

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末上市基金前十名持有人	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.4 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情况	62
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息	66
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	66
§13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指原材料 ETF
场内简称	材料 ETF
基金主代码	159944
交易代码	159944
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 25 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,608,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 6 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510308	100818
法定代表人		孙树明	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	2,247,519.69	-1,749,177.37	-7,366,624.23
本期利润	7,912,285.47	3,938,036.99	-16,647,739.75
加权平均基金份额本期利润	0.2326	0.1304	-0.3249
本期加权平均净值利润率	27.65%	18.31%	-38.90%
本期基金份额净值增长率	28.75%	25.32%	-36.34%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	-6,446,171.88	-7,882,411.20	-11,549,213.72
期末可供分配基金份额利润	-0.2177	-0.2662	-0.3901
期末基金资产净值	29,133,351.04	22,629,184.30	18,059,128.28
期末基金份额净值	0.9840	0.7643	0.6099
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	-1.60%	-23.56%	-39.01%

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）。

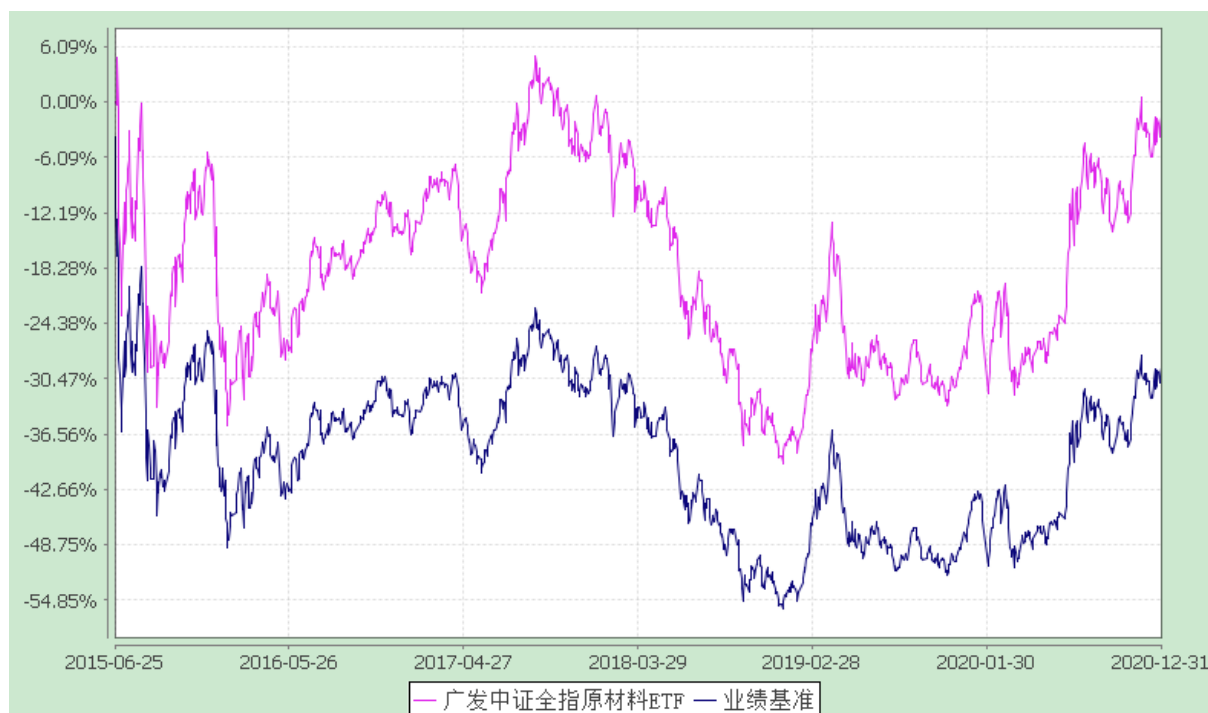
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	14.75%	1.32%	15.14%	1.34%	-0.39%	-0.02%
过去六个月	28.91%	1.58%	29.45%	1.59%	-0.54%	-0.01%
过去一年	28.75%	1.63%	28.18%	1.65%	0.57%	-0.02%
过去三年	2.70%	1.51%	1.80%	1.54%	0.90%	-0.03%
过去五年	7.42%	1.52%	-2.39%	1.55%	9.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-1.60%	1.76%	-29.31%	1.78%	27.71%	-0.02%

