

# 广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资 基金

2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月二十七日

## 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。本中期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 8 月 25 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<b>7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
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	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48

<b>8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	50
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	50
10.1	基金份额持有人大会决议.....	50
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4	基金投资策略的改变.....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	52
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	53
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	53
12.1	备查文件目录.....	53
12.2	存放地点.....	54
12.3	查阅方式.....	54

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指原材料 ETF
场内简称	材料 ETF
基金主代码	159944
交易代码	159944
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 25 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	27,608,342.00 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	2015 年 7 月 6 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原材料指数。
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	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	ccl@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	上海证券报
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	-1,036,732.59
本期利润	25,650.36
加权平均基金份额本期利润	0.0009
本期加权平均净值利润率	0.12%
本期基金份额净值增长率	-0.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-8,306,318.83
期末可供分配基金份额利润	-0.3009
期末基金资产净值	21,072,881.12
期末基金份额净值	0.7633
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-23.67%

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）。

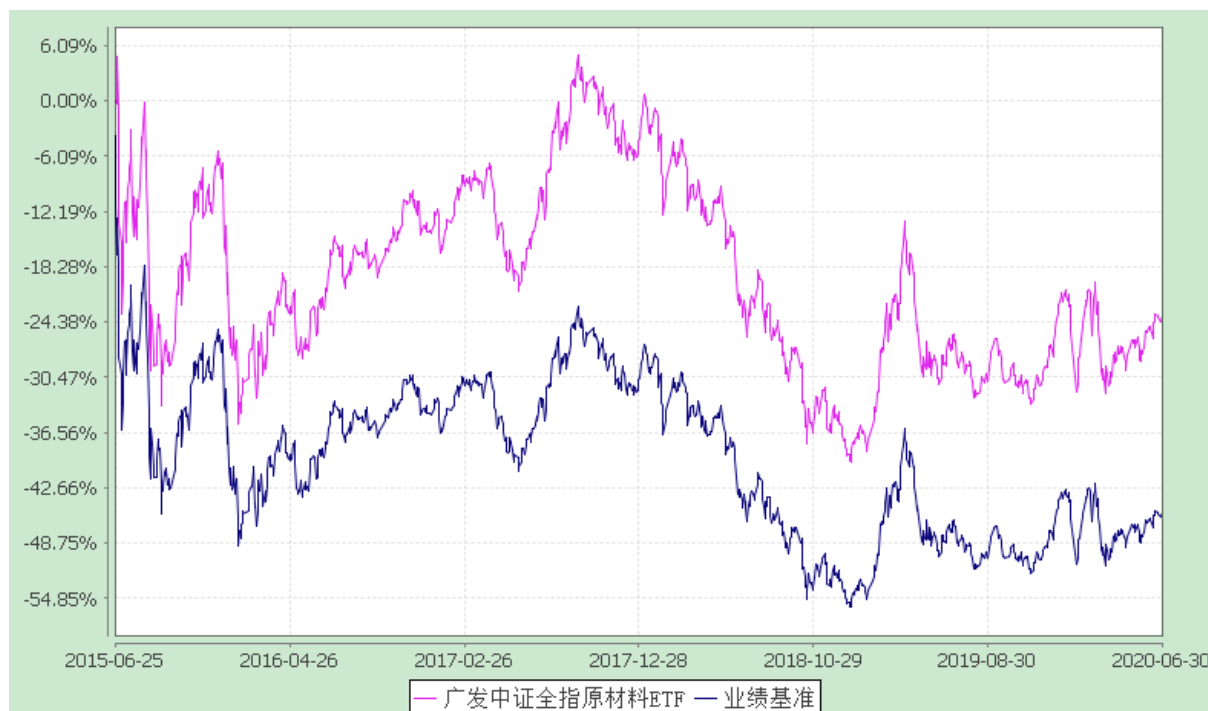
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.81%	0.85%	4.21%	0.86%	0.60%	-0.01%
过去三个月	10.53%	1.02%	9.56%	1.03%	0.97%	-0.01%
过去六个月	-0.13%	1.69%	-0.98%	1.71%	0.85%	-0.02%
过去一年	5.17%	1.36%	4.11%	1.38%	1.06%	-0.02%
过去三年	-11.67%	1.44%	-15.21%	1.47%	3.54%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-23.67%	1.77%	-45.39%	1.80%	21.72%	-0.03%

#### 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

广发中证全指原材料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  
 （2015年6月25日至2020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 2020 年 6 月 30 日，公司管理 225 只开放式基金，管理公募基金规模为 6394.81 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；广发中证全指可选消费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	2015-06-25	-	21 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)。

	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				
--	---	--	--	--	--

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

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

在投资决策的内部控制方面，公司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。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 3 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跟踪指数，即按照标的指数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。

2020 年上半年，疫情在全球蔓延，全球经济受到严重打击，中国在疫情防控方面较为成功，经济也从疫情中快速复苏。上半年国内生产总值同比下降 1.6%，分季度看，一季度同比下降 6.8%，二季度增长 3.2%。上证指数下跌 2.15%，深证成指上涨 14.97%，中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.60%，中证全指原材料指数下跌 0.98%。

#### 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-0.13%，同期业绩比较基准收益率为-0.98%。

#### 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，中国疫情防控形势持续向好，复工、复产、复商、复市加快推进，主要的经济指标恢复增长，经济运行稳步复苏，市场预期总体向好，社会发展大局稳定。从供给端及需求端来看，受全球疫情影响，材料供给与需求均有所减少。在全球主要国家出台提高新能源车比例政策的大背景下，新能源汽车的生产预计将呈现爆发增长态势，使得镍、钴、锂等稀有金属、有色金属的需求大增。

#### 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 6 月 30 日出现了基金资产净值低于五千万的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

