# 广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金
# 2020 年年度报告
# 2020 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

**1.2 目录**

**§1 重要提示及目录** 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
**§2 基金简介** 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况** 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
**§4 管理人报告** 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
**§5 托管人报告** 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
**§6 审计报告** 17
6.1 审计意见 17
6.2 形成审计意见的基础 17
6.3 其他信息 17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 18
**§7 年度财务报表** 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 24
**§8 投资组合报告** 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 ..... 57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... 57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... 57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 58
8.12 投资组合报告附注 ..... 58
**§9 基金份额持有人信息** ..... 59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 59
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 ..... 60
**§10 开放式基金份额变动** ..... 60
**§11 重大事件揭示** ..... 61
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 61
11.4 基金投资策略的改变 ..... 61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 61
11.8 其他重大事件 ..... 63
**§12 影响投资者决策的其他重要信息** ..... 63
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 63
**§13 备查文件目录** ..... 64
13.1 备查文件目录 ..... 64
13.2 存放地点 ..... 64
13.3 查阅方式 ..... 64

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 广发中证全指汽车指数 | |
| 基金主代码 | 004854 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 7 月 31 日 | |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,460,818,157.22 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004854 | 004855 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,717,529,107.01 份 | 743,289,050.21 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪中证全指汽车指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证全指汽车指数中的基准权重构建指数化投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指汽车指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。 |
| 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。<br>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 | 中国建设银行股份有限公司 |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 程才良 | 李申 |
| | 联系电话 | 020-83936666 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | ccl@gffunds.com.cn | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 95105828 | (021)60637111 |
| 传真 | | 020-89899158 | 021-60635778 |
| 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） | 北京市西城区金融大街25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 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 510308 | 100033 |
| 法定代表人 | | 孙树明 | 田国立 |

**2.4 信息披露方式**

| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gffunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼 |

**2.5 其他相关资料**

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国 北京 |
| 注册登记机构 | 广发基金管理有限公司 | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2020 年 | | 2019 年 | | 2018 年 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C |
| 本期已实现收益 | 117,298,305.33 | 52,704,326.86 | -4,023,641.50 | -4,584,164.27 | -1,228,150.09 | -830,779.91 |
| 本期利润 | 295,420,304.01 | 150,100,138.44 | -1,788,249.65 | -3,622,169.42 | -7,632,895.59 | -5,380,431.44 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.7667 | 0.7229 | -0.0506 | -0.0845 | -0.3415 | -0.3356 |
| 本期加权平均净值利润率 | 63.34% | 62.15% | -6.64% | -11.14% | -41.47% | -41.16% |
| 本期基金份额净值增长率 | 78.89% | 78.54% | 11.84% | 11.89% | -32.82% | -32.88% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **2020 年末** | | **2019 年末** | | **2018 年末** | |
| | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C |
| 期末可供分配利润 | -191,953,504.48 | -84,383,218.59 | -12,060,664.18 | -14,959,840.14 | -7,469,357.07 | -5,526,296.71 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1118 | -0.1135 | -0.2394 | -0.2395 | -0.3199 | -0.3203 |
| 期末基金资产净值 | 2,336,844,542.21 | 1,009,250,329.46 | 38,323,448.31 | 47,508,885.71 | 15,876,322.86 | 11,727,308.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.3606 | 1.3578 | 0.7606 | 0.7605 | 0.6801 | 0.6797 |
| **3.1.3 累计** | **2020 年末** | | **2019 年末** | | **2018 年末** | |

| 期末指标 | 广发中证全指汽车指数A | 广发中证全指汽车指数C | 广发中证全指汽车指数A | 广发中证全指汽车指数C | 广发中证全指汽车指数A | 广发中证全指汽车指数C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 基金份额累计净值增长率 | 36.06% | 35.78% | -23.93% | -23.95% | -31.99% | -32.03% |

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

**广发中证全指汽车指数 A：**

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 35.84% | 2.41% | 38.05% | 2.49% | -2.21% | -0.08% |
| 过去六个月 | 73.97% | 2.14% | 74.88% | 2.21% | -0.91% | -0.07% |
| 过去一年 | 78.89% | 2.06% | 77.79% | 2.12% | 1.10% | -0.06% |
| 过去三年 | 34.39% | 1.65% | 26.31% | 1.69% | 8.08% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.06% | 1.58% | 27.12% | 1.62% | 8.94% | -0.04% |

**广发中证全指汽车指数 C：**

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 35.78% | 2.41% | 38.05% | 2.49% | -2.27% | -0.08% |
| 过去六个月 | 73.81% | 2.14% | 74.88% | 2.21% | -1.07% | -0.07% |
| 过去一年 | 78.54% | 2.06% | 77.79% | 2.12% | 0.75% | -0.06% |
| 过去三年 | 34.08% | 1.65% | 26.31% | 1.69% | 7.77% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 35.78% | 1.58% | 27.12% | 1.62% | 8.66% | -0.04% |

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

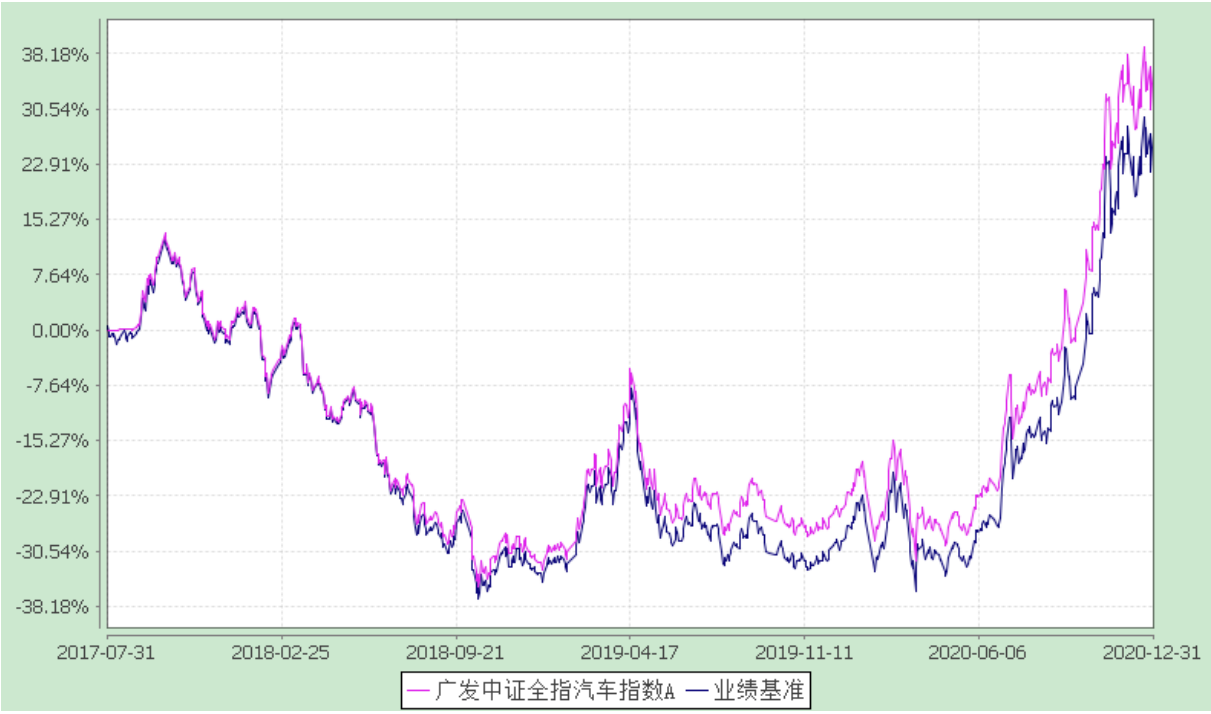
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金