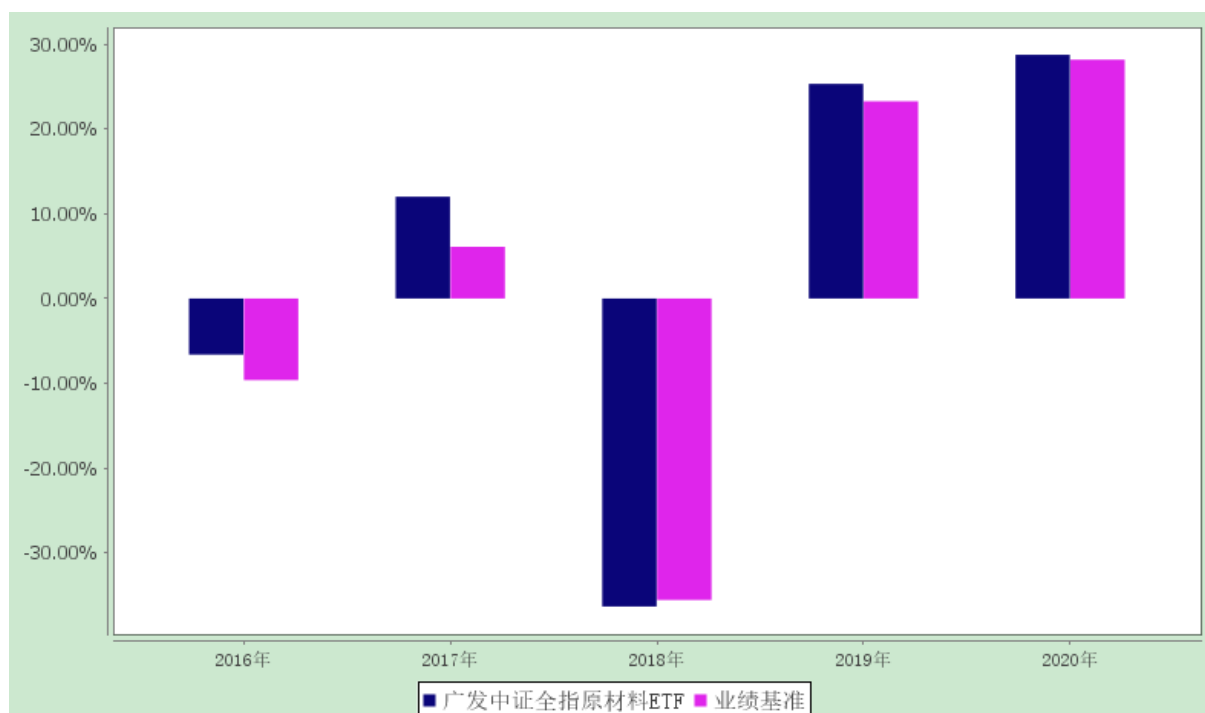
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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的历史走势对比图
(2015 年 6 月 25 日至 2020 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆志明	本基金的基金	2015-06-2	-	22 年	陆志明先生，经济学硕士，持有

	<p>经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指金融</p>	5		<p>中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 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)。</p>
--	---	---	--	--

	地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；量化投资部副总经理				
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金主要采取完全复制法投资策略跟踪指数，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。

2020 年，疫情肆虐全球，人类活动受到了严重的制约，全球各国为了应对疫情对经济的冲击，纷纷采取宽松的货币政策。中国在疫情防控方面较为成功，经济也快速从疫情中复苏。2020 年全年国内生产总值同比上涨 2.3%，分季度看，一季度同比下降 6.8%，二季度同比增长 3.2%，三季度同比增长 4.9%，四季度同比增长 6.5%。全年，上证指数上涨 13.87%，深证成指上涨 38.73%，创业板指上涨 64.96%，中证全指原材料指数上涨 28.18%。

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 28.75%，同期业绩比较基准收益率为 28.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，新冠疫苗已推出，全球的接种人数有望快速增加。可以预计，随着新冠疫苗的普

及，全球经济或将从疫情中得到恢复。中国在 2020 年 4 季度的经济水平已经恢复到疫情前的水平，预计 2021 年，中国经济运行稳步发展，市场预期总体向好，社会发展大局稳定。从供给端及需求端来看，受全球疫情影响，材料供给与需求均有所减少。稀有金属、有色金属方面，锂钴是新能源汽车电池的重要材料，新能源汽车产业的需求大增对锂钴产品的拉动作用持续显现。未来预计锂钴原料端的紧张局面将持续，价格将保持上涨态势。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

