

广发中证全指可选消费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
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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
8 基金份额持有人信息	61

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2	期末上市基金前十名持有人	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
9	开放式基金份额变动	63
10	重大事件揭示	63
10.1	基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4	基金投资策略的改变	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8	其他重大事件	65
11	影响投资者决策的其他重要信息	66
12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指可选消费 ETF
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	126,156,094.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-06-25

注：本基金的扩位证券简称为“可选消费 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	中证全指可选消费指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

传真	020-89899158	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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	35,064,014.68
本期利润	8,124,192.31
加权平均基金份额本期利润	0.0582
本期加权平均净值利润率	2.89%
本期基金份额净值增长率	1.92%
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	46,917,256.38
期末可供分配基金份额利润	0.3719
期末基金资产净值	256,307,894.72
期末基金份额净值	2.0317
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	103.17%

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）。

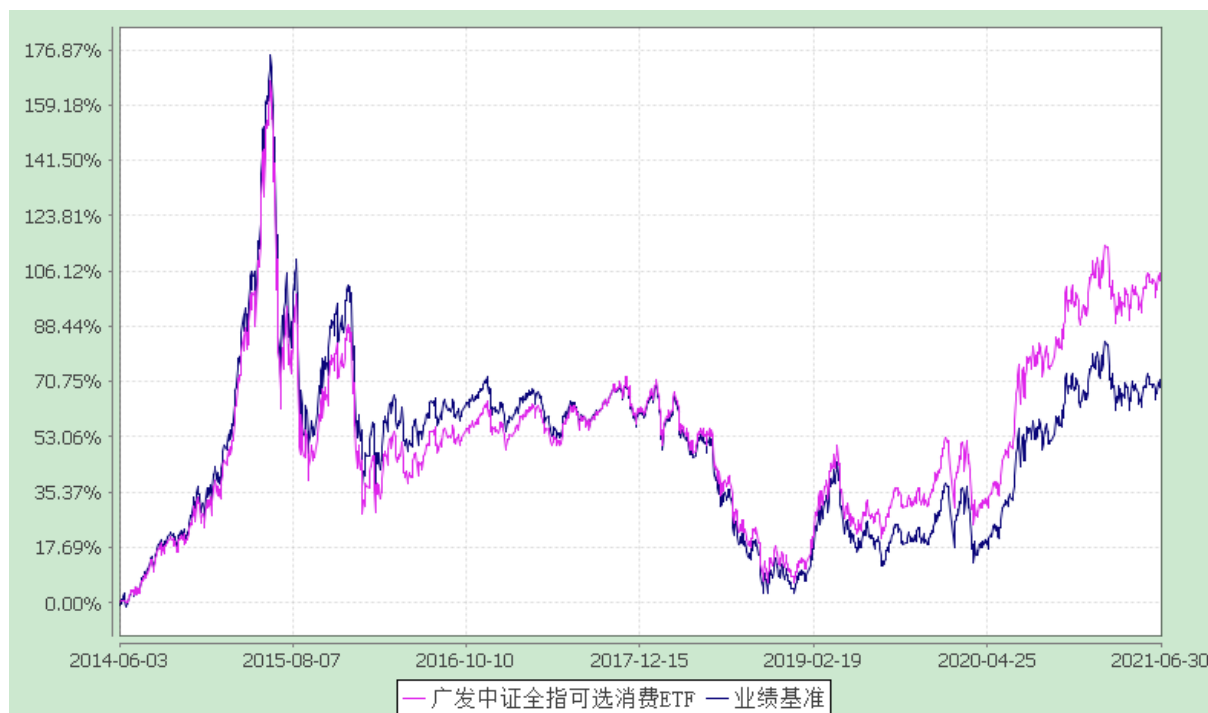
3.2 基金净值表现

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	-0.45%	0.83%	-1.57%	0.85%	1.12%	-0.02%
过去三个月	4.21%	1.01%	1.97%	1.02%	2.24%	-0.01%
过去六个月	1.92%	1.25%	-1.13%	1.27%	3.05%	-0.02%
过去一年	34.05%	1.37%	25.51%	1.38%	8.54%	-0.01%
过去三年	42.86%	1.45%	21.79%	1.47%	21.07%	-0.02%
自基金合同生效起至今	103.17%	1.58%	68.98%	1.62%	34.19%	-0.04%

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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2014 年 6 月 3 日至 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任量化研究员。

	<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发起式联接基金的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</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>	2014-06-03	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%。中证全指可选消费指数下跌 1.13%。消费市场继续保持高景气度。国家统计局数据显示，1 至 6 月，社会消费品零售总额同比增长 23.0%，两年平均增速为 4.4%。在可选消费类别中，1 至 6 月，家用电器和音像器材类零售额同比增长 19.3%，汽车类零售额同比增长 30.4%。随着疫苗接种率的持续提升，居民外出消费活动或将越来越频繁，可选消费板块企业的经营状况或将持续改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 1.92%，同期业绩比较基准收益率为-1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。可选消费板块中，新能源汽车、游戏等领域或将保持高速增长态势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“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：广发中证全指可选消费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	4,845,901.41	4,048,580.78
结算备付金		10,869.11	69,894.04
存出保证金		33,019.64	31,289.80

交易性金融资产	6.4.7.2	251,368,839.25	383,185,669.49
其中：股票投资		251,237,739.25	383,148,876.97
基金投资		-	-
债券投资		131,100.00	36,792.52
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		273,122.43	101,083.43
应收利息	6.4.7.5	8,741.57	23,599.70
应收股利		23,696.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		256,564,189.41	387,460,117.24
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		103,783.80	159,228.40
应付托管费		20,756.75	31,845.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,542.27	33,127.52
应交税费		593.83	1,841.82
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,618.04	183,599.28
负债合计		256,294.69	409,642.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	126,156,094.00	194,156,094.00
未分配利润	6.4.7.10	130,151,800.72	192,894,380.55
所有者权益合计		256,307,894.72	387,050,474.55
负债和所有者权益总计		256,564,189.41	387,460,117.24

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 2.0317 元，基金份额总额 126,156,094.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		9,284,307.86	18,524,844.45
1.利息收入		135,192.53	43,044.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,884.65	11,345.39
债券利息收入		31.78	173.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		128,276.10	31,525.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		35,981,416.25	-17,324,539.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,050,261.20	-21,634,592.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,347.06	63,417.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,925,807.99	4,246,636.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-26,939,822.37	35,740,410.71
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	107,521.45	65,928.53
减：二、费用		1,160,115.55	1,347,911.30
1. 管理人报酬		700,911.79	849,514.52
2. 托管费		140,182.33	169,902.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	195,898.14	197,467.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		462.08	114.20
7. 其他费用	6.4.7.19	122,661.21	130,912.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,124,192.31	17,176,933.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,124,192.31	17,176,933.15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	194,156,094.00	192,894,380.55	387,050,474.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,124,192.31	8,124,192.31
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）	-68,000,000.00	-70,866,772.14	-138,866,772.14
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	4,177,715.32	8,177,715.32
2.基金赎回款	-72,000,000.00	-75,044,487.46	-147,044,487.46
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）	126,156,094.00	130,151,800.72	256,307,894.72
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）	220,156,094.00	94,698,604.33	314,854,698.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,176,933.15	17,176,933.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	0.00	1,645,189.34	1,645,189.34
其中：1.基金申购款	54,000,000.00	25,296,932.34	79,296,932.34
2.基金赎回款	-54,000,000.00	-23,651,743.00	-77,651,743.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	220,156,094.00	113,520,726.82	333,676,820.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的财务报表于 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 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,845,901.41
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	4,845,901.41

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	215,352,381.49	251,237,739.25	35,885,357.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	131,100.00	131,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	131,100.00	131,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	215,483,481.49	251,368,839.25	35,885,357.76

