	名雕股份	4,500	65,655.00	0.02
439	603121	华培动力	3,600	65,232.00	0.02
440	002765	蓝黛传动	10,600	64,872.00	0.02
441	603208	江山欧派	1,800	61,974.00	0.02
442	002790	瑞尔特	8,960	60,569.60	0.02
443	603099	长白山	5,900	57,643.00	0.02
444	603629	利通电子	1,700	54,383.00	0.02
445	300749	顶固集创	3,300	49,566.00	0.02
446	002888	惠威科技	2,100	48,825.00	0.02
447	300428	四通新材	4,100	44,403.00	0.02
448	300756	中山金马	1,200	43,356.00	0.02
449	603657	春光科技	1,600	40,528.00	0.01
450	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
451	603266	天龙股份	3,200	37,984.00	0.01
452	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
453	603709	中源家居	1,300	35,880.00	0.01
454	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
455	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
456	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
457	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	002739	万达电影	1,794,939.00	0.80
2	002027	分众传媒	1,770,004.00	0.78
3	000333	美的集团	1,430,445.75	0.63
4	002602	世纪华通	952,886.00	0.42
5	000887	中鼎股份	787,285.00	0.35
6	600936	广西广电	634,571.00	0.28
7	601010	文峰股份	521,154.00	0.23
8	002621	美吉姆	429,099.00	0.19
9	600733	北汽蓝谷	416,124.00	0.18
10	600297	广汇汽车	380,008.00	0.17
11	600448	华纺股份	366,122.00	0.16
12	601258	庞大集团	342,810.00	0.15
13	002131	利欧股份	329,132.00	0.15
14	600824	益民集团	319,373.00	0.14

15	600037	歌华有线	319,254.00	0.14
16	600730	中国高科	317,586.00	0.14
17	601019	山东出版	308,157.00	0.14
18	000589	贵州轮胎	306,481.00	0.14
19	000651	格力电器	302,610.00	0.13
20	002563	森马服饰	299,185.00	0.13

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，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	000651	格力电器	2,791,850.00	1.24
2	000418	小天鹅 A	1,430,445.75	0.63
3	601258	庞大集团	975,817.00	0.43
4	600633	浙数文化	699,510.00	0.31
5	600989	宝丰能源	409,180.80	0.18
6	300413	芒果超媒	389,540.00	0.17
7	002190	*ST 集成	362,323.60	0.16
8	300081	恒信东方	341,480.00	0.15
9	603869	新智认知	288,301.95	0.13
10	300005	探路者	276,380.21	0.12
11	000572	*ST 海马	261,246.00	0.12
12	603306	华懋科技	248,273.30	0.11
13	000981	ST 银亿	247,065.66	0.11
14	000719	中原传媒	244,605.12	0.11
15	603889	新澳股份	243,399.40	0.11
16	002561	徐家汇	242,489.00	0.11
17	002186	全聚德	239,418.00	0.11
18	600928	西安银行	222,835.50	0.10
19	002394	联发股份	218,080.00	0.10
20	601007	金陵饭店	212,822.53	0.09

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	20,678,950.10
卖出股票收入（成交）总额	19,571,027.24

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,542.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	706.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,249.08

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		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	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
764	282,926.8 2	209,914 ,797.00	97.11%	6,241,2 97.00	2.89%	209,388,96 8.00	96.87%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证全指可选消费交易型开放
第 47 页共 53 页

式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	杭州钱江新城金融投资有限公司	499,400.00	0.23%
2	朱益	384,200.00	0.18%
3	高洁	149,600.00	0.07%
4	王浩	144,519.00	0.07%
5	张虎	111,500.00	0.05%
6	朱晓晔	107,000.00	0.05%
7	苑桂花	100,006.00	0.05%
8	李桂青	100,000.00	0.05%
9	王昕	100,000.00	0.05%
10	许国根	100,000.00	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	209,388,968.00	96.87%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

8.4 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	208,156,094.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	216,156,094.00

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

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	14,599,658.62	41.05%	10,615.74	40.91%	-
招商证券	2	20,966,605.37	58.95%	15,332.93	59.09%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

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

金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
2	关于增加国盛证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-25

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	20190101-20190630	202,631,244.00	12,000,000.00	5,242,276.00	209,388,968.00	96.87%
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：投资者可在营业时间免费查阅，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
二〇一九年八月二十八日