（2）持续加强制度建设，积极推进公司内部管理进一步精细化、规范化、科学化。

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

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

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

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

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

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

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

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

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理

制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 7 月 17 日、2020 年 7 月 22 日至 2020 年 12 月 31 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

安永华明（2021）审字第 60873695_G176 号

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时，管理层负责评估广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2021 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	332,435.92	375,792.07
结算备付金		19,416.43	-
存出保证金		624.39	300.45
交易性金融资产	7.4.7.2	28,875,053.71	22,293,065.13
其中：股票投资		28,865,602.11	22,293,065.13

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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	73.09	76.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		29,227,603.54	22,669,233.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,459.40	9,011.51
应付托管费		2,491.89	1,802.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,417.87	1,735.78
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	7.4.7.8	69,883.33	27,500.00
负债合计		94,252.50	40,049.61
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	29,608,342.00	29,608,342.00
未分配利润	7.4.7.10	-474,990.96	-6,979,157.70
所有者权益合计		29,133,351.04	22,629,184.30
负债和所有者权益总计		29,227,603.54	22,669,233.91

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.9840 元，基金份额总额 29,608,342.00 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		8,238,288.12	4,191,751.27
1.利息收入		3,133.09	2,980.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,085.55	2,980.66
债券利息收入		47.54	-
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,543,468.81	-1,474,771.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,122,920.93	-1,889,583.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	48,090.95	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	372,456.93	414,811.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,664,765.78	5,687,214.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	26,920.44	-23,672.00
减：二、费用		326,002.65	253,714.28
1. 管理人报酬		141,644.82	107,335.92
2. 托管费		28,328.93	21,467.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	77,836.12	6,866.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	-
7. 其他费用	7.4.7.19	78,192.74	118,045.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,912,285.47	3,938,036.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,912,285.47	3,938,036.99

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	29,608,342.00	-6,979,157.70	22,629,184.30

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,912,285.47	7,912,285.47
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）	-	-1,408,118.73	-1,408,118.73
其中：1.基金申购款	54,000,000.00	-7,298,294.58	46,701,705.42
2.基金赎回款	-54,000,000.00	5,890,175.85	-48,109,824.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	29,608,342.00	-474,990.96	29,133,351.04
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29,608,342.00	-11,549,213.72	18,059,128.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,938,036.99	3,938,036.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	632,019.03	632,019.03
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	-1,177,544.78	6,822,455.22
2.基金赎回款	-8,000,000.00	1,809,563.81	-6,190,436.19

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	29,608,342.00	-6,979,157.70	22,629,184.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明 主管会计工作负责人：窦刚 会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发中证全指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 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公

允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时

本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

（6）债券投资收益/（损失）

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配。在收益评价日,基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算,计算方法参见《招募说明书》;

(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合基金收益分配条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次;

(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式;

(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(5) 每一基金份额享有同等分配权;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

值税纳税人；

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	332,435.92	375,792.07
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	332,435.92	375,792.07

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		25,545,761.74	28,865,602.11	3,319,840.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,600.00	9,451.60	-148.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,600.00	9,451.60	-148.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		25,555,361.74	28,875,053.71	3,319,691.97
项目		上年度末		

		2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		24,638,138.94	22,293,065.13	-2,345,073.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		24,638,138.94	22,293,065.13	-2,345,073.81

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	61.42	76.16
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	0.30	0.10
应收结算备付金利息	9.72	-

应收债券利息	1.65	-
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	73.09	76.26

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	9,417.87	1,735.78
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,417.87	1,735.78

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 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	67,500.00	17,500.00
应付指数使用费	2,383.33	10,000.00
可退替代款	-	-
应付替代款	-	-
合计	69,883.33	27,500.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	54,000,000.00	54,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-54,000,000.00	-54,000,000.00
本期末	29,608,342.00	29,608,342.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,882,411.20	903,253.50	-6,979,157.70
本期利润	2,247,519.69	5,664,765.78	7,912,285.47
本期基金份额交易产生的变动数	-811,280.37	-596,838.36	-1,408,118.73
其中：基金申购款	-15,390,745.78	8,092,451.20	-7,298,294.58
基金赎回款	14,579,465.41	-8,689,289.56	5,890,175.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,446,171.88	5,971,180.92	-474,990.96

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,685.23	2,895.24
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	22.11	7.46