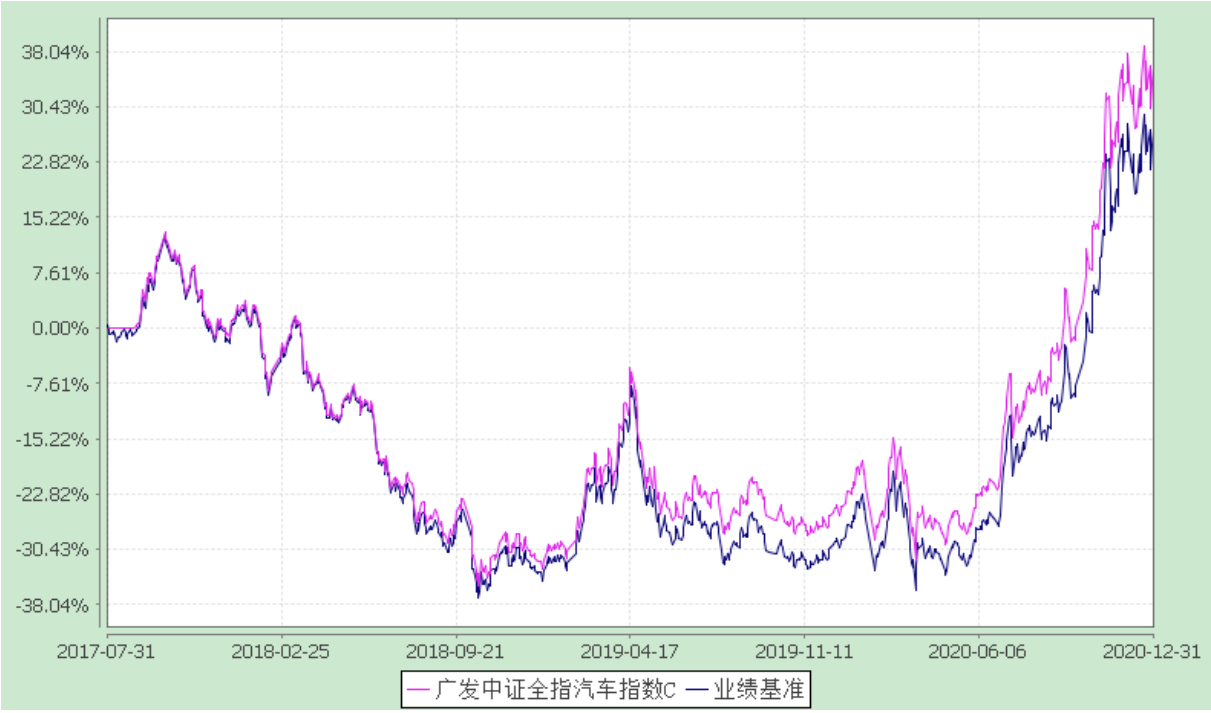
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 7 月 31 日至 2020 年 12 月 31 日)