### 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”）在广发中证全指原材料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 托管人对本中期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：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	240,986.02	375,792.07
结算备付金		16,595.45	-
存出保证金		1,097.81	300.45
交易性金融资产	6.4.7.2	20,859,450.11	22,293,065.13
其中：股票投资		20,851,850.11	22,293,065.13
基金投资		-	-
债券投资		7,600.00	-
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		763,131.26	-
应收利息	6.4.7.5	34.70	76.26
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		21,881,295.35	22,669,233.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		12,943.47	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,152.56	9,011.51
应付托管费		1,830.52	1,802.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,330.74	1,735.78
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	777,156.94	27,500.00
负债合计		808,414.23	40,049.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	27,608,342.00	29,608,342.00
未分配利润	6.4.7.10	-6,535,460.88	-6,979,157.70
所有者权益合计		21,072,881.12	22,629,184.30

负债和所有者权益总计		21,881,295.35	22,669,233.91
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7633 元，基金份额总额 27,608,342.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>120,278.20</b>	<b>2,927,493.26</b>
1.利息收入		1,244.93	1,509.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,233.17	1,509.46
债券利息收入		11.76	-
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）		-954,385.90	-1,328,708.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,231,083.77	-1,662,915.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,709.96	-
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	270,987.91	334,207.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,062,382.95	4,278,364.03
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	11,036.22	-23,672.00
<b>减：二、费用</b>		<b>94,627.84</b>	<b>127,999.96</b>
1. 管理人报酬		54,967.94	54,893.78
2. 托管费		10,993.56	10,978.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	16,061.87	3,380.70
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	12,604.47	58,746.73

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,650.36	2,799,493.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,650.36	2,799,493.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	29,608,342.00	-6,979,157.70	22,629,184.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,650.36	25,650.36
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）	-2,000,000.00	418,046.46	-1,581,953.54
其中：1.基金申购款	10,000,000.00	-2,501,458.50	7,498,541.50
2.基金赎回款	-12,000,000.00	2,919,504.96	-9,080,495.04
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）	27,608,342.00	-6,535,460.88	21,072,881.12
项目	上年度可比期间 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）	29,608,342.00	-11,549,213.72	18,059,128.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,799,493.30	2,799,493.30
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）	-	632,019.03	632,019.03
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	-1,177,544.78	6,822,455.22
2.基金赎回款	-8,000,000.00	1,809,563.81	-6,190,436.19



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）	29,608,342.00	-8,117,701.39	21,490,640.61

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

广发中证全指原材料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]1266 号文核准，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《广发中证全指原材料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 2015 年 6 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 16 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 281,608,342.00 元，有效认购户数为 6,500 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 14,342.00 元，折合基金份额 14,342.00 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 8 月 25 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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 2020 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	240,986.02
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	240,986.02

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,134,540.97	20,851,850.11	-1,282,690.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,600.00	7,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	7,600.00	7,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,142,140.97	20,859,450.11	-1,282,690.86

#### 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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	25.87
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.45
应收结算备付金利息	6.75
应收债券利息	1.63
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	34.70

#### 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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	7,330.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,330.74

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	8,701.42
应付替代款	765,157.47
应付指数使用费	3,298.05
合计	777,156.94

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,608,342.00	29,608,342.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	27,608,342.00	27,608,342.00

#### 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	-7,882,411.20	903,253.50	-6,979,157.70
本期利润	-1,036,732.59	1,062,382.95	25,650.36
本期基金份额交易产生的变动数	612,824.96	-194,778.50	418,046.46

其中：基金申购款	-2,773,160.05	271,701.55	-2,501,458.50
基金赎回款	3,385,985.01	-466,480.05	2,919,504.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,306,318.83	1,770,857.95	-6,535,460.88

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,150.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3.95
结算备付金利息收入	78.23
其他	-
合计	1,233.17

#### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-694,907.71
股票投资收益——赎回差价收入	-536,176.06
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	-1,231,083.77

##### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,994,734.13
减：卖出股票成本总额	6,689,641.84
买卖股票差价收入	-694,907.71

##### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	9,080,495.04
减：现金支付赎回款总额	3,871,781.04
减：赎回股票成本总额	5,744,890.06
赎回差价收入	-536,176.06

#### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,709.96
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,709.96

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,320.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	39,600.00
减：应收利息总额	10.14
买卖债券差价收入	5,709.96

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	270,987.91
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	270,987.91

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	1,062,382.95
——股票投资	1,062,382.95
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,062,382.95

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,036.22
合计	11,036.22

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。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	16,061.87
银行间市场交易费用	-
合计	16,061.87

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	8,701.42
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	605.00
指数使用费	3,298.05
合计	12,604.47

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
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、代销机构

#### 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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	28,200.00	30.48%	-	-

###### 6.4.10.1.4 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。

##### 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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	54,967.94	54,893.78
其中：支付销售机构的客户维护费	1,847.88	1,904.21

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,993.56	10,978.75

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 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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。

##### 6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	240,986.02	1,150.99	305,192.22	1,442.76

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	600459	贵研铂业	配股	648.00	6,726.24

#### 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（2020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：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
127017	万青转债	2020-06-03	2020-07-02	新债流通受限	100.00	100.00	52.00	5,200.00	5,200.00	-
128110	永兴转债	2020-06-09	2020-07-08	新债流通受限	100.00	100.00	24.00	2,400.00	2,400.00	-

注：截至本报告期末 2020 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股票和权证。

#### 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
600069	退市银鸽	2020-06-10	重大事项停牌	0.92	2020-07-10	0.83	7,600.00	26,593.92	6,992.00	-
002470	*ST 金正	2020-06-30	重大事项停牌	2.27	2020-07-01	2.16	13,118.00	82,473.32	29,777.86	-
600226	*ST 瀚叶	2020-04-30	重大事项停牌	2.35	2020-07-01	2.23	16,421.00	66,012.35	38,589.35	-
002254	泰和新材	2020-06-29	重大事项停牌	13.60	2020-07-14	14.96	3,340.00	42,079.32	45,424.00	-