结算备付金利息收入	378.21	77.96
其他	-	-
合计	3,085.55	2,980.66

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,256,643.14	-1,234,701.55
股票投资收益——赎回差价收入	866,277.79	-654,882.13
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	2,122,920.93	-1,889,583.68

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	29,198,794.05	2,606,283.42
减：卖出股票成本总额	27,942,150.91	3,840,984.97
买卖股票差价收入	1,256,643.14	-1,234,701.55

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	48,109,824.15	6,190,436.19
减：现金支付赎回款总额	23,929,328.15	229,869.19
减：赎回股票成本总额	23,314,218.21	6,615,449.13
赎回差价收入	866,277.79	-654,882.13

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	48,090.95	-
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	48,090.95	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	280,837.13	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	232,700.00	-
减：应收利息总额	46.18	-
买卖债券差价收入	48,090.95	-

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	372,456.93	414,811.93
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	372,456.93	414,811.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	5,664,765.78	5,687,214.36
——股票投资	5,664,914.18	5,687,214.36
——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	5,664,765.78	5,687,214.36

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	26,920.44	-23,672.00
合计	26,920.44	-23,672.00

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

交易所市场交易费用	77,836.12	6,866.18
银行间市场交易费用	-	-
合计	77,836.12	6,866.18

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	17,500.00	17,500.00
信息披露费	50,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	2,193.99	545.00
指数使用费	8,498.75	40,000.00
上市费	-	60,000.00
合计	78,192.74	118,045.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	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
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司）	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人控股子公司（瑞元资本管理有限公司）的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited（广发国际资产管理（英国）有限公司）	基金管理人全资子公司（GF International Investment Management Limited）的全资子公司

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	31,805.00	0.05%	32,427.50	0.60%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	172,300.00	32.94%	-	-

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	141,644.82	107,335.92
其中：支付销售机构的客户维护费	4,374.75	3,651.47

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,328.93	21,467.18

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	332,435.92	2,685.23	375,792.07	2,895.24

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	600459	贵研铂业	配股	648.00	6,726.24

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
12309 1	长海 转债	2020-1 2-23	2021-0 1-15	新债 流通 受限	100.00	100.00	23.00	2,300. 00	2,300. 00	-
11361 2	永冠 转债	2020-1 2-09	2021-0 1-07	新债 流通 受限	100.00	100.00	20.00	2,000. 00	2,000. 00	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、

金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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。

7.4.13.3 流动性风险

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

而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	375,792.07	-	-	-	375,792.07
存出保证金	300.45	-	-	-	300.45
交易性金融资产	-	-	-	22,293,065.13	22,293,065.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	76.26	76.26
资产总计	376,092.52	-	-	22,293,141.39	22,669,233.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,011.51	9,011.51
应付托管费	-	-	-	1,802.32	1,802.32
应付交易费用	-	-	-	1,735.78	1,735.78
其他负债	-	-	-	27,500.00	27,500.00
负债总计	-	-	-	40,049.61	40,049.61
利率敏感度缺口	376,092.52	-	-	22,253,091.78	22,629,184.30

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	28,865,602.11	99.08	22,293,065.13	98.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	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	28,875,053.71	99.11	22,293,065.13	98.51

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	上升 5%	1,457,020.15	1,113,032.38
	下降 5%	-1,457,020.15	-1,113,032.38

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 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（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 22,030,526.01 元，属于第二层次的余额为人民币 262,539.12 元，无属于第三层次的金额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	28,865,602.11	98.76
	其中：股票	28,865,602.11	98.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,451.60	0.03
	其中：债券	9,451.60	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	351,852.35	1.20
8	其他各项资产	697.48	0.00
9	合计	29,227,603.54	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	110,675.60	0.38
B	采矿业	3,306,645.44	11.35
C	制造业	25,337,583.03	86.97
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	17,479.00	0.06
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	30,847.04	0.11
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	62,372.00	0.21
	合计	28,865,602.11	99.08

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600309	万华化学	12,962	1,180,060.48	4.05
2	601899	紫金矿业	113,575	1,055,111.75	3.62
3	600585	海螺水泥	19,800	1,022,076.00	3.51
4	002460	赣锋锂业	6,301	637,661.20	2.19
5	002271	东方雨虹	13,646	529,464.80	1.82
6	002812	恩捷股份	3,610	511,825.80	1.76
7	600346	恒力石化	17,500	489,475.00	1.68
8	002493	荣盛石化	16,751	462,495.11	1.59
9	603799	华友钴业	5,708	452,644.40	1.55
10	600019	宝钢股份	73,572	437,753.40	1.50
11	603993	洛阳钼业	58,400	365,000.00	1.25
12	600176	中国巨石	17,868	356,645.28	1.22
13	600547	山东黄金	15,065	355,835.30	1.22
14	600426	华鲁恒升	9,382	349,948.60	1.20
15	000786	北新建材	8,400	336,420.00	1.15
16	002601	龙蟠佰利	10,101	310,807.77	1.07
17	600352	浙江龙盛	21,500	292,830.00	1.01
18	300285	国瓷材料	6,353	286,583.83	0.98
19	002709	天赐材料	2,660	276,108.00	0.95

