

# 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 年年度报告

### 2019 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年三月二十七日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	16
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 其他信息.....	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	62
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	62
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12	投资组合报告附注 .....	62
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>63</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	63
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.4	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 .....	64
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>64</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>65</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4	基金投资策略的改变 .....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8	其他重大事件 .....	67
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>67</b>
12.1	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 .....	67
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>68</b>
13.1	备查文件目录 .....	68
13.2	存放地点 .....	68
13.3	查阅方式 .....	68

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指可选消费 ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	220,156,094.00 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	2014-06-25

### 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	邱春杨	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	<b>2019 年</b>	<b>2018 年</b>	<b>2017 年</b>
本期已实现收益	-4,624,504.56	-22,336,488.26	-3,846,590.24
本期利润	74,172,663.65	-109,862,593.56	20,365,189.14
加权平均基金份额本期利润	0.3429	-0.5312	0.0862
本期加权平均净值利润率	26.41%	-38.15%	5.39%
本期基金份额净值增长率	31.95%	-33.19%	5.17%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2019 年末</b>	<b>2018 年末</b>	<b>2017 年末</b>
期末可供分配利润	22,703,115.22	17,438,713.18	50,297,998.66
期末可供分配基金份额利润	0.1031	0.0838	0.2371
期末基金资产净值	314,854,698.33	225,594,807.18	344,165,737.71
期末基金份额净值	1.4301	1.0838	1.6222
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2019 年末</b>	<b>2018 年末</b>	<b>2017 年末</b>
基金份额累计净值增长率	43.01%	8.38%	62.23%

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

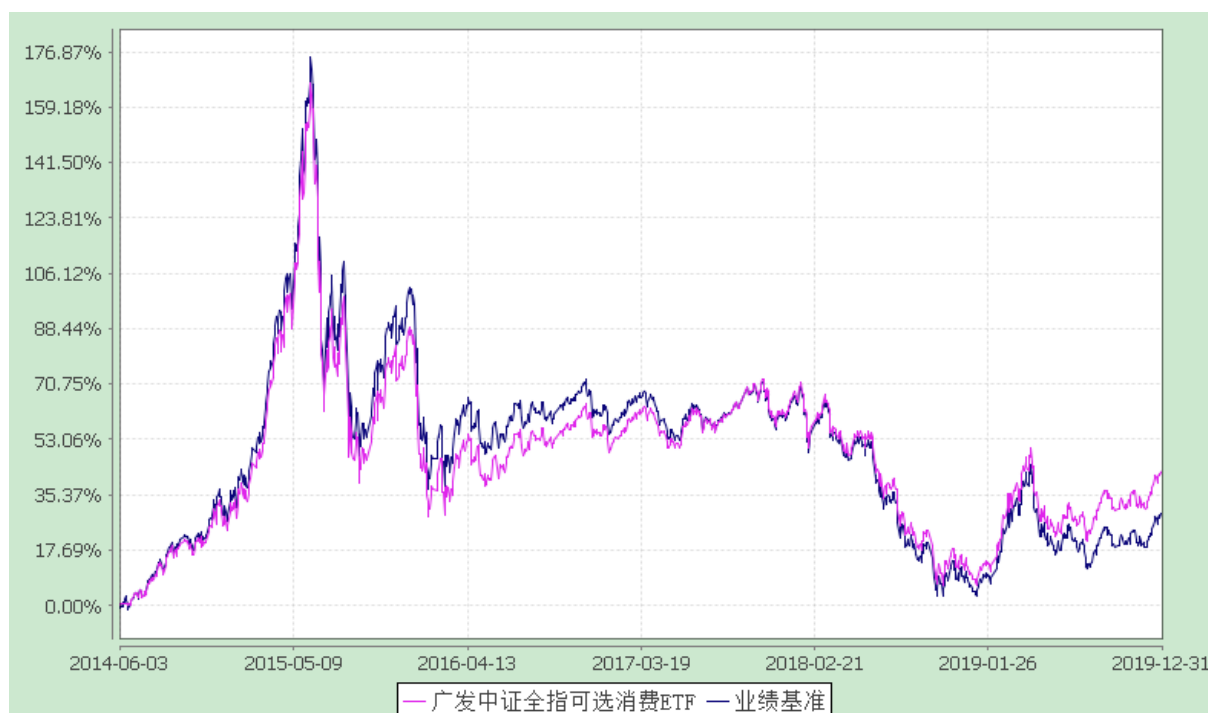
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	9.59%	0.85%	9.03%	0.86%	0.56%	-0.01%
过去六个月	11.81%	0.97%	6.55%	0.98%	5.26%	-0.01%
过去一年	31.95%	1.34%	23.81%	1.35%	8.14%	-0.01%
过去三年	-7.29%	1.19%	-19.26%	1.21%	11.97%	-0.02%
过去五年	13.94%	1.65%	0.71%	1.70%	13.23%	-0.05%
自基金合同生效起至今	43.01%	1.60%	29.60%	1.65%	13.41%	-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

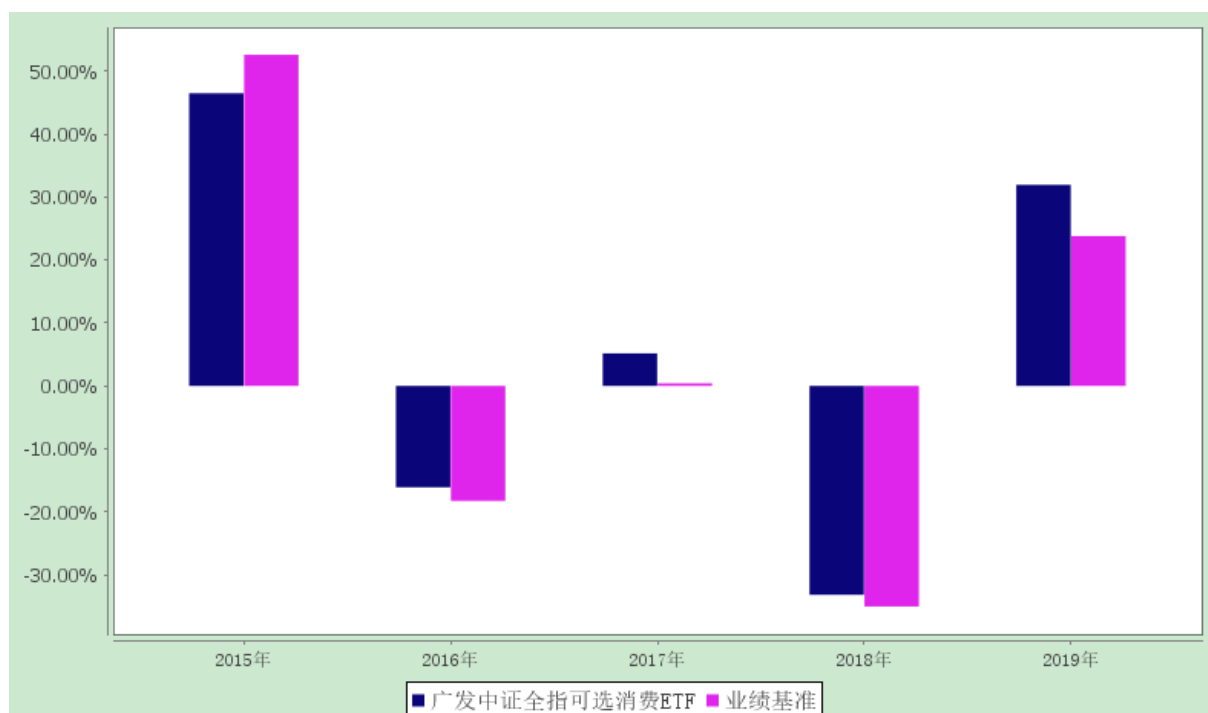
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2014年6月3日至2019年12月31日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司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人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 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 12 月 31 日，公司管理 207 只开放式基金，管理公募基金规模为 5025.61 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	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

