

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资 基金

2021 年中期报告

2021 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：二〇二一年八月三十日

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 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48

8	基金份额持有人信息	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
9	开放式基金份额变动	50
10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议.....	50
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4	基金投资策略的改变.....	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8	其他重大事件.....	53
11	影响投资者决策的其他重要信息	53
12	备查文件目录	54
12.1	备查文件目录.....	54
12.2	存放地点.....	54
12.3	查阅方式.....	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指原材料 ETF
基金主代码	159944
交易代码	159944
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 25 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,608,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-07-06

注：本基金的扩位证券简称为“材料 ETF”。

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	中证全指原材料指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
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（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	4,621,891.69
本期利润	3,212,600.88
加权平均基金份额本期利润	0.1134
本期加权平均净值利润率	10.53%
本期基金份额净值增长率	15.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-1,355,812.89
期末可供分配基金份额利润	-0.0627
期末基金资产净值	24,596,802.49
期末基金份额净值	1.1383
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	13.83%

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）。

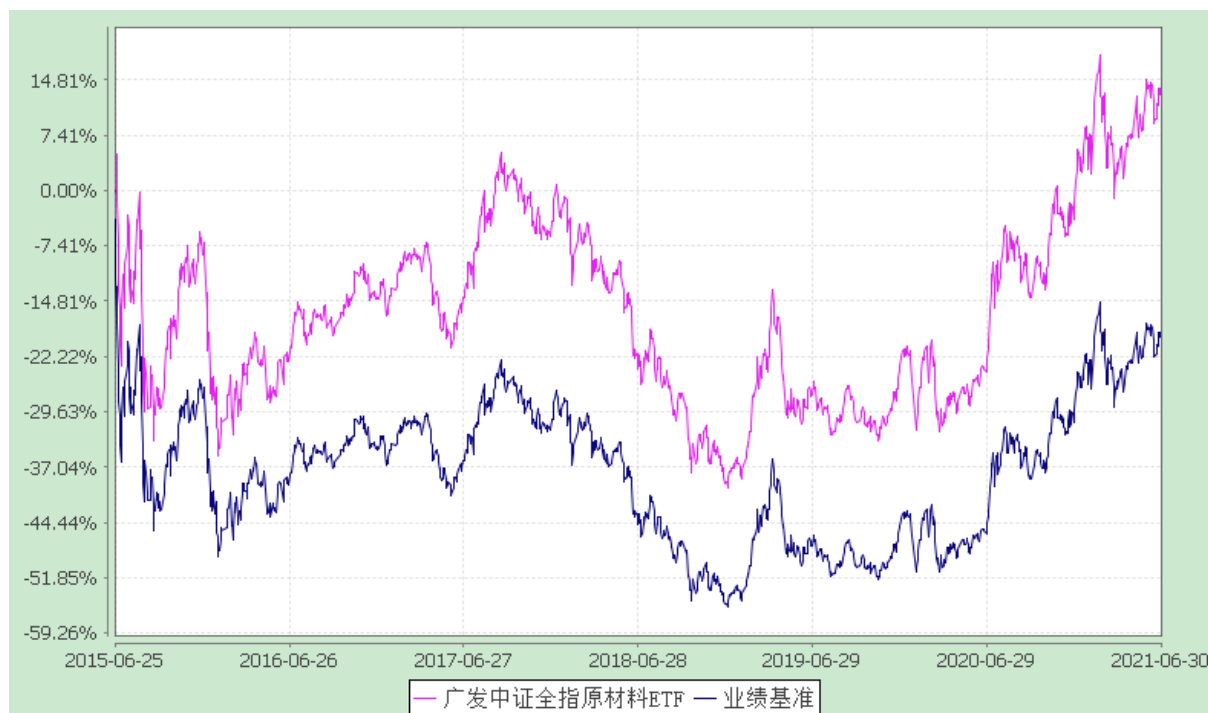
3.2 基金净值表现

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	0.24%	1.11%	-0.49%	1.12%	0.73%	-0.01%
过去三个月	11.27%	1.19%	10.17%	1.21%	1.10%	-0.02%
过去六个月	15.68%	1.66%	14.57%	1.68%	1.11%	-0.02%
过去一年	49.13%	1.62%	48.32%	1.63%	0.81%	-0.01%
过去三年	45.88%	1.55%	43.05%	1.57%	2.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	13.83%	1.75%	-19.01%	1.77%	32.84%	-0.02%

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

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015年6月25日至2021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

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		
夏浩洋	本基金的基金经理；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	2021-05-20	-	4 年	夏浩洋先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司指数投资部量化研究员。

	<p>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；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指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；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>				
陆志明	<p>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 1000 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；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资</p>	2015-06-25	2021-06-17	22 年	<p>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、量化投资部副总经理、广发中小企业 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)、广发中小企业 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)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全</p>

	<p>基金的基金经 理</p>			<p>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)、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基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2021 年 2 月 10 日)、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经理(自 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、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基金经理(自 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、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基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、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基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至</p>
--	---------------------	--	--	---

					2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、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基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 日)。
--	--	--	--	--	---

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，本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% 的交易共有 13 次，其中 7 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2021 年上半年，全球经济持续复苏，国内经济增速逐渐往中长期中枢回归。但由于变种病毒的出现，部分发达国家爆发了新一轮疫情，导致全球经济复苏节奏并非一帆风顺，仍然面临一定挑战。1 季度，在国内外市场需求稳定恢复、同期基数较低以及“就地过年”等因素共同作用下，国内经济运行延续了稳定恢复的态势。2 季度，由于变种病毒的出现，全球疫情防控形势再度复杂化，导致经济完全恢复仍需时日。