20	600143	金发科技	14,900	255,386.00	0.88
21	601233	桐昆股份	12,391	255,130.69	0.88
22	600111	北方稀土	18,022	235,907.98	0.81
23	600010	包钢股份	188,310	220,322.70	0.76
24	600486	扬农化工	1,580	208,560.00	0.72
25	300037	新宙邦	2,001	202,901.40	0.70
26	600529	山东药玻	3,967	198,945.05	0.68
27	601600	中国铝业	54,000	196,020.00	0.67
28	601168	西部矿业	15,800	195,604.00	0.67
29	000703	恒逸石化	15,206	194,636.80	0.67
30	300699	光威复材	2,180	194,129.00	0.67
31	600219	南山铝业	59,230	187,166.80	0.64
32	002078	太阳纸业	12,899	186,132.57	0.64
33	000708	中信特钢	8,360	182,164.40	0.63
34	002497	雅化集团	7,900	173,405.00	0.60
35	601636	旗滨集团	13,350	170,880.00	0.59
36	600362	江西铜业	8,537	170,313.15	0.58
37	002075	沙钢股份	14,600	160,162.00	0.55
38	000630	铜陵有色	60,898	156,507.86	0.54
39	002683	宏大爆破	4,301	154,620.95	0.53
40	600988	赤峰黄金	8,300	148,653.00	0.51
41	002250	联化科技	6,100	146,339.00	0.50
42	600489	中金黄金	16,055	141,444.55	0.49
43	601216	君正集团	27,940	138,303.00	0.47
44	002409	雅克科技	2,300	138,207.00	0.47
45	002080	中材科技	5,674	137,197.32	0.47
46	600516	方大炭素	18,849	133,262.43	0.46
47	603737	三棵树	840	127,260.00	0.44
48	000878	云南铜业	8,400	121,548.00	0.42
49	688122	西部超导	1,500	119,265.00	0.41
50	000975	银泰黄金	13,792	118,749.12	0.41
51	600549	厦门钨业	7,008	118,084.80	0.41
52	600801	华新水泥	5,660	116,765.80	0.40
53	002064	华峰化学	11,500	116,035.00	0.40
54	300618	寒锐钴业	1,216	115,410.56	0.40
55	002407	多氟多	5,751	115,192.53	0.40
56	002831	裕同科技	3,640	111,456.80	0.38
57	000401	冀东水泥	7,802	110,398.30	0.38
58	000830	鲁西化工	8,500	108,630.00	0.37
59	002648	卫星石化	4,100	107,092.00	0.37
60	600409	三友化工	10,202	104,570.50	0.36
61	600392	盛和资源	11,576	102,910.64	0.35
62	601992	金隅集团	34,410	102,197.70	0.35
63	300054	鼎龙股份	5,360	101,357.60	0.35