	药卫生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				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(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 公平交易制度和控制方法

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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。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；对于不同投资组合的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现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。

#### 4.3.3 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 5 次，其中 4 次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,1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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A股各大指数均有正的涨幅。上证综指上涨22.30%,深证成指上涨44.08%,创业板指上涨43.79%,中小板指上涨41.03%,而中证全指可选消费指数上涨23.81%。从政府公告的数据来看,2019年社会消费品零售总额同比增长8.0%,高于GDP增速,显示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31.95%,同期业绩比较基准收益率为23.81%。

#### 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2020年,虽然外部政治经济情况复杂多变,但中国经济的内生增长动力并没有改变,预计2020年中国经济依然可以平稳增长,并且经济结构将进一步得到改善。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。未来随着经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动,消费升级伴随着居民收入的提高将成为整体经济发展的趋势。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据法律法规、监管规则的变化和业务发展情况,坚持从保护基金份额持有人利益出发,积极推动主动、全面合规管理,持续完善内控机制,进一步加强内部风险的控制与防范,有效保障了法律法规、监管要求和各项规章制度的落实,保证了基金合同得到严格履行。

本年度主要的监察稽核工作如下:

(1) 认真贯彻落实易会满主席在证券基金行业文化建设动员大会上的讲话精神,积极践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化,在公司成立企业文化建设领导小组与企业文化建设工作小组,

研究制定工作方案，全力推进公司企业文化建设工作。

(2) 健全公司制度体系，夯实合规内控制度基础，应新发布、修订的法律、法规及监管规定以及新开展的科创板股票交易、商品期货投资等业务需要，及时建立、完善各项管理制度及业务流程，确保所有业务有章可循、依法合规。

(3) 从实用性出发采取多种形式组织开展合规教育和培训，内容涵盖信息披露新规、资管新规、内幕交易、债券违约风险处置及策略应对等法律法规和业务知识，及时传达监管要求和监管精神，切实提升了公司员工合规意识和遵规守法能力。

(4) 健全各业务、产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 按照审慎经营原则，对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 严守合规底线，强化对投资、研究、交易等关键环节实时监控，严格落实公平交易、关联交易、异常交易管控要求，严防内幕交易、利益输送、市场操纵等违法违规行为。

(7) 加强对投资组合日常合规风险监控，大力推进合规、风控系统建设，提升信息化管理水平，实现精细化管理。

(8) 完善信息披露工作机制，优化基金定期报告工作流程。为确保定期报告工作的有序开展，公司全面梳理和优化定期报告信息披露工作流程，进一步提高信息披露工作效率和质量。

(9) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，不断完善发现问题、整改落实、制度流程优化的内部监督与反馈改进机制，主动发现自身管理中的不足，促进相关业务依法、合规开展。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

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

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

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

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

## §6 审计报告

安永华明（2020）审字第 60873695\_G143 号

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的



持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2020 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	2,954,241.40	2,128,277.24
结算备付金		20,262.49	100,844.16
存出保证金		15,556.53	5,615.39
交易性金融资产	7.4.7.2	312,213,230.90	223,859,224.39
其中：股票投资		312,168,930.90	223,859,224.39
基金投资		-	-
债券投资		44,300.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	588.94	462.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>315,203,880.26</b>	<b>226,094,423.68</b>

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		128,679.61	97,715.27
应付托管费		25,735.92	19,543.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	18,555.48	16,312.23
应交税费		0.05	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	176,210.87	366,045.95
<b>负债合计</b>		<b>349,181.93</b>	<b>499,616.50</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	220,156,094.00	208,156,094.00
未分配利润	7.4.7.10	94,698,604.33	17,438,713.18
<b>所有者权益合计</b>		<b>314,854,698.33</b>	<b>225,594,807.18</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>315,203,880.26</b>	<b>226,094,423.68</b>

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.4301 元，基金份额总额 220,156,094.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>76,332,568.75</b>	<b>-107,543,327.06</b>
1.利息收入		28,044.78	25,541.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,043.37	25,541.00
债券利息收入		1.41	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,498,142.03	-20,069,024.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,189,058.86	-24,793,422.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,690,916.83	4,724,397.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	78,797,168.21	-87,526,105.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,497.79	26,261.77
<b>减：二、费用</b>		<b>2,159,905.10</b>	<b>2,319,266.50</b>
1. 管理人报酬		1,400,921.88	1,443,328.82
2. 托管费		280,184.32	288,665.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	178,053.52	102,867.49

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	7.4.7.19	300,745.38	484,404.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>74,172,663.65</b>	<b>-109,862,593.56</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>74,172,663.65</b>	<b>-109,862,593.56</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	74,172,663.65	74,172,663.65
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	3,087,227.50	15,087,227.50
其中：1.基金申购款	24,000,000.00	6,559,938.91	30,559,938.91
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-3,472,711.41	-15,472,711.41
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)	220,156,094.00	94,698,604.33	314,854,698.33
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	-109,862,593.56	-109,862,593.56
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)	-4,000,000.00	-4,708,336.97	-8,708,336.97
其中：1.基金申购款	38,000,000.00	17,945,084.14	55,945,084.14
2.基金赎回款	-42,000,000.00	-22,653,421.11	-64,653,421.11
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)	208,156,094.00	17,438,713.18	225,594,807.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]1265 号《关于核准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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 2020 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工

具的合同。

#### (1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

#### (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。



#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 分部报告

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### (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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	2,954,241.40	2,128,277.24
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	2,954,241.40	2,128,277.24