**广发中证全指汽车指数 A**




**广发中证全指汽车指数 C**

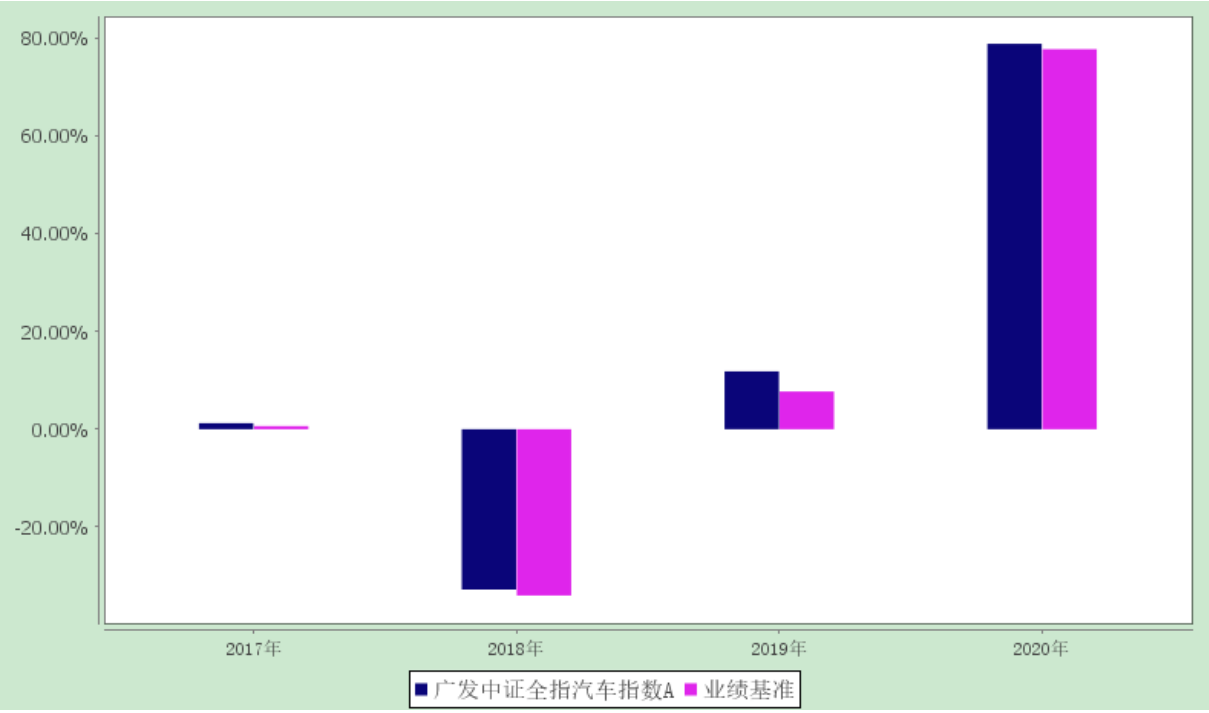



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

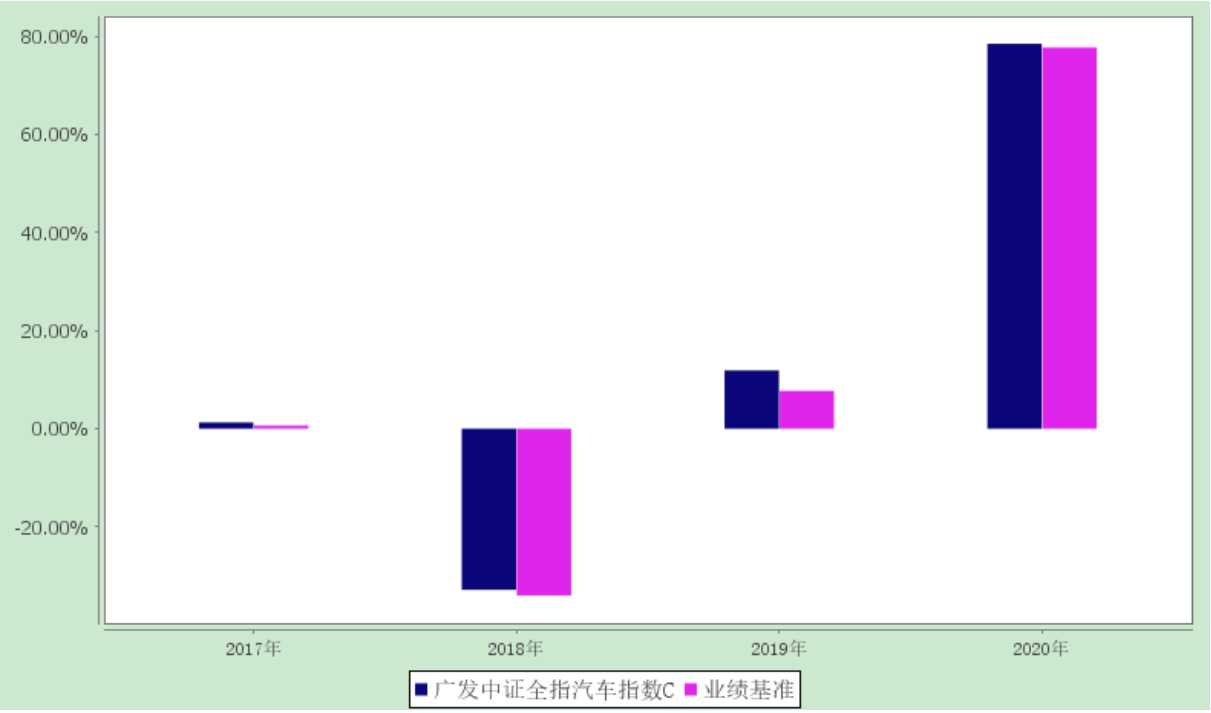
广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

**广发中证全指汽车指数 A**




**广发中证全指汽车指数 C**




注：本基金的基金合同于 2017 年 7 月 31 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4. 1 基金管理人及基金经理情况

#### 4. 1. 1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、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、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、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 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 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 罗国庆 | 本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒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 1000 指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 100 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 | 2017-07-31 | - | 11 年 | 罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部副总经理 | | | | |

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，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。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合

经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的是中证全指汽车指数，该指数选取中证全指样本股中的汽车行业股票组成，以反映该行业股票的整体表现。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2020 年 A 股市场呈现震荡上行趋势，沪深 300 指数上涨 27.21%，中证 500 指数上涨 20.87%，创业板指上涨 64.96%，中证全指汽车指数上涨 82.66%。2020 年年初，在疫情的冲击下，各国的经济活动被迫陷于停滞，股市也出现较大幅度的波动。主要经济体随即推出经济刺激政策。年末，随着全球尤其是欧美疫情的稳定及局部好转、各国政府经济刺激计划的推出以及复工复产的有序进行，市场风险偏好抬升；叠加国内较好的出口和经济增长数据，A 股震荡上行。2020 年上半年，汽车板块跟随着 A 股整体走势，呈现震荡上行状态。在三、四季度疫情改善后，汽车板块的超额收益较为明显。一方面是因为国内疫情得到有效控制后，需求端强劲复苏，另一方面是因为龙头车企不断推出新车型以及加速电动化。

在基金投资运作方面，本报告期内，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，运作过程中未发生任何风险事件。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 78.89%，C 类基金份额净值增长率为 78.54%，同期业绩比较基准收益率为 77.79%。

## 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 2021 年，在经济持续修复和新能源车出现历史性产业机遇的背景下，汽车产业仍然具有相当高的投资价值。首先，经济复苏的步伐在上半年仍将延续，汽车产业的需求将得到进一步释放。另外，2020 年一季度由于疫情影响，乘用车的销量基数较低，2021 年一季度乘用车销量同比数据或将会有较高的增长。最后，政策和车企从供需两端强力推进，产业价值链迎来重构，汽车板块作为顺周期板块，有望迎来高速增长。因此，我们看好汽车板块短期以及中长期的投资机会。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司严格遵循“合规、诚信、专业、稳健”的证券基金行业文化核心理念，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

（1）推进实施公司企业文化建设，将企业文化建设的基本要求制度化、规范化，加大内部合规培训、品牌宣传及投资者教育的力度。

（2）持续加强制度建设，积极推进公司内部管理进一步精细化、规范化、科学化。

（3）逐步提高专兼职合规管理人员工作质量，推动形成合规稽核部门与专兼职合规管理员的信息及资源互动机制，确保合规管理覆盖公司所有重要业务流程和风险点。

（4）深入完善宣传推介材料管理机制，努力提高材料的制作质量与审核效率，推进宣传材料规范化。

（5）根据监管精神和要求，逐条逐项研究制定整改办法和整改措施，稳步推进资管新规及销售新规的整改工作。

（6）针对投研交业务、基金销售业务、中后台运营业务的不同特点，结合监管最新颁布的监管要求、行业及公司发生的热点合规风险事件，开展差别化培训。

（7）认真做好合规审核及咨询服务，对公司内部重大决策、新产品和新业务方案、产品运作过程中的重要法律文本等进行审查，通过及时有效的事前事中审核把关，监督防范业务中可能存在的风险。

（8）平稳推进信息披露与监管报送工作，包括报送历史信息披露文件、完成存量公募基金产品资料概要制作及复核、改造信息披露及销售系统、完成信息披露和监管定期数据常规工作等。

（9）强化投资组合日常的合规风险监控，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水

平。

（10）持续夯实反洗钱工作基础，不断完善客户身份识别工作，不断优化公司反洗钱系统，并积极尝试运用新技术提升反洗钱工作质量。

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

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

安永华明（2021）审字第 60873695_G81 号

广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

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

### 6.3 其他信息

广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告

中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

**6.4 管理层和治理层对财务报表的责任**

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

在编制财务报表时，管理层负责评估广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。

**6.5 注册会计师对财务报表审计的责任**

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

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

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

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

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致

对广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金不能持续经营。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

赵雅　马婧

中国 北京

2021 年 3 月 26 日

# §7　年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | - | - |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 251,859,433.02 | 6,932,970.56 |
| 结算备付金 | | 18,858,486.59 | 31,999.62 |
| 存出保证金 | | 644,249.23 | 12,512.11 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,165,064,254.32 | 80,439,541.96 |
| 其中：股票投资 | | 3,165,064,254.32 | 80,439,541.96 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 172,512,070.48 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 55,828.56 | 1,508.80 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 24,603,072.97 | 813,619.30 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,633,597,395.17 | 88,232,152.35 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2020 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2019 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 280,383,229.34 | 2,285,071.82 |
| 应付管理人报酬 | | 1,638,724.91 | 37,314.85 |
| 应付托管费 | | 327,744.96 | 7,462.98 |
| 应付销售服务费 | | 212,220.06 | 8,482.40 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 4,670,381.17 | 26,485.90 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 270,223.06 | 35,000.38 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 负债合计 | | 287,502,523.50 | 2,399,818.33 |
| **所有者权益：** | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,460,818,157.22 | 112,852,838.34 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 885,276,714.45 | -27,020,504.32 |
| 所有者权益合计 | | 3,346,094,871.67 | 85,832,334.02 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,633,597,395.17 | 88,232,152.35 |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，广发中证全指汽车指数 A 基金份额净值人民币 1.3606 元，基金份额总额 1,717,529,107.01 份；广发中证全指汽车指数 C 基金份额净值人民币 1.3578 元，基金份额总额 743,289,050.21 份；总份额总额 2,460,818,157.22 份。