#### 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 2020 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 2020 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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。

##### 6.4.13.2.1 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。

##### 6.4.13.2.2 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	7,600.00	-
未评级	-	-
合计	7,600.00	-

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。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	240,986.02	-	-	-	240,986.02

结算备付金	16,595.45	-	-	-	16,595.45
存出保证金	1,097.81	-	-	-	1,097.81
交易性金融资产	7,600.00	-	-	20,851,850.11	20,859,450.11
应收证券清算款	-	-	-	763,131.26	763,131.26
应收利息	-	-	-	34.70	34.70
资产总计	266,279.28	-	-	21,615,016.07	21,881,295.35
<b>负债：</b>					
应付证券清算款	-	-	-	12,943.47	12,943.47
应付管理人报酬	-	-	-	9,152.56	9,152.56
应付托管费	-	-	-	1,830.52	1,830.52
应付交易费用	-	-	-	7,330.74	7,330.74
其他负债	-	-	-	777,156.94	777,156.94
负债总计	-	-	-	808,414.23	808,414.23
利率敏感度缺口	266,279.28	-	-	20,806,601.84	21,072,881.12
<b>上年度末</b>					
<b>2019 年 12 月 31</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>日</b>					
<b>资产：</b>					
银行存款	375,792.07	-	-	-	375,792.07
存出保证金	300.45	-	-	-	300.45
交易性金融资产	-	-	-	22,293,065.13	22,293,065.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	76.26	76.26
资产总计	376,092.52	-	-	22,293,141.39	22,669,233.91
<b>负债：</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	9,011.51	9,011.51
应付托管费	-	-	-	1,802.32	1,802.32
应付交易费用	-	-	-	1,735.78	1,735.78
其他负债	-	-	-	27,500.00	27,500.00
负债总计	-	-	-	40,049.61	40,049.61
利率敏感度缺口	376,092.52	-	-	22,253,091.78	22,629,184.30

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。

#### 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	20,851,850.11	98.95	22,293,065.13	98.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,600.00	0.04	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	20,859,450.11	98.99	22,293,065.13	98.51

##### 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,239,100.73	1,113,032.38
业绩比较基准下降 5%	-1,239,100.73	-1,113,032.38	

#### 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) 各层次金融工具公允价值

于 2020 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次的余额为人民币 20,731,066.90 元，属于第二层次的余额为人民币 128,383.21 元，无属于第三层次的金额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 22,030,526.01 元，属于第二层次的余额为人民币 262,539.12 元，无属于第三层次的金额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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	20,851,850.11	95.30
	其中：股票	20,851,850.11	95.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,600.00	0.03
	其中：债券	7,600.00	0.03

	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	257,581.47	1.18
8	其他各项资产	764,263.77	3.49
9	合计	21,881,295.35	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	104,928.70	0.50
B	采矿业	2,239,530.99	10.63
C	制造业	18,294,029.21	86.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,747.50	0.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	12,818.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	47,575.57	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	40,300.14	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	82,920.00	0.39
	合计	20,851,850.11	98.95

### 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	600585	海螺水泥	19,200	1,015,872.00	4.82
2	600309	万华化学	12,562	627,974.38	2.98
3	601899	紫金矿业	109,875	483,450.00	2.29
4	600547	山东黄金	10,361	379,419.82	1.80
5	002271	东方雨虹	8,831	358,803.53	1.70
6	002460	赣锋锂业	6,201	332,187.57	1.58
7	600019	宝钢股份	71,272	325,000.32	1.54
8	600352	浙江龙盛	20,800	266,032.00	1.26
9	600346	恒力石化	16,900	236,600.00	1.12
10	600529	山东药玻	3,767	218,486.00	1.04
11	603799	华友钴业	5,508	214,040.88	1.02
12	002812	恩捷股份	3,210	211,218.00	1.00
13	603993	洛阳钼业	56,500	207,355.00	0.98
14	300285	国瓷材料	6,153	206,187.03	0.98
15	600010	包钢股份	182,210	196,786.80	0.93
16	600143	金发科技	14,400	189,648.00	0.90
17	002493	荣盛石化	15,051	185,127.30	0.88
18	002075	沙钢股份	14,100	176,250.00	0.84
19	002466	天齐锂业	7,149	164,069.55	0.78
20	600111	北方稀土	17,422	162,373.04	0.77
21	600426	华鲁恒升	9,082	160,569.76	0.76
22	600176	中国巨石	16,868	154,342.20	0.73
23	002601	龙蟠佰利	8,101	149,868.50	0.71
24	000975	银泰黄金	9,523	149,320.64	0.71
25	601600	中国铝业	52,300	144,348.00	0.68
26	000786	北新建材	6,700	142,911.00	0.68