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		359,641,553.73	312,168,930.90	-47,472,622.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	44,300.00	44,300.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	44,300.00	44,300.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		359,685,853.73	312,213,230.90	-47,472,622.83
项目		上年度末		
		2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		350,129,015.43	223,859,224.39	-126,269,791.04
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		350,129,015.43	223,859,224.39	-126,269,791.04

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	571.38	446.38
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	7.00	2.50
应收结算备付金利息	9.10	13.62
应收债券利息	1.46	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	588.94	462.50

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	18,555.48	16,312.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	18,555.48	16,312.23

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	154,000.00	336,000.00
应付指数使用费	22,210.87	17,457.73
可退替代款	-	12,588.22
合计	176,210.87	366,045.95

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	220,156,094.00	220,156,094.00

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,001,028.23	-8,562,315.05	17,438,713.18
本期利润	-4,624,504.56	78,797,168.21	74,172,663.65
本期基金份额交易产生的变动数	1,326,591.55	1,760,635.95	3,087,227.50
其中：基金申购款	2,659,355.82	3,900,583.09	6,559,938.91
基金赎回款	-1,332,764.27	-2,139,947.14	-3,472,711.41
本期已分配利润	-	-	-



本期末	22,703,115.22	71,995,489.11	94,698,604.33
-----	---------------	---------------	---------------

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	26,940.41	24,189.20
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	118.49	84.70
结算备付金利息收入	984.47	1,267.10
其他	-	-
合计	28,043.37	25,541.00

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,609,563.95	-15,353,455.60
股票投资收益——赎回差价收入	-4,579,494.91	-9,439,966.57
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-8,189,058.86	-24,793,422.17

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	57,902,651.09	38,842,991.60
减：卖出股票成本总额	61,512,215.04	54,196,447.20
买卖股票差价收入	-3,609,563.95	-15,353,455.60

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
赎回基金份额对价总额	15,472,711.41	64,653,421.11
减：现金支付赎回款总额	81,339.41	2,131,234.11
减：赎回股票成本总额	19,970,866.91	71,962,153.57
赎回差价收入	-4,579,494.91	-9,439,966.57

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,690,916.83	4,724,397.64
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,690,916.83	4,724,397.64

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1.交易性金融资产	78,796,191.01	-87,525,128.10
——股票投资	78,796,191.01	-87,525,128.10
——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	-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	78,797,168.21	-87,526,105.30

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	5,497.79	26,261.77
手续费返还	-	-
其他	-	-
基金转换费收入	-	-
印花税返还	-	-
合计	5,497.79	26,261.77

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时,补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)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(赎回)确认日估值的差额。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	178,053.52	102,867.49
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
合计	178,053.52	102,867.49

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	34,000.00	36,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	2,690.09	1,804.56
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	84,055.29	86,599.81
其他	-	-
合计	300,745.38	484,404.37

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人控股子公司的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理（英国）有限公司)	基金管理人全资子公司的全资子公司

广发纳正（上海）资产管理有限公司	基金管理人全资子公司的全资子公司
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：根据广发基金管理有限公司于 2019 年 11 月 14 日发布的公告，经股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1948 号文核准，广发基金管理有限公司原股东康美药业股份有限公司将其持有的公司 9.458% 股权转让给广发证券股份有限公司，康美药业股份有限公司不再持有广发基金管理有限公司的股权。广发纳正（上海）资产管理有限公司于 2019 年 11 月 28 日经上海市市场监督管理局批准注销登记。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	44,300.00	100.00%	-	-

###### 7.4.10.1.4 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,400,921.88	1,443,328.82
其中：支付销售机构的客户维护费	1,035.78	827.61

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	280,184.32	288,665.82

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	211,408,868.00	96.03%	202,631,244.00	97.35%

##### 7.4.10.6 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12月31日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	2,954,241.40	26,940.41	2,128,277.24	24,189.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2019-07-12	2020-01-22	新股流通受限	29.01	89.16	22,658.00	657,308.58	2,020,187.28	-
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	新股流通受限	4.94	4.66	294,195.00	1,453,323.30	1,370,948.70	-
601077	渝农商行	2019-10-16	2020-04-29	新股流通受限	7.36	6.26	147,778.00	1,087,646.08	925,090.28	-
688196	卓越新能	2019-11-13	2020-05-21	新股流通受限	42.93	38.37	11,131.00	477,853.83	427,096.47	-
688258	卓易信息	2019-11-28	2020-06-09	新股流通受限	26.49	70.05	3,465.00	91,787.85	242,723.25	-
688101	三达膜	2019-11-08	2020-05-15	新股流通受限	18.26	17.89	13,483.00	246,199.58	241,210.87	-
688358	祥生医疗	2019-11-25	2020-06-03	新股流通受限	50.53	48.96	4,541.00	229,456.73	222,327.36	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股流通受限	5.74	5.74	1,146.00	6,578.04	6,578.04	-



7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128090	汽模转2	2019-12-27	2020-01-23	新债流通受限	100.00	100.00	443.00	44,300.00	44,300.00	-

注：截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300269	联建光电	2019-12-30	重大事项停牌	4.96	2020-01-07	5.46	42,000.00	692,369.08	208,320.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人

制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	44,300.00	-
未评级	-	-
合计	44,300.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

#### 7.4.13.3.1 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。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	2,954,241.40	-	-	-	2,954,241.40
结算备付金	20,262.49	-	-	-	20,262.49
存出保证金	15,556.53	-	-	-	15,556.53
交易性金融资产	44,300.00	-	-	312,168,930.90	312,213,230.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	588.94	588.94
资产总计	3,034,360.42	-	-	312,169,519.84	315,203,880.26
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	128,679.61	128,679.61
应付托管费	-	-	-	25,735.92	25,735.92
应付交易费用	-	-	-	18,555.48	18,555.48
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	176,210.87	176,210.87
负债总计	-	-	-	349,181.93	349,181.93
利率敏感度缺口	3,034,360.42	-	-	311,820,337.91	314,854,698.33
上年度末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2019 年 12 月 31 日		2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	312,168,930.90	99.15	223,859,224.39	99.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	44,300.00	0.01	-	-
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	312,213,230.90	99.16	223,859,224.39	99.23

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	16,044,683.41	10,602,955.94
	业绩比较基准下降 5%	-16,044,683.41	-10,602,955.94

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 306,504,448.65 元，属于第二层级的余额为人民币 5,708,782.25 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	312,168,930.90	99.04
	其中：股票	312,168,930.90	99.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,300.00	0.01
	其中：债券	44,300.00	0.01
	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	2,974,503.89	0.94
8	其他各项资产	16,145.47	0.01
9	合计	315,203,880.26	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	216,287,800.74	68.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	65,044.00	0.02
F	批发和零售业	22,514,626.53	7.15
G	交通运输、仓储和邮政业	314,042.40	0.10
H	住宿和餐饮业	2,263,480.61	0.72
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,550,549.09	4.30
J	金融业	2,296,038.98	0.73
K	房地产业	185,730.93	0.06
L	租赁和商务服务业	23,035,725.24	7.32
M	科学研究和技术服务业	245,083.30	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,779,410.96	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,766,700.56	0.88
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	26,814,685.36	8.52
S	综合	50,012.20	0.02
	合计	312,168,930.90	99.15

