

# 广发中证全指可选消费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
<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>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>58</b>

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	58
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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 .....	59
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>59</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>60</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4	基金投资策略的改变 .....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8	其他重大事件 .....	62
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>63</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>64</b>
12.1	备查文件目录 .....	64
12.2	存放地点 .....	64
12.3	查阅方式 .....	64

## 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 年 6 月 25 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证全指可选消费指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	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	中国证券报
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	-18,563,477.56
本期利润	17,176,933.15
加权平均基金份额本期利润	0.0705
本期加权平均净值利润率	5.02%
本期基金份额净值增长率	5.98%
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	5,939,239.10
期末可供分配基金份额利润	0.0270
期末基金资产净值	333,676,820.82
期末基金份额净值	1.5156
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	51.56%

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）。

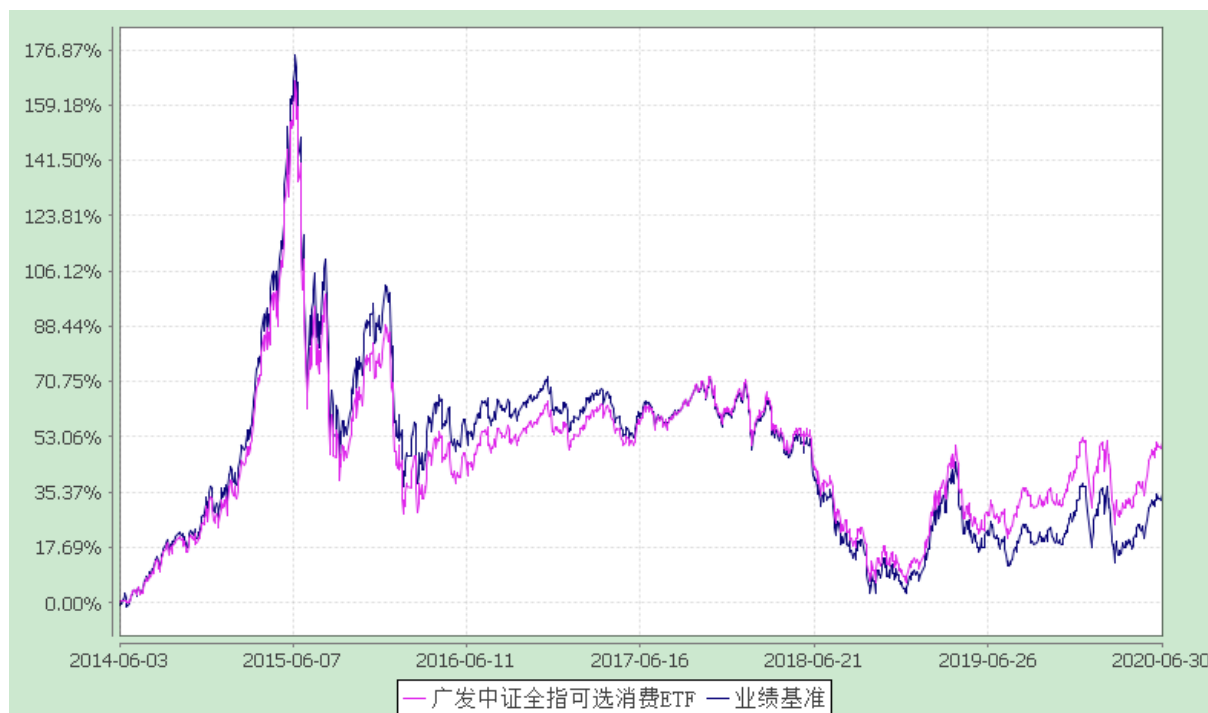
### 3.2 基金净值表现

#### 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	7.83%	0.95%	6.62%	0.96%	1.21%	-0.01%
过去三个月	18.26%	1.04%	16.61%	1.05%	1.65%	-0.01%
过去六个月	5.98%	1.76%	3.88%	1.78%	2.10%	-0.02%
过去一年	18.50%	1.40%	10.68%	1.42%	7.82%	-0.02%
过去三年	-6.65%	1.35%	-17.91%	1.37%	11.26%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.56%	1.61%	34.63%	1.66%	16.93%	-0.05%

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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2014 年 6 月 3 日至 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；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指	2014-06-03	-	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)。

	<p>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</p>				
--	---	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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的投资策略跟踪指数，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%，中证全指可选消费指数上涨 3.88%。随着国内疫情的好转，我国的消费开始复苏，数据显示，1 月-5 月份我国社会消费品零售总额累计同比减少 13.50%，相对于第 1 季度有了明显的改善。

#### 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 5.98%，同期业绩比较基准收益率为 3.88%。

#### 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。可选消费行业上半年受疫情影响较大，下半年行业复苏将会更明显。从国家经济发展的角度看，受国内房地产调控与劳动力成本提高的影响，投资与出口对我国经济增长的作用逐步减弱，经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动，未来随着居民收入的提高，消费升级是大势所趋。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本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：广发中证全指可选消费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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,017,918.65	2,954,241.40
结算备付金		48,104.19	20,262.49
存出保证金		4,396.91	15,556.53
交易性金融资产	6.4.7.2	330,930,500.52	312,213,230.90

其中：股票投资		330,858,300.52	312,168,930.90
基金投资		-	-
债券投资		72,200.00	44,300.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	10,126.66	588.94
应收股利		44,726.30	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		334,055,773.23	315,203,880.26
<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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		141,606.07	128,679.61
应付托管费		28,321.21	25,735.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	79,899.46	18,555.48
应交税费		580.92	0.05
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	128,544.75	176,210.87
负债合计		378,952.41	349,181.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	220,156,094.00	220,156,094.00
未分配利润	6.4.7.10	113,520,726.82	94,698,604.33
所有者权益合计		333,676,820.82	314,854,698.33
负债和所有者权益总计		334,055,773.23	315,203,880.26

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5156 元，基金份额总额 220,156,094.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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>18,524,844.45</b>	<b>41,810,256.20</b>
1.利息收入		43,044.34	12,536.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,345.39	12,536.12
债券利息收入		173.54	-
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		31,525.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,324,539.13	-7,082,277.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-21,634,592.61	-10,487,590.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	63,417.07	-
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	4,246,636.41	3,405,312.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	35,740,410.71	48,868,794.69
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	65,928.53	11,203.35
<b>减：二、费用</b>		<b>1,347,911.30</b>	<b>998,730.88</b>
1. 管理人报酬		849,514.52	673,739.91
2. 托管费		169,902.91	134,748.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	197,467.37	47,237.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		114.20	-
7. 其他费用	6.4.7.19	130,912.30	143,005.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17,176,933.15</b>	<b>40,811,525.32</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17,176,933.15</b>	<b>40,811,525.32</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	220,156,094.00	94,698,604.33	314,854,698.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,176,933.15	17,176,933.15
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）	0.00	1,645,189.34	1,645,189.34
其中：1.基金申购款	54,000,000.00	25,296,932.34	79,296,932.34
2.基金赎回款	-54,000,000.00	-23,651,743.00	-77,651,743.00
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	113,520,726.82	333,676,820.82
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）	208,156,094.00	17,438,713.18	225,594,807.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,811,525.32	40,811,525.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	8,000,000.00	2,054,164.72	10,054,164.72
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	3,285,689.77	15,285,689.77
2.基金赎回款	-4,000,000.00	-1,231,525.05	-5,231,525.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	216,156,094.00	60,304,403.22	276,460,497.22