就 A 股市场而言，上半年整体呈现三段走势：快速上涨、反转调整后再震荡企稳。成长风格在上半年表现相对强势，主题投资受到市场追捧，锂电、光伏、半导体等成长类板块表现较好，此外，业绩增长较快的化工、有色金属等周期板块表现也相对突出。主要宽基指数的表现在上半年出现了一定程度的分化，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%，创业板指数上涨 17.22%。中证全指原材料指数上涨 14.57%。

受供需错配等因素影响，全球大宗商品价格持续高位运行。由于原材料板块周期属性显著，投资者在把握阶段性投资机会的同时，也应该关注大宗商品价格可能下行的风险。

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 15.68%，同期业绩比较基准收益率为 14.57%。

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，疫情仍是影响全球经济复苏节奏的重要因素。短期来看，变异毒株是未来防疫工作开展中的巨大挑战。

当前，市场最大的担忧在于美联储货币政策转向及央行流动性收紧导致高估值板块的估值下杀。诚然，我们认为流动性指标的确需要保持关注，但一些新兴产业带来的战略性投资机会更值得投资者关注。例如，以碳中和相关政策作为催化的能源产业革新可能带来的光伏、新能源车等板块的发展机会。此外，我国人口结构也走向拐点，未来新一代所推崇的线上便捷式多元消费领域、人口老龄化所带来的养老板块的投资机会也值得关注。

就 A 股而言，我们认为下半年主要投资逻辑在于各板块景气度的确定性，其核心为业绩增速。原材料各子板块中，锂钴是新能源车电池的重要材料，新能源汽车产业需求的大增对锂钴产品的拉动作用或将持续显现。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日出现了基金资产净值低于五千万的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	398,882.58	332,435.92
结算备付金		-	19,416.43
存出保证金		417.72	624.39
交易性金融资产	6.4.7.2	24,276,351.60	28,875,053.71
其中：股票投资		24,276,351.60	28,865,602.11
基金投资		-	-
债券投资		-	9,451.60
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	91.77	73.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		24,675,743.67	29,227,603.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,707.19	12,459.40
应付托管费		2,141.41	2,491.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,263.14	9,417.87
应交税费		-	0.01
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	60,829.44	69,883.33
负债合计		78,941.18	94,252.50
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	21,608,342.00	29,608,342.00
未分配利润	6.4.7.10	2,988,460.49	-474,990.96

所有者权益合计		24,596,802.49	29,133,351.04
负债和所有者权益总计		24,675,743.67	29,227,603.54

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.1383 元，基金份额总额 21,608,342.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		3,375,269.81	120,278.20
1.利息收入		1,852.58	1,244.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,843.20	1,233.17
债券利息收入		9.38	11.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,592,839.02	-954,385.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,297,574.22	-1,231,083.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,570.72	5,709.96
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	286,694.08	270,987.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,409,290.81	1,062,382.95
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	189,869.02	11,036.22
减：二、费用		162,668.93	94,627.84
1. 管理人报酬		75,590.99	54,967.94
2. 托管费		15,118.17	10,993.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	57,481.26	16,061.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-

7. 其他费用	6.4.7.19	14,478.51	12,604.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,212,600.88	25,650.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,212,600.88	25,650.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29,608,342.00	-474,990.96	29,133,351.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,212,600.88	3,212,600.88
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	250,850.57	-7,749,149.43
其中：1.基金申购款	32,000,000.00	3,594,467.94	35,594,467.94
2.基金赎回款	-40,000,000.00	-3,343,617.37	-43,343,617.37
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）	21,608,342.00	2,988,460.49	24,596,802.49
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29,608,342.00	-6,979,157.70	22,629,184.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,650.36	25,650.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	418,046.46	-1,581,953.54
其中：1.基金申购款	10,000,000.00	-2,501,458.50	7,498,541.50

2.基金赎回款	-12,000,000.00	2,919,504.96	-9,080,495.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	27,608,342.00	-6,535,460.88	21,072,881.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]1266 号文核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2015 年 6 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 16 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 281,608,342.00 元，有效认购户数为 6,500 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 14,342.00 元，折合基金份额 14,342.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	398,882.58
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	398,882.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,365,950.44	24,276,351.60	1,910,401.16
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	22,365,950.44	24,276,351.60	1,910,401.16

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	87.99
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	0.18
应收结算备付金利息	3.60
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	91.77

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,263.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,263.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	58,678.95
应付指数使用费	2,150.49
合计	60,829.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,608,342.00	29,608,342.00
本期申购	32,000,000.00	32,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-40,000,000.00	-40,000,000.00
本期末	21,608,342.00	21,608,342.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,446,171.88	5,971,180.92	-474,990.96
本期利润	4,621,891.69	-1,409,290.81	3,212,600.88
本期基金份额交易产生的变动数	468,467.30	-217,616.73	250,850.57
其中：基金申购款	-5,013,240.58	8,607,708.52	3,594,467.94
基金赎回款	5,481,707.88	-8,825,325.25	-3,343,617.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,355,812.89	4,344,273.38	2,988,460.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,477.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12.15
结算备付金利息收入	353.80
其他	-
合计	1,843.20

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,292,705.35
股票投资收益——赎回差价收入	2,004,868.87
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	4,297,574.22

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,740,713.97
减：卖出股票成本总额	19,448,008.62
买卖股票差价收入	2,292,705.35

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

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	43,343,617.37
减：现金支付赎回款总额	19,573,267.37
减：赎回股票成本总额	21,765,481.13
赎回差价收入	2,004,868.87

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
	2021年1月1日至2021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	8,570.72
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	8,570.72

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	52,781.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	44,200.00
减：应收利息总额	11.03
买卖债券差价收入	8,570.72

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	286,694.08
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	286,694.08

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-1,409,290.81
——股票投资	-1,409,439.21
——债券投资	148.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,409,290.81