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------



1	000651	格力电器	508,288	33,333,527.04	10.59
2	000333	美的集团	556,752	32,430,804.00	10.30
3	601888	中国国旅	111,950	9,957,952.50	3.16
4	600104	上汽集团	401,834	9,583,740.90	3.04
5	600690	海尔智家	419,446	8,179,197.00	2.60
6	002027	分众传媒	1,178,096	7,374,880.96	2.34
7	000100	TCL 集团	1,238,155	5,534,552.85	1.76
8	002594	比亚迪	104,019	4,958,585.73	1.57
9	600741	华域汽车	180,312	4,686,308.88	1.49
10	002024	苏宁易购	436,443	4,412,438.73	1.40
11	600660	福耀玻璃	160,240	3,844,157.60	1.22
12	600177	雅戈尔	400,951	2,794,628.47	0.89
13	300144	宋城演艺	83,165	2,570,630.15	0.82
14	002602	世纪华通	205,048	2,343,698.64	0.74
15	000625	长安汽车	222,801	2,234,694.03	0.71
16	300413	芒果超媒	63,832	2,231,566.72	0.71
17	600637	东方明珠	236,347	2,212,207.92	0.70
18	600066	宇通客车	152,027	2,166,384.75	0.69
19	688012	中微公司	22,658	2,020,187.28	0.64
20	002508	老板电器	54,375	1,838,418.75	0.58
21	002739	万达电影	97,800	1,775,070.00	0.56
22	603833	欧派家居	14,505	1,697,085.00	0.54
23	600699	均胜电子	91,640	1,640,356.00	0.52
24	002131	利欧股份	547,826	1,627,043.22	0.52
25	002572	索菲亚	74,182	1,554,112.90	0.49
26	601799	星宇股份	16,100	1,529,178.00	0.49
27	002032	苏泊尔	19,000	1,458,820.00	0.46
28	002607	中公教育	79,882	1,428,290.16	0.45
29	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.44
30	600977	中国电影	85,600	1,302,832.00	0.41
31	000581	威孚高科	67,186	1,279,893.30	0.41
32	601966	玲珑轮胎	55,100	1,263,443.00	0.40
33	600297	广汇汽车	385,501	1,256,733.26	0.40
34	601238	广汽集团	106,221	1,241,723.49	0.39
35	600839	四川长虹	421,634	1,226,954.94	0.39
36	300251	光线传媒	103,617	1,222,680.60	0.39
37	601633	长城汽车	137,891	1,220,335.35	0.39
38	600398	海澜之家	158,404	1,216,542.72	0.39
39	600258	首旅酒店	56,168	1,157,622.48	0.37
40	600959	江苏有线	290,261	1,155,238.78	0.37
41	600166	福田汽车	549,600	1,148,664.00	0.36
42	002035	华帝股份	83,080	1,114,933.60	0.35
43	300058	蓝色光标	197,166	1,113,987.90	0.35
44	000839	中信国安	313,550	1,109,967.00	0.35

45	600373	中文传媒	80,898	1,101,021.78	0.35
46	002085	万丰奥威	150,056	1,050,392.00	0.33
47	600655	豫园股份	133,000	1,042,720.00	0.33
48	300027	华谊兄弟	224,440	1,039,157.20	0.33
49	600037	歌华有线	114,801	1,034,357.01	0.33
50	600060	海信视像	92,579	1,004,482.15	0.32
51	601058	赛轮轮胎	222,705	995,491.35	0.32
52	601098	中南传媒	82,400	983,856.00	0.31
53	603816	顾家家居	21,280	973,134.40	0.31
54	000800	一汽轿车	95,849	955,614.53	0.30
55	002563	森马服饰	95,400	941,598.00	0.30
56	300133	华策影视	125,242	926,790.80	0.29
57	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.29
58	002242	九阳股份	36,155	909,659.80	0.29
59	000917	电广传媒	133,500	899,790.00	0.29
60	000559	万向钱潮	162,069	870,310.53	0.28
61	601689	拓普集团	49,638	865,190.34	0.27
62	600729	重庆百货	28,826	860,456.10	0.27
63	600138	中青旅	68,173	858,979.80	0.27
64	601718	际华集团	251,700	820,542.00	0.26
65	600754	锦江酒店	28,403	815,450.13	0.26
66	002048	宁波华翔	51,645	798,431.70	0.25
67	002292	奥飞娱乐	79,900	793,407.00	0.25
68	002042	华孚时尚	107,313	787,677.42	0.25
69	600418	江淮汽车	156,151	783,878.02	0.25
70	000158	常山北明	114,590	781,503.80	0.25
71	000887	中鼎股份	86,200	780,110.00	0.25
72	002126	银轮股份	94,406	763,744.54	0.24
73	002429	兆驰股份	213,102	741,594.96	0.24
74	300182	捷成股份	212,100	740,229.00	0.24
75	002925	盈趣科技	16,400	720,780.00	0.23
76	000681	视觉中国	41,800	720,632.00	0.23
77	002640	跨境通	91,950	709,854.00	0.23
78	000156	华数传媒	67,540	705,117.60	0.22
79	600733	北汽蓝谷	119,900	700,216.00	0.22
80	300616	尚品宅配	9,340	696,016.80	0.22
81	600612	老凤祥	14,616	695,867.76	0.22
82	601928	凤凰传媒	89,900	684,139.00	0.22
83	000921	海信家电	53,251	656,584.83	0.21
84	002426	胜利精密	277,750	655,490.00	0.21
85	600682	南京新百	64,353	650,608.83	0.21
86	600337	美克家居	146,100	647,223.00	0.21
87	600859	王府井	45,712	639,510.88	0.20
88	000793	华闻集团	188,100	633,897.00	0.20