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]1265 号《关于核准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2014 年 6 月 3 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 5 月 5 日至 2014 年 5 月 23 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 838,156,094.00 元，有效认购户数为 7,064 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 40,743.00 元，折合基金份额 40,743.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 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	3,017,918.65
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,017,918.65

#### 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	342,590,512.64	330,858,300.52	-11,732,212.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	72,200.00	72,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	72,200.00	72,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	342,662,712.64	330,930,500.52	-11,732,212.12

#### 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	267.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1.80
应收结算备付金利息	118.51
应收债券利息	7.92
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	9,730.59
其他	-
合计	10,126.66

#### 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	79,899.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	79,899.46

#### 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	77,573.86
应付指数使用费	50,970.89
合计	128,544.75

#### 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	220,156,094.00	220,156,094.00
本期申购	54,000,000.00	54,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-54,000,000.00	-54,000,000.00
本期末	220,156,094.00	220,156,094.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,703,115.22	71,995,489.11	94,698,604.33
本期利润	-18,563,477.56	35,740,410.71	17,176,933.15
本期基金份额交易产生的变动数	1,799,601.44	-154,412.10	1,645,189.34
其中：基金申购款	5,626,354.74	19,670,577.60	25,296,932.34
基金赎回款	-3,826,753.30	-19,824,989.70	-23,651,743.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,939,239.10	107,581,487.72	113,520,726.82

#### 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	10,473.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	52.10
结算备付金利息收入	819.44
其他	-
合计	11,345.39

#### 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	-17,838,901.90
股票投资收益——赎回差价收入	-3,795,690.71
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	-21,634,592.61

##### 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	75,407,086.47
减：卖出股票成本总额	93,245,988.37
买卖股票差价收入	-17,838,901.90

##### 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	77,651,743.00
减：现金支付赎回款总额	27,922,457.00
减：赎回股票成本总额	53,524,976.71
赎回差价收入	-3,795,690.71

#### 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	63,417.07
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	63,417.07

#### 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	627,289.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	563,700.00
减：应收利息总额	172.32
买卖债券差价收入	63,417.07

#### 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	4,246,636.41
其中：证券出借权益补偿收入	74,816.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,246,636.41

#### 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	35,740,410.71
——股票投资	35,740,410.71
——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	35,740,410.71

#### 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	65,928.53
合计	65,928.53

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	197,467.37
银行间市场交易费用	-
合计	197,467.37

#### 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	17,901.52
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,367.55
指数使用费	50,970.89
合计	130,912.30

### 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
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	86,006.38	0.06%	-	-

##### 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	372,600.00	30.57%	-	-

##### 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	849,514.52	673,739.91
其中：支付销售机构的客户维护费	1,042.96	520.64

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	169,902.91	134,748.00

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	207,337,668.00	94.18%	211,408,868.00	96.03%

##### 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		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	3,017,918.65	10,473.85	3,972,269.18	12,190.12

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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：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
688318	财富趋势	2020-04-17	2020-10-27	新股流通受限	107.41	237.93	2,439.00	261,972.99	580,311.27	-
688505	复旦张江	2020-06-10	2020-12-21	新股流通受限	8.95	24.78	17,792.00	159,238.40	440,885.76	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2021-01-08	新股流通受限	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股流通受限	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股流通受限	15.50	15.50	5,468.00	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股流通受限	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
6.4.12.1.2 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
12811	比音	2020-0	2020-0	新债	100.00	100.00	442.00	44,200	44,200	-

3	转债	6-15	7-15	流通受限				.00	.00	
113589	天创转债	2020-06-29	2020-07-16	新债流通受限	100.00	100.00	280.00	28,000.00	28,000.00	-

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权证。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
2020060500003282	002662	京威股份	2020-06-05	2020-07-03	3.34	23,000.00	76,820.00
2020060800002345	000559	万向钱潮	2020-06-08	2020-07-06	4.84	10,000.00	48,400.00
2020060800002347	000581	威孚高科	2020-06-08	2020-07-06	20.68	10,000.00	206,800.00
2020060800002385	300133	华策影视	2020-06-08	2020-07-06	7.25	10,000.00	72,500.00
2020060800002391	600060	海信视像	2020-06-08	2020-07-06	12.15	10,000.00	121,500.00
2020060800002421	600859	王府井	2020-06-08	2020-07-06	45.55	10,000.00	455,500.00
202006080000	601966	玲珑轮胎	2020-06-08	2020-07-06	20.20	10,000.00	202,000.00

2431							
202006 080000 2929	300058	蓝色光标	2020-06-08	2020-07- 06	7.80	10,000.00	78,000.00
202006 080000 2931	600006	东风汽车	2020-06-08	2020-07- 06	4.03	10,000.00	40,300.00
202006 080000 3145	000016	深康佳 A	2020-06-08	2020-07- 06	6.76	10,000.00	67,600.00
202006 080000 3153	002503	搜于特	2020-06-08	2020-07- 06	2.81	10,000.00	28,100.00
202006 080000 3163	600448	华纺股份	2020-06-08	2020-07- 06	3.91	12,000.00	46,920.00
202006 080000 3375	603766	隆鑫通用	2020-06-08	2020-07- 06	3.87	10,000.00	38,700.00
202006 090000 0257	000100	TCL 科技	2020-06-09	2020-07- 07	6.20	20,000.00	124,000.00
202006 090000 0271	000501	鄂武商 A	2020-06-09	2020-07- 07	15.68	10,000.00	156,800.00
202006 090000 0296	000793	华闻集团	2020-06-09	2020-07- 07	4.12	30,000.00	123,600.00
202006 090000 0300	000802	北京文化	2020-06-09	2020-07- 07	6.13	10,600.00	64,978.00
202006 090000 0312	000901	航天科技	2020-06-09	2020-07- 07	10.19	10,000.00	101,900.00
202006 090000 0315	000957	中通客车	2020-06-09	2020-07- 07	6.51	10,000.00	65,100.00
202006 090000 0323	000917	电广传媒	2020-06-09	2020-07- 07	6.32	10,000.00	63,200.00
202006 090000 0329	002042	华孚时尚	2020-06-09	2020-07- 07	6.23	10,000.00	62,300.00
202006	002131	利欧股份	2020-06-09	2020-07-	3.86	20,000.00	77,200.00

090000 0335				07			
202006 090000 0368	002251	步步高	2020-06-09	2020-07-07	13.98	10,000.00	139,800.00
202006 090000 0372	002355	兴民智通	2020-06-09	2020-07-07	5.40	10,000.00	54,000.00
202006 090000 0389	002489	浙江永强	2020-06-09	2020-07-07	3.98	26,700.00	106,266.00
202006 090000 0393	002488	金固股份	2020-06-09	2020-07-07	5.30	17,500.00	92,750.00
202006 090000 0395	002537	海联金汇	2020-06-09	2020-07-07	5.81	10,000.00	58,100.00
202006 090000 0424	300058	蓝色光标	2020-06-09	2020-07-07	7.80	10,000.00	78,000.00
202006 090000 0513	600336	澳柯玛	2020-06-09	2020-07-07	6.05	11,800.00	71,390.00
202006 090000 0517	600825	新华传媒	2020-06-09	2020-07-07	6.21	12,900.00	80,109.00
202006 090000 0562	600707	彩虹股份	2020-06-09	2020-07-07	4.56	17,700.00	80,712.00
202006 090000 0569	600337	美克家居	2020-06-09	2020-07-07	4.42	20,000.00	88,400.00
202006 090000 0589	600839	四川长虹	2020-06-09	2020-07-07	2.87	11,500.00	33,005.00
202006 090000 0625	600676	交运股份	2020-06-09	2020-07-07	5.56	15,200.00	84,512.00
202006 090000 0637	600166	福田汽车	2020-06-09	2020-07-07	1.80	15,400.00	27,720.00
202006 090000 0642	600686	金龙汽车	2020-06-09	2020-07-07	5.64	10,000.00	56,400.00