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	463.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	13.41
应收结算备付金利息	119.84
应收债券利息	13.97
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	8,130.92
其他	-
合计	8,741.57

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	34,542.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,542.27

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	77,359.40
应付替代款	300.75
应付指数使用费	18,957.89
合计	96,618.04

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	194,156,094.00	194,156,094.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-72,000,000.00	-72,000,000.00
本期末	126,156,094.00	126,156,094.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,860,909.69	166,033,470.86	192,894,380.55
本期利润	35,064,014.68	-26,939,822.37	8,124,192.31
本期基金份额交易产生的变动数	-15,007,667.99	-55,859,104.15	-70,866,772.14

其中：基金申购款	1,460,295.01	2,717,420.31	4,177,715.32
基金赎回款	-16,467,963.00	-58,576,524.46	-75,044,487.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,917,256.38	83,234,544.34	130,151,800.72

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	5,939.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	214.46
结算备付金利息收入	731.00
其他	-
合计	6,884.65

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	18,644,550.14
股票投资收益——赎回差价收入	15,405,711.06
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	34,050,261.20

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	89,034,741.15
减：卖出股票成本总额	70,390,191.01
买卖股票差价收入	18,644,550.14

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	147,044,487.46
减：现金支付赎回款总额	54,401,058.46
减：赎回股票成本总额	77,237,717.94
赎回差价收入	15,405,711.06

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	5,347.06
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,347.06

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	82,474.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	77,100.00
减：应收利息总额	27.04
买卖债券差价收入	5,347.06

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	1,925,807.99
其中：证券出借权益补偿收入	127,567.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,925,807.99

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	-26,939,822.37
——股票投资	-26,939,529.85
——债券投资	-292.52
——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	-26,939,822.37

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	107,521.45
合计	107,521.45

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	195,898.14
银行间市场交易费用	-
合计	195,898.14

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	17,852.03
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,247.08
指数使用费	42,054.73
合计	122,661.21

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	-	-	86,006.38	0.06%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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

		额的比例		额的比例
广发证券股份有限公司	66,700.00	26.56%	372,600.00	30.57%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	700,911.79	849,514.52
其中：支付销售机构的客户维护费	4,208.49	1,042.96

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	140,182.33	169,902.91

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	113,446,968.00	89.93%	169,664,668.00	87.39%

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	4,845,901.41	5,939.19	3,017,918.65	10,473.85

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688630	芯碁微装	2021-03-25	2021-10-08	新股流通受限	15.23	58.42	3,397.00	51,736.31	198,452.74	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	新股流通受限	19.11	32.62	2,789.00	53,297.79	90,977.18	20210616 除权除息,派息比例 0.4500 (含税)
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股流通受限	12.76	39.20	2,251.00	28,722.76	88,239.20	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	326.00	8,019.60	53,138.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	8.29	8.29	6,078.00	50,386.62	50,386.62	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	新股流通受限	45.72	103.85	442.00	20,208.24	45,901.70	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股流通受限	38.85	38.85	1,124.00	43,667.40	43,667.40	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股流通受限	19.11	33.21	1,137.00	21,728.07	37,759.77	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股流通	14.71	24.83	1,259.00	18,519.89	31,260.97	-

				受限						
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	1,283.00	28,174.68	28,174.68	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	165.00	4,747.05	16,475.25	20210617 除权除息,派息比例 0.1400 (含税)
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	20210618 除权除息,派息比例 0.0790 (含税)
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	114.00	3,223.92	13,190.94	20210622 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	20210602 除权除

										息,派 息比 例 0.0450 (含税)
30094 1	创识 科技	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 流通 受限	21.31	49.94	252.00	5,370. 12	12,584 .88	20210 629 除 权除 息,派 息比 例 0.3000 (含税)
30093 3	中辰 股份	2021-0 1-15	2021-0 7-22	新股 流通 受限	3.37	10.44	1,112. 00	3,747. 44	11,609 .28	20210 618 除 权除 息,派 息比 例 0.0300 (含税)
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	31.56	31.56	349.00	11,014 .44	11,014 .44	-
30100 9	可靠 股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	新股 流通 受限	12.54	27.89	385.00	4,827. 90	10,737 .65	-
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 流通 受限	3.40	16.37	576.00	1,958. 40	9,429. 12	20210 610 除 权除 息,派 息比 例 0.1600 (含税)
30099 6	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	新股 流通 受限	20.81	42.23	221.00	4,599. 01	9,332. 83	-
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	20210 603 除 权除 息,派 息比 例 0.2200

										(含税)
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	20210609 除权除息,派息比例 0.0950 (含税)
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	663.00	3,275.22	8,652.15	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	20210601 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	256.00	3,520.00	8,442.88	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股流通受限	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	20210528 除权除息,派息比例 0.1000 (含税)
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	304.00	3,906.40	7,843.20	20210527 除权除息,派息比

										例 0.3000 (含税)
30096 8	格林 精密	2021-0 4-06	2021-1 0-15	新股 流通 受限	6.87	12.07	644.00	4,424. 28	7,773. 08	-
30097 1	博亚 精工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	新股 流通 受限	18.24	28.29	245.00	4,468. 80	6,931. 05	2021 611 除 权除 息,派 息比 例 0.4000 (含税)
30096 1	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	新股 流通 受限	8.48	22.07	302.00	2,560. 96	6,665. 14	2021 611 除 权除 息,派 息比 例 0.0530 (含税)
30098 1	中红 医疗	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通 受限	48.59	90.39	73.00	3,547. 07	6,598. 47	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 流通 受限	16.53	46.07	142.00	2,347. 26	6,541. 94	2021 628 除 权除 息,派 息比 例 0.4100 (含税)
30092 7	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	新股 流通 受限	13.39	30.10	217.00	2,905. 63	6,531. 70	2021 621 除 权除 息,派 息比 例 0.2100 (含税)
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 流通 受限	5.48	13.03	492.00	2,696. 16	6,410. 76	2021 608 除 权除 息,派

										息比例 0.0360 (含税)
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	9.79	23.01	255.00	2,496. 45	5,867. 55	20210 617 除 权除 息,派 息比 例 0.1000 (含税)
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股 流通 受限	8.29	8.29	676.00	5,604. 04	5,604. 04	-
30097 2	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 流通 受限	7.19	12.65	430.00	3,091. 70	5,439. 50	-
30092 9	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-21	新股 流通 受限	13.87	29.55	183.00	2,538. 21	5,407. 65	20210 618 除 权除 息,派 息比 例 0.1200 (含税)
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 流通 受限	12.13	22.49	221.00	2,680. 73	4,970. 29	20210 611 除 权除 息,派 息比 例 0.1500 (含税)
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191.00	2,811. 52	4,454. 12	-
30100 7	德迈 仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股 流通 受限	5.29	14.44	303.00	1,602. 87	4,375. 32	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	201.00	1,210. 02	4,285. 32	-
30101 2	扬电 科技	2021-0 6-15	2021-1 2-22	新股 流通	8.05	24.26	170.00	1,368. 50	4,124. 20	-

				受限						
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	145.00	3,610.50	3,597.45	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127037	银轮转债	2021-06-07	2021-07-09	新债流通受限	100.00	100.00	471.00	47,100.00	47,100.00	-
113049	长汽转债	2021-06-11	2021-07-08	新债流通受限	100.00	100.00	360.00	36,000.00	36,000.00	-
113626	伯特转债	2021-06-30	2021-07-21	新债流通受限	100.00	100.00	300.00	30,000.00	30,000.00	-
113625	江山转债	2021-06-15	2021-07-01	新债流通受限	100.00	100.00	150.00	15,000.00	15,000.00	-
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债流通受限	100.00	100.00	30.00	3,000.00	3,000.00	-