89	002351	漫步者	28,134	633,015.00	0.20
90	002705	新宝股份	38,000	626,620.00	0.20
91	600986	科达股份	125,040	620,198.40	0.20
92	000810	创维数字	50,600	606,694.00	0.19
93	000501	鄂武商 A	45,220	600,521.60	0.19
94	002434	万里扬	63,088	598,074.24	0.19
95	300770	新媒股份	4,600	598,000.00	0.19
96	002419	天虹股份	56,600	597,130.00	0.19
97	002488	金固股份	83,351	594,292.63	0.19
98	002920	德赛西威	19,500	591,435.00	0.19
99	002512	达华智能	90,201	581,796.45	0.18
100	600742	一汽富维	47,813	578,059.17	0.18
101	000016	深康佳 A	131,512	574,707.44	0.18
102	002798	帝欧家居	22,689	568,359.45	0.18
103	000901	航天科技	50,600	566,720.00	0.18
104	002400	省广集团	166,567	549,671.10	0.17
105	603596	伯特利	24,400	549,000.00	0.17
106	601929	吉视传媒	256,390	546,110.70	0.17
107	002681	奋达科技	97,165	542,180.70	0.17
108	002343	慈文传媒	44,760	542,043.60	0.17
109	600831	广电网络	58,400	540,784.00	0.17
110	002489	浙江永强	128,052	536,537.88	0.17
111	600936	广西广电	137,700	528,768.00	0.17
112	002537	海联金汇	73,500	515,970.00	0.16
113	601019	山东出版	73,800	512,910.00	0.16
114	000564	供销大集	212,400	507,636.00	0.16
115	603377	东方时尚	27,740	506,532.40	0.16
116	603515	欧普照明	17,920	503,731.20	0.16
117	002867	周大生	25,850	492,184.00	0.16
118	600261	阳光照明	102,611	487,402.25	0.15
119	000726	鲁泰 A	52,978	484,748.70	0.15
120	601311	骆驼股份	50,900	477,442.00	0.15
121	000802	北京文化	51,276	476,354.04	0.15
122	002832	比音勒芬	18,215	473,043.55	0.15
123	600694	大商股份	17,264	472,860.96	0.15
124	001696	宗申动力	81,000	471,420.00	0.15
125	002045	国光电器	38,653	471,180.07	0.15
126	601010	文峰股份	152,300	466,038.00	0.15
127	002083	孚日股份	74,800	465,256.00	0.15
128	600593	大连圣亚	10,700	465,022.00	0.15
129	002625	光启技术	50,760	464,454.00	0.15
130	002251	步步高	50,840	462,644.00	0.15
131	000829	天音控股	73,300	459,591.00	0.15
132	300526	中潜股份	8,200	459,200.00	0.15

133	002605	姚记科技	23,507	457,211.15	0.15
134	603766	隆鑫通用	120,858	450,800.34	0.14
135	600757	长江传媒	71,471	440,261.36	0.14
136	600623	华谊集团	65,800	437,570.00	0.14
137	002503	搜于特	182,014	435,013.46	0.14
138	600712	南宁百货	44,900	434,632.00	0.14
139	601163	三角轮胎	28,300	432,990.00	0.14
140	002668	奥马电器	76,607	432,829.55	0.14
141	600006	东风汽车	94,300	431,894.00	0.14
142	000996	中国中期	40,713	431,557.80	0.14
143	600628	新世界	45,655	430,070.10	0.14
144	688196	卓越新能	11,131	427,096.47	0.14
145	000980	众泰汽车	143,210	419,605.30	0.13
146	000955	欣龙控股	50,700	415,740.00	0.13
147	600978	宜华生活	139,644	414,742.68	0.13
148	601949	中国出版	65,000	411,450.00	0.13
149	002031	巨轮智能	207,100	410,058.00	0.13
150	002677	浙江美大	30,500	407,480.00	0.13
151	002510	天汽模	86,708	404,926.36	0.13
152	600987	航民股份	63,639	402,834.87	0.13
153	600400	红豆股份	119,280	400,780.80	0.13
154	000030	富奥股份	82,999	395,075.24	0.13
155	002707	众信旅游	63,042	393,382.08	0.12
156	000801	四川九洲	72,340	390,636.00	0.12
157	000927	一汽夏利	75,100	388,267.00	0.12
158	601801	皖新传媒	70,489	386,279.72	0.12
159	002664	长鹰信质	23,572	385,166.48	0.12
160	002277	友阿股份	114,912	380,358.72	0.12
161	601127	小康股份	33,300	379,620.00	0.12
162	601965	中国汽研	45,705	378,437.40	0.12
163	603197	保隆科技	11,880	374,576.40	0.12
164	600653	中华控股	183,317	373,966.68	0.12
165	600146	商赢环球	27,700	373,950.00	0.12
166	000541	佛山照明	76,116	372,968.40	0.12
167	000957	中通客车	55,910	372,919.70	0.12
168	000599	青岛双星	78,683	372,170.59	0.12
169	002154	报喜鸟	114,745	369,478.90	0.12
170	603008	喜临门	23,296	360,389.12	0.11
171	600070	浙江富润	36,830	355,409.50	0.11
172	002293	罗莱生活	39,100	355,028.00	0.11
173	600707	彩虹股份	84,502	354,908.40	0.11
174	600136	当代明诚	28,800	354,240.00	0.11
175	603096	新经典	6,400	353,920.00	0.11
176	000913	钱江摩托	32,100	353,421.00	0.11

177	600825	新华传媒	61,600	352,968.00	0.11
178	002327	富安娜	50,700	351,858.00	0.11
179	600083	博信股份	16,500	351,450.00	0.11
180	002654	万润科技	63,800	350,900.00	0.11
181	002614	奥佳华	33,087	350,060.46	0.11
182	300788	中信出版	6,800	346,800.00	0.11
183	000796	凯撒旅业	38,000	346,180.00	0.11
184	002283	天润曲轴	93,000	342,240.00	0.11
185	002721	金一文化	59,854	341,167.80	0.11
186	300783	三只松鼠	5,300	341,161.00	0.11
187	000589	贵州轮胎	73,100	340,646.00	0.11
188	603129	春风动力	8,000	338,400.00	0.11
189	000550	江铃汽车	24,400	336,720.00	0.11
190	600220	江苏阳光	147,100	335,388.00	0.11
191	600448	华纺股份	61,800	334,338.00	0.11
192	002416	爱施德	43,782	333,181.02	0.11
193	300755	华致酒行	14,660	332,195.60	0.11
194	002003	伟星股份	54,280	332,193.60	0.11
195	002239	奥特佳	184,299	328,052.22	0.10
196	300176	派生科技	36,494	326,986.24	0.10
197	600523	贵航股份	23,865	326,950.50	0.10
198	603305	旭升股份	9,500	322,525.00	0.10
199	002540	亚太科技	74,800	318,648.00	0.10
200	603313	梦百合	15,050	317,705.50	0.10
201	000417	合肥百货	64,292	316,959.56	0.10
202	600676	交运股份	72,695	314,042.40	0.10
203	002029	七匹狼	53,400	312,390.00	0.10
204	600088	中视传媒	23,465	312,319.15	0.10
205	002575	群兴玩具	44,300	311,429.00	0.10
206	600715	文投控股	87,378	310,191.90	0.10
207	002621	美吉姆	28,200	308,790.00	0.10
208	002181	粤传媒	54,700	307,414.00	0.10
209	601858	中国科传	28,000	306,880.00	0.10
210	002448	中原内配	57,250	306,860.00	0.10
211	603486	科沃斯	15,080	305,973.20	0.10
212	600609	金杯汽车	77,175	305,613.00	0.10
213	000665	湖北广电	56,207	300,707.45	0.10
214	600480	凌云股份	38,980	299,366.40	0.10
215	600824	益民集团	86,900	298,936.00	0.09
216	002355	兴民智通	44,213	298,879.88	0.09
217	600335	国机汽车	51,470	298,526.00	0.09
218	601900	南方传媒	32,100	297,246.00	0.09
219	600996	贵广网络	36,800	296,240.00	0.09
220	600229	城市传媒	41,302	293,244.20	0.09