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	189,869.02
合计	189,869.02

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 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	57,481.26
银行间市场交易费用	-
合计	57,481.26

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	8,678.95
信息披露费	-
证券出借违约金	-

银行汇划费	1,264.05
指数使用费	4,535.51
合计	14,478.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	700.00	0.00%	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	19,600.00	22.43%	28,200.00	30.48%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	75,590.99	54,967.94
其中：支付销售机构的客户维护费	2,081.66	1,847.88

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,118.17	10,993.56

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金

托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	398,882.58	1,477.25	240,986.02	1,150.99

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（2021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

截至本报告期末 2021 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证券。

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 2021 年 6 月 30 日止，本基金未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 2021 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 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	9,451.60
未评级	-	-
合计	-	9,451.60

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。

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，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	398,882.58	-	-	-	398,882.58
存出保证金	417.72	-	-	-	417.72
交易性金融资产	-	-	-	24,276,351.60	24,276,351.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	91.77	91.77
资产总计	399,300.30	-	-	24,276,443.37	24,675,743.67
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	10,707.19	10,707.19
应付托管费	-	-	-	2,141.41	2,141.41
应付交易费用	-	-	-	5,263.14	5,263.14
其他负债	-	-	-	60,829.44	60,829.44
负债总计	-	-	-	78,941.18	78,941.18
利率敏感度缺口	399,300.30	-	-	24,197,502.19	24,596,802.49
上年度末 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	332,435.92	-	-	-	332,435.92
结算备付金	19,416.43	-	-	-	19,416.43
存出保证金	624.39	-	-	-	624.39
交易性金融资产	9,451.60	-	-	28,865,602.11	28,875,053.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	73.09	73.09
资产总计	361,928.34	-	-	28,865,675.20	29,227,603.54
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	12,459.40	12,459.40
应付托管费	-	-	-	2,491.89	2,491.89
应付交易费用	-	-	-	9,417.87	9,417.87
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	69,883.33	69,883.33
负债总计	-	-	-	94,252.50	94,252.50
利率敏感度缺口	361,928.34	-	-	28,771,422.70	29,133,351.04

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），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资产，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，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。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	24,276,351.60	98.70	28,865,602.11	99.08

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	9,451.60	0.03
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	24,276,351.60	98.70	28,875,053.71	99.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	1,218,722.23	1,457,020.15
	下降 5%	-1,218,722.23	-1,457,020.15

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

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 2021 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 24,276,351.60 元，无属于第二层次和第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 28,870,753.71 元，属于第二层次的余额为人民币 4,300.00 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	24,276,351.60	98.38
	其中：股票	24,276,351.60	98.38
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	398,882.58	1.62
8	其他各项资产	509.49	0.00
9	合计	24,675,743.67	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	84,676.80	0.34
B	采矿业	2,220,487.63	9.03
C	制造业	21,902,144.19	89.04

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,444.00	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,535.98	0.07
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	39,063.00	0.16
	合计	24,276,351.60	98.70

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600309	万华化学	9,062	986,126.84	4.01
2	601899	紫金矿业	79,075	766,236.75	3.12
3	002812	恩捷股份	3,210	751,461.00	3.06
4	600585	海螺水泥	13,700	562,385.00	2.29
5	002271	东方雨虹	9,946	550,212.72	2.24
6	603799	华友钴业	4,808	549,073.60	2.23
7	002460	赣锋锂业	4,401	532,917.09	2.17

8	600019	宝钢股份	51,172	390,954.08	1.59
9	002709	天赐材料	3,182	339,137.56	1.38
10	600346	恒力石化	12,100	317,504.00	1.29
11	002493	荣盛石化	17,976	310,445.52	1.26
12	600111	北方稀土	13,622	281,975.40	1.15
13	002601	龙佰集团	7,701	266,300.58	1.08
14	600426	华鲁恒升	8,517	263,601.15	1.07
15	000786	北新建材	5,900	231,575.00	0.94
16	300285	国瓷材料	4,553	221,958.75	0.90
17	601233	桐昆股份	9,091	219,002.19	0.89
18	600143	金发科技	10,300	214,858.00	0.87
19	600176	中国巨石	13,666	211,959.66	0.86
20	603993	洛阳钼业	40,500	208,980.00	0.85
21	600352	浙江龙盛	14,800	203,352.00	0.83
22	600010	包钢股份	130,910	202,910.50	0.82
23	600547	山东黄金	10,365	199,215.30	0.81
24	601600	中国铝业	37,500	198,750.00	0.81
25	601636	旗滨集团	9,150	169,824.00	0.69
26	000301	东方盛虹	8,100	169,290.00	0.69
27	600989	宝丰能源	12,300	168,264.00	0.68
28	300037	新宙邦	1,501	150,250.10	0.61
29	600219	南山铝业	41,230	148,428.00	0.60
30	000703	恒逸石化	12,306	147,056.70	0.60
31	002648	卫星石化	3,740	146,570.60	0.60
32	603026	石大胜华	900	145,845.00	0.59
33	603737	三棵树	796	140,096.00	0.57
34	600362	江西铜业	5,937	132,870.06	0.54
35	601168	西部矿业	10,900	130,037.00	0.53
36	002409	雅克科技	1,600	129,600.00	0.53
37	600392	盛和资源	7,376	128,047.36	0.52
38	300699	光威复材	1,680	127,596.00	0.52
39	002407	多氟多	3,551	126,202.54	0.51
40	000830	鲁西化工	6,700	125,491.00	0.51
41	000807	云铝股份	10,516	125,140.40	0.51
42	000708	中信特钢	5,860	122,122.40	0.50
43	002497	雅化集团	5,300	120,734.00	0.49
44	002078	太阳纸业	8,999	120,136.65	0.49
45	000630	铜陵有色	42,298	115,050.56	0.47
46	002250	联化科技	4,100	114,390.00	0.47
47	002064	华峰化学	8,000	113,600.00	0.46
48	002075	沙钢股份	10,100	110,191.00	0.45
49	600486	扬农化工	980	109,534.60	0.45
50	600549	厦门钨业	5,008	104,316.64	0.42
51	002092	中泰化学	9,800	100,646.00	0.41