注：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权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300660	江苏雷利	2021-06-21	重大事项停牌	20.57	2021-07-05	20.82	6,936.00	140,817.99	142,673.52	-
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	245,643.00	3,107,193.20	1,373,144.37	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	000333	美的集团	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	71.37	20,000.00	1,427,400.00
2	000625	长安汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 21 日	26.28	44,000.00	1,156,320.00
3	000651	格力电器	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 20 日	52.10	21,700.00	1,130,570.00
4	601633	长城汽车	2021 年 7 月 7 日	43.59	20,000.00	871,800.00
5	600660	福耀玻璃	2021 年 7 月 2 日	55.85	10,000.00	558,500.00
6	600733	北汽蓝谷	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	13.48	40,000.00	539,200.00
7	601966	玲珑轮胎	2021 年 7 月 2 日	43.74	10,000.00	437,400.00
8	600655	豫园股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 20 日	11.59	30,000.00	347,700.00
9	601238	广汽集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	12.95	20,000.00	259,000.00
10	600699	均胜电子	2021 年 7 月 2 日	25.52	10,000.00	255,200.00
11	600418	江淮汽车	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 22 日	12.43	20,000.00	248,600.00
12	002572	索菲亚	2021 年 7 月 2 日	24.20	10,000.00	242,000.00
13	002607	中公教育	2021 年 7 月 14 日	20.89	10,000.00	208,900.00
14	600637	东方明珠	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	8.19	24,500.00	200,655.00
15	000800	一汽解放	2021 年 7 月 7 日	10.82	16,000.00	173,120.00
16	002239	奥特佳	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 8 日	3.70	37,000.00	136,900.00
17	601311	骆驼股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	11.57	11,400.00	131,898.00
18	002400	省广集团	2021 年 7 月 20 日	5.19	25,000.00	129,750.00
19	600977	中国电影	2021 年 7 月 2 日	12.53	10,000.00	125,300.00

20	000887	中鼎股份	2021 年 7 月 2 日	12.08	10,000.00	120,800.00
21	002563	森马服饰	2021 年 7 月 2 日	11.95	10,000.00	119,500.00
22	300133	华策影视	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	5.92	20,000.00	118,400.00
23	601717	郑煤机	2021 年 7 月 1 日	11.63	10,000.00	116,300.00
24	600158	中体产业	2021 年 7 月 14 日	11.41	10,000.00	114,100.00
25	002024	苏宁易购	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.59	20,000.00	111,800.00
26	000793	华闻集团	2021 年 7 月 5 日	2.65	40,000.00	106,000.00
27	600138	中青旅	2021 年 7 月 6 日	10.50	10,000.00	105,000.00
28	601928	凤凰传媒	2021 年 7 月 2 日	7.14	14,700.00	104,958.00
29	600297	广汇汽车	2021 年 7 月 16 日 -2021 年 7 月 22 日	2.88	36,300.00	104,544.00
30	600742	一汽富维	2021 年 7 月 13 日	10.19	10,000.00	101,900.00
31	002416	爱施德	2021 年 7 月 2 日	10.03	10,000.00	100,300.00
32	300182	捷成股份	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 8 日	4.99	20,000.00	99,800.00
33	600373	中文传媒	2021 年 7 月 2 日	9.86	10,000.00	98,600.00
34	600037	歌华有线	2021 年 7 月 2 日	9.61	10,000.00	96,100.00
35	601098	中南传媒	2021 年 7 月 2 日	8.82	10,000.00	88,200.00
36	000901	航天科技	2021 年 7 月 6 日	8.63	10,000.00	86,300.00
37	000829	天音控股	2021 年 7 月 7 日	8.24	10,000.00	82,400.00
38	002434	万里扬	2021 年 7 月 2 日	8.11	10,000.00	81,100.00
39	001696	宗申动力	2021 年 7 月 14 日	7.98	10,000.00	79,800.00
40	002739	万达电影	2021 年 7 月 9 日	15.79	4,900.00	77,371.00
41	000156	华数传媒	2021 年 7 月 2 日	7.71	10,000.00	77,100.00
42	600398	海澜之家	2021 年 7 月 2 日	7.24	10,000.00	72,400.00
43	002429	兆驰股份	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	6.07	11,500.00	69,805.00
44	000801	四川九洲	2021 年 7 月 22 日	6.77	10,000.00	67,700.00
45	002029	七匹狼	2021 年 7 月 1 日	6.66	10,000.00	66,600.00
46	000016	深康佳 A	2021 年 7 月 13 日	6.66	10,000.00	66,600.00
47	600177	雅戈尔	2021 年 7 月 2 日	6.59	10,000.00	65,900.00
48	002292	奥飞娱乐	2021 年 7 月 14 日	6.48	10,000.00	64,800.00
49	601010	文峰股份	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	3.22	20,000.00	64,400.00
50	000030	富奥股份	2021 年 7 月 1 日	6.37	10,000.00	63,700.00
51	002154	报喜鸟	2021 年 7 月 21 日	6.37	10,000.00	63,700.00
52	601949	中国出版	2021 年 7 月 1 日	6.35	10,000.00	63,500.00
53	002488	金固股份	2021 年 7 月 13 日	6.11	10,000.00	61,100.00
54	600006	东风汽车	2021 年 7 月 9 日	7.30	8,100.00	59,130.00
55	000917	电广传媒	2021 年 7 月 13 日	4.91	12,000.00	58,920.00
56	600831	广电网络	2021 年 7 月 13 日	5.89	10,000.00	58,900.00
57	002115	三维通信	2021 年 7 月 14 日	5.71	10,000.00	57,100.00

58	002085	万丰奥威	2021 年 7 月 2 日	5.60	10,000.00	56,000.00
59	000700	模塑科技	2021 年 7 月 1 日	5.55	10,000.00	55,500.00
60	002537	海联金汇	2021 年 7 月 20 日	5.46	10,000.00	54,600.00
61	000559	万向钱潮	2021 年 7 月 2 日	5.31	10,000.00	53,100.00
62	600987	航民股份	2021 年 7 月 2 日	5.25	10,000.00	52,500.00
63	600609	金杯汽车	2021 年 7 月 13 日	5.18	10,000.00	51,800.00
64	002131	利欧股份	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 20 日	2.34	20,800.00	48,672.00
65	002042	华孚时尚	2021 年 7 月 13 日	4.83	10,000.00	48,300.00
66	000417	合肥百货	2021 年 7 月 21 日	4.54	10,000.00	45,400.00
67	002048	宁波华翔	2021 年 7 月 8 日	19.50	2,200.00	42,900.00
68	600337	美克家居	2021 年 7 月 13 日	4.21	10,000.00	42,100.00
69	600303	曙光股份	2021 年 7 月 6 日	4.14	10,000.00	41,400.00
70	600261	阳光照明	2021 年 7 月 2 日	3.91	10,000.00	39,100.00
71	002512	达华智能	2021 年 7 月 6 日	3.76	10,000.00	37,600.00
72	000850	华茂股份	2021 年 7 月 13 日	3.66	10,000.00	36,600.00
73	603766	隆鑫通用	2021 年 7 月 14 日	3.63	10,000.00	36,300.00
74	002489	浙江永强	2021 年 7 月 15 日	3.51	10,000.00	35,100.00
75	002662	京威股份	2021 年 7 月 1 日	3.48	10,000.00	34,800.00
76	600166	福田汽车	2021 年 7 月 13 日	3.45	10,000.00	34,500.00
77	600448	华纺股份	2021 年 7 月 21 日	3.29	10,000.00	32,900.00
78	002503	搜于特	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	1.57	20,000.00	31,400.00
79	600959	江苏有线	2021 年 7 月 2 日	3.05	10,000.00	30,500.00
80	600839	四川长虹	2021 年 7 月 2 日	2.91	10,000.00	29,100.00
81	601718	际华集团	2021 年 7 月 2 日	2.82	10,000.00	28,200.00
82	002277	友阿股份	2021 年 7 月 14 日	3.46	8,100.00	28,026.00
合计	-	-	-	-	1,128,200.00	12,821,239.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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	39,000.00	-
AAA 以下	92,100.00	36,792.52
未评级	-	-
合计	131,100.00	36,792.52