**7.2 利润表**

会计主体：广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | **458,897,753.16** | **-4,696,230.49** |
| 1.利息收入 | | 305,950.24 | 38,531.45 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 305,765.81 | 38,531.45 |
| 债券利息收入 | | 184.43 | - |
| 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） | | 171,922,572.27 | -8,154,406.47 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 169,633,690.93 | -9,104,515.72 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 92,376.86 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 2,196,504.48 | 950,109.25 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 275,517,810.26 | 3,197,386.70 |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 11,151,420.39 | 222,257.83 |
| **减：二、费用** | | **13,377,310.71** | **714,188.58** |
| 1．管理人报酬 | | 3,355,074.50 | 297,575.99 |
| 2．托管费 | | 671,014.83 | 59,515.22 |
| 3．销售服务费 | | 460,586.94 | 65,096.51 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.18 | 8,563,241.24 | 221,018.62 |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．税金及附加 | | 0.65 | - |
| 7．其他费用 | 7.4.7.19 | 327,392.55 | 70,982.24 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **445,520,442.45** | **-5,410,419.07** |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **445,520,442.45** | **-5,410,419.07** |

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| **项目** | **本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日** | | |
|---|---|---|---|
| | **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 112,852,838.34 | -27,020,504.32 | 85,832,334.02 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 445,520,442.45 | 445,520,442.45 |
| 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） | 2,347,965,318.88 | 466,776,776.32 | 2,814,742,095.20 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,640,357,193.93 | 1,739,207,548.30 | 9,379,564,742.23 |
| 2.基金赎回款 | -5,292,391,875.05 | -1,272,430,771.98 | -6,564,822,647.03 |
| 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） | 2,460,818,157.22 | 885,276,714.45 | 3,346,094,871.67 |
| **项目** | **上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日** | | |
| | **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 40,599,285.53 | -12,995,653.78 | 27,603,631.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -5,410,419.07 | -5,410,419.07 |
| 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） | 72,253,552.81 | -8,614,431.47 | 63,639,121.34 |
| 其中：1.基金申购款 | 344,231,856.00 | -69,440,161.73 | 274,791,694.27 |
| 2.基金赎回款 | -271,978,303.19 | 60,825,730.26 | -211,152,572.93 |
| 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） | 112,852,838.34 | -27,020,504.32 | 85,832,334.02 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明 主管会计工作负责人：窦刚 会计机构负责人：张晓章

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2017]783 号文《关于准予广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金注册的批复》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《广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2017 年 7 月 31 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期为 2017 年 7 月 24 日至 2017 年 7 月 26 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 25,377,874.75 元，有效认购户数为 71 户。其中广发中证全指汽车指数 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 10,012,984.07 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 200.24 元；广发中证全指汽车指数 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 15,364,690.10 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 0.34 元。认购资金在募集期间产生的利息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 2021 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则 （以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国

证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

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

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可

根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

（6）债券投资收益/（损失）

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

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

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

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

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

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

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

**7.4.4.11 基金的收益分配政策**

（1）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（3）由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

**7.4.4.12 分部报告**

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

（1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增

值税纳税人；

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

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

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

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 251,859,433.02 | 6,932,970.56 |
| 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 | 251,859,433.02 | 6,932,970.56 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 2,898,698,494.87 | 3,165,064,254.32 | 266,365,759.45 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,898,698,494.87 | 3,165,064,254.32 | 266,365,759.45 |
| 项目 | | 上年度末 | | |

| | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 89,591,592.77 | 80,439,541.96 | -9,152,050.81 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 89,591,592.77 | 80,439,541.96 | -9,152,050.81 |

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 46,174.74 | 1,486.80 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | 318.89 | 6.16 |
| 应收结算备付金利息 | 9,334.93 | 15.84 |

| | | |
|---|---|---|
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 55,828.56 | 1,508.80 |

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 4,670,381.17 | 26,485.90 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 4,670,381.17 | 26,485.90 |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 5,212.84 | 0.38 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 154,000.00 | 25,000.00 |
| 应付指数使用费 | 111,010.22 | 10,000.00 |
| 合计 | 270,223.06 | 35,000.38 |

**7.4.7.9 实收基金**

广发中证全指汽车指数 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 50,384,112.49 | 50,384,112.49 |
| 本期申购 | 4,842,425,576.16 | 4,842,425,576.16 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,175,280,581.64 | -3,175,280,581.64 |
| 本期末 | 1,717,529,107.01 | 1,717,529,107.01 |

广发中证全指汽车指数 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 62,468,725.85 | 62,468,725.85 |
| 本期申购 | 2,797,931,617.77 | 2,797,931,617.77 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,117,111,293.41 | -2,117,111,293.41 |
| 本期末 | 743,289,050.21 | 743,289,050.21 |

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

**7.4.7.10 未分配利润**

广发中证全指汽车指数 A

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 | -9,269,762.41 | -2,790,901.77 | -12,060,664.18 |
| 本期利润 | 117,298,305.33 | 178,121,998.68 | 295,420,304.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -299,982,047.40 | 635,937,842.77 | 335,955,795.37 |
| 其中：基金申购款 | -813,976,838.92 | 1,965,957,805.48 | 1,151,980,966.56 |
| 基金赎回款 | 513,994,791.52 | -1,330,019,962.71 | -816,025,171.19 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 本期末 | -191,953,504.48 | 811,268,939.68 | 619,315,435.20 |

广发中证全指汽车指数 C

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 | -11,482,705.11 | -3,477,135.03 | -14,959,840.14 |
| 本期利润 | 52,704,326.86 | 97,395,811.58 | 150,100,138.44 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -125,604,840.34 | 256,425,821.29 | 130,820,980.95 |
| 其中：基金申购款 | -480,937,110.47 | 1,068,163,692.21 | 587,226,581.74 |
| 基金赎回款 | 355,332,270.13 | -811,737,870.92 | -456,405,600.79 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -84,383,218.59 | 350,344,497.84 | 265,961,279.25 |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 269,500.79 | 36,867.47 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | 1,613.07 | 269.01 |
| 结算备付金利息收入 | 34,651.95 | 1,394.97 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 305,765.81 | 38,531.45 |

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 2,398,672,241.09 | 53,245,818.51 |

| | | |
|---|---|---|
| 减：卖出股票成本总额 | 2,229,038,550.16 | 62,350,334.23 |
| 买卖股票差价收入 | 169,633,690.93 | -9,104,515.72 |

**7.4.7.13 债券投资收益**

**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31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 | 92,376.86 | - |
| 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 | 92,376.86 | - |

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,295,566.70 | - |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,203,000.00 | - |
| 减：应收利息总额 | 189.84 | - |
| 买卖债券差价收入 | 92,376.86 | - |

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,196,504.48 | 950,109.25 |
| 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 | 2,196,504.48 | 950,109.25 |