52	601005	重庆钢铁	37,600	100,392.00	0.41
53	600988	赤峰黄金	6,600	98,934.00	0.40
54	601216	君正集团	19,340	98,440.60	0.40
55	000825	太钢不锈	12,999	97,362.51	0.40
56	600516	方大炭素	13,049	97,084.56	0.39
57	600489	中金黄金	11,155	96,156.10	0.39
58	002080	中材科技	3,674	96,148.58	0.39
59	300618	寒锐钴业	1,216	95,869.44	0.39
60	000960	锡业股份	5,910	94,737.30	0.39
61	002240	盛新锂能	3,300	94,215.00	0.38
62	000975	银泰黄金	9,592	91,219.92	0.37
63	000932	华菱钢铁	13,700	90,420.00	0.37
64	002145	中核钛白	6,916	89,562.20	0.36
65	600529	山东药玻	2,567	87,149.65	0.35
66	000818	航锦科技	3,002	87,027.98	0.35
67	603260	合盛硅业	1,060	81,524.60	0.33
68	000012	南玻 A	7,916	81,059.84	0.33
69	688122	西部超导	1,200	77,844.00	0.32
70	002585	双星新材	3,810	76,695.30	0.31
71	000878	云南铜业	5,900	75,697.00	0.31
72	002683	宏大爆破	2,701	75,006.77	0.30
73	600497	驰宏锌锗	17,199	74,127.69	0.30
74	300395	菲利华	1,500	72,330.00	0.29
75	300054	鼎龙股份	3,960	72,270.00	0.29
76	600409	三友化工	7,102	71,801.22	0.29
77	000683	远兴能源	15,120	70,610.40	0.29
78	000401	冀东水泥	5,702	70,419.70	0.29
79	601678	滨化股份	8,701	68,824.91	0.28
80	600141	兴发集团	3,640	68,541.20	0.28
81	600160	巨化股份	7,750	68,510.00	0.28
82	600963	岳阳林纸	6,465	68,335.05	0.28
83	002408	齐翔腾达	5,481	68,074.02	0.28
84	002756	永兴材料	1,140	67,704.60	0.28
85	002831	裕同科技	2,240	66,505.60	0.27
86	600801	华新水泥	3,760	66,063.20	0.27
87	000060	中金岭南	14,315	64,703.80	0.26
88	601992	金隅集团	23,910	64,317.90	0.26
89	600567	山鹰国际	18,573	64,076.85	0.26
90	000762	西藏矿业	2,401	63,818.58	0.26
91	000831	五矿稀土	3,300	63,690.00	0.26
92	603077	和邦生物	30,380	63,190.40	0.26
93	600500	中化国际	8,023	63,060.78	0.26
94	600282	南钢股份	17,697	63,001.32	0.26
95	603225	新凤鸣	3,096	62,848.80	0.26

96	002597	金禾实业	1,800	62,460.00	0.25
97	688019	安集科技	200	62,200.00	0.25
98	002203	海亮股份	5,801	61,722.64	0.25
99	000933	神火股份	6,500	61,425.00	0.25
100	000898	鞍钢股份	13,666	60,813.70	0.25
101	002312	川发龙蟒	7,100	60,634.00	0.25
102	600456	宝钛股份	1,400	60,060.00	0.24
103	000709	河钢股份	24,195	59,519.70	0.24
104	300748	金力永磁	1,880	59,464.40	0.24
105	300487	蓝晓科技	700	59,220.00	0.24
106	300777	中简科技	1,300	58,734.00	0.24
107	600966	博汇纸业	4,500	58,725.00	0.24
108	601677	明泰铝业	3,000	58,650.00	0.24
109	600808	马钢股份	13,578	58,249.62	0.24
110	000488	晨鸣纸业	7,051	57,395.14	0.23
111	600596	新安股份	3,200	56,704.00	0.23
112	300737	科顺股份	1,800	56,592.00	0.23
113	000629	攀钢钒钛	24,600	56,334.00	0.23
114	002004	华邦健康	9,070	56,324.70	0.23
115	000902	新洋丰	3,600	56,268.00	0.23
116	600096	云天化	4,001	56,174.04	0.23
117	002643	万润股份	3,050	54,229.00	0.22
118	600022	山东钢铁	31,419	54,040.68	0.22
119	600586	金晶科技	5,800	53,998.00	0.22
120	600881	亚泰集团	18,699	53,292.15	0.22
121	002738	中矿资源	1,200	53,280.00	0.22
122	603906	龙蟠科技	1,520	53,200.00	0.22
123	600459	贵研铂业	2,150	52,890.00	0.22
124	002810	山东赫达	1,090	51,404.40	0.21
125	600782	新钢股份	9,200	51,336.00	0.21
126	000778	新兴铸管	13,700	50,964.00	0.21
127	600273	嘉化能源	5,800	50,460.00	0.21
128	002002	鸿达兴业	12,789	50,260.77	0.20
129	002701	奥瑞金	9,740	50,063.60	0.20
130	000923	河钢资源	2,600	49,582.00	0.20
131	601118	海南橡胶	9,700	49,373.00	0.20
132	300236	上海新阳	1,000	48,540.00	0.20
133	600126	杭钢股份	9,460	48,529.80	0.20
134	300655	晶瑞电材	1,300	47,437.00	0.19
135	002254	泰和新材	2,340	47,431.80	0.19
136	002110	三钢闽光	7,000	47,180.00	0.19
137	300072	三聚环保	8,073	46,339.02	0.19
138	002318	久立特材	3,802	45,700.04	0.19
139	000877	天山股份	3,501	45,618.03	0.19