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	4,845,901.41	-	-	-	4,845,901.41
结算备付金	10,869.11	-	-	-	10,869.11
存出保证金	33,019.64	-	-	-	33,019.64
交易性金融资产	131,100.00	-	-	251,237,739.25	251,368,839.25
应收证券清算款	-	-	-	273,122.43	273,122.43
应收利息	-	-	-	8,741.57	8,741.57
应收股利	-	-	-	23,696.00	23,696.00
资产总计	5,020,890.16	-	-	251,543,299.25	256,564,189.41

负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	103,783.80	103,783.80
应付托管费	-	-	-	20,756.75	20,756.75
应付交易费用	-	-	-	34,542.27	34,542.27
应交税费	-	-	-	593.83	593.83
其他负债	-	-	-	96,618.04	96,618.04
负债总计	-	-	-	256,294.69	256,294.69
利率敏感度缺口	5,020,890.16	-	-	251,287,004.56	256,307,894.72
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	4,048,580.78	-	-	-	4,048,580.78
结算备付金	69,894.04	-	-	-	69,894.04
存出保证金	31,289.80	-	-	-	31,289.80
交易性金融资产	36,792.52	-	-	383,148,876.97	383,185,669.49
应收证券清算款	-	-	-	101,083.43	101,083.43
应收利息	-	-	-	23,599.70	23,599.70
资产总计	4,186,557.14	-	-	383,273,560.10	387,460,117.24
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	159,228.40	159,228.40
应付托管费	-	-	-	31,845.67	31,845.67
应付交易费用	-	-	-	33,127.52	33,127.52
应交税费	-	-	-	1,841.82	1,841.82
其他负债	-	-	-	183,599.28	183,599.28
负债总计	-	-	-	409,642.69	409,642.69
利率敏感度缺口	4,186,557.14	-	-	382,863,917.41	387,050,474.55

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	251,237,739.25	98.02	383,148,876.97	98.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	131,100.00	0.05	36,792.52	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	251,368,839.25	98.07	383,185,669.49	99.00

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%	12,902,342.45	19,323,238.13

	下降 5%	-12,902,342.45	-19,323,238.13
--	-------	----------------	----------------

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 248,742,327.25 元，属于第二层次的余额为人民币 2,626,512.00 元，无属于第三层次的金額（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 380,880,720.80 元，属于第二层次的余额为人民币 2,304,948.69 元，无属于第三层次的金額）。

(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	251,237,739.25	97.92

	其中：股票	251,237,739.25	97.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,100.00	0.05
	其中：债券	131,100.00	0.05
	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	4,856,770.52	1.89
8	其他各项资产	338,579.64	0.13
9	合计	256,564,189.41	100.00

注：（1）上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 12,821,239.00 元，占基金资产净值比例 5.00%。

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	178,079,641.12	69.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	36,330.57	0.01
F	批发和零售业	12,608,934.49	4.92
G	交通运输、仓储和邮政业	311,916.45	0.12
H	住宿和餐饮业	2,625,413.33	1.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,662,766.13	2.60
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	505,463.00	0.20

L	租赁和商务服务业	30,514,699.07	11.91
M	科学研究和技术服务业	238,936.20	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,043,626.19	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,538,686.51	1.38
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,018,145.20	5.86
S	综合	-	-
	合计	251,237,739.25	98.02

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	000333	美的集团	325,408	23,224,368.96	9.06
2	601888	中国中免	65,750	19,731,575.00	7.70
3	000651	格力电器	324,102	16,885,714.20	6.59
4	002594	比亚迪	61,021	15,316,271.00	5.98
5	600690	海尔智家	254,846	6,603,059.86	2.58
6	002027	分众传媒	691,870	6,510,496.70	2.54
7	600660	福耀玻璃	94,440	5,274,474.00	2.06
8	600104	上汽集团	236,034	5,185,666.98	2.02
9	000625	长安汽车	152,801	4,015,610.28	1.57
10	601633	长城汽车	82,091	3,578,346.69	1.40
11	603486	科沃斯	15,480	3,530,678.40	1.38
12	300413	芒果超媒	48,012	3,293,623.20	1.29
13	600741	华域汽车	106,112	2,787,562.24	1.09
14	002607	中公教育	122,864	2,566,628.96	1.00
15	601799	星宇股份	9,300	2,099,196.00	0.82
16	688169	石头科技	1,624	2,047,864.00	0.80
17	600733	北汽蓝谷	144,300	1,945,164.00	0.76
18	601238	广汽集团	144,721	1,874,136.95	0.73
19	300144	宋城演艺	105,597	1,774,029.60	0.69

20	603833	欧派家居	12,247	1,738,584.12	0.68
21	601127	小康股份	26,000	1,733,420.00	0.68
22	603816	顾家家居	21,263	1,643,204.64	0.64
23	002920	德赛西威	14,800	1,629,184.00	0.64
24	601966	玲珑轮胎	36,918	1,614,793.32	0.63
25	002508	老板电器	31,875	1,482,187.50	0.58
26	601058	赛轮轮胎	144,005	1,438,609.95	0.56
27	600699	均胜电子	55,240	1,409,724.80	0.55
28	600754	锦江酒店	24,603	1,401,140.85	0.55
29	002024	苏宁易购	245,643	1,373,144.37	0.54
30	600177	雅戈尔	186,951	1,232,007.09	0.48
31	600655	豫园股份	104,600	1,212,314.00	0.47
32	600066	宇通客车	91,327	1,140,674.23	0.45
33	600637	东方明珠	138,047	1,130,604.93	0.44
34	601689	拓普集团	29,738	1,113,093.34	0.43
35	600418	江淮汽车	89,251	1,109,389.93	0.43
36	603195	公牛集团	5,300	1,070,600.00	0.42
37	600166	福田汽车	309,900	1,069,155.00	0.42
38	002131	利欧股份	454,726	1,064,058.84	0.42
39	002572	索菲亚	42,986	1,040,261.20	0.41
40	002739	万达电影	60,200	950,558.00	0.37
41	600707	彩虹股份	95,702	900,555.82	0.35
42	600060	海信视像	52,979	895,345.10	0.35
43	300251	光线传媒	79,017	854,173.77	0.33
44	601717	郑煤机	70,200	816,426.00	0.32
45	300058	蓝色光标	134,266	812,309.30	0.32
46	600258	首旅酒店	33,268	793,774.48	0.31
47	600297	广汇汽车	273,301	787,106.88	0.31
48	600859	王府井	26,112	754,114.56	0.29
49	002429	兆驰股份	122,102	741,159.14	0.29
50	600839	四川长虹	248,434	722,942.94	0.28
51	000581	威孚高科	33,788	703,804.04	0.27
52	002032	苏泊尔	11,000	701,690.00	0.27
53	300182	捷成股份	138,700	692,113.00	0.27
54	000800	一汽解放	62,549	676,780.18	0.26
55	002242	九阳股份	20,659	671,210.91	0.26
56	002614	奥佳华	29,488	667,313.44	0.26
57	002048	宁波华翔	33,745	658,027.50	0.26
58	002291	星期六	34,800	653,544.00	0.25
59	002563	森马服饰	54,500	651,275.00	0.25
60	002612	朗姿股份	11,902	642,946.04	0.25
61	600398	海澜之家	87,404	632,804.96	0.25
62	600037	歌华有线	65,501	629,464.61	0.25
63	600977	中国电影	50,200	629,006.00	0.25