64	600497	驰宏锌锗	20,999	100,795.20	0.35
65	000060	中金岭南	20,615	99,364.30	0.34
66	600966	博汇纸业	6,600	99,198.00	0.34
67	002643	万润股份	4,550	99,053.50	0.34
68	000807	云铝股份	12,916	97,257.48	0.33
69	600456	宝钛股份	1,800	93,762.00	0.32
70	000960	锡业股份	8,310	93,072.00	0.32
71	002597	金禾实业	2,800	90,804.00	0.31
72	002240	盛新锂能	3,700	90,428.00	0.31
73	600160	巨化股份	11,150	90,426.50	0.31
74	002092	中泰化学	14,200	87,330.00	0.30
75	000902	新洋丰	5,400	86,400.00	0.30
76	300777	中简科技	1,700	86,037.00	0.30
77	000818	航锦科技	4,002	84,001.98	0.29
78	000012	南玻 A	11,316	83,512.08	0.29
79	600881	亚泰集团	26,899	83,386.90	0.29
80	600567	山鹰国际	26,573	80,250.46	0.28
81	000923	河钢资源	3,200	79,648.00	0.27
82	600282	南钢股份	25,397	79,238.64	0.27
83	000709	河钢股份	35,095	78,612.80	0.27
84	000877	天山股份	5,201	78,535.10	0.27
85	000629	攀钢钒钛	35,500	77,035.00	0.26
86	600273	嘉化能源	8,300	76,692.00	0.26
87	000301	东方盛虹	8,000	75,840.00	0.26
88	002233	塔牌集团	5,902	75,191.48	0.26
89	000933	神火股份	9,400	75,012.00	0.26
90	000778	新兴铸管	19,800	72,864.00	0.25
91	000932	华菱钢铁	15,200	72,656.00	0.25
92	002004	华邦健康	13,070	72,407.80	0.25
93	601005	重庆钢铁	48,500	71,780.00	0.25
94	600989	宝丰能源	6,100	71,370.00	0.24
95	600720	祁连山	5,101	69,271.58	0.24
96	300236	上海新阳	1,400	69,006.00	0.24
97	002701	奥瑞金	13,940	68,863.60	0.24
98	002110	三钢闽光	10,100	67,973.00	0.23
99	601118	海南橡胶	14,100	67,962.00	0.23
100	000825	太钢不锈	18,799	67,864.39	0.23
101	600490	鹏欣资源	14,600	67,452.00	0.23
102	002756	永兴材料	1,240	67,232.80	0.23
103	000831	五矿稀土	4,900	66,787.00	0.23
104	000672	上峰水泥	3,403	66,392.53	0.23
105	300072	三聚环保	11,673	66,302.64	0.23
106	603026	石大胜华	1,300	65,533.00	0.22
107	000488	晨鸣纸业	10,151	65,169.42	0.22

108	600022	山东钢铁	45,219	64,663.17	0.22
109	600459	贵研铂业	2,508	64,581.00	0.22
110	600673	东阳光	12,400	62,372.00	0.21
111	603077	和邦生物	43,780	62,167.60	0.21
112	600507	方大特钢	8,936	62,015.84	0.21
113	000990	诚志股份	5,200	61,672.00	0.21
114	002237	恒邦股份	4,700	61,053.00	0.21
115	600782	新钢股份	13,200	60,588.00	0.21
116	300180	华峰超纤	10,224	60,423.84	0.21
117	000898	鞍钢股份	19,866	60,392.64	0.21
118	600500	中化国际	11,423	60,199.21	0.21
119	300737	科顺股份	2,800	60,088.00	0.21
120	002203	海亮股份	8,101	59,866.39	0.21
121	000426	兴业矿业	7,600	59,584.00	0.20
122	002155	湖南黄金	7,001	59,578.51	0.20
123	688019	安集科技	200	59,560.00	0.20
124	600126	杭钢股份	11,160	59,036.40	0.20
125	002324	普利特	3,480	58,951.20	0.20
126	002318	久立特材	5,402	58,881.80	0.20
127	601677	明泰铝业	4,100	57,974.00	0.20
128	000758	中色股份	11,400	57,912.00	0.20
129	002585	双星新材	5,710	57,442.60	0.20
130	002171	楚江新材	6,620	56,534.80	0.19
131	603599	广信股份	2,300	55,131.00	0.19
132	601212	白银有色	18,400	54,464.00	0.19
133	000603	盛达资源	3,400	54,128.00	0.19
134	600586	金晶科技	8,300	53,950.00	0.19
135	002440	闰土股份	5,700	53,124.00	0.18
136	000789	万年青	3,981	52,947.30	0.18
137	002428	云南锗业	4,300	52,847.00	0.18
138	600808	马钢股份	19,678	52,343.48	0.18
139	300225	金力泰	3,201	52,336.35	0.18
140	002312	三泰控股	9,100	52,143.00	0.18
141	600141	兴发集团	4,640	51,179.20	0.18
142	300748	金力永磁	1,400	50,876.00	0.17
143	000959	首钢股份	13,100	50,173.00	0.17
144	600596	新安股份	4,600	49,910.00	0.17
145	601958	金钼股份	8,004	49,704.84	0.17
146	002254	泰和新材	3,240	49,539.60	0.17
147	000683	远兴能源	22,820	49,291.20	0.17
148	002408	齐翔腾达	5,881	49,165.16	0.17
149	603601	再升科技	3,600	49,140.00	0.17
150	002182	云海金属	3,700	48,914.00	0.17
151	600378	昊华科技	2,300	48,323.00	0.17