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 275,517,810.26 | 3,197,386.70 |
| ——股票投资 | 275,517,810.26 | 3,197,386.70 |
| ——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 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 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 | 275,517,810.26 | 3,197,386.70 |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 10,736,043.35 | 200,212.76 |
| 基金转换费收入 | 415,268.53 | 22,045.07 |
| 其他 | 108.51 | - |
| 合计 | 11,151,420.39 | 222,257.83 |

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 8,563,241.24 | 221,018.62 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 8,563,241.24 | 221,018.62 |

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 34,000.00 | 25,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | - |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 30,023.51 | 5,982.24 |
| 指数使用费 | 143,369.04 | 40,000.00 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 327,392.55 | 70,982.24 |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 中国建设银行股份有限公司 | 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、注册登记与过户机构、直销机构 |
| 广发证券股份有限公司 | 基金管理人控股股东、代销机构 |

| | |
|---|---|
| 深圳市前海香江金融控股集团有限公司 | 基金管理人股东 |
| 烽火通信科技股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广州科技金融创新投资控股有限公司 | 基金管理人股东 |
| 嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司） | 基金管理人全资子公司 |
| 瑞元资本管理有限公司 | 基金管理人控股子公司 |
| 珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理人控股子公司（瑞元资本管理有限公司）的控股子公司 |
| GF International Asset Management (UK) Company Limited（广发国际资产管理（英国）有限公司） | 基金管理人全资子公司（GF International Investment Management Limited）的全资子公司 |

注：根据 2020 年 12 月 26 日发布的《广发基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》，经广发基金管理有限公司股东会决议，并经中国证券监督管理委员会《关于核准广发基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2020]3563 号）核准，新增嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）为广发基金管理有限公司股东，上述事项已完成工商变更登记手续。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31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 | 4,504,667.00 | 0.06% | 164,480,418.36 | 100.00% |

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 4,195.20 | 0.08% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 153,161.87 | 100.00% | 26,485.90 | 100.00% |

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,355,074.50 | 297,575.99 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,316,022.51 | 118,115.29 |

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×0.50%÷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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 671,014.83 | 59,515.22 |

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×0.10%÷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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C | 合计 |
| 广发基金管理有限公司 | - | 32,627.56 | 32,627.56 |
| 广发证券股份有限公司 | - | 1,777.69 | 1,777.69 |
| 合计 | - | 34,405.25 | 34,405.25 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |

| | 广发中证全指汽车指数A | 广发中证全指汽车指数C | 合计 |
|---|---|---|---|
| 广发证券股份有限公司 | - | 101.09 | 101.09 |
| 广发基金管理有限公司 | - | 5,515.70 | 5,515.70 |
| 合计 | - | 5,616.79 | 5,616.79 |

注：本基金 A类基金份额不收取销售服务费， C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%（根据《广发基金管理有限公司关于旗下部分基金实施销售服务费率优惠的公告》，本基金自2018年5月16日起适用0.20%优惠费率，结束时间届时将另行公告）的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.20%（优惠费率）÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由登记机构代付给销售机构。基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

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

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

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

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

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

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 广发中证全指汽车指数A | 广发中证全指汽车指数C | 广发中证全指汽车指数A | 广发中证全指汽车指数C |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,001,200.02 | - | 10,001,200.02 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,001,200.02 | - | 10,001,200.02 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.58% | - | 19.85% | - |

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

广发中证全指汽车指数 A

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。

广发中证全指汽车指数 C

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。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---|---|---|

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|---|---|---|---|---|
| 中国建设银行股份有限公司 | 251,859,433.02 | 269,500.79 | 6,932,970.56 | 36,867.47 |

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

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688777 | 中控技术 | 2020-11-13 | 2021-05-24 | 新股流通受限 | 35.73 | 77.12 | 5,794.00 | 207,019.62 | 446,833.28 | - |
| 300903 | 科翔股份 | 2020-10-29 | 2021-05-06 | 新股流通受限 | 13.06 | 30.47 | 4,775.00 | 62,361.50 | 145,494.25 | - |
| 688093 | 世华科技 | 2020-09-22 | 2021-03-30 | 新股流通受限 | 17.55 | 23.63 | 3,939.00 | 69,129.45 | 93,078.57 | - |
| 300920 | 润阳科技 | 2020-12-17 | 2021-06-25 | 新股流通受限 | 26.93 | 34.13 | 2,503.00 | 67,405.79 | 85,427.39 | - |
| 688698 | 伟创电气 | 2020-12-22 | 2021-06-29 | 新股流通受限 | 10.75 | 15.29 | 4,751.00 | 51,073.25 | 72,642.79 | - |
| 688377 | 迪威尔 | 2020-06-29 | 2021-01-08 | 新股流通 | 16.42 | 18.68 | 3,216.00 | 52,806.72 | 60,074.88 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 300926 | 博俊科技 | 2020-12-29 | 2021-01-07 | 新股流通受限 | 10.76 | 10.76 | 3,584.00 | 38,563.84 | 38,563.84 | - |
| 300919 | 中伟股份 | 2020-12-15 | 2021-06-23 | 新股流通受限 | 24.60 | 61.51 | 610.00 | 15,006.00 | 37,521.10 | - |
| 300870 | 欧陆通 | 2020-08-13 | 2021-02-24 | 新股流通受限 | 36.81 | 65.67 | 478.00 | 17,595.18 | 31,390.26 | - |
| 300900 | 广联航空 | 2020-10-19 | 2021-04-29 | 新股流通受限 | 17.87 | 33.16 | 879.00 | 15,707.73 | 29,147.64 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-01-07 | 新股流通受限 | 13.39 | 13.39 | 2,163.00 | 28,962.57 | 28,962.57 | - |
| 300894 | 火星人 | 2020-12-24 | 2021-06-30 | 新股流通受限 | 14.07 | 36.97 | 628.00 | 8,835.96 | 23,217.16 | - |
| 300891 | 惠云钛业 | 2020-09-10 | 2021-03-17 | 新股流通受限 | 3.64 | 16.40 | 1,143.00 | 4,160.52 | 18,745.20 | - |
| 300908 | 仲景食品 | 2020-11-13 | 2021-05-24 | 新股流通受限 | 39.74 | 60.44 | 285.00 | 11,325.90 | 17,225.40 | - |
| 300898 | 熊猫乳品 | 2020-10-09 | 2021-04-16 | 新股流通受限 | 10.78 | 33.03 | 496.00 | 5,346.88 | 16,382.88 | - |
| 300909 | 汇创达 | 2020-11-11 | 2021-05-18 | 新股流通受限 | 29.57 | 40.67 | 386.00 | 11,414.02 | 15,698.62 | - |
| 300877 | 金春股份 | 2020-08-17 | 2021-03-03 | 新股流通受限 | 30.54 | 50.85 | 307.00 | 9,375.78 | 15,610.95 | - |
| 300871 | 回盛生物 | 2020-08-13 | 2021-02-24 | 新股流通受限 | 33.61 | 38.70 | 391.00 | 13,141.51 | 15,131.70 | - |
| 300925 | 法本信息 | 2020-12-21 | 2021-06-30 | 新股流通受限 | 20.08 | 37.33 | 353.00 | 7,088.24 | 13,177.49 | - |
| 300882 | 万胜智能 | 2020-08-27 | 2021-03-10 | 新股流通受限 | 10.33 | 25.79 | 440.00 | 4,545.20 | 11,347.60 | - |
| 30086 | 杰美 | 2020-0 | 2021-0 | 新股 | 41.26 | 43.28 | 248.00 | 10,232 | 10,733 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 8 | 特 | 8-12 | 2-24 | 流通受限 | | | | .48 | .44 | |
| 300911 | 亿田智能 | 2020-11-24 | 2021-06-03 | 新股流通受限 | 24.35 | 33.06 | 309.00 | 7,524.15 | 10,215.54 | - |
| 300864 | 南大环境 | 2020-08-13 | 2021-02-25 | 新股流通受限 | 71.71 | 90.85 | 108.00 | 7,744.68 | 9,811.80 | - |
| 300918 | 南山智尚 | 2020-12-15 | 2021-06-22 | 新股流通受限 | 4.97 | 8.94 | 1,063.00 | 5,283.11 | 9,503.22 | - |
| 300917 | 特发服务 | 2020-12-14 | 2021-06-21 | 新股流通受限 | 18.78 | 31.94 | 281.00 | 5,277.18 | 8,975.14 | - |
| 605277 | 新亚电子 | 2020-12-25 | 2021-01-06 | 新股流通受限 | 16.95 | 16.95 | 507.00 | 8,593.65 | 8,593.65 | - |
| 003030 | 祖名股份 | 2020-12-25 | 2021-01-06 | 新股流通受限 | 15.18 | 15.18 | 480.00 | 7,286.40 | 7,286.40 | - |
| 003031 | 中瓷电子 | 2020-12-24 | 2021-01-04 | 新股流通受限 | 15.27 | 15.27 | 387.00 | 5,909.49 | 5,909.49 | - |