64	002925	盈趣科技	15,780	613,999.80	0.24
65	603008	喜临门	18,296	603,950.96	0.24
66	000887	中鼎股份	49,300	595,544.00	0.23
67	603489	八方股份	2,500	590,950.00	0.23
68	300616	尚品宅配	6,640	587,706.40	0.23
69	002705	新宝股份	22,300	585,375.00	0.23
70	002867	周大生	29,475	582,720.75	0.23
71	002472	双环传动	36,854	578,607.80	0.23
72	002085	万丰奥威	102,956	576,553.60	0.22
73	603650	彤程新材	11,800	567,580.00	0.22
74	002239	奥特佳	152,599	564,616.30	0.22
75	603129	春风动力	4,500	558,360.00	0.22
76	002126	银轮股份	53,306	554,382.40	0.22
77	601311	骆驼股份	45,320	524,352.40	0.20
78	600158	中体产业	44,300	505,463.00	0.20
79	002759	天际股份	13,503	501,636.45	0.20
80	000016	深康佳 A	75,312	501,577.92	0.20
81	601718	际华集团	177,000	499,140.00	0.19
82	603596	伯特利	13,700	489,775.00	0.19
83	002400	省广集团	93,867	487,169.73	0.19
84	000559	万向钱潮	89,069	472,956.39	0.18
85	000917	电广传媒	95,086	466,872.26	0.18
86	002832	比音勒芬	18,015	461,003.85	0.18
87	603306	华懋科技	12,600	457,254.00	0.18
88	600682	南京新百	45,353	456,251.18	0.18
89	300133	华策影视	76,942	455,496.64	0.18
90	600612	老凤祥	8,516	451,092.52	0.18
91	600373	中文传媒	45,498	448,610.28	0.18
92	000921	海信家电	30,356	436,215.72	0.17
93	601098	中南传媒	48,900	431,298.00	0.17
94	000681	视觉中国	32,956	426,121.08	0.17
95	002416	爱施德	41,706	418,311.18	0.16
96	002154	报喜鸟	65,445	416,884.65	0.16
97	300432	富临精工	29,920	415,888.00	0.16
98	600959	江苏有线	134,561	410,411.05	0.16
99	600138	中青旅	38,973	409,216.50	0.16
100	002351	漫步者	29,863	404,345.02	0.16
101	600006	东风汽车	53,900	393,470.00	0.15
102	300783	三只松鼠	8,100	383,616.00	0.15
103	000839	中信国安	185,050	383,053.50	0.15
104	300770	新媒股份	7,740	376,938.00	0.15
105	600729	重庆百货	13,726	376,778.70	0.15
106	600986	浙文互联	89,040	373,968.00	0.15
107	002293	罗莱生活	27,700	370,903.00	0.14

108	001696	宗申动力	46,400	370,272.00	0.14
109	300792	壹网壹创	7,251	370,018.53	0.14
110	600742	一汽富维	36,107	367,930.33	0.14
111	601928	凤凰传媒	51,400	366,996.00	0.14
112	002434	万里扬	44,988	364,852.68	0.14
113	000501	鄂武商 A	31,020	362,934.00	0.14
114	000793	华闻集团	134,600	356,690.00	0.14
115	603355	莱克电气	5,500	342,265.00	0.13
116	603877	太平鸟	6,400	341,632.00	0.13
117	300755	华致酒行	8,360	341,171.60	0.13
118	000829	天音控股	41,400	341,136.00	0.13
119	002035	华帝股份	46,880	338,473.60	0.13
120	603801	志邦家居	10,564	337,625.44	0.13
121	000913	钱江摩托	18,400	328,808.00	0.13
122	000550	江铃汽车	14,000	328,020.00	0.13
123	002488	金固股份	53,651	327,807.61	0.13
124	603179	新泉股份	9,966	327,682.08	0.13
125	600337	美克家居	77,000	324,170.00	0.13
126	000901	航天科技	37,505	323,668.15	0.13
127	601010	文峰股份	99,400	320,068.00	0.12
128	002677	浙江美大	17,400	318,072.00	0.12
129	300280	紫天科技	8,700	317,637.00	0.12
130	601163	三角轮胎	21,800	316,536.00	0.12
131	002045	国光电器	25,256	314,184.64	0.12
132	002190	成飞集成	11,800	306,682.00	0.12
133	600327	大东方	35,600	306,160.00	0.12
134	603305	旭升股份	9,000	303,570.00	0.12
135	000030	富奥股份	47,539	302,823.43	0.12
136	603313	梦百合	10,050	302,002.50	0.12
137	002283	天润工业	54,204	300,290.16	0.12
138	002906	华阳集团	9,500	300,010.00	0.12
139	002042	华孚时尚	61,413	296,624.79	0.12
140	002292	奥飞娱乐	45,600	295,488.00	0.12
141	000156	华数传媒	37,440	288,662.40	0.11
142	600694	大商股份	13,864	287,816.64	0.11
143	600480	凌云股份	31,012	284,069.92	0.11
144	300061	旗天科技	31,100	279,900.00	0.11
145	000801	四川九洲	41,240	279,194.80	0.11
146	600628	新世界	34,955	276,144.50	0.11
147	600609	金杯汽车	52,975	274,410.50	0.11
148	002537	海联金汇	49,720	271,471.20	0.11
149	601929	吉视传媒	146,690	271,376.50	0.11
150	603035	常熟汽饰	16,600	270,580.00	0.11
151	300475	聚隆科技	11,100	268,842.00	0.10

152	603208	江山欧派	2,830	265,991.70	0.10
153	603377	东方时尚	24,708	264,128.52	0.10
154	002516	旷达科技	49,500	262,350.00	0.10
155	603515	欧普照明	10,120	259,780.40	0.10
156	002251	步步高	35,040	257,894.40	0.10
157	002489	浙江永强	73,052	256,412.52	0.10
158	000589	贵州轮胎	45,000	253,350.00	0.10
159	603766	隆鑫通用	69,158	251,043.54	0.10
160	000796	凯撒旅业	26,800	250,580.00	0.10
161	002540	亚太科技	51,400	250,318.00	0.10
162	603348	文灿股份	7,000	245,000.00	0.10
163	603587	地素时尚	9,760	243,121.60	0.09
164	002668	奥马电器	43,907	241,927.57	0.09
165	002284	亚太股份	29,835	241,365.15	0.09
166	000700	模塑科技	43,304	240,337.20	0.09
167	601949	中国出版	36,900	234,315.00	0.09
168	688383	新益昌	1,655	233,371.55	0.09
169	002029	七匹狼	34,700	231,102.00	0.09
170	600261	阳光照明	58,911	230,342.01	0.09
171	603197	保隆科技	6,980	229,572.20	0.09
172	603997	继峰股份	27,800	228,516.00	0.09
173	002503	搜于特	145,114	227,828.98	0.09
174	002277	友阿股份	65,712	227,363.52	0.09
175	600933	爱柯迪	17,400	226,896.00	0.09
176	600715	文投控股	74,778	226,577.34	0.09
177	603786	科博达	3,000	226,500.00	0.09
178	002707	众信旅游	36,642	226,081.14	0.09
179	600831	广电网络	38,300	225,587.00	0.09
180	002345	潮宏基	42,601	223,229.24	0.09
181	000996	中国中期	23,269	220,357.43	0.09
182	300258	精锻科技	16,300	217,931.00	0.09
183	601366	利群股份	34,800	217,848.00	0.08
184	600070	浙江富润	24,630	217,482.90	0.08
185	600757	长江传媒	40,871	217,025.01	0.08
186	300680	隆盛科技	8,080	216,140.00	0.08
187	002406	远东传动	33,605	216,080.15	0.08
188	002327	富安娜	27,903	215,969.22	0.08
189	002115	三维通信	37,800	215,838.00	0.08
190	000541	佛山照明	36,316	214,990.72	0.08
191	002664	长鹰信质	13,772	214,980.92	0.08
192	300342	天银机电	17,407	214,976.45	0.08
193	605168	三人行	1,400	214,704.00	0.08
194	002959	小熊电器	3,200	212,608.00	0.08
195	002510	天汽模	51,408	212,315.04	0.08