202006 090000 0659	600730	中国高科	2020-06-09	2020-07- 07	4.88	11,600.00	56,608.00
202006 090000 0668	600037	歌华有线	2020-06-09	2020-07- 07	15.20	10,000.00	152,000.00
202006 090000 2917	002400	省广集团	2020-06-09	2020-07- 07	10.49	10,000.00	104,900.00
202006 110000 2398	002503	搜于特	2020-06-11	2020-07- 09	2.81	10,000.00	28,100.00
202006 110000 2410	002400	省广集团	2020-06-11	2020-07- 09	10.49	10,000.00	104,900.00
202006 110000 2412	000800	一汽解放	2020-06-11	2020-07- 09	10.74	30,000.00	322,200.00
202006 110000 2418	600448	华纺股份	2020-06-11	2020-07- 09	3.91	10,000.00	39,100.00
202006 110000 2420	600733	北汽蓝谷	2020-06-11	2020-07- 09	6.43	30,000.00	192,900.00
202006 150000 3602	600839	四川长虹	2020-06-15	2020-07- 13	2.87	79,700.00	228,739.00
202006 150000 3632	600754	锦江酒店	2020-06-15	2020-07- 13	27.75	10,000.00	277,500.00
202006 150000 3650	600699	均胜电子	2020-06-15	2020-07- 13	23.81	15,400.00	366,674.00
202006 150000 3708	600418	江淮汽车	2020-06-15	2020-07- 13	8.83	27,500.00	242,825.00
202006 150000 3726	600373	中文传媒	2020-06-15	2020-07- 13	11.78	14,000.00	164,920.00
202006 150000 3730	600335	国机汽车	2020-06-15	2020-07- 13	4.62	10,000.00	46,200.00
202006 150000	600258	首旅酒店	2020-06-15	2020-07- 13	15.37	10,000.00	153,700.00



3754							
202006 150000 3768	600166	福田汽车	2020-06-15	2020-07-13	1.80	98,200.00	176,760.00
202006 150000 3782	600138	中青旅	2020-06-15	2020-07-13	9.87	11,300.00	111,531.00
202006 150000 3798	600060	海信视像	2020-06-15	2020-07-13	12.15	14,100.00	171,315.00
202006 150000 3806	600037	歌华有线	2020-06-15	2020-07-13	15.20	20,200.00	307,040.00
202006 150000 3818	600006	东风汽车	2020-06-15	2020-07-13	4.03	17,000.00	68,510.00
202006 150000 3836	300251	光线传媒	2020-06-15	2020-07-13	10.91	16,000.00	174,560.00
202006 150000 3844	300182	捷成股份	2020-06-15	2020-07-13	3.99	37,100.00	148,029.00
202006 150000 3854	300133	华策影视	2020-06-15	2020-07-13	7.25	19,000.00	137,750.00
202006 150000 3864	300058	蓝色光标	2020-06-15	2020-07-13	7.80	35,500.00	276,900.00
202006 150000 3890	002640	跨境通	2020-06-15	2020-07-13	6.49	17,000.00	110,330.00
202006 150000 4828	002572	索菲亚	2020-06-15	2020-07-13	24.17	12,800.00	309,376.00
202006 150000 4854	002434	万里扬	2020-06-15	2020-07-13	8.68	10,000.00	86,800.00
202006 150000 4858	002419	天虹股份	2020-06-15	2020-07-13	9.55	10,000.00	95,500.00
202006 150000 4860	002416	爱施德	2020-06-15	2020-07-13	7.18	10,000.00	71,800.00
202006	002242	九阳股份	2020-06-15	2020-07-	37.27	10,000.00	372,700.00

150000 4906				13			
202006 150000 4954	002048	宁波华翔	2020-06-15	2020-07-13	15.44	10,000.00	154,400.00
202006 150000 5036	000681	视觉中国	2020-06-15	2020-07-13	18.62	10,000.00	186,200.00
202006 150000 5050	000559	万向钱潮	2020-06-15	2020-07-13	4.84	28,900.00	139,876.00
202006 150000 5072	000156	华数传媒	2020-06-15	2020-07-13	10.83	11,600.00	125,628.00
202006 150000 5106	603766	隆鑫通用	2020-06-15	2020-07-13	3.87	21,100.00	81,657.00
202006 150000 5150	601928	凤凰传媒	2020-06-15	2020-07-13	6.80	16,100.00	109,480.00
202006 150000 5158	601718	际华集团	2020-06-15	2020-07-13	3.32	48,200.00	160,024.00
202006 150000 5202	600996	贵广网络	2020-06-15	2020-07-13	7.13	10,000.00	71,300.00
202006 160000 1543	002131	利欧股份	2020-06-16	2020-07-14	3.86	23,600.00	91,096.00
202006 160000 1758	603377	东方时尚	2020-06-16	2020-07-14	16.56	10,000.00	165,600.00
202006 160000 2193	601717	郑煤机	2020-06-16	2020-07-14	5.89	10,000.00	58,900.00
202006 160000 2355	601058	赛轮轮胎	2020-06-16	2020-07-14	3.53	10,000.00	35,300.00
202006 170001 2441	002503	搜于特	2020-06-17	2020-07-15	2.81	10,000.00	28,100.00
202006 170001 2445	300342	天银机电	2020-06-17	2020-07-15	17.13	10,000.00	171,300.00

202006 170001 2457	601777	力帆股份	2020-06-17	2020-07- 15	4.49	10,000.00	44,900.00
202006 170001 2461	002400	省广集团	2020-06-17	2020-07- 15	10.49	20,000.00	209,800.00
202006 170001 2469	600831	广电网络	2020-06-17	2020-07- 15	7.72	20,000.00	154,400.00
202006 180000 0396	002640	跨境通	2020-06-18	2020-07- 16	6.49	16,500.00	107,085.00
202006 180000 0493	300182	捷成股份	2020-06-18	2020-07- 16	3.99	30,000.00	119,700.00
202006 190000 0162	000030	富奥股份	2020-06-19	2020-07- 17	6.39	10,000.00	63,900.00
202006 190000 0164	000016	深康佳 A	2020-06-19	2020-07- 17	6.76	10,000.00	67,600.00
202006 190000 0202	000417	合肥百货	2020-06-19	2020-07- 17	5.57	10,000.00	55,700.00
202006 190000 0289	002131	利欧股份	2020-06-19	2020-07- 17	3.86	19,200.00	74,112.00
202006 190000 0298	002154	报喜鸟	2020-06-19	2020-07- 17	3.10	10,000.00	31,000.00
202006 190000 0319	002292	奥飞娱乐	2020-06-19	2020-07- 17	8.42	10,000.00	84,200.00
202006 190000 0343	002537	海联金汇	2020-06-19	2020-07- 17	5.81	10,000.00	58,100.00
202006 190000 0368	300058	蓝色光标	2020-06-19	2020-07- 17	7.80	10,000.00	78,000.00
202006 190000 0494	601777	力帆股份	2020-06-19	2020-07- 17	4.49	10,000.00	44,900.00
202006 190000	600838	上海九百	2020-06-19	2020-07- 17	7.99	10,000.00	79,900.00