140	603733	仙鹤股份	1,200	45,600.00	0.19
141	000959	首钢股份	8,000	44,960.00	0.18
142	000990	诚志股份	3,500	44,555.00	0.18
143	002258	利尔化学	1,700	43,860.00	0.18
144	000949	新乡化纤	5,100	43,197.00	0.18
145	600338	西藏珠峰	3,020	42,793.40	0.17
146	601208	东材科技	2,600	42,432.00	0.17
147	600507	方大特钢	6,236	42,280.08	0.17
148	603429	集友股份	1,283	41,697.50	0.17
149	600307	酒钢宏兴	17,900	41,528.00	0.17
150	002233	塔牌集团	4,002	41,140.56	0.17
151	000672	上峰水泥	2,303	40,256.44	0.16
152	000426	兴业矿业	5,300	39,909.00	0.16
153	002440	闰土股份	4,500	39,825.00	0.16
154	002171	楚江新材	4,520	39,459.60	0.16
155	600063	皖维高新	7,700	39,424.00	0.16
156	603599	广信股份	1,300	39,104.00	0.16
157	600673	东阳光	8,700	39,063.00	0.16
158	600720	祁连山	3,601	37,954.54	0.15
159	000758	中色股份	7,900	37,525.00	0.15
160	002155	湖南黄金	4,801	37,207.75	0.15
161	300225	金力泰	2,201	37,130.87	0.15
162	601958	金钼股份	5,704	36,961.92	0.15
163	605376	博迁新材	500	36,940.00	0.15
164	002237	恒邦股份	3,200	36,768.00	0.15
165	000761	本钢板材	7,900	36,498.00	0.15
166	600328	中盐化工	2,600	36,322.00	0.15
167	002386	天原股份	3,500	36,050.00	0.15
168	002428	云南锗业	2,900	35,931.00	0.15
169	600490	鹏欣资源	9,300	35,805.00	0.15
170	300587	天铁股份	1,590	35,695.50	0.15
171	600378	昊华科技	1,600	35,248.00	0.14
172	300180	华峰超纤	7,024	34,768.80	0.14
173	688199	久日新材	800	34,528.00	0.14
174	000969	安泰科技	4,000	34,400.00	0.14
175	600259	广晟有色	1,000	33,810.00	0.14
176	003022	联泓新科	1,100	33,770.00	0.14
177	600210	紫江企业	6,999	33,245.25	0.14
178	601212	白银有色	12,700	33,147.00	0.13
179	002324	普利特	2,796	32,713.20	0.13
180	603010	万盛股份	1,540	32,293.80	0.13
181	002274	华昌化工	3,200	32,224.00	0.13
182	000717	韶钢松山	7,000	32,130.00	0.13
183	002108	沧州明珠	5,784	31,869.84	0.13

184	300910	瑞丰新材	300	31,365.00	0.13
185	002206	海利得	4,952	30,751.92	0.13
186	000789	万年青	2,681	30,670.64	0.12
187	002539	云图控股	3,490	30,467.70	0.12
188	300398	飞凯材料	1,660	30,095.80	0.12
189	002043	兔宝宝	3,050	30,073.00	0.12
190	000912	泸天化	7,200	29,952.00	0.12
191	002182	云海金属	2,500	29,950.00	0.12
192	603612	索通发展	1,640	29,470.80	0.12
193	000603	盛达资源	2,300	28,957.00	0.12
194	603601	再升科技	2,500	28,925.00	0.12
195	600888	新疆众和	5,278	28,765.10	0.12
196	600295	鄂尔多斯	1,600	28,624.00	0.12
197	000657	中钨高新	2,821	28,604.94	0.12
198	000612	焦作万方	3,949	27,998.41	0.11
199	600433	冠豪高新	5,167	27,746.79	0.11
200	600326	西藏天路	4,100	27,634.00	0.11
201	002088	鲁阳节能	1,200	27,588.00	0.11
202	002637	赞宇科技	1,801	27,537.29	0.11
203	600389	江山股份	800	27,512.00	0.11
204	603378	亚士创能	500	27,510.00	0.11
205	300041	回天新材	1,902	27,483.90	0.11
206	000592	平潭发展	8,900	27,323.00	0.11
207	600623	华谊集团	3,100	27,311.00	0.11
208	603826	坤彩科技	720	27,309.60	0.11
209	000893	亚钾国际	1,600	26,720.00	0.11
210	300429	强力新材	1,966	26,639.30	0.11
211	600277	亿利洁能	7,900	26,623.00	0.11
212	600581	八一钢铁	4,300	26,574.00	0.11
213	600531	豫光金铅	5,000	26,400.00	0.11
214	600103	青山纸业	10,503	26,047.44	0.11
215	300821	东岳硅材	2,000	26,000.00	0.11
216	300596	利安隆	600	25,998.00	0.11
217	600366	宁波韵升	3,880	25,996.00	0.11
218	002149	西部材料	1,601	25,776.10	0.10
219	002226	江南化工	5,020	25,702.40	0.10
220	600308	华泰股份	4,600	25,392.00	0.10
221	601969	海南矿业	2,175	25,295.25	0.10
222	601137	博威合金	2,200	25,234.00	0.10
223	300224	正海磁材	2,300	25,001.00	0.10
224	002201	九鼎新材	1,580	24,569.00	0.10
225	600810	神马股份	2,050	24,538.50	0.10
226	002067	景兴纸业	6,600	24,222.00	0.10
227	601388	怡球资源	7,579	24,177.01	0.10