27	600489	中金黄金	14,855	135,774.70	0.64
28	000703	恒逸石化	14,706	134,265.78	0.64
29	600801	华新水泥	5,460	129,456.60	0.61
30	002250	联化科技	5,900	128,620.00	0.61
31	300699	光威复材	1,980	124,205.40	0.59
32	600486	扬农化工	1,480	122,100.00	0.58
33	000401	冀东水泥	7,502	120,332.08	0.57
34	002683	宏大爆破	3,401	118,694.90	0.56
35	002078	太阳纸业	12,399	118,038.48	0.56
36	600219	南山铝业	57,330	116,379.90	0.55
37	600516	方大炭素	18,249	114,603.72	0.54
38	000630	铜陵有色	58,898	113,673.14	0.54
39	600362	江西铜业	8,337	112,216.02	0.53
40	601233	桐昆股份	8,791	112,173.16	0.53
41	600126	杭钢股份	10,760	111,904.00	0.53
42	300037	新宙邦	2,001	110,175.06	0.52
43	002409	雅克科技	1,900	99,123.00	0.47
44	600988	赤峰黄金	8,000	95,200.00	0.45
45	300054	鼎龙股份	5,460	90,636.00	0.43
46	601168	西部矿业	15,300	88,740.00	0.42
47	000878	云南铜业	8,200	87,002.00	0.41
48	000818	航锦科技	3,802	84,898.66	0.40
49	300236	上海新阳	1,400	84,084.00	0.40
50	600497	驰宏锌锗	24,399	83,932.56	0.40
51	002080	中材科技	5,374	83,297.00	0.40
52	600673	东阳光	12,000	82,920.00	0.39
53	300618	寒锐钴业	1,316	81,618.32	0.39
54	601992	金隅集团	26,610	81,426.60	0.39
55	600720	祁连山	4,901	79,641.25	0.38
56	600549	厦门钨业	6,708	79,422.72	0.38
57	002831	裕同科技	2,840	78,128.40	0.37
58	000672	上峰水泥	3,303	77,983.83	0.37
59	601636	旗滨集团	12,950	76,664.00	0.36
60	600567	山鹰纸业	25,673	75,735.35	0.36
61	600881	亚泰集团	25,999	75,657.09	0.36
62	000877	天山股份	5,001	75,515.10	0.36
63	002643	万润股份	4,350	74,689.50	0.35
64	000060	中金岭南	19,915	74,083.80	0.35
65	600160	巨化股份	10,750	74,067.50	0.35
66	002709	天赐材料	2,160	72,986.40	0.35
67	600459	贵研铂业	2,408	71,782.48	0.34
68	002497	雅化集团	7,600	70,148.00	0.33
69	002648	卫星石化	4,300	69,961.00	0.33
70	600273	嘉化能源	8,000	69,920.00	0.33

71	601005	重庆钢铁	46,900	69,881.00	0.33
72	600392	盛和资源	9,876	69,625.80	0.33
73	000709	河钢股份	33,895	69,145.80	0.33
74	000629	攀钢钒钛	34,400	69,144.00	0.33
75	002233	塔牌集团	5,702	68,595.06	0.33
76	000960	锡业股份	8,010	68,565.60	0.33
77	600282	南钢股份	21,197	68,466.31	0.32
78	601216	君正集团	26,940	68,427.60	0.32
79	002203	海亮股份	7,801	68,258.75	0.32
80	603737	三棵树	740	68,242.80	0.32
81	002004	华邦健康	12,670	68,164.60	0.32
82	601118	海南橡胶	13,700	66,582.00	0.32
83	000778	新兴铸管	19,100	65,513.00	0.31
84	002110	三钢闽光	9,800	65,268.00	0.31
85	600966	博汇纸业	6,400	64,960.00	0.31
86	002092	中泰化学	13,700	62,061.00	0.29
87	002597	金禾实业	2,700	62,019.00	0.29
88	600808	马钢股份	23,778	61,347.24	0.29
89	000830	鲁西化工	8,200	61,172.00	0.29
90	000825	太钢不锈	18,299	60,752.68	0.29
91	000012	南玻 A	12,016	60,320.32	0.29
92	002237	恒邦股份	4,400	60,148.00	0.29
93	300180	华峰超纤	6,824	58,413.44	0.28
94	002407	多氟多	5,451	57,998.64	0.28
95	300737	科顺股份	2,900	57,217.00	0.27
96	600022	山东钢铁	43,719	56,397.51	0.27
97	002064	华峰氨纶	11,100	56,277.00	0.27
98	603077	和邦生物	42,380	55,941.60	0.27
99	600500	中化国际	11,023	55,776.38	0.26
100	000932	华菱钢铁	14,700	55,419.00	0.26
101	000959	首钢股份	12,700	54,610.00	0.26
102	000807	云铝股份	12,516	54,569.76	0.26
103	000301	东方盛虹	9,700	53,932.00	0.26
104	600989	宝丰能源	6,400	53,888.00	0.26
105	000936	华西股份	4,300	53,750.00	0.26
106	000831	五矿稀土	4,700	53,674.00	0.25
107	002155	湖南黄金	6,701	52,803.88	0.25
108	000488	晨鸣纸业	10,651	52,615.94	0.25
109	600782	新钢股份	12,800	52,224.00	0.25
110	000426	兴业矿业	7,400	50,912.00	0.24
111	002324	普利特	3,380	50,733.80	0.24
112	002440	闰土股份	5,500	50,270.00	0.24
113	600803	新奥股份	4,851	50,159.34	0.24
114	000688	国城矿业	2,700	50,031.00	0.24