0547							
202006 230000 1578	002277	友阿股份	2020-06-23	2020-07-07	4.00	26,100.00	104,400.00
202006 230000 1590	600609	金杯汽车	2020-06-23	2020-07-07	7.00	17,600.00	123,200.00
202006 230000 1596	600936	广西广电	2020-06-23	2020-07-07	3.85	30,000.00	115,500.00
202006 230000 1648	000700	模塑科技	2020-06-23	2020-07-07	7.48	10,000.00	74,800.00
202006 230000 1802	000665	湖北广电	2020-06-23	2020-07-07	5.23	10,000.00	52,300.00
202006 240000 0560	000829	天音控股	2020-06-24	2020-07-22	6.55	10,000.00	65,500.00
202006 240000 1433	002154	报喜鸟	2020-06-24	2020-07-22	3.10	10,000.00	31,000.00
202006 240000 2111	601801	皖新传媒	2020-06-24	2020-07-22	5.56	10,000.00	55,600.00
202006 240000 6577	000016	深康佳 A	2020-06-24	2020-07-22	6.76	11,700.00	79,092.00
202006 240000 6587	000887	中鼎股份	2020-06-24	2020-07-22	7.85	10,000.00	78,500.00
202006 240000 6607	600107	美尔雅	2020-06-24	2020-07-22	7.08	10,000.00	70,800.00
202006 290000 0452	002292	奥飞娱乐	2020-06-29	2020-07-13	8.42	10,000.00	84,200.00
202006 290000 0489	002429	兆驰股份	2020-06-29	2020-07-27	4.95	35,200.00	174,240.00
202006 290000 0537	002563	森马服饰	2020-06-29	2020-07-27	7.05	17,600.00	124,080.00
202006	000541	佛山照明	2020-06-29	2020-07-	5.17	20,000.00	103,400.00

290000 3738				27			
202006 290000 3756	600418	江淮汽车	2020-06-29	2020-07- 27	8.83	20,000.00	176,600.00
202006 290000 3760	600733	北汽蓝谷	2020-06-29	2020-07- 27	6.43	20,000.00	128,600.00
202006 290000 3770	600986	科达股份	2020-06-29	2020-07- 27	4.83	40,000.00	193,200.00
合计	-	-	-	-	-	1,854,100.0 0	13,160,719. 00

#### 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	72,200.00	44,300.00
未评级	-	-
合计	72,200.00	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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金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
<b>资产：</b>					
银行存款	3,017,918.65	-	-	-	3,017,918.65
结算备付金	48,104.19	-	-	-	48,104.19
存出保证金	4,396.91	-	-	-	4,396.91
交易性金融资产	72,200.00	-	-	330,858,300.52	330,930,500.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,126.66	10,126.66
应收股利	-	-	-	44,726.30	44,726.30
资产总计	3,142,619.75	-	-	330,913,153.48	334,055,773.23
<b>负债：</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	141,606.07	141,606.07
应付托管费	-	-	-	28,321.21	28,321.21
应付交易费用	-	-	-	79,899.46	79,899.46
应交税费	-	-	-	580.92	580.92
其他负债	-	-	-	128,544.75	128,544.75
负债总计	-	-	-	378,952.41	378,952.41
利率敏感度缺口	3,142,619.75	-	-	330,534,201.07	333,676,820.82
<b>上年度末 2019年12月31日</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>资产：</b>					
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
<b>负债：</b>					
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

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末持有的债券占基金资产净值较小，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	330,858,300.52	99.16	312,168,930.90	99.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	72,200.00	0.02	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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>330,930,500.52</b>	<b>99.18</b>	<b>312,213,230.90</b>	<b>99.16</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2020年6月30日	2019年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	17,684,871.50	16,044,683.41
	业绩比较基准下降 5%	-17,684,871.50	-16,044,683.41

#### 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 329,210,447.27 元，属于第二层次的余额为人民币 1,720,053.25 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 306,504,448.65 元，属于第二层次的余额为人民币 5,708,782.25 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	330,858,300.52	99.04
	其中：股票	330,858,300.52	99.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	72,200.00	0.02
	其中：债券	72,200.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,066,022.84	0.92
8	其他各项资产	59,249.87	0.02
9	合计	334,055,773.23	100.00

注：（1）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。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 13,160,719.00 元，占

基金资产净值比例 3.94%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	220,217,827.94	66.00
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	25,114,266.22	7.53
G	交通运输、仓储和邮政业	624,788.70	0.19
H	住宿和餐饮业	2,632,808.41	0.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,821,670.96	5.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	206,451.00	0.06
L	租赁和商务服务业	31,678,335.56	9.49
M	科学研究和技术服务业	320,599.08	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	1,643,613.72	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,001,744.10	1.20
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	27,596,194.83	8.27
S	综合	-	-
	合计	330,858,300.52	99.16

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	534,152	31,936,948.08	9.57
2	000651	格力电器	525,202	29,710,677.14	8.90
3	601888	中国中免	113,650	17,505,509.50	5.25
4	000100	TCL 科技	1,574,955	9,764,721.00	2.93
5	600690	海尔智家	440,646	7,799,434.20	2.34
6	002594	比亚迪	105,521	7,576,407.80	2.27
7	600104	上汽集团	408,034	6,932,497.66	2.08
8	002027	分众传媒	1,196,170	6,662,666.90	2.00
9	300413	芒果超媒	82,912	5,405,862.40	1.62
10	600741	华域汽车	183,512	3,815,214.48	1.14
11	002024	苏宁易购	433,543	3,802,172.11	1.14
12	600660	福耀玻璃	163,240	3,406,818.80	1.02
13	300144	宋城演艺	182,597	3,158,928.10	0.95
14	002131	利欧股份	786,426	3,035,604.36	0.91
15	000625	长安汽车	227,101	2,498,111.00	0.75
16	600637	东方明珠	238,547	2,301,978.55	0.69
17	002607	中公教育	78,982	2,191,750.50	0.66
18	600859	王府井	45,212	2,059,406.60	0.62
19	600699	均胜电子	86,440	2,058,136.40	0.62
20	601799	星宇股份	16,100	2,044,700.00	0.61
21	600177	雅戈尔	323,351	1,927,171.96	0.58
22	600066	宇通客车	154,627	1,886,449.40	0.57
23	300058	蓝色光标	231,966	1,809,334.80	0.54
24	002572	索菲亚	74,386	1,797,909.62	0.54
25	600037	歌华有线	113,701	1,728,255.20	0.52
26	002508	老板电器	55,275	1,719,605.25	0.52
27	603833	欧派家居	14,705	1,704,309.50	0.51
28	002400	省广集团	162,367	1,703,229.83	0.51
29	600655	豫园股份	180,900	1,602,774.00	0.48
30	600297	广汇汽车	472,101	1,506,002.19	0.45
31	300251	光线传媒	136,617	1,490,491.47	0.45
32	002739	万达电影	96,800	1,478,136.00	0.44
33	000581	威孚高科	68,188	1,410,127.84	0.42
34	601689	拓普集团	49,138	1,370,950.20	0.41
35	600418	江淮汽车	154,251	1,362,036.33	0.41
36	002705	新宝股份	37,300	1,360,704.00	0.41
37	002032	苏泊尔	19,100	1,356,100.00	0.41
38	002242	九阳股份	35,759	1,332,737.93	0.40
39	600959	江苏有线	349,261	1,313,221.36	0.39
40	600733	北汽蓝谷	203,400	1,307,862.00	0.39
41	000564	供销大集	279,800	1,256,302.00	0.38