196	002419	天虹股份	32,300	211,888.00	0.08
197	002031	巨轮智能	118,100	211,399.00	0.08
198	002083	孚日股份	48,800	210,816.00	0.08
199	600636	国新文化	20,700	209,484.00	0.08
200	000026	飞亚达	14,925	207,756.00	0.08
201	002512	达华智能	54,101	203,419.76	0.08
202	002355	兴民智通	33,213	201,270.78	0.08
203	002448	中原内配	32,550	198,555.00	0.08
204	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.08
205	002003	伟星股份	31,480	196,435.20	0.08
206	300160	秀强股份	25,091	195,709.80	0.08
207	300217	东方电热	59,884	194,623.00	0.08
208	600523	贵航股份	13,565	194,250.80	0.08
209	000957	中通客车	31,910	194,012.80	0.08
210	000955	欣龙控股	36,400	193,648.00	0.08
211	002213	大为股份	13,900	192,932.00	0.08
212	600987	航民股份	36,539	191,829.75	0.07
213	601801	皖新传媒	40,289	190,164.08	0.07
214	603579	荣泰健康	4,600	188,968.00	0.07
215	000726	鲁泰 A	31,586	188,884.28	0.07
216	600880	博瑞传播	50,400	187,488.00	0.07
217	600653	申华控股	104,817	186,574.26	0.07
218	300526	中潜股份	5,544	185,169.60	0.07
219	300304	云意电气	34,930	183,033.20	0.07
220	601566	九牧王	11,694	183,011.10	0.07
221	600336	澳柯玛	32,200	182,574.00	0.07
222	603096	新经典	5,500	182,490.00	0.07
223	600824	益民集团	49,607	182,057.69	0.07
224	600220	江苏阳光	84,200	181,872.00	0.07
225	603180	金牌厨柜	3,804	181,412.76	0.07
226	300894	火星人	2,640	179,520.00	0.07
227	300816	艾可蓝	2,100	179,298.00	0.07
228	603730	岱美股份	9,694	176,624.68	0.07
229	600335	国机汽车	29,570	175,350.10	0.07
230	002662	京威股份	50,304	175,057.92	0.07
231	688022	瀚川智能	4,316	173,891.64	0.07
232	300242	佳云科技	34,300	172,529.00	0.07
233	300973	立高食品	1,137	171,755.94	0.07
234	002328	新朋股份	36,173	171,460.02	0.07
235	002984	森麒麟	4,700	171,315.00	0.07
236	600676	交运股份	41,495	170,544.45	0.07
237	600054	黄山旅游	17,300	170,232.00	0.07
238	603319	湘油泵	6,440	169,694.00	0.07
239	300464	星徽股份	14,300	168,740.00	0.07

240	603610	麒盛科技	9,355	167,922.25	0.07
241	000417	合肥百货	36,892	167,489.68	0.07
242	300272	开能健康	23,315	165,536.50	0.06
243	600686	金龙汽车	24,110	163,706.90	0.06
244	601339	百隆东方	30,300	163,317.00	0.06
245	002536	飞龙股份	20,121	160,968.00	0.06
246	603809	豪能股份	12,172	160,913.84	0.06
247	300428	立中集团	12,200	159,942.00	0.06
248	000888	峨眉山 A	24,902	159,621.82	0.06
249	300063	天龙集团	35,200	158,752.00	0.06
250	000599	青岛双星	37,983	158,389.11	0.06
251	300279	和晶科技	24,120	157,503.60	0.06
252	600960	渤海汽车	38,500	157,465.00	0.06
253	002654	万润科技	41,300	157,353.00	0.06
254	600825	新华传媒	34,900	157,050.00	0.06
255	000038	深大通	13,940	155,431.00	0.06
256	603303	得邦照明	9,840	154,980.00	0.06
257	002084	海鸥住工	28,695	154,666.05	0.06
258	603358	华达科技	8,820	153,203.40	0.06
259	002059	云南旅游	27,300	152,880.00	0.06
260	600303	曙光股份	36,279	150,195.06	0.06
261	002404	嘉欣丝绸	23,300	149,120.00	0.06
262	002087	新野纺织	43,891	148,790.49	0.06
263	300651	金陵体育	3,490	148,045.80	0.06
264	300291	华录百纳	30,900	148,011.00	0.06
265	300176	派生科技	20,894	147,511.64	0.06
266	002101	广东鸿图	17,911	146,870.20	0.06
267	002621	美吉姆	27,880	146,370.00	0.06
268	600996	贵广网络	28,200	145,794.00	0.06
269	300911	亿田智能	2,100	145,488.00	0.06
270	600088	中视传媒	13,365	144,074.70	0.06
271	300788	中信出版	3,900	143,403.00	0.06
272	600229	城市传媒	23,602	143,264.14	0.06
273	000719	中原传媒	20,700	143,244.00	0.06
274	002699	美盛文化	30,462	142,866.78	0.06
275	300660	江苏雷利	6,936	142,673.52	0.06
276	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.06
277	600136	当代文体	23,500	142,175.00	0.06
278	603825	华扬联众	7,700	142,142.00	0.06
279	601900	南方传媒	18,200	141,960.00	0.06
280	000521	长虹美菱	41,701	141,783.40	0.06
281	601858	中国科传	15,900	141,669.00	0.06
282	002676	顺威股份	33,800	141,622.00	0.06
283	002627	三峡旅游	22,950	141,372.00	0.06

284	603158	腾龙股份	12,080	141,336.00	0.06
285	601595	上海电影	12,120	141,319.20	0.06
286	603808	歌力思	8,895	140,541.00	0.05
287	002553	南方轴承	13,800	140,208.00	0.05
288	600448	华纺股份	42,540	139,956.60	0.05
289	300403	汉宇集团	20,224	139,950.08	0.05
290	002033	丽江股份	22,155	139,576.50	0.05
291	000850	华茂股份	38,100	139,446.00	0.05
292	603868	飞科电器	3,300	138,798.00	0.05
293	603558	健盛集团	15,804	137,336.76	0.05
294	002238	天威视讯	21,710	137,207.20	0.05
295	300577	开润股份	6,400	137,152.00	0.05
296	603818	曲美家居	15,400	136,752.00	0.05
297	003016	欣贺股份	8,500	136,085.00	0.05
298	600730	中国高科	31,800	135,786.00	0.05
299	002454	松芝股份	25,163	135,628.57	0.05
300	600838	上海九百	21,700	134,540.00	0.05
301	002181	粤传媒	31,300	133,964.00	0.05
302	000665	湖北广电	33,307	133,894.14	0.05
303	600107	美尔雅	19,400	132,890.00	0.05
304	002634	棒杰股份	21,703	132,605.33	0.05
305	600814	杭州解百	19,200	131,136.00	0.05
306	002186	全聚德	12,400	129,704.00	0.05
307	002486	嘉麟杰	44,700	129,630.00	0.05
308	002343	慈文传媒	25,486	128,449.44	0.05
309	300507	苏奥传感	14,383	127,433.38	0.05
310	603551	奥普家居	10,700	127,116.00	0.05
311	600593	*ST 圣亚	6,000	127,080.00	0.05
312	603519	立霸股份	8,900	126,825.00	0.05
313	300375	鹏翎股份	28,600	126,698.00	0.05
314	600576	祥源文化	24,800	126,480.00	0.05
315	600738	丽尚国潮	20,700	126,477.00	0.05
316	002590	万安科技	16,201	124,585.69	0.05
317	600081	东风科技	8,400	123,312.00	0.05
318	600135	乐凯胶片	18,638	121,892.52	0.05
319	600865	百大集团	15,245	120,892.85	0.05
320	002708	光洋股份	19,925	120,745.50	0.05
321	603239	浙江仙通	7,300	120,012.00	0.05
322	002721	金一文化	38,554	119,131.86	0.05
323	300625	三雄极光	7,500	119,025.00	0.05
324	002780	三夫户外	6,800	119,000.00	0.05
325	600469	风神股份	24,500	118,825.00	0.05
326	002105	信隆健康	14,900	118,753.00	0.05
327	605068	明新旭腾	3,300	118,701.00	0.05