115	002171	楚江新材	5,320	49,688.80	0.24
116	000708	中信特钢	2,860	48,877.40	0.23
117	000789	万年青	3,781	48,661.47	0.23
118	300072	三聚环保	11,273	48,248.44	0.23
119	002428	云南锗业	4,200	47,880.00	0.23
120	601958	金钼股份	7,704	47,610.72	0.23
121	002398	垒知集团	4,501	47,575.57	0.23
122	002701	奥瑞金	11,340	47,514.60	0.23
123	000898	鞍钢股份	19,166	46,956.70	0.22
124	600456	宝钛股份	1,700	46,495.00	0.22
125	600409	三友化工	9,902	46,143.32	0.22
126	000758	中色股份	11,000	45,980.00	0.22
127	000902	新洋丰	5,200	45,968.00	0.22
128	002254	泰和新材	3,340	45,424.00	0.22
129	600259	广晟有色	1,500	45,000.00	0.21
130	600507	方大特钢	8,636	44,820.84	0.21
131	600490	鹏欣资源	14,200	44,730.00	0.21
132	002002	鸿达兴业	12,389	44,724.29	0.21
133	603601	再升科技	3,400	44,540.00	0.21
134	300429	强力新材	2,466	44,092.08	0.21
135	300398	飞凯材料	2,060	43,507.20	0.21
136	300748	金力永磁	1,300	43,394.00	0.21
137	600378	昊华科技	2,100	43,029.00	0.20
138	601137	博威合金	2,700	42,228.00	0.20
139	000910	大亚圣象	2,678	41,616.12	0.20
140	600210	紫江企业	9,699	41,608.71	0.20
141	300655	晶瑞股份	1,000	41,150.00	0.20
142	000912	泸天化	10,100	41,006.00	0.19
143	600668	尖峰集团	2,800	40,824.00	0.19
144	000683	远兴能源	21,920	40,771.20	0.19
145	000933	神火股份	9,800	40,670.00	0.19
146	002312	三泰控股	8,900	40,495.00	0.19
147	000546	金圆股份	4,002	40,300.14	0.19
148	002145	中核钛白	8,816	39,848.32	0.19
149	600326	西藏天路	5,500	39,160.00	0.19
150	600596	新安股份	4,500	38,700.00	0.18
151	600307	酒钢宏兴	25,100	38,654.00	0.18
152	002240	威华股份	3,000	38,610.00	0.18
153	600226	*ST 瀚叶	16,421	38,589.35	0.18
154	002302	西部建设	4,000	38,400.00	0.18
155	000969	安泰科技	5,800	38,280.00	0.18
156	000990	诚志股份	3,000	38,070.00	0.18
157	603429	集友股份	1,183	37,654.89	0.18
158	603826	坤彩科技	1,120	37,598.40	0.18

159	603599	广信股份	2,200	37,114.00	0.18
160	002043	兔宝宝	4,350	37,105.50	0.18
161	600141	兴发集团	4,140	37,053.00	0.18
162	601678	滨化股份	8,701	36,892.24	0.18
163	000717	韶钢松山	9,700	36,860.00	0.17
164	002596	海南瑞泽	5,500	36,630.00	0.17
165	300041	回天新材	2,402	36,438.34	0.17
166	002768	国恩股份	1,100	36,047.00	0.17
167	600277	亿利洁能	11,000	35,860.00	0.17
168	002258	利尔化学	2,000	35,660.00	0.17
169	600425	青松建化	8,900	35,511.00	0.17
170	002408	齐翔腾达	5,681	35,279.01	0.17
171	600063	皖维高新	10,800	35,208.00	0.17
172	300596	利安隆	1,000	34,830.00	0.17
173	002585	双星新材	5,510	34,657.90	0.16
174	002182	云海金属	3,600	34,344.00	0.16
175	300328	宜安科技	2,770	33,156.90	0.16
176	002539	云图控股	4,790	33,051.00	0.16
177	000603	盛达资源	2,800	32,900.00	0.16
178	000553	安道麦 A	3,601	32,481.02	0.15
179	000592	平潭发展	12,400	32,116.00	0.15
180	600366	宁波韵升	5,580	31,806.00	0.15
181	002734	利民股份	2,083	31,182.51	0.15
182	000795	英洛华	5,451	31,125.21	0.15
183	600636	国新文化	2,500	30,750.00	0.15
184	603378	亚士创能	700	30,625.00	0.15
185	002565	顺灏股份	6,000	30,480.00	0.14
186	002810	山东赫达	900	30,384.00	0.14
187	300576	容大感光	520	30,097.60	0.14
188	601212	白银有色	11,800	30,090.00	0.14
189	000612	焦作万方	5,749	29,952.29	0.14
190	600308	华泰股份	6,500	29,900.00	0.14
191	002470	*ST 金正	13,118	29,777.86	0.14
192	600586	金晶科技	8,000	29,760.00	0.14
193	002235	安妮股份	3,650	29,747.50	0.14
194	601677	明泰铝业	3,400	29,512.00	0.14
195	603026	石大胜华	1,100	29,359.00	0.14
196	002522	浙江众成	4,400	29,216.00	0.14
197	002318	久立特材	4,002	29,214.60	0.14
198	600338	西藏珠峰	2,920	29,200.00	0.14
199	300261	雅本化学	4,700	29,140.00	0.14
200	603260	合盛硅业	1,060	28,980.40	0.14
201	002226	江南化工	5,000	28,850.00	0.14
202	300224	正海磁材	3,300	28,578.00	0.14