221	002699	美盛文化	42,893	289,527.75	0.09
222	600122	宏图高科	109,137	289,213.05	0.09
223	000892	欢瑞世纪	57,700	289,077.00	0.09
224	300291	华录百纳	47,835	288,923.40	0.09
225	002616	长青集团	35,000	286,300.00	0.09
226	002362	汉王科技	17,902	286,073.96	0.09
227	601366	利群股份	50,700	285,441.00	0.09
228	000888	峨眉山 A	43,502	285,373.12	0.09
229	000026	飞亚达 A	25,525	283,072.25	0.09
230	600933	爱柯迪	20,300	282,982.00	0.09
231	000025	特力 A	13,185	279,522.00	0.09
232	601599	鹿港文化	84,096	279,198.72	0.09
233	002406	远东传动	46,200	277,662.00	0.09
234	002592	八菱科技	20,102	277,005.56	0.09
235	600054	黄山旅游	30,200	276,934.00	0.09
236	600693	东百集团	52,900	276,667.00	0.09
237	002087	新野纺织	76,991	274,857.87	0.09
238	300148	天舟文化	69,734	274,751.96	0.09
239	300577	开润股份	7,800	274,560.00	0.09
240	600730	中国高科	55,300	274,288.00	0.09
241	002472	双环传动	48,552	271,891.20	0.09
242	300336	新文化	66,442	271,747.78	0.09
243	300304	云意电气	61,430	270,292.00	0.09
244	000850	华茂股份	66,700	269,468.00	0.09
245	600630	龙头股份	35,089	266,325.51	0.08
246	002284	亚太股份	52,135	264,845.80	0.08
247	603558	健盛集团	24,500	263,375.00	0.08
248	000719	中原传媒	36,700	262,772.00	0.08
249	603035	常熟汽饰	19,900	258,700.00	0.08
250	002486	嘉麟杰	78,400	256,368.00	0.08
251	300432	富临精工	20,500	253,995.00	0.08
252	002543	万和电气	26,293	251,624.01	0.08
253	600686	金龙汽车	35,810	251,386.20	0.08
254	603385	惠达卫浴	21,740	250,227.40	0.08
255	002328	新朋股份	62,773	249,836.54	0.08
256	000521	长虹美菱	72,701	249,364.43	0.08
257	000526	紫光学大	8,000	248,800.00	0.08
258	600336	澳柯玛	56,500	248,035.00	0.08
259	601811	新华文轩	18,700	246,653.00	0.08
260	603801	志邦家居	10,560	245,942.40	0.08
261	002776	柏堡龙	31,829	245,083.30	0.08
262	603650	彤程新材	14,000	243,880.00	0.08
263	002033	丽江旅游	38,862	242,887.50	0.08
264	688258	卓易信息	3,465	242,723.25	0.08

265	300342	天银机电	25,406	241,865.12	0.08
266	688101	三达膜	13,483	241,210.87	0.08
267	600838	上海九百	37,800	241,164.00	0.08
268	603587	地素时尚	9,500	241,110.00	0.08
269	300343	联创股份	83,513	239,682.31	0.08
270	601777	力帆股份	77,489	238,666.12	0.08
271	603898	好莱客	14,600	238,564.00	0.08
272	000673	当代东方	46,600	237,660.00	0.08
273	000607	华媒控股	48,000	237,120.00	0.08
274	002516	旷达科技	87,800	236,182.00	0.08
275	002084	海鸥住工	36,300	235,587.00	0.07
276	601566	九牧王	20,394	233,307.36	0.07
277	603808	歌力思	15,595	231,897.65	0.07
278	600107	美尔雅	33,900	230,859.00	0.07
279	002712	思美传媒	27,430	230,137.70	0.07
280	000700	模塑科技	58,400	229,512.00	0.07
281	600071	凤凰光学	20,000	229,200.00	0.07
282	000587	金洲慈航	125,062	227,612.84	0.07
283	002780	三夫户外	12,200	225,578.00	0.07
284	002502	鼎龙文化	70,880	225,398.40	0.07
285	603355	莱克电气	9,500	224,865.00	0.07
286	002101	广东鸿图	31,411	224,274.54	0.07
287	600303	曙光股份	63,679	224,150.08	0.07
288	002708	光洋股份	27,620	223,998.20	0.07
289	603788	宁波高发	13,540	223,951.60	0.07
290	002397	梦洁股份	45,600	223,440.00	0.07
291	688358	祥生医疗	4,541	222,327.36	0.07
292	300279	和晶科技	37,020	222,120.00	0.07
293	000038	深大通	18,540	219,699.00	0.07
294	300217	东方电热	89,905	218,469.15	0.07
295	603598	引力传媒	12,800	217,472.00	0.07
296	002454	松芝股份	44,463	216,534.81	0.07
297	300178	腾邦国际	43,645	216,479.20	0.07
298	603366	日出东方	37,800	216,216.00	0.07
299	300625	三雄极光	13,200	215,424.00	0.07
300	002345	潮宏基	53,300	214,799.00	0.07
301	603868	飞科电器	5,700	214,776.00	0.07
302	002348	高乐股份	66,904	214,761.84	0.07
303	603586	金麒麟	12,000	214,680.00	0.07
304	600960	渤海汽车	67,200	214,368.00	0.07
305	300473	德尔股份	4,900	212,905.00	0.07
306	601339	百隆东方	53,100	211,869.00	0.07
307	603825	华扬联众	10,900	210,915.00	0.07
308	000753	漳州发展	70,200	209,898.00	0.07