328	002765	蓝黛科技	15,500	118,265.00	0.05
329	300622	博士眼镜	5,800	117,682.00	0.05
330	000025	特力 A	7,885	117,328.80	0.05
331	603123	翠微股份	16,100	116,725.00	0.05
332	600052	浙江广厦	33,900	116,616.00	0.05
333	300793	佳禾智能	7,140	116,382.00	0.05
334	300805	电声股份	8,400	115,668.00	0.05
335	300192	科德教育	11,700	115,596.00	0.05
336	300729	乐歌股份	4,800	114,864.00	0.04
337	002631	德尔未来	18,100	113,306.00	0.04
338	600178	东安动力	15,200	113,088.00	0.04
339	603898	好莱客	8,200	112,340.00	0.04
340	002712	思美传媒	23,490	112,047.30	0.04
341	300824	北鼎股份	4,400	110,528.00	0.04
342	002543	万和电气	14,800	110,260.00	0.04
343	605099	共创草坪	2,600	110,188.00	0.04
344	002394	联发股份	13,400	109,478.00	0.04
345	002853	皮阿诺	5,000	108,150.00	0.04
346	000785	居然之家	17,700	107,439.00	0.04
347	000526	学大教育	4,000	105,960.00	0.04
348	603600	永艺股份	10,300	105,884.00	0.04
349	300707	威唐工业	6,300	105,525.00	0.04
350	300580	贝斯特	5,400	105,030.00	0.04
351	002878	元隆雅图	5,954	104,195.00	0.04
352	300473	德尔股份	4,500	103,860.00	0.04
353	002571	德力股份	15,500	103,540.00	0.04
354	002659	凯文教育	28,000	103,040.00	0.04
355	603136	天目湖	6,257	102,865.08	0.04
356	601999	出版传媒	14,900	102,661.00	0.04
357	603385	惠达卫浴	10,440	102,625.20	0.04
358	603085	天成自控	14,600	102,200.00	0.04
359	000524	岭南控股	13,500	102,195.00	0.04
360	600697	欧亚集团	7,500	101,925.00	0.04
361	300694	蠡湖股份	8,700	101,877.00	0.04
362	605108	同庆楼	5,300	101,654.00	0.04
363	603999	读者传媒	19,400	101,268.00	0.04
364	600693	东百集团	24,200	101,156.00	0.04
365	002397	梦洁股份	25,400	100,838.00	0.04
366	600551	时代出版	13,700	100,832.00	0.04
366	300733	西菱动力	4,600	100,832.00	0.04
367	002965	祥鑫科技	4,000	99,960.00	0.04
368	603366	日出东方	21,600	99,360.00	0.04
369	300968	格林精密	6,440	99,349.88	0.04
370	002674	兴业科技	7,700	98,945.00	0.04

371	000607	华媒控股	27,300	98,553.00	0.04
372	603787	新日股份	4,100	98,318.00	0.04
373	603661	恒林股份	2,000	98,140.00	0.04
374	002953	日丰股份	6,520	97,995.60	0.04
375	000892	欢瑞世纪	33,000	97,020.00	0.04
376	000428	华天酒店	34,500	96,945.00	0.04
377	002723	金莱特	7,140	96,033.00	0.04
378	688288	鸿泉物联	2,000	95,180.00	0.04
379	603608	天创时尚	14,540	95,091.60	0.04
380	603598	引力传媒	9,000	94,230.00	0.04
381	002103	广博股份	21,600	93,528.00	0.04
382	600712	南宁百货	22,200	93,240.00	0.04
383	603788	宁波高发	7,340	92,777.60	0.04
384	002758	浙农股份	9,800	92,708.00	0.04
385	002348	高乐股份	38,404	92,169.60	0.04
386	603633	徕木股份	8,800	91,960.00	0.04
387	603121	华培动力	8,876	91,600.32	0.04
388	603040	新坐标	4,514	91,092.52	0.04
389	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.04
390	603982	泉峰汽车	5,400	90,936.00	0.04
391	002187	广百股份	11,200	89,600.00	0.03
392	300681	英搏尔	2,500	89,475.00	0.03
393	603214	爱婴室	3,800	89,376.00	0.03
394	002703	浙江世宝	15,400	89,320.00	0.03
395	300833	浩洋股份	1,700	88,604.00	0.03
396	300877	金春股份	2,400	88,248.00	0.03
397	688315	诺禾致源	2,251	88,239.20	0.03
398	600623	华谊集团	10,000	88,100.00	0.03
399	000757	浩物股份	22,477	87,885.07	0.03
400	603950	长源东谷	4,700	87,608.00	0.03
401	300612	宣亚国际	5,400	87,264.00	0.03
402	603390	通达电气	9,300	86,862.00	0.03
403	603657	春光科技	2,660	85,519.00	0.03
404	003032	传智教育	2,700	84,915.00	0.03
405	603398	邦宝益智	9,200	84,272.00	0.03
406	002905	金逸影视	10,060	82,793.80	0.03
407	300863	卡倍亿	1,100	82,665.00	0.03
408	002363	隆基机械	16,700	80,828.00	0.03
409	300643	万通智控	6,700	80,802.00	0.03
410	603166	福达股份	11,900	80,444.00	0.03
411	603238	诺邦股份	3,400	80,240.00	0.03
412	605117	德业股份	627	80,005.20	0.03
413	603023	威帝股份	18,954	79,606.80	0.03
414	300901	中胤时尚	4,700	79,289.00	0.03

415	605136	丽人丽妆	2,600	79,118.00	0.03
416	603665	康隆达	5,300	78,758.00	0.03
417	603701	德宏股份	8,640	78,019.20	0.03
418	603839	安正时尚	8,160	78,009.60	0.03
419	605299	舒华体育	3,600	77,436.00	0.03
420	300868	杰美特	2,500	76,525.00	0.03
421	603103	横店影视	5,180	76,249.60	0.03
422	603055	台华新材	11,160	75,330.00	0.03
423	605336	帅丰电器	2,800	75,320.00	0.03
424	600818	中路股份	7,964	74,065.20	0.03
425	603726	朗迪集团	5,100	72,879.00	0.03
426	002870	香山股份	2,200	72,600.00	0.03
427	600679	上海凤凰	6,000	71,820.00	0.03
428	300928	华安鑫创	1,600	71,408.00	0.03
429	300840	酷特智能	4,800	70,464.00	0.03
430	603615	茶花股份	6,500	69,550.00	0.03
431	603326	我乐家居	6,380	68,840.20	0.03
432	300920	润阳科技	2,000	67,360.00	0.03
433	300695	兆丰股份	1,300	66,963.00	0.03
434	603758	秦安股份	8,900	66,839.00	0.03
435	002863	今飞凯达	13,200	66,264.00	0.03
436	003010	若羽臣	2,400	65,208.00	0.03
437	003011	海象新材	2,000	64,980.00	0.03
438	002725	跃岭股份	8,500	64,770.00	0.03
439	300893	松原股份	2,900	64,728.00	0.03
440	300926	博俊科技	2,800	63,280.00	0.02
441	002740	爱迪尔	15,401	62,990.09	0.02
442	603768	常青股份	4,000	62,960.00	0.02
443	300781	因赛集团	2,890	62,597.40	0.02
444	603101	汇嘉时代	12,540	62,449.20	0.02
445	603949	雪龙集团	4,300	60,974.00	0.02
446	300808	久量股份	4,300	60,716.00	0.02
447	603655	朗博科技	2,900	59,885.00	0.02
448	300528	幸福蓝海	10,200	58,854.00	0.02
449	300819	聚杰微纤	1,900	58,387.00	0.02
450	600828	茂业商业	16,200	57,348.00	0.02
451	603013	亚普股份	4,200	57,036.00	0.02
452	301018	申菱环境	6,754	55,990.66	0.02
453	605055	迎丰股份	5,800	55,216.00	0.02
454	603992	松霖科技	3,000	55,080.00	0.02
455	605128	上海沿浦	1,600	54,080.00	0.02
456	605088	冠盛股份	3,300	53,262.00	0.02
457	300919	中伟股份	326	53,138.00	0.02
458	603900	莱绅通灵	6,900	52,164.00	0.02