203	000973	佛塑科技	6,100	28,304.00	0.13
204	600449	宁夏建材	2,301	28,118.22	0.13
205	600103	青山纸业	14,703	28,082.73	0.13
206	601069	西部黄金	2,000	27,660.00	0.13
207	600531	豫光金铅	7,000	27,440.00	0.13
208	600527	江南高纤	11,100	27,417.00	0.13
209	002108	沧州明珠	7,884	27,357.48	0.13
210	002125	湘潭电化	3,000	27,240.00	0.13
211	000859	国风塑业	4,800	26,880.00	0.13
212	002392	北京利尔	6,700	26,800.00	0.13
213	002067	景兴纸业	8,800	26,752.00	0.13
214	002303	美盈森	6,100	26,535.00	0.13
215	300684	中石科技	764	26,510.80	0.13
216	000762	西藏矿业	3,401	26,425.77	0.13
217	300487	蓝晓科技	800	26,304.00	0.12
218	603078	江化微	585	26,295.75	0.12
219	002838	道恩股份	900	26,271.00	0.12
220	603688	石英股份	1,100	26,202.00	0.12
221	600075	新疆天业	5,401	26,194.85	0.12
222	002215	诺普信	4,400	26,136.00	0.12
223	600963	岳阳林纸	7,265	25,790.75	0.12
224	002391	长青股份	3,150	25,546.50	0.12
225	002666	德联集团	3,600	25,488.00	0.12
226	300575	中旗股份	640	25,273.60	0.12
227	603916	苏博特	1,000	25,150.00	0.12
228	002224	三力士	4,101	24,770.04	0.12
229	000949	新乡化纤	7,100	24,566.00	0.12
230	000731	四川美丰	4,728	24,443.76	0.12
231	000935	四川双马	1,900	24,396.00	0.12
232	300174	元力股份	1,400	24,220.00	0.11
233	002641	永高股份	3,600	24,156.00	0.11
234	600165	新日恒力	4,451	24,079.91	0.11
235	300409	道氏技术	2,122	23,808.84	0.11
236	000659	珠海中富	10,200	23,562.00	0.11
237	600331	宏达股份	11,400	23,484.00	0.11
238	002783	凯龙股份	2,380	23,276.40	0.11
239	000751	锌业股份	9,001	23,222.58	0.11
240	002443	金洲管道	3,400	23,154.00	0.11
241	300481	濮阳惠成	1,200	23,136.00	0.11
242	002206	海利得	6,852	23,091.24	0.11
243	002637	赞宇科技	2,301	23,010.00	0.11
244	603399	吉翔股份	3,100	23,002.00	0.11
245	601208	东材科技	3,500	22,995.00	0.11
246	600802	福建水泥	2,100	22,806.00	0.11



247	002228	合兴包装	5,600	22,456.00	0.11
248	600172	黄河旋风	8,082	22,225.50	0.11
249	600328	中盐化工	3,100	22,041.00	0.10
250	600389	江山股份	1,200	21,948.00	0.10
251	002274	华昌化工	4,600	21,942.00	0.10
252	600096	云天化	4,601	21,854.75	0.10
253	600888	新疆众和	4,860	21,772.80	0.10
254	002756	永兴材料	1,140	21,762.60	0.10
255	002476	宝莫股份	3,900	21,723.00	0.10
256	603033	三维股份	1,000	21,720.00	0.10
257	002243	通产丽星	1,500	21,600.00	0.10
258	600433	冠豪高新	7,167	21,572.67	0.10
259	002386	天原集团	4,400	21,516.00	0.10
260	002584	西陇科学	2,801	21,483.67	0.10
261	002201	九鼎新材	1,600	21,472.00	0.10
262	600458	时代新材	3,280	21,254.40	0.10
263	002381	双箭股份	2,300	21,183.00	0.10
264	002632	道明光学	2,500	21,175.00	0.10
265	002225	濮耐股份	4,900	20,727.00	0.10
266	002132	恒星科技	8,050	20,688.50	0.10
267	002167	东方锆业	4,000	20,680.00	0.10
268	002669	康达新材	1,400	20,678.00	0.10
269	300530	达志科技	500	20,640.00	0.10
270	002012	凯恩股份	3,700	20,498.00	0.10
271	603181	皇马科技	900	20,430.00	0.10
272	300192	科斯伍德	1,200	20,256.00	0.10
273	002361	神剑股份	4,702	20,124.56	0.10
274	002082	万邦德	2,000	20,000.00	0.09
275	300230	永利股份	4,600	19,964.00	0.09
276	603360	百傲化学	1,020	19,818.60	0.09
277	603010	万盛股份	1,400	19,614.00	0.09
278	600810	神马股份	2,750	19,607.50	0.09
279	603980	吉华集团	2,800	19,516.00	0.09
280	002588	史丹利	4,620	19,496.40	0.09
281	603505	金石资源	900	19,440.00	0.09
282	000420	吉林化纤	9,400	19,364.00	0.09
283	002057	中钢天源	2,800	19,180.00	0.09
284	600581	八一钢铁	6,200	18,910.00	0.09
285	000815	美利云	2,800	18,900.00	0.09
286	603612	索通发展	1,640	18,728.80	0.09
287	600569	安阳钢铁	9,200	18,676.00	0.09
287	600076	康欣新材	5,800	18,676.00	0.09
288	002478	常宝股份	3,800	18,354.00	0.09
289	000525	红太阳	2,300	18,262.00	0.09

290	600691	阳煤化工	9,500	18,240.00	0.09
291	601003	柳钢股份	4,100	18,163.00	0.09
292	300057	万顺新材	3,800	18,126.00	0.09
293	601388	怡球资源	10,579	18,090.09	0.09
294	300196	长海股份	1,700	17,986.00	0.09
295	300320	海达股份	3,400	17,884.00	0.08
296	002741	光华科技	1,500	17,700.00	0.08
297	300082	奥克股份	2,700	17,334.00	0.08
298	000510	新金路	3,900	17,160.00	0.08
299	002521	齐峰新材	3,201	16,901.28	0.08
300	600230	沧州大化	2,000	16,900.00	0.08
301	300537	广信材料	900	16,893.00	0.08
302	002824	和胜股份	600	16,872.00	0.08
303	300225	金力泰	2,601	16,828.47	0.08
304	000657	中钨高新	2,821	16,813.16	0.08
305	002160	常铝股份	3,800	16,720.00	0.08
305	002165	红宝丽	3,800	16,720.00	0.08
306	600844	丹化科技	5,200	16,484.00	0.08
307	002246	北化股份	2,202	16,470.96	0.08
308	002170	芭田股份	4,300	16,426.00	0.08
309	002538	司尔特	3,400	16,354.00	0.08
310	300067	安诺其	4,461	16,238.04	0.08
311	603995	甬金股份	600	16,140.00	0.08
312	002088	鲁阳节能	1,800	16,074.00	0.08
313	300200	高盟新材	1,000	16,030.00	0.08
314	000881	中广核技	2,200	15,972.00	0.08
315	603379	三美股份	740	15,887.80	0.08
316	603823	百合花	940	15,792.00	0.07
317	002379	宏创控股	6,000	15,720.00	0.07
318	601020	华钰矿业	2,002	15,615.60	0.07
319	601969	海南矿业	3,175	15,494.00	0.07
320	600589	广东榕泰	3,500	14,980.00	0.07
321	603227	雪峰科技	4,001	14,883.72	0.07
322	300109	新开源	1,000	14,810.00	0.07
323	603969	银龙股份	3,402	14,798.70	0.07
324	603002	宏昌电子	2,950	14,779.50	0.07
325	300121	阳谷华泰	1,790	14,713.80	0.07
326	000677	恒天海龙	4,800	14,592.00	0.07
327	000822	山东海化	4,300	14,534.00	0.07
328	002149	西部材料	2,101	14,517.91	0.07
329	603639	海利尔	696	14,490.72	0.07
330	300777	中简科技	400	14,480.00	0.07
331	603978	深圳新星	700	14,406.00	0.07
332	002395	双象股份	800	14,296.00	0.07