注：截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

**7.4.12.2 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 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其相关的信用风险不重大。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种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。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

**7.4.13.4 市场风险**

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

**7.4.13.4.1 利率风险**

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

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 251,859,433.02 | - | - | - | 251,859,433.02 |
| 结算备付金 | 18,858,486.59 | - | - | - | 18,858,486.59 |
| 存出保证金 | 644,249.23 | - | - | - | 644,249.23 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,165,064,254.32 | 3,165,064,254.32 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 172,512,070.48 | 172,512,070.4 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 8 |
| 应收利息 | - | - | - | 55,828.56 | 55,828.56 |
| 应收申购款 | - | - | - | 24,603,072.97 | 24,603,072.97 |
| 资产总计 | 271,362,168.84 | - | - | 3,362,235,226.33 | 3,633,597,395.17 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 280,383,229.34 | 280,383,229.34 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,638,724.91 | 1,638,724.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | 327,744.96 | 327,744.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 212,220.06 | 212,220.06 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,670,381.17 | 4,670,381.17 |
| 其他负债 | - | - | - | 270,223.06 | 270,223.06 |
| 负债总计 | - | - | - | 287,502,523.50 | 287,502,523.50 |
| 利率敏感度缺口 | 271,362,168.84 | - | - | 3,074,732,702.83 | 3,346,094,871.67 |
| **上年度末 2019 年 12 月 31 日** | **1 年以内** | **1-5 年** | **5 年以上** | **不计息** | **合计** |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 6,932,970.56 | - | - | - | 6,932,970.56 |
| 结算备付金 | 31,999.62 | - | - | - | 31,999.62 |
| 存出保证金 | 12,512.11 | - | - | - | 12,512.11 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 80,439,541.96 | 80,439,541.96 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,508.80 | 1,508.80 |
| 应收申购款 | - | - | - | 813,619.30 | 813,619.30 |
| 资产总计 | 6,977,482.29 | - | - | 81,254,670.06 | 88,232,152.35 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,285,071.82 | 2,285,071.82 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 37,314.85 | 37,314.85 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,462.98 | 7,462.98 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 8,482.40 | 8,482.40 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 26,485.90 | 26,485.90 |
| 其他负债 | - | - | - | 35,000.38 | 35,000.38 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,399,818.33 | 2,399,818.33 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 利率敏感度缺口 | 6,977,482.29 | - | - | 78,854,851.73 | 85,832,334.02 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**7.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

**7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析**

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

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

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>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 | 3,165,064,254.32 | 94.59 | 80,439,541.96 | 93.72 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,165,064,254.32 | 94.59 | 80,439,541.96 | 93.72 |

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变。 | | |
|---|---|---|---|
| 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<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
| | 上升 5% | 159,262,198.80 | 4,227,678.14 |
| | 下降 5% | -159,262,198.80 | -4,227,678.14 |

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

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

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 3,163,777,552.07 元，属于第二层次的余额为人民币 1,286,702.25 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 79,297,087.04 元，属于第二层次的余额为人民币 1,142,454.92 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。