152	002145	中核钛白	8,516	47,263.80	0.16
153	603906	龙蟠科技	1,400	47,110.00	0.16
154	603429	集友股份	1,583	47,030.93	0.16
155	601678	滨化股份	8,901	46,730.25	0.16
156	002258	利尔化学	2,200	45,980.00	0.16
157	600259	广晟有色	1,500	45,255.00	0.16
158	603733	仙鹤股份	1,800	45,000.00	0.15
159	002002	鸿达兴业	14,989	44,967.00	0.15
160	000762	西藏矿业	3,401	44,144.98	0.15
161	002108	沧州明珠	8,184	44,029.92	0.15
162	600210	紫江企业	9,999	43,495.65	0.15
163	600326	西藏天路	6,100	42,822.00	0.15
164	600307	酒钢宏兴	25,900	42,735.00	0.15
165	000717	韶钢松山	10,000	42,700.00	0.15
166	600531	豫光金铅	7,200	42,552.00	0.15
167	300224	正海磁材	3,400	42,534.00	0.15
168	300429	强力新材	2,966	42,028.22	0.14
169	000912	泸天化	10,400	41,392.00	0.14
170	600063	皖维高新	11,100	40,626.00	0.14
171	603826	坤彩科技	1,120	40,420.80	0.14
172	300487	蓝晓科技	900	40,050.00	0.14
173	300041	回天新材	2,802	40,040.58	0.14
174	600338	西藏珠峰	3,820	40,033.60	0.14
175	002043	兔宝宝	4,450	39,916.50	0.14
176	300409	道氏技术	2,622	39,146.46	0.13
177	600668	尖峰集团	2,800	39,144.00	0.13
178	000969	安泰科技	5,900	39,058.00	0.13
179	601028	玉龙股份	3,200	38,976.00	0.13
180	002641	永高股份	6,100	38,918.00	0.13
181	603260	合盛硅业	1,160	38,790.40	0.13
182	002149	西部材料	2,101	38,427.29	0.13
183	300398	飞凯材料	2,160	38,361.60	0.13
184	603010	万盛股份	1,700	37,910.00	0.13
185	601137	博威合金	3,300	37,884.00	0.13
186	601208	东材科技	3,600	37,584.00	0.13
187	300655	晶瑞股份	1,100	37,576.00	0.13
188	600963	岳阳林纸	8,965	37,563.35	0.13
189	000910	大亚圣象	2,678	37,384.88	0.13
190	002539	云图控股	4,990	36,876.10	0.13
191	002302	西部建设	4,200	36,876.00	0.13
192	600366	宁波韵升	5,680	36,238.40	0.12
193	002398	垒知集团	4,601	35,795.78	0.12
194	002226	江南化工	5,200	35,672.00	0.12
195	000592	平潭发展	12,800	35,456.00	0.12

196	300596	利安隆	900	35,352.00	0.12
197	600308	华泰股份	6,800	35,224.00	0.12
198	600636	国新文化	2,600	34,892.00	0.12
199	000612	焦作万方	4,949	34,741.98	0.12
200	603612	索通发展	2,540	34,721.80	0.12
201	300821	东岳硅材	3,000	34,590.00	0.12
202	000936	华西股份	4,400	34,496.00	0.12
203	002768	国恩股份	1,100	34,452.00	0.12
204	002810	山东赫达	1,000	34,400.00	0.12
205	002596	海南瑞泽	6,600	34,320.00	0.12
206	000881	中广核技	3,100	34,100.00	0.12
207	600433	冠豪高新	7,367	34,035.54	0.12
208	600277	亿利洁能	11,300	33,787.00	0.12
209	600425	青松建化	9,100	33,670.00	0.12
210	002838	道恩股份	1,300	33,462.00	0.11
211	600165	新日恒力	4,551	33,358.83	0.11
212	000751	锌业股份	9,301	33,018.55	0.11
213	601388	怡球资源	10,879	32,854.58	0.11
214	300261	雅本化学	5,600	32,424.00	0.11
215	002067	景兴纸业	9,200	32,292.00	0.11
216	603916	苏博特	1,400	32,158.00	0.11
217	603225	新凤鸣	2,296	31,914.40	0.11
218	600449	宁夏建材	2,401	31,837.26	0.11
219	600075	新疆天业	5,601	31,645.65	0.11
220	002392	北京利尔	6,900	30,981.00	0.11
221	000795	英洛华	5,651	30,910.97	0.11
222	000546	金圆股份	4,102	30,847.04	0.11
223	600527	江南高纤	11,400	30,666.00	0.11
224	600888	新疆众和	5,060	30,562.40	0.10
225	002303	美盈森	7,600	30,400.00	0.10
226	002637	赞宇科技	2,401	30,180.57	0.10
227	000973	佛塑科技	6,400	29,760.00	0.10
228	603505	金石资源	1,000	29,500.00	0.10
229	603379	三美股份	1,540	29,414.00	0.10
230	300082	奥克股份	2,800	29,176.00	0.10
231	300196	长海股份	1,700	28,951.00	0.10
232	002522	浙江众成	4,500	28,935.00	0.10
233	600103	青山纸业	15,203	28,733.67	0.10
234	600096	云天化	4,701	28,535.07	0.10
235	601069	西部黄金	2,100	28,329.00	0.10
236	603688	石英股份	1,200	28,224.00	0.10
237	300221	银禧科技	3,001	28,209.40	0.10
238	000553	安道麦 A	3,601	28,159.82	0.10
239	600458	时代新材	3,280	27,912.80	0.10