228	002263	大东南	8,500	24,055.00	0.10
229	603916	苏博特	1,160	23,942.40	0.10
230	300082	奥克股份	1,900	23,560.00	0.10
231	603688	石英股份	1,000	23,500.00	0.10
232	002532	天山铝业	2,800	23,492.00	0.10
233	000822	山东海化	3,000	23,400.00	0.10
234	600691	阳煤化工	6,800	23,256.00	0.09
235	600165	新日恒力	3,051	23,248.62	0.09
236	002398	垒知集团	3,201	22,823.13	0.09
237	600668	尖峰集团	1,900	22,686.00	0.09
238	600075	新疆天业	3,301	22,446.80	0.09
239	002132	恒星科技	5,850	22,113.00	0.09
240	000420	吉林化纤	6,200	22,072.00	0.09
241	600425	青松建化	6,400	21,888.00	0.09
242	300109	新开源	1,300	21,866.00	0.09
243	002596	海南瑞泽	4,500	21,735.00	0.09
243	603876	鼎胜新材	700	21,735.00	0.09
244	000881	中广核技	2,100	21,672.00	0.09
245	002641	永高股份	3,100	21,390.00	0.09
246	002302	西部建设	2,700	21,330.00	0.09
247	000751	锌业股份	6,601	21,321.23	0.09
248	000910	大亚圣象	1,778	21,122.64	0.09
249	000936	华西股份	3,000	21,000.00	0.09
250	002741	光华科技	1,300	20,761.00	0.08
251	002392	北京利尔	4,700	20,586.00	0.08
252	600569	安阳钢铁	6,700	20,502.00	0.08
253	600527	江南高纤	8,000	20,080.00	0.08
254	603181	皇马科技	1,150	19,860.50	0.08
255	300715	凯伦股份	840	19,798.80	0.08
256	300575	中旗股份	810	19,731.60	0.08
257	603379	三美股份	1,040	19,458.40	0.08
258	603995	甬金股份	500	19,225.00	0.08
259	603110	东方材料	600	19,032.00	0.08
259	300174	元力股份	1,200	19,032.00	0.08
260	002243	力合科创	2,000	19,020.00	0.08
261	600458	时代新材	2,280	18,992.40	0.08
262	600076	康欣新材	4,500	18,900.00	0.08
262	300261	雅本化学	3,500	18,900.00	0.08
263	300196	长海股份	1,100	18,876.00	0.08
264	601568	北元集团	2,200	18,832.00	0.08
265	300758	七彩化学	740	18,796.00	0.08
266	002522	浙江众成	3,000	18,780.00	0.08
267	002378	章源钨业	2,001	18,769.38	0.08
268	601069	西部黄金	1,500	18,765.00	0.08

269	000795	英洛华	3,751	18,717.49	0.08
270	000973	佛塑科技	4,300	18,576.00	0.08
271	300221	银禧科技	2,501	18,557.42	0.08
272	300481	濮阳惠成	800	18,416.00	0.07
273	300121	阳谷华泰	1,490	18,341.90	0.07
274	300080	易成新能	3,500	18,340.00	0.07
275	000731	四川美丰	3,328	18,304.00	0.07
276	000698	沈阳化工	2,700	18,252.00	0.07
277	002978	安宁股份	300	18,126.00	0.07
278	002167	东方锆业	2,600	17,966.00	0.07
279	002391	长青股份	2,550	17,875.50	0.07
280	000859	国风塑业	3,000	17,790.00	0.07
281	300200	高盟新材	1,560	17,768.40	0.07
282	002768	国恩股份	700	17,766.00	0.07
283	000935	四川双马	1,300	17,732.00	0.07
284	600230	沧州大化	1,400	17,640.00	0.07
285	002824	和胜股份	500	17,630.00	0.07
286	603033	三维股份	980	17,620.40	0.07
287	000546	金圆股份	2,702	17,535.98	0.07
288	002734	利民股份	1,483	17,469.74	0.07
289	002215	诺普信	3,100	17,422.00	0.07
290	002082	万邦德	1,400	17,304.00	0.07
291	688026	洁特生物	200	17,220.00	0.07
292	601968	宝钢包装	1,800	17,208.00	0.07
293	300328	宜安科技	2,270	17,206.60	0.07
294	300057	万顺新材	2,600	17,186.00	0.07
295	002538	司尔特	2,500	17,125.00	0.07
296	002588	史丹利	3,220	17,066.00	0.07
297	600449	宁夏建材	1,501	17,051.36	0.07
298	300684	中石科技	764	16,769.80	0.07
299	002125	湘潭电化	2,100	16,737.00	0.07
300	000510	新金路	3,500	16,625.00	0.07
301	000688	国城矿业	1,900	16,587.00	0.07
302	002225	濮耐股份	3,900	16,536.00	0.07
303	600331	宏达股份	8,100	16,524.00	0.07
304	601003	柳钢股份	2,800	16,520.00	0.07
305	002565	顺灏股份	4,200	16,506.00	0.07
306	002361	神剑股份	3,402	16,499.70	0.07
307	002455	百川股份	2,102	16,416.62	0.07
308	600727	鲁北化工	2,000	16,400.00	0.07
309	300576	容大感光	424	16,357.92	0.07
310	002303	美盈森	4,600	16,146.00	0.07
311	000655	金岭矿业	1,600	16,112.00	0.07
312	002838	道恩股份	900	15,966.00	0.06