309	600135	乐凯胶片	29,338	208,593.18	0.07
310	603579	荣泰健康	6,700	208,370.00	0.07
311	300269	联建光电	42,000	208,320.00	0.07
312	603179	新泉股份	10,820	203,740.60	0.06
313	603730	岱美股份	6,700	202,407.00	0.06
314	603999	读者传媒	27,300	200,382.00	0.06
315	600358	国旅联合	47,601	199,924.20	0.06
316	600469	风神股份	40,300	198,276.00	0.06
317	600551	时代出版	23,865	195,693.00	0.06
318	002590	万安科技	28,301	195,276.90	0.06
319	002722	金轮股份	12,400	194,060.00	0.06
320	603608	天创时尚	20,440	193,975.60	0.06
321	603365	水星家纺	12,600	193,032.00	0.06
322	603348	文灿股份	7,900	192,286.00	0.06
323	002634	棒杰股份	27,300	192,192.00	0.06
324	000757	浩物股份	41,577	191,669.97	0.06
325	601595	上海电影	13,200	191,532.00	0.06
326	300464	星徽精密	12,700	190,373.00	0.06
327	000678	襄阳轴承	27,400	190,156.00	0.06
328	603208	江山欧派	3,700	188,552.00	0.06
329	603839	安正时尚	14,360	188,116.00	0.06
330	600280	中央商场	67,638	188,033.64	0.06
331	300247	融捷健康	66,309	187,654.47	0.06
332	002662	京威股份	70,704	186,658.56	0.06
333	002494	华斯股份	31,850	186,641.00	0.06
334	603519	立霸股份	13,300	186,333.00	0.06
335	600555	海航创新	80,403	185,730.93	0.06
336	002878	元隆雅图	6,220	184,423.00	0.06
337	002612	朗姿股份	18,902	183,727.44	0.06
338	600738	兰州民百	36,900	182,286.00	0.06
339	300375	鹏翎股份	51,700	181,984.00	0.06
340	300242	佳云科技	44,800	180,992.00	0.06
341	002761	多喜爱	16,556	180,625.96	0.06
342	002687	乔治白	29,300	180,195.00	0.06
343	002363	隆基机械	29,400	179,634.00	0.06
344	000785	居然之家	18,000	179,280.00	0.06
345	603303	得邦照明	17,240	177,744.40	0.06
346	600386	北巴传媒	47,554	176,900.88	0.06
347	002536	飞龙股份	35,421	176,750.79	0.06
348	002485	希努尔	25,600	176,384.00	0.06
349	600081	东风科技	14,800	171,236.00	0.05
350	300707	威唐工业	9,300	171,120.00	0.05
351	002238	天威视讯	21,800	170,694.00	0.05
352	000721	西安饮食	41,200	170,568.00	0.05



353	603103	横店影视	8,980	168,913.80	0.05
354	603121	华培动力	7,700	168,399.00	0.05
355	600818	中路股份	14,064	167,642.88	0.05
356	600232	金鹰股份	26,100	167,562.00	0.05
357	300272	开能健康	34,215	166,969.20	0.05
358	002656	摩登大道	41,980	164,981.40	0.05
359	600139	西部资源	46,800	164,268.00	0.05
360	603358	华达科技	11,100	164,169.00	0.05
361	300651	金陵体育	5,990	164,006.20	0.05
362	002593	日上集团	41,900	162,572.00	0.05
363	603158	腾龙股份	10,400	160,576.00	0.05
364	603180	金牌厨柜	2,400	160,272.00	0.05
365	002574	明牌珠宝	31,162	159,237.82	0.05
366	002674	兴业科技	14,300	158,158.00	0.05
367	002103	广博股份	32,200	157,780.00	0.05
368	002905	金逸影视	9,500	157,130.00	0.05
369	300160	秀强股份	41,891	157,091.25	0.05
370	601999	出版传媒	26,300	156,748.00	0.05
371	603701	德宏股份	12,200	156,160.00	0.05
372	300061	康旗股份	24,300	155,034.00	0.05
373	603081	大丰实业	9,500	154,945.00	0.05
374	603661	恒林股份	3,500	153,790.00	0.05
375	300507	苏奥传感	10,520	150,541.20	0.05
376	603997	继峰股份	18,300	147,864.00	0.05
377	603214	爱婴室	3,500	147,350.00	0.05
378	002098	浔兴股份	21,100	147,067.00	0.05
379	002725	跃岭股份	15,100	146,621.00	0.05
380	300660	江苏雷利	9,136	146,450.08	0.05
381	300403	汉宇集团	28,490	145,868.80	0.05
382	300695	兆丰股份	2,400	143,784.00	0.05
383	000622	恒立实业	30,100	143,577.00	0.05
384	603239	浙江仙通	12,800	143,488.00	0.05
385	603398	邦宝益智	14,100	143,256.00	0.05
386	002159	三特索道	11,500	141,565.00	0.04
387	002193	如意集团	18,000	141,480.00	0.04
388	002403	爱仕达	16,600	141,100.00	0.04
389	002731	萃华珠宝	18,170	140,817.50	0.04
390	603557	起步股份	16,900	139,763.00	0.04
391	002853	皮阿诺	7,400	135,124.00	0.04
392	603982	泉峰汽车	7,200	134,856.00	0.04
393	600828	茂业商业	28,684	134,814.80	0.04
394	600679	上海凤凰	10,900	134,506.00	0.04
395	002740	爱迪尔	21,401	134,398.28	0.04
396	002676	顺威股份	42,400	133,136.00	0.04

397	002906	华阳集团	11,200	133,056.00	0.04
398	002553	南方轴承	24,600	132,840.00	0.04
399	002265	西仪股份	15,100	132,427.00	0.04
400	600178	东安动力	27,300	131,040.00	0.04
401	603555	贵人鸟	22,200	130,980.00	0.04
402	300100	双林股份	21,800	130,364.00	0.04
403	002759	天际股份	14,200	129,220.00	0.04
404	600749	西藏旅游	13,600	128,928.00	0.04
405	002071	长城影视	37,100	127,995.00	0.04
406	603040	新坐标	3,650	127,093.00	0.04
407	002790	瑞尔特	19,360	125,259.20	0.04
408	603099	长白山	12,600	125,244.00	0.04
409	300428	四通新材	8,900	125,134.00	0.04
410	300426	唐德影视	20,100	125,022.00	0.04
411	002703	浙江世宝	27,100	124,660.00	0.04
412	603326	我乐家居	8,100	124,335.00	0.04
413	002953	日丰股份	6,200	124,124.00	0.04
414	603055	台华新材	18,060	123,349.80	0.04
415	601086	国芳集团	23,600	120,360.00	0.04
416	000524	岭南控股	16,000	119,840.00	0.04
417	300528	幸福蓝海	17,600	119,328.00	0.04
418	603268	松发股份	7,400	118,326.00	0.04
419	603809	豪能股份	12,280	117,151.20	0.04
420	002765	蓝黛传动	22,700	116,451.00	0.04
421	000663	永安林业	23,900	114,720.00	0.04
422	603900	莱绅通灵	12,040	113,778.00	0.04
423	002858	力盛赛车	7,500	112,875.00	0.04
424	603013	亚普股份	7,300	112,128.00	0.04
425	600148	长春一东	8,400	112,056.00	0.04
426	603615	茶花股份	11,600	109,504.00	0.03
427	300694	蠡湖股份	7,700	108,493.00	0.03
428	002615	哈尔斯	19,600	108,388.00	0.03
429	603101	汇嘉时代	12,000	107,400.00	0.03
430	603136	天目湖	4,015	106,879.30	0.03
431	300580	贝斯特	7,100	106,642.00	0.03
432	603009	北特科技	17,050	105,880.50	0.03
433	603877	太平鸟	6,900	105,363.00	0.03
434	300742	越博动力	4,700	103,917.00	0.03
435	603787	新日股份	7,300	100,959.00	0.03
436	603006	联明股份	9,100	100,100.00	0.03
437	002863	今飞凯达	17,720	98,877.60	0.03
438	300547	川环科技	10,320	98,762.40	0.03
439	603335	迪生力	20,290	98,406.50	0.03
440	300781	因赛集团	3,000	97,440.00	0.03