# §8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 3,165,064,254.32 | 87.11 |
| | 其中：股票 | 3,165,064,254.32 | 87.11 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 270,717,919.61 | 7.45 |
| 8 | 其他各项资产 | 197,815,221.24 | 5.44 |
| 9 | 合计 | 3,633,597,395.17 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,859,482,818.04 | 85.46 |
| 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 | 243,823,137.41 | 7.29 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,434,645.40 | 0.43 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 478,727.01 | 0.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 8,975.14 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 46,826,139.52 | 1.40 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 9,811.80 | 0.00 |
| 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 | - | - |
| | 合计 | 3,165,064,254.32 | 94.59 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 2,572,305 | 499,798,861.50 | 14.94 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 18,525,396 | 452,760,678.24 | 13.53 |
| 3 | 000625 | 长安汽车 | 17,832,147 | 390,167,376.36 | 11.66 |
| 4 | 601633 | 长城汽车 | 9,714,858 | 367,318,780.98 | 10.98 |
| 5 | 600066 | 宇通客车 | 10,618,793 | 179,669,977.56 | 5.37 |
| 6 | 600733 | 北汽蓝谷 | 16,756,143 | 145,275,759.81 | 4.34 |
| 7 | 600418 | 江淮汽车 | 10,593,679 | 129,560,694.17 | 3.87 |
| 8 | 600166 | 福田汽车 | 36,796,900 | 115,910,235.00 | 3.46 |
| 9 | 601238 | 广汽集团 | 7,419,504 | 98,605,208.16 | 2.95 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 10 | 603129 | 春风动力 | 537,034 | 93,545,952.46 | 2.80 |
| 11 | 600297 | 广汇汽车 | 32,417,756 | 92,714,782.16 | 2.77 |
| 12 | 000800 | 一汽解放 | 7,368,681 | 86,066,194.08 | 2.57 |
| 13 | 600006 | 东风汽车 | 6,393,558 | 60,355,187.52 | 1.80 |
| 14 | 000913 | 钱江摩托 | 2,175,857 | 55,680,180.63 | 1.66 |
| 15 | 601965 | 中国汽研 | 3,161,792 | 46,826,139.52 | 1.40 |
| 16 | 601127 | 小康股份 | 2,014,900 | 34,414,492.00 | 1.03 |
| 17 | 000550 | 江铃汽车 | 1,660,878 | 34,280,521.92 | 1.02 |
| 18 | 000957 | 中通客车 | 3,790,206 | 33,088,498.38 | 0.99 |
| 19 | 603766 | 隆鑫通用 | 8,212,442 | 28,743,547.00 | 0.86 |
| 20 | 000996 | 中国中期 | 2,758,503 | 23,998,976.10 | 0.72 |
| 21 | 600653 | 申华控股 | 12,454,000 | 22,541,740.00 | 0.67 |
| 22 | 600686 | 金龙汽车 | 2,293,400 | 19,723,240.00 | 0.59 |
| 23 | 600303 | 曙光股份 | 4,322,300 | 19,234,235.00 | 0.57 |
| 24 | 600327 | 大东方 | 4,242,254 | 17,605,354.10 | 0.53 |
| 25 | 600335 | 国机汽车 | 3,495,673 | 17,373,494.81 | 0.52 |
| 26 | 000753 | 漳州发展 | 5,550,612 | 16,152,280.92 | 0.48 |
| 27 | 000025 | 特力 A | 942,238 | 15,923,822.20 | 0.48 |
| 28 | 002627 | 宜昌交运 | 2,723,518 | 14,434,645.40 | 0.43 |
| 29 | 002758 | 浙农股份 | 1,169,204 | 13,855,067.40 | 0.41 |
| 30 | 000757 | 浩物股份 | 2,659,900 | 11,916,352.00 | 0.36 |
| 31 | 600386 | 北巴传媒 | 3,225,623 | 11,741,267.72 | 0.35 |
| 32 | 600213 | 亚星客车 | 878,300 | 7,948,615.00 | 0.24 |
| 33 | 600099 | 林海股份 | 1,051,401 | 6,466,116.15 | 0.19 |
| 34 | 688777 | 中控技术 | 5,794 | 446,833.28 | 0.01 |
| 35 | 300903 | 科翔股份 | 4,875 | 149,722.25 | 0.00 |
| 36 | 688093 | 世华科技 | 3,939 | 93,078.57 | 0.00 |
| 37 | 300920 | 润阳科技 | 2,503 | 85,427.39 | 0.00 |
| 38 | 688698 | 伟创电气 | 4,751 | 72,642.79 | 0.00 |
| 39 | 688377 | 迪威尔 | 3,216 | 60,074.88 | 0.00 |
| 40 | 300926 | 博俊科技 | 3,584 | 38,563.84 | 0.00 |
| 41 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 37,521.10 | 0.00 |
| 42 | 300870 | 欧陆通 | 478 | 31,390.26 | 0.00 |
| 43 | 300900 | 广联航空 | 879 | 29,147.64 | 0.00 |
| 44 | 300927 | 江天化学 | 2,163 | 28,962.57 | 0.00 |
| 45 | 300894 | 火星人 | 628 | 23,217.16 | 0.00 |
| 46 | 003026 | 中晶科技 | 461 | 21,740.76 | 0.00 |
| 47 | 300891 | 惠云钛业 | 1,143 | 18,745.20 | 0.00 |
| 48 | 003029 | 吉大正元 | 716 | 18,716.24 | 0.00 |
| 49 | 003028 | 振邦智能 | 432 | 18,010.08 | 0.00 |
| 50 | 300908 | 仲景食品 | 285 | 17,225.40 | 0.00 |
| 51 | 605179 | 一鸣食品 | 939 | 16,582.74 | 0.00 |
| 52 | 300898 | 熊猫乳品 | 496 | 16,382.88 | 0.00 |
| 53 | 300909 | 汇创达 | 386 | 15,698.62 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 54 | 300877 | 金春股份 | 307 | 15,610.95 | 0.00 |
| 55 | 300871 | 回盛生物 | 391 | 15,131.70 | 0.00 |
| 56 | 300925 | 法本信息 | 353 | 13,177.49 | 0.00 |
| 57 | 300882 | 万胜智能 | 440 | 11,347.60 | 0.00 |
| 58 | 300868 | 杰美特 | 248 | 10,733.44 | 0.00 |
| 59 | 300911 | 亿田智能 | 309 | 10,215.54 | 0.00 |
| 60 | 300864 | 南大环境 | 108 | 9,811.80 | 0.00 |
| 61 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 9,503.22 | 0.00 |
| 62 | 300917 | 特发服务 | 281 | 8,975.14 | 0.00 |
| 63 | 605277 | 新亚电子 | 507 | 8,593.65 | 0.00 |
| 64 | 003030 | 祖名股份 | 480 | 7,286.40 | 0.00 |
| 65 | 003031 | 中瓷电子 | 387 | 5,909.49 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 1,006,152,031.20 | 1,172.23 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 737,857,090.21 | 859.65 |
| 3 | 000625 | 长安汽车 | 578,777,623.87 | 674.31 |
| 4 | 601633 | 长城汽车 | 398,634,548.86 | 464.43 |
| 5 | 600066 | 宇通客车 | 298,315,946.62 | 347.56 |
| 6 | 600733 | 北汽蓝谷 | 211,251,756.80 | 246.12 |
| 7 | 600166 | 福田汽车 | 187,918,861.24 | 218.94 |
| 8 | 600297 | 广汇汽车 | 187,812,860.60 | 218.81 |
| 9 | 600418 | 江淮汽车 | 171,417,554.15 | 199.71 |
| 10 | 601238 | 广汽集团 | 156,695,923.95 | 182.56 |
| 11 | 000800 | 一汽解放 | 150,781,466.70 | 175.67 |
| 12 | 603129 | 春风动力 | 134,311,701.24 | 156.48 |
| 13 | 000913 | 钱江摩托 | 94,534,917.13 | 110.14 |
| 14 | 601965 | 中国汽研 | 74,656,289.82 | 86.98 |
| 15 | 600006 | 东风汽车 | 64,142,047.65 | 74.73 |
| 16 | 000550 | 江铃汽车 | 53,077,511.80 | 61.84 |
| 17 | 603766 | 隆鑫通用 | 52,941,764.47 | 61.68 |
| 18 | 000957 | 中通客车 | 49,586,838.63 | 57.77 |
| 19 | 601127 | 小康股份 | 45,462,813.32 | 52.97 |
| 20 | 000996 | 中国中期 | 42,368,984.90 | 49.36 |
| 21 | 600653 | 申华控股 | 38,723,778.25 | 45.12 |
| 22 | 600335 | 国机汽车 | 35,405,501.10 | 41.25 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 23 | 600303 | 曙光股份 | 31,757,762.95 | 37.00 |
| 24 | 000025 | 特力 A | 29,320,487.06 | 34.16 |
| 25 | 600686 | 金龙汽车 | 29,058,022.75 | 33.85 |
| 26 | 600327 | 大东方 | 28,565,616.08 | 33.28 |
| 27 | 000753 | 漳州发展 | 27,132,227.73 | 31.61 |
| 28 | 002627 | 宜昌交运 | 25,227,298.85 | 29.39 |
| 29 | 002758 | 浙农股份 | 21,476,849.60 | 25.02 |
| 30 | 600386 | 北巴传媒 | 20,182,053.77 | 23.51 |
| 31 | 000757 | 浩物股份 | 19,506,800.00 | 22.73 |
| 32 | 600099 | 林海股份 | 11,915,960.59 | 13.88 |
| 33 | 600213 | 亚星客车 | 11,408,334.00 | 13.29 |
| 34 | 601777 | ST 力帆 | 2,652,932.00 | 3.09 |