313	300320	海达股份	2,400	15,960.00	0.06
314	600844	丹化科技	3,600	15,912.00	0.06
315	002068	黑猫股份	2,076	15,756.84	0.06
316	002228	合兴包装	4,200	15,750.00	0.06
317	603722	阿科力	300	15,600.00	0.06
318	600731	湖南海利	2,000	15,380.00	0.06
319	603002	宏昌电子	2,250	15,300.00	0.06
320	603078	江化微	590	15,239.70	0.06
321	002054	德美化工	1,401	15,200.85	0.06
322	300230	永利股份	3,200	15,200.00	0.06
323	603938	三孚股份	450	15,196.50	0.06
324	603505	金石资源	780	15,124.20	0.06
325	002443	金洲管道	2,400	15,120.00	0.06
326	002057	中钢天源	2,100	14,469.00	0.06
327	002783	凯龙股份	1,580	14,409.60	0.06
328	300305	裕兴股份	900	14,391.00	0.06
329	002521	齐峰新材	2,201	14,306.50	0.06
330	002160	常铝股份	3,500	14,140.00	0.06
331	000962	东方钨业	1,500	14,070.00	0.06
332	300019	硅宝科技	800	14,048.00	0.06
333	601609	金田铜业	1,600	13,888.00	0.06
334	600231	凌钢股份	4,800	13,680.00	0.06
335	688186	广大特材	400	13,648.00	0.06
336	603155	新亚强	300	13,647.00	0.06
337	002379	宏创控股	4,100	13,612.00	0.06
338	002170	芭田股份	3,500	13,265.00	0.05
339	002224	三力士	2,801	13,220.72	0.05
340	603639	海利尔	734	13,204.66	0.05
341	002360	同德化工	1,700	13,141.00	0.05
342	603299	苏盐井神	1,700	12,920.00	0.05
343	603227	雪峰科技	2,501	12,755.10	0.05
344	002669	康达新材	1,000	12,730.00	0.05
345	300067	安诺其	2,961	12,584.25	0.05
346	300243	瑞丰高材	900	12,582.00	0.05
347	300522	世名科技	700	12,558.00	0.05
348	603867	新化股份	500	12,555.00	0.05
349	002735	王子新材	500	12,550.00	0.05
350	002235	安妮股份	2,550	12,444.00	0.05
351	688300	联瑞新材	200	12,400.00	0.05
352	002381	双箭股份	1,500	12,330.00	0.05
353	002012	凯恩股份	2,200	12,210.00	0.05
354	601996	丰林集团	3,700	12,136.00	0.05
355	603330	上海天洋	400	12,120.00	0.05
356	002165	红宝丽	2,600	12,090.00	0.05

357	000815	美利云	2,300	12,052.00	0.05
358	600618	氯碱化工	1,300	11,895.00	0.05
359	600722	金牛化工	1,900	11,856.00	0.05
360	603969	银龙股份	2,802	11,852.46	0.05
361	688196	卓越新能	200	11,836.00	0.05
362	600802	福建水泥	1,700	11,730.00	0.05
363	002632	道明光学	1,700	11,577.00	0.05
364	002246	北化股份	1,602	11,534.40	0.05
365	002109	兴化股份	2,400	11,496.00	0.05
366	300337	银邦股份	2,300	11,477.00	0.05
367	002469	三维化学	2,100	11,340.00	0.05
368	601702	华峰铝业	1,600	11,280.00	0.05
369	600800	渤海化学	2,600	11,258.00	0.05
370	300489	中飞股份	500	11,150.00	0.05
371	300179	四方达	1,900	11,134.00	0.05
372	002584	西陇科学	1,901	11,101.84	0.05
373	600558	大西洋	3,475	11,050.50	0.04
374	600746	江苏索普	700	10,738.00	0.04
375	300214	日科化学	1,500	10,680.00	0.04
376	002666	德联集团	2,100	10,605.00	0.04
377	300727	润禾材料	300	10,590.00	0.04
378	600117	西宁特钢	2,800	10,556.00	0.04
379	603067	振华股份	1,408	10,447.36	0.04
380	300891	惠云钛业	600	10,434.00	0.04
381	600961	株冶集团	1,700	10,302.00	0.04
382	300537	广信材料	600	10,194.00	0.04
383	000920	南方汇通	1,400	10,150.00	0.04
384	603681	永冠新材	400	10,080.00	0.04
385	603360	百傲化学	720	10,036.80	0.04
386	300107	建新股份	1,800	9,864.00	0.04
387	603931	格林达	300	9,642.00	0.04
388	002915	中欣氟材	500	9,580.00	0.04
389	002613	北玻股份	2,600	9,542.00	0.04
390	002886	沃特股份	620	9,355.80	0.04
391	300641	正丹股份	1,100	9,229.00	0.04
392	603256	宏和科技	1,000	9,140.00	0.04
393	300586	美联新材	1,030	9,115.50	0.04
394	601686	友发集团	800	8,928.00	0.04
395	300501	海顺新材	500	8,845.00	0.04
396	300905	宝丽迪	300	8,829.00	0.04
397	600819	耀皮玻璃	1,600	8,736.00	0.04
398	603978	深圳新星	500	8,685.00	0.04
399	002578	闽发铝业	2,700	8,559.00	0.03
400	603079	圣达生物	500	8,535.00	0.03