441	002888	惠威科技	4,400	95,656.00	0.03
442	300612	宣亚国际	5,600	95,592.00	0.03
443	603629	利通电子	3,400	94,078.00	0.03
444	300681	英搏尔	2,700	92,205.00	0.03
445	002865	钧达股份	5,800	91,640.00	0.03
446	300749	顶固集创	7,300	91,250.00	0.03
447	300745	欣锐科技	4,000	91,200.00	0.03
448	000715	中兴商业	14,890	90,680.10	0.03
449	300756	中山金马	2,600	90,636.00	0.03
450	300733	西菱动力	7,600	88,160.00	0.03
451	603196	日播时尚	8,600	87,806.00	0.03
452	603677	奇精机械	6,940	86,680.60	0.03
453	603848	好太太	6,000	83,220.00	0.03
454	603266	天龙股份	7,100	81,721.00	0.03
455	603657	春光科技	3,300	81,312.00	0.03
456	603767	中马传动	10,620	78,906.60	0.03
457	603089	正裕工业	5,500	78,595.00	0.02
458	603726	朗迪集团	6,600	77,220.00	0.02
459	603709	中源家居	2,900	73,080.00	0.02
460	603238	诺邦股份	4,200	72,954.00	0.02
461	002875	安奈儿	4,600	72,174.00	0.02
462	603922	金鸿顺	4,500	69,300.00	0.02
463	603157	拉夏贝尔	11,800	67,260.00	0.02
464	002830	名雕股份	4,600	65,044.00	0.02
465	300716	国立科技	5,700	59,166.00	0.02
466	603389	亚振家居	9,280	54,195.20	0.02
467	601512	中新集团	3,598	50,012.20	0.02
468	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	3,993,948.75	1.77
2	601916	浙商银行	2,076,173.32	0.92
3	002027	分众传媒	2,051,722.00	0.91
4	002739	万达电影	1,909,073.00	0.85
5	601077	渝农商行	1,553,776.96	0.69
6	000651	格力电器	1,434,067.00	0.64

7	002602	世纪华通	1,359,545.00	0.60
8	300413	芒果超媒	882,984.00	0.39
9	600733	北汽蓝谷	882,230.00	0.39
10	000887	中鼎股份	844,700.00	0.37
11	688006	杭可科技	765,708.45	0.34
12	688008	澜起科技	747,645.60	0.33
13	600936	广西广电	686,003.00	0.30
14	688111	金山办公	672,261.74	0.30
15	688012	中微公司	657,308.58	0.29
16	688099	晶晨股份	600,484.50	0.27
17	601888	中国国旅	583,908.00	0.26
18	300770	新媒股份	579,575.07	0.26
19	600104	上汽集团	569,050.00	0.25
20	601010	文峰股份	565,086.00	0.25

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	4,172,085.00	1.85
2	688008	澜起科技	2,358,104.80	1.05
3	000333	美的集团	2,326,957.68	1.03
4	688099	晶晨股份	2,212,997.32	0.98
5	688111	金山办公	2,096,383.59	0.93
6	688188	柏楚电子	1,883,873.73	0.84
7	688006	杭可科技	1,544,614.44	0.68
8	000418	小天鹅 A	1,430,445.75	0.63
9	688321	微芯生物	1,296,265.53	0.57
10	601258	ST 庞大	975,817.00	0.43
11	688005	容百科技	763,959.50	0.34
12	688116	天奈科技	725,424.00	0.32
13	600633	浙数文化	699,510.00	0.31
14	601916	浙商银行	655,912.79	0.29

15	601077	渝农商行	614,299.80	0.27
16	600104	上汽集团	581,458.00	0.26
17	601888	中国国旅	535,206.00	0.24
18	600398	海澜之家	512,438.45	0.23
19	300413	芒果超媒	487,382.00	0.22
20	688333	铂力特	482,014.50	0.21

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	63,793,815.11
卖出股票收入（成交）总额	57,902,651.09

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,300.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,300.00	0.01

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	128090	汽模转 2	443	44,300.00	0.01

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

#### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 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。

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

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,556.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	588.94
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,145.47

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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
841	261,778.9 5	211,985,29 6.00	96.29%	8,170,798.0 0	3.71%	211,408,86 8.00	96.03%

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。

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈建锋	750,900.00	0.34%

2	钱中明	689,900.00	0.31%
3	杭州钱江新城金融投资有限公司	499,400.00	0.23%
4	涂慧芬	460,000.00	0.21%
5	朱益	384,200.00	0.17%
6	高洁	149,600.00	0.07%
7	王浩	144,519.00	0.07%
8	张虎	111,500.00	0.05%
9	朱晓晔	107,000.00	0.05%
10	苑桂花	100,006.00	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	211,408,868.00	96.03%

### 9.3 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%

### 9.4 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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年6月3日)基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	208,156,094.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	220,156,094.00



## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。2019 年 6 月，刘连舸先生任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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	2,127,561.00	2.03%	1,555.85	2.03%	-
招商证券	2	20,966,605.37	19.98%	15,332.93	20.02%	-
安信证券	1	29,786,627.30	28.39%	21,784.59	28.45%	-
银河证券	2	52,033,363.13	49.60%	37,897.90	49.49%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

财达证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	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。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

联讯证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	44,300.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加平安证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-11-04
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-23
3	关于增加广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-21
4	关于广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金开通场内申购赎回业务并修改基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-16
5	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
6	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

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20190101-20191231	202,631,244.00	24,000,000.00	15,222,376.00	211,408,868.00	96.03%
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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者需求，根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的业务方案，广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，决定于 2019 年 10 月 21 日起对本基金新增场内申购赎回业务，保留原有场外实物申赎模式，并对本基金的基金合同作相应修改。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金开通场内申购赎回业务并修改基金合同的公告》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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  
二〇二〇年三月二十七日