42	600839	四川长虹	429,934	1,233,910.58	0.37
43	002920	德赛西威	19,200	1,177,536.00	0.35
44	000800	一汽解放	107,349	1,152,928.26	0.35
45	600977	中国电影	86,900	1,140,997.00	0.34
46	601966	玲珑轮胎	55,900	1,129,180.00	0.34
47	002126	银轮股份	92,206	1,128,601.44	0.34
48	600060	海信视像	91,379	1,110,254.85	0.33
49	002351	漫步者	51,763	1,093,234.56	0.33
50	601633	长城汽车	141,491	1,092,310.52	0.33
51	002429	兆驰股份	210,802	1,043,469.90	0.31
52	300133	华策影视	143,042	1,037,054.50	0.31
53	600754	锦江酒店	37,303	1,035,158.25	0.31
54	300770	新媒股份	4,500	1,006,470.00	0.30
55	002085	万丰奥威	152,756	989,858.88	0.30
56	300526	中潜股份	7,900	981,180.00	0.29
57	601238	广汽集团	108,021	972,189.00	0.29
58	600166	福田汽车	535,800	964,440.00	0.29
59	300182	捷成股份	239,800	956,802.00	0.29
60	603816	顾家家居	20,980	944,309.80	0.28
61	600373	中文传媒	79,098	931,774.44	0.28
62	002925	盈趣科技	16,000	927,040.00	0.28
63	000681	视觉中国	48,900	910,518.00	0.27
64	002048	宁波华翔	58,345	900,846.80	0.27
65	600398	海澜之家	154,404	898,631.28	0.27
66	600729	重庆百货	28,426	887,459.72	0.27
67	002605	姚记科技	23,309	885,742.00	0.27
68	601098	中南传媒	83,600	884,488.00	0.27
69	600258	首旅酒店	57,468	883,283.16	0.26
70	000016	深康佳 A	130,112	879,557.12	0.26
71	300792	壹网壹创	5,000	870,800.00	0.26
72	601718	际华集团	255,600	848,592.00	0.25
73	002251	步步高	60,340	843,553.20	0.25
74	000501	鄂武商 A	53,720	842,329.60	0.25
75	603596	伯特利	23,800	837,760.00	0.25
76	000917	电广传媒	131,986	834,151.52	0.25
77	002640	跨境通	126,950	823,905.50	0.25
78	002035	华帝股份	80,980	820,327.40	0.25
79	002292	奥飞娱乐	94,800	798,216.00	0.24
80	600682	南京新百	78,353	794,499.42	0.24
81	603486	科沃斯	26,280	793,918.80	0.24
82	601058	赛轮轮胎	220,005	776,617.65	0.23
83	000559	万向钱潮	160,269	775,701.96	0.23
84	000793	华闻集团	186,000	766,320.00	0.23
85	000839	中信国安	319,450	760,291.00	0.23

86	000810	创维数字	61,900	747,752.00	0.22
87	600986	科达股份	154,240	744,979.20	0.22
88	002239	奥特佳	182,299	743,779.92	0.22
89	002798	帝欧家居	22,689	736,711.83	0.22
90	002625	光启技术	100,307	727,225.75	0.22
91	000156	华数传媒	66,740	722,794.20	0.22
92	601717	郑煤机	121,400	715,046.00	0.21
93	600612	老凤祥	14,816	713,983.04	0.21
94	600628	新世界	60,255	706,791.15	0.21
95	002434	万里扬	77,988	676,935.84	0.20
96	000887	中鼎股份	85,300	669,605.00	0.20
97	600138	中青旅	67,373	664,971.51	0.20
98	002959	小熊电器	5,400	664,200.00	0.20
99	002563	森马服饰	94,200	664,110.00	0.20
100	002042	华孚时尚	106,113	661,083.99	0.20
101	300280	紫天科技	13,200	650,760.00	0.20
102	000921	海信家电	52,556	639,080.96	0.19
103	600337	美克家居	144,300	637,806.00	0.19
104	000901	航天科技	60,254	613,988.26	0.18
105	002503	搜于特	216,014	606,999.34	0.18
106	601928	凤凰传媒	88,900	604,520.00	0.18
107	002291	星期六	25,800	595,980.00	0.18
108	603489	八方股份	4,200	592,158.00	0.18
109	688318	财富趋势	2,439	580,311.27	0.17
110	603377	东方时尚	34,240	567,014.40	0.17
111	002867	周大生	25,550	566,443.50	0.17
112	000700	模塑科技	74,704	558,785.92	0.17
113	300616	尚品宅配	9,240	555,139.20	0.17
114	000955	欣龙控股	62,700	551,760.00	0.17
115	601311	骆驼股份	60,300	547,524.00	0.16
116	601929	吉视传媒	253,490	542,468.60	0.16
117	600070	浙江富润	42,430	538,436.70	0.16
118	601010	文峰股份	172,100	535,231.00	0.16
119	600609	金杯汽车	76,275	533,925.00	0.16
120	002419	天虹股份	55,900	533,845.00	0.16
121	603129	春风动力	7,800	532,038.00	0.16
122	600936	广西广电	136,200	524,370.00	0.16
123	000030	富奥股份	82,039	524,229.21	0.16
124	002832	比音勒芬	30,515	522,416.80	0.16
125	002416	爱施德	72,106	517,721.08	0.16
126	300342	天银机电	30,207	517,445.91	0.16
127	000526	紫光学大	9,000	515,340.00	0.15
128	001696	宗申动力	80,000	515,200.00	0.15
129	600831	广电网络	66,200	511,064.00	0.15

130	600742	一汽富维	61,507	505,587.54	0.15
131	600593	大连圣亚	12,000	504,360.00	0.15
132	002489	浙江永强	126,652	504,074.96	0.15
133	601163	三角轮胎	37,300	493,852.00	0.15
134	000796	凯撒旅业	46,700	487,548.00	0.15
135	603515	欧普照明	17,620	482,259.40	0.14
136	603208	江山欧派	4,930	480,182.00	0.14
137	603650	彤程新材	20,500	477,035.00	0.14
138	000829	天音控股	72,100	472,255.00	0.14
139	300755	华致酒行	14,560	471,744.00	0.14
140	002512	达华智能	93,301	471,170.05	0.14
141	603766	隆鑫通用	119,558	462,689.46	0.14
142	002668	奥马电器	101,007	459,581.85	0.14
143	002283	天润工业	105,004	456,767.40	0.14
144	601019	山东出版	72,900	455,625.00	0.14
145	002277	友阿股份	113,612	454,448.00	0.14
146	002083	孚日股份	84,600	453,456.00	0.14
147	002707	众信旅游	61,442	442,382.40	0.13
148	688505	复旦张江	17,792	440,885.76	0.13
149	002488	金固股份	82,451	436,990.30	0.13
150	002213	特 尔 佳	24,000	430,800.00	0.13
151	600480	凌云股份	38,280	428,736.00	0.13
152	000913	钱江摩托	31,700	426,999.00	0.13
153	300432	富临精工	51,620	423,284.00	0.13
154	002537	海联金汇	72,020	418,436.20	0.13
155	000801	四川九洲	71,440	417,209.60	0.13
156	002970	锐明技术	6,000	409,980.00	0.12
157	600694	大商股份	17,064	409,365.36	0.12
158	600220	江苏阳光	145,300	403,934.00	0.12
159	601965	中国汽研	46,005	401,163.60	0.12
160	600523	贵航股份	23,565	399,662.40	0.12
161	600676	交运股份	71,795	399,180.20	0.12
162	600400	红豆股份	117,980	398,772.40	0.12
163	603305	旭升股份	10,400	398,112.00	0.12
164	000726	鲁 泰 A	52,386	397,085.88	0.12
165	300242	佳云科技	59,100	392,424.00	0.12
166	002616	长青集团	34,500	391,575.00	0.12
167	000541	佛山照明	75,216	388,866.72	0.12
168	300783	三只松鼠	5,100	387,498.00	0.12
169	601801	皖新传媒	69,489	386,358.84	0.12
170	603786	科博达	5,100	384,285.00	0.12
171	002343	慈文传媒	44,186	383,534.48	0.11
172	002031	巨轮智能	204,800	382,976.00	0.11
173	600707	彩虹股份	83,502	380,769.12	0.11