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 643,120,597.24 | 749.28 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 293,760,945.32 | 342.25 |
| 3 | 000625 | 长安汽车 | 265,503,969.82 | 309.33 |
| 4 | 601633 | 长城汽车 | 192,045,468.61 | 223.74 |
| 5 | 600066 | 宇通客车 | 120,203,098.79 | 140.04 |
| 6 | 600733 | 北汽蓝谷 | 88,076,589.53 | 102.61 |
| 7 | 600418 | 江淮汽车 | 87,199,160.90 | 101.59 |
| 8 | 600166 | 福田汽车 | 80,908,384.00 | 94.26 |
| 9 | 601238 | 广汽集团 | 68,890,283.92 | 80.26 |
| 10 | 600297 | 广汇汽车 | 68,833,001.92 | 80.19 |
| 11 | 000800 | 一汽解放 | 61,027,485.96 | 71.10 |
| 12 | 603129 | 春风动力 | 57,724,136.00 | 67.25 |
| 13 | 000913 | 钱江摩托 | 39,015,925.54 | 45.46 |
| 14 | 600006 | 东风汽车 | 35,599,797.52 | 41.48 |
| 15 | 601965 | 中国汽研 | 31,655,462.83 | 36.88 |
| 16 | 000550 | 江铃汽车 | 23,428,699.91 | 27.30 |
| 17 | 601127 | 小康股份 | 22,037,841.00 | 25.68 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 18 | 000957 | 中通客车 | 22,017,431.96 | 25.65 |
| 19 | 603766 | 隆鑫通用 | 20,367,265.53 | 23.73 |
| 20 | 000996 | 中国中期 | 16,671,350.00 | 19.42 |
| 21 | 600653 | 申华控股 | 15,590,579.37 | 18.16 |
| 22 | 600335 | 国机汽车 | 14,283,812.86 | 16.64 |
| 23 | 600303 | 曙光股份 | 13,615,922.00 | 15.86 |
| 24 | 600327 | 大东方 | 12,602,133.72 | 14.68 |
| 25 | 600686 | 金龙汽车 | 12,591,039.00 | 14.67 |
| 26 | 000025 | 特力 A | 11,416,439.35 | 13.30 |
| 27 | 000753 | 漳州发展 | 11,054,664.00 | 12.88 |
| 28 | 002627 | 宜昌交运 | 9,903,943.94 | 11.54 |
| 29 | 000757 | 浩物股份 | 8,413,719.33 | 9.80 |
| 30 | 600386 | 北巴传媒 | 8,114,621.00 | 9.45 |
| 31 | 002758 | 浙农股份 | 7,473,941.00 | 8.71 |
| 32 | 600213 | 亚星客车 | 5,126,417.00 | 5.97 |
| 33 | 600099 | 林海股份 | 4,625,635.00 | 5.39 |
| 34 | 601777 | ST 力帆 | 4,331,809.76 | 5.05 |

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 5,038,145,452.26 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,398,672,241.09 |

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，重庆长安汽车股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 644,249.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | 172,512,070.48 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 55,828.56 |
| 5 | 应收申购款 | 24,603,072.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 197,815,221.24 |

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 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 |
| 广发中证全指汽车指数 A | 442,785 | 3,878.92 | 11,901,846.30 | 0.69% | 1,705,627,260.71 | 99.31% |
| 广发中证全指汽车指数 C | 113,522 | 6,547.53 | 3,325,048.55 | 0.45% | 739,964,001.66 | 99.55% |
| 合计 | 556,307 | 4,423.49 | 15,226,894.85 | 0.62% | 2,445,591,262.37 | 99.38% |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 广发中证全指汽车指数 A | 17.23 | 0.0000% |
| | 广发中证全指汽车指数 C | 743,731.56 | 0.1001% |
| | 合计 | 743,748.79 | 0.0302% |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 广发中证全指汽车指数 A | 0 |
| | 广发中证全指汽车指数 C | 0 |

| | | |
|---|---|---|
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 广发中证全指汽车指数 A | 0 |
| | 广发中证全指汽车指数 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

**9.4 发起式基金发起资金持有份额情况**

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,001,200.02 | 0.41% | 10,001,200.02 | 0.41% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,001,200.02 | 0.41% | 10,001,200.02 | 0.41% | 三年 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 广发中证全指汽车指数 A | 广发中证全指汽车指数 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2017 年 7 月 31 日）基金份额总额 | 10,013,184.31 | 15,364,690.44 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 50,384,112.49 | 62,468,725.85 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,842,425,576.16 | 2,797,931,617.77 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,175,280,581.64 | 2,117,111,293.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,717,529,107.01 | 743,289,050.21 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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；于 2020 年 12 月 11 日发布公告，自 2020 年 12 月 11 日起，林传辉先生不再担任公司总经理，王凡先生由公司副总经理转任公司总经理。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略新增存托凭证投资策略。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 广发证券 | 4 | 4,504,667.00 | 0.06% | 4,195.20 | 0.08% | 新增 2 个 |
| 江海证券 | 1 | 89,108,300.89 | 1.20% | 65,165.49 | 1.19% | 新增 1 个 |
| 申万宏源 | 1 | 253,847,978.62 | 3.42% | 236,410.37 | 4.31% | - |
| 野村东方国际 | 2 | 481,564,049.49 | 6.48% | 352,167.12 | 6.42% | 新增 2 个 |
| 光大证券 | 2 | 878,124,322.01 | 11.82% | 642,176.11 | 11.71% | 新增 1 个 |
| 中信证券 | 4 | 883,538,406.42 | 11.89% | 646,113.84 | 11.78% | 新增 2 个 |
| 东方证券 | 1 | 1,024,069,044.89 | 13.78% | 748,887.34 | 13.65% | - |
| 安信证券 | 2 | 1,081,174,442.70 | 14.55% | 790,661.25 | 14.42% | - |
| 方正证券 | 1 | 1,307,977,068.40 | 17.61% | 956,501.58 | 17.44% | 新增 1 个 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | 2 | 1,425,348,959.56 | 19.19% | 1,042,349.66 | 19.00% | 新增 2 个 |
| 宏信证券 | 2 | - | - | - | - | 新增 2 个 |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | 新增 2 个 |

注：1、交易席位选择标准：

（1）财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

（2）经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（3）具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

（4）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（5）能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

（6）能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

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

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

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1,203,000.00 | 48.15% | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1,295,566.70 | 51.85% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |

**11.8 其他重大事件**

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 19 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-01-04 |
| 2 | 关于增加坤元基金为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-01-07 |
| 3 | 关于增加陆享基金为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-01-16 |
| 4 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-01-17 |
| 5 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-02-28 |
| 6 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-03-27 |
| 7 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-04-21 |
| 8 | 关于广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金暂停申购业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-05-14 |
| 9 | 关于广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金恢复申购业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-05-20 |
| 10 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-07-20 |
| 11 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年中期报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-08-27 |
| 12 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金基金产品资料概要的提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-08-28 |
| 13 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-10-28 |
| 14 | 关于旗下部分基金调整投资范围并相应修订基金合同等法律文件的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020-11-26 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《存托

凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本公司就参与存托凭证投资事宜修订本基金基金合同等法律文件，本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金调整投资范围并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

2、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）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 19 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》。

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金募集的文件

（二）《广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

## 13.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 13.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址 http://www.gffunds.com.cn。

**广发基金管理有限公司**

**二〇二一年三月三十日**