333	603810	丰山集团	300	14,289.00	0.07
334	600558	大西洋	4,975	14,278.25	0.07
335	600731	湖南海利	2,000	14,200.00	0.07
336	002054	德美化工	2,101	14,034.68	0.07
337	002455	百川股份	2,902	13,871.56	0.07
338	300214	日科化学	1,700	13,838.00	0.07
339	300758	七彩化学	840	13,776.00	0.07
340	603876	鼎胜新材	1,000	13,650.00	0.06
341	000545	金浦钛业	5,500	13,640.00	0.06
342	002886	沃特股份	500	13,555.00	0.06
343	600078	澄星股份	3,200	13,504.00	0.06
344	000655	金岭矿业	2,400	13,488.00	0.06
345	002613	北玻股份	3,000	13,440.00	0.06
346	600727	鲁北化工	2,000	13,280.00	0.06
347	000962	东方钨业	2,100	13,062.00	0.06
348	300179	四方达	2,300	13,041.00	0.06
349	603225	新凤鸣	1,296	12,934.08	0.06
350	000819	岳阳兴长	1,677	12,896.13	0.06
351	600724	宁波富达	3,400	12,818.00	0.06
352	600618	氯碱化工	1,800	12,780.00	0.06
353	603722	阿科力	400	12,700.00	0.06
354	000923	河钢资源	1,000	12,600.00	0.06
355	300587	天铁股份	700	12,586.00	0.06
356	600117	西宁特钢	4,200	12,516.00	0.06
357	000506	中润资源	5,201	12,482.40	0.06
358	002442	龙星化工	3,100	12,400.00	0.06
359	603938	三孚股份	500	12,320.00	0.06
360	002068	黑猫股份	2,876	12,194.24	0.06
361	002378	章源钨业	3,001	12,124.04	0.06
362	300107	建新股份	2,200	12,056.00	0.06
363	000698	沈阳化工	3,900	12,051.00	0.06
364	603878	武进不锈	1,608	11,867.04	0.06
365	300019	硅宝科技	1,000	11,750.00	0.06
366	300387	富邦股份	1,400	11,704.00	0.06
367	600367	红星发展	1,700	11,696.00	0.06
368	002846	英联股份	700	11,690.00	0.06
369	002942	新农股份	400	11,688.00	0.06
370	002211	宏达新材	2,003	11,657.46	0.06
371	603968	醋化股份	800	11,560.00	0.05
372	603856	东宏股份	790	11,376.00	0.05
373	300337	银邦股份	3,300	11,352.00	0.05
374	600295	鄂尔多斯	1,600	11,280.00	0.05
375	603022	新通联	700	11,235.00	0.05
376	002114	罗平锌电	1,600	11,200.00	0.05

377	300715	凯伦股份	300	11,184.00	0.05
378	300221	银禧科技	2,501	11,179.47	0.05
379	002895	川恒股份	900	11,016.00	0.05
380	603681	永冠新材	600	11,010.00	0.05
381	603906	龙蟠科技	700	10,920.00	0.05
382	002172	澳洋健康	4,400	10,912.00	0.05
383	300637	扬帆新材	1,140	10,681.80	0.05
384	002735	王子新材	500	10,535.00	0.05
385	603067	振华股份	1,708	10,504.20	0.05
386	603086	先达股份	700	10,311.00	0.05
387	000637	茂化实华	2,500	10,225.00	0.05
388	002109	兴化股份	3,450	10,108.50	0.05
389	603977	国泰集团	1,300	10,088.00	0.05
390	002971	和远气体	400	10,004.00	0.05
391	603351	威尔药业	420	9,811.20	0.05
392	603663	三祥新材	700	9,716.00	0.05
393	002842	翔鹭钨业	1,036	9,665.88	0.05
394	603733	仙鹤股份	600	9,642.00	0.05
395	002915	中欣氟材	500	9,555.00	0.05
396	002742	三圣股份	1,500	9,510.00	0.05
397	603867	新化股份	400	9,216.00	0.04
398	300586	美联新材	1,030	9,094.90	0.04
399	300064	豫金刚石	4,801	9,073.89	0.04
400	603028	赛福天	800	8,992.00	0.04
401	600722	金牛化工	2,700	8,991.00	0.04
402	603217	元利科技	320	8,848.00	0.04
403	600980	北矿科技	700	8,834.00	0.04
404	000635	英力特	1,200	8,112.00	0.04
405	603192	汇得科技	300	7,800.00	0.04
406	002799	环球印务	400	7,768.00	0.04
407	603110	东方材料	500	7,375.00	0.03
408	603165	荣晟环保	644	7,373.80	0.03
409	603278	大业股份	940	7,059.40	0.03
410	600069	退市银鸽	7,600	6,992.00	0.03
411	002917	金奥博	710	6,950.90	0.03
412	603790	雅运股份	500	6,915.00	0.03
413	603687	大胜达	500	6,885.00	0.03
414	603332	苏州龙杰	300	6,735.00	0.03
415	603863	松炆资源	500	6,250.00	0.03
416	002679	福建金森	630	6,230.70	0.03
417	002969	嘉美包装	800	6,104.00	0.03
418	300796	贝斯美	300	6,099.00	0.03
419	603226	菲林格尔	556	6,038.16	0.03
420	603499	翔港科技	320	5,561.60	0.03