459	605228	神通科技	5,500	51,810.00	0.02
460	603221	爱丽家居	4,900	51,597.00	0.02
461	605003	众望布艺	2,200	51,414.00	0.02
462	601086	国芳集团	13,100	50,828.00	0.02
463	603408	建霖家居	3,300	48,906.00	0.02
464	003023	彩虹集团	1,600	48,480.00	0.02
465	605151	西上海	2,600	47,788.00	0.02
466	688682	霍莱沃	442	45,901.70	0.02
467	603848	好太太	3,600	44,352.00	0.02
468	688499	利元亨	1,124	43,667.40	0.02
469	605005	合兴股份	2,600	42,328.00	0.02
470	603629	利通电子	1,900	41,401.00	0.02
471	300985	致远新能	1,443	41,096.67	0.02
472	605018	长华股份	3,000	39,630.00	0.02
473	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
474	605333	沪光股份	2,600	35,594.00	0.01
475	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
476	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
477	688087	英科再生	1,283	28,174.68	0.01
478	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
479	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
480	300953	震裕科技	165	16,475.25	0.01
481	605098	行动教育	289	16,262.03	0.01
482	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
483	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
484	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
485	300909	汇创达	299	12,886.90	0.01
486	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
487	300941	创识科技	252	12,584.88	0.00
488	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
489	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
490	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
491	605289	罗曼股份	380	10,959.20	0.00
492	301009	可靠股份	385	10,737.65	0.00
493	300918	南山智尚	1,000	10,410.00	0.00
494	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
495	300996	普联软件	221	9,332.83	0.00
496	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
497	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
498	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
499	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
500	300997	欢乐家	663	8,652.15	0.00
501	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
502	301016	雷尔伟	256	8,442.88	0.00

503	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
504	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
505	300956	英力股份	304	7,843.20	0.00
506	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
507	300961	深水海纳	302	6,665.14	0.00
508	300981	中红医疗	73	6,598.47	0.00
509	300955	嘉亨家化	142	6,541.94	0.00
510	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
511	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
512	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
513	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
514	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
515	300963	中洲特材	221	4,970.29	0.00
516	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
517	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
518	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
519	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
520	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
521	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	3,510,083.00	0.91
2	688169	石头科技	2,311,028.99	0.60
3	002607	中公教育	1,948,989.00	0.50
4	601888	中国中免	1,029,550.00	0.27
5	601238	广汽集团	1,020,128.00	0.26
6	601127	小康股份	627,837.00	0.16
7	600158	中体产业	616,683.00	0.16
8	000651	格力电器	554,420.00	0.14
9	002594	比亚迪	518,235.00	0.13
10	603195	公牛集团	509,766.00	0.13
11	002920	德赛西威	479,323.00	0.12
12	603489	八方股份	474,008.00	0.12
13	600707	彩虹股份	473,644.00	0.12
14	601799	星宇股份	321,461.00	0.08
15	002190	成飞集成	303,429.00	0.08

16	002115	三维通信	234,452.00	0.06
17	300792	壹网壹创	232,726.00	0.06
18	600690	海尔智家	231,367.00	0.06
19	600636	国新文化	223,455.00	0.06
20	000100	TCL 科技	215,906.00	0.06

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	601888	中国中免	11,106,038.00	2.87
2	000100	TCL 科技	7,111,326.40	1.84
3	600690	海尔智家	4,369,150.32	1.13
4	600104	上汽集团	2,853,683.00	0.74
5	600660	福耀玻璃	2,706,080.60	0.70
6	002625	光启技术	1,674,773.29	0.43
7	601633	长城汽车	1,669,491.00	0.43
8	600741	华域汽车	1,629,586.00	0.42
9	601966	玲珑轮胎	1,604,811.62	0.41
10	601799	星宇股份	1,257,838.00	0.32
11	603833	欧派家居	928,537.00	0.24
12	603486	科沃斯	900,077.00	0.23
13	603816	顾家家居	857,613.90	0.22
14	600177	雅戈尔	757,124.00	0.20
15	600699	均胜电子	753,778.00	0.19
16	601965	中国汽研	716,860.25	0.19
17	601689	拓普集团	701,855.00	0.18
18	603195	公牛集团	688,147.00	0.18
19	600733	北汽蓝谷	680,920.00	0.18
20	600066	宇通客车	671,901.00	0.17

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	35,014,500.95
卖出股票收入（成交）总额	89,034,741.15

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	131,100.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,100.00	0.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127037	银轮转债	471	47,100.00	0.02
2	113049	长汽转债	360	36,000.00	0.01
3	113626	伯特转债	300	30,000.00	0.01
4	113625	江山转债	150	15,000.00	0.01
5	113050	南银转债	30	3,000.00	0.00

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，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。

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	33,019.64
2	应收证券清算款	273,122.43
3	应收股利	23,696.00
4	应收利息	8,741.57

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	338,579.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	1,427,400.00	0.56	转融通流通受限
2	000625	长安汽车	1,156,320.00	0.45	转融通流通受限
3	000651	格力电器	1,130,570.00	0.44	转融通流通受限
4	601633	长城汽车	871,800.00	0.34	转融通流通受限
5	600660	福耀玻璃	558,500.00	0.22	转融通流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

1,963	64,266.99	114,062,496.00	90.41%	12,093,598.00	9.59%	113,446,968.00	89.93%
-------	-----------	----------------	--------	---------------	-------	----------------	--------

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴晓彤	1,260,035.00	1.00%
2	文华	701,800.00	0.56%
3	钱中明	341,500.00	0.27%
4	天风证券-广发银行-天风证券全天候宏观配置 1 号集合资产管理计划	300,000.00	0.24%
5	沈婷婷	232,100.00	0.18%
6	涂慧芬	187,200.00	0.15%
7	闻振华	181,000.00	0.14%
8	陈荣荣	171,000.00	0.14%
9	李超伦	137,400.00	0.11%
10	郑州银行股份有限公司	106,600.00	0.08%
11	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	113,446,968.00	89.93%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 6 月 3 日）基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	194,156,094.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	72,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	126,156,094.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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	
长江证券	2	28,962,905.63	24.03%	21,108.41	23.97%	-
安信证券	1	35,350,276.96	29.34%	25,851.74	29.36%	-
海通证券	2	56,189,938.47	46.63%	41,090.75	46.67%	-

东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

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
长江证券	128,260.50	51.06%	-	-	-	-
安信证券	56,213.60	22.38%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	66,700.00	26.56%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金场外申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-29
6	关于广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-20
7	关于广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20210101-20210630	169,664,668.00	4,000,000.00	60,217,700.00	113,446,968.00	89.93%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
2. 《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3. 《广发中证全指可选消费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