174	600825	新华传媒	60,800	377,568.00	0.11
175	600006	东风汽车	93,100	375,193.00	0.11
176	603313	梦百合	15,850	372,950.50	0.11
177	002045	国光电器	38,156	372,402.56	0.11
178	603096	新经典	6,300	371,889.00	0.11
179	300336	新文化	75,042	369,206.64	0.11
180	601366	利群股份	60,100	367,211.00	0.11
181	002510	天汽模	85,708	365,116.08	0.11
182	002328	新朋股份	62,073	363,127.05	0.11
183	600261	阳光照明	101,411	360,009.05	0.11
184	600757	长江传媒	70,671	359,715.39	0.11
185	000957	中通客车	55,210	359,417.10	0.11
186	002614	奥佳华	32,688	358,587.36	0.11
187	000802	北京文化	58,379	357,863.27	0.11
188	002293	罗莱生活	38,600	356,664.00	0.11
189	000417	合肥百货	63,592	354,207.44	0.11
190	300160	秀强股份	43,191	352,870.47	0.11
191	002154	报喜鸟	113,445	351,679.50	0.11
192	002084	海鸥住工	38,750	350,687.50	0.11
193	600996	贵广网络	49,000	349,370.00	0.10
194	603825	华扬联众	10,800	347,220.00	0.10
195	000996	中国中期	40,169	347,060.16	0.10
196	603801	志邦家居	12,960	345,902.40	0.10
197	002327	富安娜	49,103	345,685.12	0.10
198	601777	力帆股份	76,489	343,435.61	0.10
199	603197	保隆科技	11,580	342,536.40	0.10
200	603008	喜临门	31,896	342,244.08	0.10
201	002677	浙江美大	30,100	339,528.00	0.10
202	600336	澳柯玛	55,800	337,590.00	0.10
203	600987	航民股份	62,939	336,723.65	0.10
204	600088	中视传媒	23,165	335,660.85	0.10
205	600623	华谊集团	65,000	335,400.00	0.10
206	601949	中国出版	63,700	334,425.00	0.10
207	000599	青岛双星	77,183	327,255.92	0.10
208	600653	申华控股	181,317	322,744.26	0.10
209	002699	美盛文化	52,962	321,479.34	0.10
210	002776	柏堡龙	37,629	320,599.08	0.10
211	002540	亚太科技	74,000	318,940.00	0.10
212	300788	中信出版	6,600	318,054.00	0.10
213	002362	汉王科技	17,702	315,626.66	0.09
214	002029	七匹狼	61,600	311,696.00	0.09
215	603179	新泉股份	13,666	309,398.24	0.09
216	002664	长鹰信质	23,272	307,655.84	0.09
217	600229	城市传媒	40,902	303,492.84	0.09



218	603306	华懋科技	21,700	301,630.00	0.09
219	002486	嘉麟杰	77,500	300,700.00	0.09
220	603730	岱美股份	9,300	299,925.00	0.09
221	000589	贵州轮胎	74,300	299,429.00	0.09
222	000550	江铃汽车	24,200	299,354.00	0.09
223	000665	湖北广电	57,107	298,669.61	0.09
224	600838	上海九百	37,300	298,027.00	0.09
225	603385	惠达卫浴	21,540	296,821.20	0.09
226	000038	深大通	24,340	295,731.00	0.09
227	002448	中原内配	56,550	290,101.50	0.09
228	600448	华纺股份	73,340	286,759.40	0.09
229	002406	远东传动	45,705	286,570.35	0.09
230	300061	旗天科技	47,200	284,616.00	0.09
231	002003	伟星股份	52,980	284,502.60	0.09
232	601900	南方传媒	31,300	282,952.00	0.08
233	603587	地素时尚	16,760	282,406.00	0.08
234	002472	双环传动	55,952	279,200.48	0.08
235	600933	爱柯迪	20,000	278,400.00	0.08
236	600136	当代文体	34,000	277,440.00	0.08
237	000785	居然之家	35,000	277,200.00	0.08
238	603868	飞科电器	5,600	276,248.00	0.08
239	002355	兴民智通	50,613	273,310.20	0.08
240	300577	开润股份	10,100	272,397.00	0.08
241	002087	新野纺织	76,091	271,644.87	0.08
242	002181	粤传媒	54,100	268,877.00	0.08
243	002654	万润科技	61,500	267,525.00	0.08
244	600730	中国高科	54,600	266,448.00	0.08
245	002404	嘉欣丝绸	40,400	265,428.00	0.08
246	002397	梦洁股份	44,500	265,220.00	0.08
247	002516	旷达科技	85,600	263,648.00	0.08
248	601595	上海电影	17,400	262,392.00	0.08
249	002238	天威视讯	37,310	253,334.90	0.08
250	002284	亚太股份	51,535	251,490.80	0.08
251	000025	特力 A	13,685	250,846.05	0.08
252	300258	精锻科技	23,600	248,508.00	0.07
253	000719	中原传媒	35,700	248,472.00	0.07
254	300793	佳禾智能	9,340	248,444.00	0.07
255	601858	中国科传	27,600	248,124.00	0.07
256	002103	广博股份	37,300	245,434.00	0.07
257	601127	小康股份	29,500	245,145.00	0.07
258	600054	黄山旅游	29,900	243,087.00	0.07
259	000888	峨眉山 A	42,902	242,825.32	0.07
260	002780	三夫户外	13,600	241,672.00	0.07
261	600327	大东方	61,800	241,638.00	0.07