421	300798	锦鸡股份	400	5,500.00	0.03
-----	--------	------	-----	----------	------

#### 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	600585	海螺水泥	580,901.93	2.57
2	600309	万华化学	252,928.00	1.12
3	600547	山东黄金	197,599.00	0.87
4	601899	紫金矿业	165,424.00	0.73
5	600019	宝钢股份	161,867.00	0.72
6	600352	浙江龙盛	113,325.00	0.50
7	600010	包钢股份	111,087.00	0.49
8	600346	恒力石化	106,211.00	0.47
9	603993	洛阳钼业	96,219.00	0.43
10	603799	华友钴业	81,680.00	0.36
11	600426	华鲁恒升	73,514.00	0.32
12	600111	北方稀土	72,554.00	0.32
13	601600	中国铝业	70,108.00	0.31
14	002271	东方雨虹	68,696.00	0.30
15	600176	中国巨石	66,343.00	0.29
16	600143	金发科技	66,170.00	0.29
17	600529	山东药玻	65,142.00	0.29
18	600801	华新水泥	61,548.00	0.27
19	600489	中金黄金	61,009.00	0.27
20	600516	方大炭素	55,855.00	0.25

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	600585	海螺水泥	420,922.47	1.86

2	600309	万华化学	267,593.00	1.18
3	601899	紫金矿业	176,325.00	0.78
4	600019	宝钢股份	165,836.00	0.73
5	002340	格林美	162,775.20	0.72
6	600547	山东黄金	137,591.00	0.61
7	600352	浙江龙盛	119,931.00	0.53
8	600346	恒力石化	109,250.00	0.48
9	603993	洛阳钼业	99,453.00	0.44
10	600010	包钢股份	94,367.00	0.42
11	600206	有研新材	93,606.00	0.41
12	603799	华友钴业	90,315.64	0.40
13	600143	金发科技	78,167.00	0.35
14	600426	华鲁恒升	76,786.00	0.34
15	600111	北方稀土	76,586.00	0.34
16	601600	中国铝业	71,664.00	0.32
17	600176	中国巨石	67,043.00	0.30
18	002010	传化智联	65,911.00	0.29
19	002326	永太科技	64,958.89	0.29
20	600801	华新水泥	62,015.00	0.27

#### 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	6,279,974.93
卖出股票收入（成交）总额	5,994,734.13

#### 7.5 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）	7,600.00	0.04

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,600.00	0.04

#### 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

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	127017	万青转债	52	5,200.00	0.02
2	128110	永兴转债	24	2,400.00	0.01

#### 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	1,097.81
2	应收证券清算款	763,131.26
3	应收股利	-
4	应收利息	34.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	764,263.77

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,212	22,779.16	1,138,532.0	4.12%	26,469,810.	95.88%



		0		00	
--	--	---	--	----	--

## 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	华泰证券股份有限公司	1,111,825.00	4.03%
2	程丽琼	1,000,053.00	3.62%
3	林晓春	708,606.00	2.57%
4	胡毅	600,000.00	2.17%
5	肖佳鹏	560,100.00	2.03%
6	翟春光	500,043.00	1.81%
7	谭惠贞	500,034.00	1.81%
8	何新良	438,029.00	1.59%
9	李国铭	400,015.00	1.45%
10	邹林安	400,000.00	1.45%

## 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（2015 年 6 月 25 日）基金份额总额	281,608,342.00
本报告期期初基金份额总额	29,608,342.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
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	-
本报告期末基金份额总额	27,608,342.00

## 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 2020 年 7 月 11 日发布公告，自 2020 年 7 月 11 日起，邱春杨先生不再担任公司督察长，程才良先生新任公司督察长。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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	2,431,989.12	19.81%	1,778.49	19.81%	-
安信证券	1	2,525,777.90	20.58%	1,847.09	20.58%	-
海通证券	2	7,316,942.04	59.61%	5,350.98	59.61%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-

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	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
银河证券	40,145.20	43.39%	-	-	-	-
安信证券	24,174.90	26.13%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	28,200.00	30.48%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-21
2	关于增加中信证券（华南）为旗下部分基金场外申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
3	关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金调整标的指数许可使用费并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-31
4	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27

5	关于增加中信建投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	2020-03-12
6	关于变更旗下部分基金场内简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-12
7	关于增加东吴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	2020-03-09
8	关于旗下基金调整申购(含定期定额投资)及转换转入确认业务规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-28
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-17
10	根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 41 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-11

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，本公司于本报告期内对本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件进行了信息披露相关条款的修订。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 41 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》。

2、根据中证指数有限公司下发的《关于国内市场 A 股 ETF 收费调整的通知》及基金合同的有关规定，本基金管理人经与相关托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定调整本基金标的指数许可使用费，并相应修订基金合同。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金调整标的指数许可使用费并修订基金合同的公告》。

## 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原材料交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中证全指原材料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  
二〇二〇年八月二十七日