401	600724	宁波富达	2,500	8,525.00	0.03
402	603823	百合花	540	8,175.60	0.03
403	688398	赛特新材	200	8,148.00	0.03
404	603878	武进不锈	1,108	8,143.80	0.03
405	002679	福建金森	430	7,980.80	0.03
406	605377	华旺科技	500	7,720.00	0.03
407	002211	宏达新材	1,503	7,710.39	0.03
408	605008	长鸿高科	400	7,656.00	0.03
409	002895	川恒股份	500	7,535.00	0.03
410	002799	环球印务	540	7,414.20	0.03
411	300801	泰和科技	400	7,412.00	0.03
412	300796	贝斯美	400	7,304.00	0.03
413	603663	三祥新材	500	7,245.00	0.03
414	603968	醋化股份	500	7,175.00	0.03
415	605500	森林包装	400	7,068.00	0.03
416	605399	晨光新材	300	7,053.00	0.03
417	002971	和远气体	400	7,000.00	0.03
418	002986	宇新股份	280	6,955.20	0.03
419	002842	翔鹭钨业	736	6,719.68	0.03
420	603856	东宏股份	590	6,625.70	0.03
421	300876	蒙泰高新	200	6,610.00	0.03
422	603977	国泰集团	900	6,498.00	0.03
423	688268	华特气体	86	6,465.48	0.03
424	002096	南岭民爆	800	6,424.00	0.03
425	300848	美瑞新材	200	6,372.00	0.03
426	002846	英联股份	720	6,300.00	0.03
427	300881	盛德鑫泰	200	6,158.00	0.03
428	002827	高争民爆	600	6,132.00	0.02
429	605006	山东玻纤	500	6,100.00	0.02
429	605366	宏柏新材	500	6,100.00	0.02
430	300883	龙利得	500	6,090.00	0.02
431	002998	优彩资源	600	6,084.00	0.02
432	603948	建业股份	300	5,706.00	0.02
433	003018	金富科技	500	5,705.00	0.02
434	605007	五洲特纸	300	5,649.00	0.02
435	603810	丰山集团	364	5,587.40	0.02
436	605166	聚合顺	600	5,580.00	0.02
437	605183	确成股份	300	5,250.00	0.02
438	002996	顺博合金	300	5,124.00	0.02
439	300930	屹通新材	200	4,978.00	0.02
440	003002	壶化股份	400	4,936.00	0.02
441	002969	嘉美包装	1,000	4,820.00	0.02
442	002917	金奥博	510	4,498.20	0.02
443	300798	锦鸡股份	500	4,480.00	0.02

444	300849	锦盛新材	300	4,299.00	0.02
445	003003	天元股份	300	4,272.00	0.02
446	603687	大胜达	500	3,920.00	0.02
447	003017	大洋生物	100	3,880.00	0.02
448	603332	苏州龙杰	200	3,384.00	0.01
449	300886	华业香料	100	3,243.00	0.01
450	300927	江天化学	100	3,037.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600309	万华化学	1,840,866.00	6.32
2	601899	紫金矿业	1,590,524.00	5.46
3	600585	海螺水泥	1,182,750.00	4.06
4	600346	恒力石化	772,856.00	2.65
5	603799	华友钴业	735,075.00	2.52
6	600019	宝钢股份	575,308.00	1.97
7	603993	洛阳钼业	471,338.00	1.62
8	600176	中国巨石	470,309.00	1.61
9	600426	华鲁恒升	457,942.00	1.57
10	600352	浙江龙盛	407,140.00	1.40
11	600143	金发科技	401,732.00	1.38
12	601233	桐昆股份	390,004.00	1.34
13	600547	山东黄金	380,431.00	1.31
14	600111	北方稀土	347,355.00	1.19
15	601168	西部矿业	295,524.00	1.01
16	603737	三棵树	281,926.00	0.97
17	600219	南山铝业	278,200.00	0.95
18	600010	包钢股份	259,218.00	0.89
19	688122	西部超导	258,142.00	0.89
20	600362	江西铜业	251,256.00	0.86

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	600309	万华化学	1,821,117.00	6.25
2	601899	紫金矿业	1,543,389.00	5.30
3	600585	海螺水泥	1,255,556.00	4.31
4	600346	恒力石化	747,595.00	2.57
5	603799	华友钴业	654,424.82	2.25
6	600019	宝钢股份	631,341.00	2.17
7	600176	中国巨石	476,857.97	1.64
8	600426	华鲁恒升	465,145.00	1.60
9	603993	洛阳钼业	463,979.00	1.59
10	600143	金发科技	409,169.00	1.40
11	600352	浙江龙盛	405,140.00	1.39
12	600547	山东黄金	404,121.04	1.39
13	601233	桐昆股份	370,746.00	1.27
14	600111	北方稀土	356,963.00	1.23
15	600010	包钢股份	300,580.00	1.03
16	601168	西部矿业	287,266.00	0.99
17	600219	南山铝业	277,185.00	0.95
18	603737	三棵树	277,041.00	0.95
19	601600	中国铝业	267,225.00	0.92
20	600362	江西铜业	258,886.00	0.89

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	21,914,978.45
卖出股票收入（成交）总额	21,740,713.97

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙江华友钴业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到嘉兴海事局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚。

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。

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	417.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	91.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	509.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,637	13,199.96	366,903.00	1.70%	21,241,439.00	98.30%

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	吴晓彤	900,006.00	4.17%
2	胡毅	600,000.00	2.78%
3	翟春光	500,043.00	2.31%
4	胡蹕峰	409,303.00	1.89%

5	华泰证券股份有限公司	340,196.00	1.57%
6	胡煜成	324,200.00	1.50%
7	朱清滨	300,000.00	1.39%
8	马雪梅	300,000.00	1.39%
9	赵建平	300,000.00	1.39%
10	杨德贵	255,100.00	1.18%

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（2015年6月25日）基金份额总额	281,608,342.00
本报告期期初基金份额总额	29,608,342.00
本报告期基金总申购份额	32,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	40,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	21,608,342.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	700.00	0.00%	-	-	-
银河证券	2	2,755,208.25	6.31%	1,962.23	6.16%	-
安信证券	1	2,846,315.13	6.52%	2,081.49	6.53%	-
海通证券	2	38,053,469.04	87.17%	27,828.86	87.31%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

注：1、交易单元选择标准：

- (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、交易单元选择流程：

(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	19,600.00	22.43%	-	-	-	-
银河证券	35,921.10	41.11%	-	-	-	-
安信证券	31,860.65	36.46%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-

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 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
3	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
5	关于广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-20
6	关于广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-17

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.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

二〇二一年八月三十日