262	000892	欢瑞世纪	57,100	241,533.00	0.07
263	002631	德尔未来	31,100	238,848.00	0.07
264	002363	隆基机械	29,100	238,038.00	0.07
265	600107	美尔雅	33,500	237,180.00	0.07
266	002621	美吉姆	38,480	236,267.20	0.07
267	002712	思美传媒	33,790	236,192.10	0.07
268	002186	全聚德	21,500	235,210.00	0.07
269	600335	国机汽车	50,870	235,019.40	0.07
270	002662	京威股份	69,804	233,145.36	0.07
271	600630	龙头股份	34,589	232,783.97	0.07
272	601599	鹿港文化	82,696	232,375.76	0.07
273	603610	麒盛科技	7,237	232,162.96	0.07
274	603788	宁波高发	12,940	232,014.20	0.07
275	603355	莱克电气	9,300	231,477.00	0.07
276	600715	文投控股	86,378	230,629.26	0.07
277	002536	飞龙股份	35,021	228,336.92	0.07
278	603158	腾龙股份	10,100	227,553.00	0.07
279	000753	漳州发展	80,800	227,048.00	0.07
280	002878	元隆雅图	10,354	226,545.52	0.07
281	300304	云意电气	60,530	225,776.90	0.07
282	002627	宜昌交运	39,650	225,608.50	0.07
283	002033	丽江股份	38,355	225,527.40	0.07
284	000026	飞亚达	25,225	225,259.25	0.07
285	002659	凯文教育	40,600	224,924.00	0.07
286	603035	常熟汽饰	19,600	223,832.00	0.07
287	000850	华茂股份	65,900	223,401.00	0.07
288	300279	和晶科技	41,820	222,900.60	0.07
289	002721	金一文化	58,354	220,578.12	0.07
290	603579	荣泰健康	8,100	217,242.00	0.07
291	002059	云南旅游	47,100	217,131.00	0.07
292	000980	*ST 众泰	141,510	216,510.30	0.06
293	603608	天创时尚	20,040	213,826.80	0.06
294	002101	广东鸿图	31,011	213,045.57	0.06
295	000521	长虹美菱	71,901	211,388.94	0.06
296	600135	乐凯胶片	32,238	210,836.52	0.06
297	002345	潮宏基	63,201	210,459.33	0.06
298	002612	朗姿股份	20,602	209,728.36	0.06
299	600712	南宁百货	38,000	209,380.00	0.06
300	603366	日出东方	37,300	209,253.00	0.06
301	603598	引力传媒	12,600	208,782.00	0.06
302	603558	健盛集团	24,200	208,604.00	0.06
303	002965	祥鑫科技	5,300	206,965.00	0.06
304	600052	浙江广厦	60,900	206,451.00	0.06
305	603348	文灿股份	10,800	206,388.00	0.06

306	002725	跃岭股份	17,900	206,208.00	0.06
307	000607	华媒控股	47,400	206,190.00	0.06
308	600303	曙光股份	62,879	205,614.33	0.06
309	603214	爱婴室	6,700	205,489.00	0.06
310	600960	渤海汽车	66,400	205,176.00	0.06
311	002454	松芝股份	43,863	204,401.58	0.06
312	300217	东方电热	88,984	201,993.68	0.06
313	603358	华达科技	11,000	200,420.00	0.06
314	603808	歌力思	15,495	199,575.60	0.06
315	603999	读者传媒	33,500	199,325.00	0.06
316	300651	金陵体育	5,990	198,868.00	0.06
317	603600	永艺股份	17,600	198,352.00	0.06
318	000428	华天酒店	59,300	197,469.00	0.06
319	300473	德尔股份	8,000	195,440.00	0.06
320	603809	豪能股份	14,580	193,476.60	0.06
321	300176	派生科技	36,094	192,020.08	0.06
322	600071	凤凰光学	19,700	191,287.00	0.06
323	002590	万安科技	27,901	190,005.81	0.06
324	603586	金麒麟	11,900	188,853.00	0.06
325	300375	鹏翎股份	52,300	188,803.00	0.06
326	002634	棒杰股份	32,103	188,444.61	0.06
327	600686	金龙汽车	33,410	188,432.40	0.06
328	600738	兰州民百	36,300	187,671.00	0.06
329	603477	振静股份	14,000	187,460.00	0.06
330	601811	新华文轩	18,400	187,128.00	0.06
331	603239	浙江仙通	12,600	186,732.00	0.06
332	000721	西安饮食	40,700	185,592.00	0.06
333	002676	顺威股份	58,700	185,492.00	0.06
334	300625	三雄极光	13,000	183,820.00	0.06
335	603123	翠微股份	24,400	183,000.00	0.05
336	603303	得邦照明	17,040	182,668.80	0.05
337	300694	蠡湖股份	15,000	182,250.00	0.05
338	603721	中广天择	7,600	182,096.00	0.05
339	601999	出版传媒	25,700	181,956.00	0.05
340	603365	水星家纺	12,400	178,932.00	0.05
341	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
342	002592	ST 八菱	23,102	177,885.40	0.05
343	603839	安正时尚	13,960	177,292.00	0.05
344	603238	诺邦股份	4,200	177,240.00	0.05
345	601566	九牧王	20,094	176,827.20	0.05
346	601339	百隆东方	52,400	176,588.00	0.05
347	603661	恒林股份	3,500	176,050.00	0.05
348	300695	兆丰股份	2,300	175,835.00	0.05
349	600469	风神股份	39,300	174,492.00	0.05

350	603040	新坐标	5,995	174,454.50	0.05
351	300580	贝斯特	9,300	173,910.00	0.05
352	002708	光洋股份	27,325	173,513.75	0.05
353	300507	苏奥传感	17,888	172,261.44	0.05
354	002740	爱迪尔	26,401	171,342.49	0.05
355	002906	华阳集团	11,000	170,390.00	0.05
356	300272	开能健康	33,915	169,914.15	0.05
357	603519	立霸股份	12,900	169,764.00	0.05
358	002348	高乐股份	66,204	167,496.12	0.05
359	300749	顶固集创	11,900	166,005.00	0.05
360	000757	浩物股份	38,677	165,924.33	0.05
361	300643	万通智控	11,600	163,908.00	0.05
362	600818	中路股份	13,864	163,733.84	0.05
363	002853	皮阿诺	7,200	163,296.00	0.05
364	600386	北巴传媒	46,954	161,991.30	0.05
365	300464	星徽精密	12,300	161,991.00	0.05
366	603390	通达电气	12,300	160,884.00	0.05
367	603655	朗博科技	4,900	160,671.00	0.05
368	603180	金牌厨柜	3,360	158,524.80	0.05
369	300660	江苏雷利	9,036	158,491.44	0.05
370	000678	襄阳轴承	32,107	157,966.44	0.05
371	300612	宣亚国际	5,200	156,572.00	0.05
372	300585	奥联电子	11,200	156,464.00	0.05
373	603121	华培动力	12,076	155,659.64	0.05
374	603326	我乐家居	7,900	153,734.00	0.05
375	600232	金鹰股份	25,500	153,255.00	0.05
376	300428	四通新材	10,100	152,712.00	0.05
377	600370	三房巷	46,400	151,728.00	0.05
378	600081	东风科技	14,600	150,672.00	0.05
379	002674	兴业科技	14,100	149,601.00	0.04
380	603557	起步股份	16,600	147,242.00	0.04
381	002722	金轮股份	12,300	146,985.00	0.04
382	603009	北特科技	25,050	146,542.50	0.04
383	002953	日丰股份	6,000	145,200.00	0.04
384	300707	威唐工业	9,200	145,176.00	0.04
385	002574	明牌珠宝	30,771	143,700.57	0.04
386	603103	横店影视	8,880	140,304.00	0.04
387	603701	德宏股份	15,340	139,900.80	0.04
388	002731	萃华珠宝	17,870	139,743.40	0.04
389	300547	川环科技	17,720	138,393.20	0.04
390	603787	新日股份	7,100	138,237.00	0.04
391	300403	汉宇集团	28,124	137,245.12	0.04
392	002265	西仪股份	18,500	135,975.00	0.04
393	002591	恒大高新	17,900	135,324.00	0.04

394	603667	五洲新春	17,000	133,620.00	0.04
395	603055	台华新材	17,860	131,449.60	0.04
396	600679	上海凤凰	10,700	130,968.00	0.04
397	002905	金逸影视	13,160	129,889.20	0.04
398	000622	恒立实业	34,700	129,778.00	0.04
399	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
400	300622	博士眼镜	9,900	124,443.00	0.04
401	300805	电声股份	5,400	123,768.00	0.04
402	300745	欣锐科技	6,700	123,347.00	0.04
403	002193	如意集团	18,300	123,342.00	0.04
404	603997	继峰股份	17,900	122,973.00	0.04
405	603398	邦宝益智	13,800	121,854.00	0.04
406	603982	泉峰汽车	7,000	121,030.00	0.04
407	600178	东安动力	26,900	119,705.00	0.04
408	603726	朗迪集团	8,600	119,626.00	0.04
409	002759	天际股份	18,703	119,512.17	0.04
410	603335	迪生力	24,890	119,472.00	0.04
411	002790	瑞尔特	19,460	118,900.60	0.04
412	603013	亚普股份	7,200	116,064.00	0.03
413	300528	幸福蓝海	17,400	115,536.00	0.03
414	600749	西藏旅游	13,200	113,520.00	0.03
415	002703	浙江世宝	26,700	113,208.00	0.03
416	601086	国芳集团	23,300	112,306.00	0.03
417	002098	浔兴股份	20,802	111,290.70	0.03
418	300808	久量股份	5,600	110,880.00	0.03
419	603081	大丰实业	9,400	106,126.00	0.03
420	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
421	300756	中山金马	4,780	103,248.00	0.03
422	603101	汇嘉时代	16,440	102,585.60	0.03
423	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
424	002763	汇洁股份	14,400	100,800.00	0.03
425	002765	蓝黛传动	22,400	98,112.00	0.03
426	002888	惠威科技	4,400	98,032.00	0.03
427	603136	天目湖	4,015	97,163.00	0.03
428	000524	岭南控股	15,600	96,096.00	0.03
429	002485	希努尔	19,000	94,240.00	0.03
430	002615	哈尔斯	19,100	90,916.00	0.03
431	603006	联明股份	8,900	90,246.00	0.03
432	300781	因赛集团	3,000	88,650.00	0.03
433	603629	利通电子	3,500	87,255.00	0.03
434	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.03
435	002863	今飞凯达	17,520	84,446.40	0.03
436	603848	好太太	6,100	83,265.00	0.02
437	603551	奥普家居	5,100	82,773.00	0.02

438	603266	天龙股份	7,000	81,760.00	0.02
439	603992	松霖科技	5,100	81,396.00	0.02
440	603657	春光科技	4,660	78,940.40	0.02
441	603767	中马传动	10,720	76,433.60	0.02
442	603677	奇精机械	6,740	69,489.40	0.02
443	603709	中源家居	2,800	64,484.00	0.02
444	002875	安奈儿	4,600	63,802.00	0.02
445	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
446	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
447	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
448	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
449	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
450	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

#### 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	000651	格力电器	3,753,882.00	1.19
2	000100	TCL 科技	1,847,045.00	0.59
3	601888	中国中免	1,503,793.00	0.48
4	300413	芒果超媒	1,364,091.00	0.43
5	600104	上汽集团	1,351,816.00	0.43
6	002602	世纪华通	1,309,455.00	0.42
7	600690	海尔智家	1,286,663.00	0.41
8	000333	美的集团	1,211,497.00	0.38
9	002131	利欧股份	1,122,610.00	0.36
10	300792	壹网壹创	1,084,701.00	0.34
11	002291	星期六	805,076.00	0.26
12	601717	郑煤机	754,533.22	0.24
13	600741	华域汽车	740,668.00	0.24
14	600733	北汽蓝谷	726,857.00	0.23
15	002959	小熊电器	663,710.00	0.21
16	300144	宋城演艺	644,905.00	0.20
17	603489	八方股份	618,155.00	0.20
18	600660	福耀玻璃	600,674.68	0.19
19	600655	豫园股份	595,554.00	0.19
20	300280	紫天科技	594,712.00	0.19

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	002602	世纪华通	4,606,971.20	1.46
2	688012	中微公司	3,836,747.80	1.22
3	601888	中国中免	3,398,037.00	1.08
4	000333	美的集团	2,688,099.00	0.85
5	000651	格力电器	2,274,435.08	0.72
6	600104	上汽集团	2,103,565.00	0.67
7	600690	海尔智家	1,879,978.00	0.60
8	000158	常山北明	1,288,705.10	0.41
9	600177	雅戈尔	1,229,826.00	0.39
10	601916	浙商银行	1,137,319.75	0.36
11	600741	华域汽车	1,128,678.00	0.36
12	300027	华谊兄弟	1,009,739.20	0.32
13	600660	福耀玻璃	974,440.00	0.31
14	601077	渝农商行	729,298.22	0.23
15	600637	东方明珠	690,864.10	0.22
16	600699	均胜电子	680,591.00	0.22
17	601799	星宇股份	593,823.00	0.19
18	600066	宇通客车	545,480.00	0.17
19	688312	燕麦科技	471,378.26	0.15
20	002426	*ST 胜利	464,004.50	0.15

#### 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	62,813,358.31
卖出股票收入（成交）总额	75,407,086.47

#### 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）	72,200.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	72,200.00	0.02

#### 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	128113	比音转债	442	44,200.00	0.01
2	113589	天创转债	280	28,000.00	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	4,396.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	44,726.30
4	应收利息	10,126.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,249.87

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	000100	TCL 科技	124,000.00	0.04	转融通出借 流通受限

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证全指可选消费交 易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
1,345	163,684.8 3	208,208 ,796.00	94.57%	11,947, 298.00	5.43%	207,337,66 8.00	94.18%

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。

### 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	钱中明	1,833,000.00	0.83%
2	中国建设银行股份有限公司-长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	774,100.00	0.35%
3	朱益	330,000.00	0.15%
4	陈伟杰	309,700.00	0.14%

5	李晓晨	291,600.00	0.13%
6	程冬	279,100.00	0.13%
7	涂慧芬	207,200.00	0.09%
8	陈荣荣	150,000.00	0.07%
9	高洁	149,500.00	0.07%
10	王浩	144,519.00	0.07%
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	207,337,668.00	94.18%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年6月3日）基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	220,156,094.00
本报告期基金总申购份额	54,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	220,156,094.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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	
广发证券	3	86,006.38	0.06%	-	-	-
长江证券	2	9,938,620.93	7.33%	7,268.74	7.34%	新增 2 个
银河证券	2	27,193,723.78	20.06%	19,882.99	20.07%	-
海通证券	2	41,522,642.51	30.64%	30,365.01	30.66%	-
安信证券	1	56,796,985.60	41.90%	41,535.81	41.93%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
中信证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
广发证券	372,600.00	30.57%	-	-	-	-
长江证券	28,000.00	2.30%	-	-	-	-
银河证券	400,114.70	32.83%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	418,174.69	34.31%	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
7	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
8	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
9	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-11

	协议并更新招募说明书及摘要的公告		
--	------------------	--	--

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20200101-20200630	211,408,868.00	50,000,000.00	54,071,200.00	207,337,668.00	94.18%
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>							

### 11.2 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可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

### 12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 12.3 查阅方式

- 1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2. 网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十七日