240	002132	恒星科技	8,350	27,805.50	0.10
241	000688	国城矿业	2,800	27,804.00	0.10
242	002734	利民股份	2,183	27,745.93	0.10
243	002588	史丹利	4,820	27,666.80	0.09
244	002206	海利得	7,052	27,573.32	0.09
245	601968	宝钢包装	3,400	27,540.00	0.09
246	600172	黄河旋风	8,382	27,492.96	0.09
247	002082	万邦德	2,000	27,400.00	0.09
248	002215	诺普信	4,500	26,910.00	0.09
249	002361	神剑股份	4,802	26,795.16	0.09
250	002386	天原股份	4,500	26,595.00	0.09
251	002225	濮耐股份	5,800	26,448.00	0.09
252	300481	濮阳惠成	1,300	26,377.00	0.09
253	300121	阳谷华泰	2,190	26,192.40	0.09
254	603033	三维股份	1,100	26,191.00	0.09
255	600331	宏达股份	11,800	26,078.00	0.09
256	603181	皇马科技	1,350	26,028.00	0.09
257	300758	七彩化学	1,140	26,026.20	0.09
258	002565	顺灏股份	6,100	25,864.00	0.09
259	002228	合兴包装	6,100	25,681.00	0.09
260	603378	亚士创能	600	25,626.00	0.09
261	600810	神马股份	2,750	25,547.50	0.09
262	000657	中钨高新	3,521	25,527.25	0.09
263	002167	东方锆业	4,100	25,215.00	0.09
264	300174	元力股份	1,500	25,200.00	0.09
265	000731	四川美丰	4,928	25,132.80	0.09
266	300328	宜安科技	2,870	25,112.50	0.09
267	601020	华钰矿业	2,302	25,022.74	0.09
268	000859	国风塑业	4,900	24,990.00	0.09
269	600389	江山股份	1,200	24,708.00	0.08
270	002669	康达新材	1,500	24,705.00	0.08
271	002125	湘潭电化	3,100	24,645.00	0.08
272	300575	中旗股份	640	24,576.00	0.08
273	300576	容大感光	520	24,518.00	0.08
274	000935	四川双马	1,900	24,396.00	0.08
275	601609	金田铜业	2,400	24,360.00	0.08
276	300320	海达股份	3,500	24,325.00	0.08
277	002224	三力士	4,201	24,323.79	0.08
278	600581	八一钢铁	6,300	24,129.00	0.08
279	600569	安阳钢铁	9,400	23,970.00	0.08
280	000949	新乡化纤	7,300	23,944.00	0.08
281	002170	芭田股份	5,200	23,868.00	0.08
282	002741	光华科技	1,900	23,731.00	0.08
283	300230	永利股份	4,700	23,594.00	0.08

284	300587	天铁股份	1,890	23,530.50	0.08
285	000510	新金路	5,000	23,350.00	0.08
286	002391	长青股份	3,250	23,335.00	0.08
287	300489	中飞股份	700	23,331.00	0.08
288	300200	高盟新材	2,160	23,328.00	0.08
289	603980	吉华集团	3,500	22,645.00	0.08
290	002165	红宝丽	4,000	22,600.00	0.08
291	002274	华昌化工	4,700	22,372.00	0.08
292	600844	丹化科技	5,400	22,248.00	0.08
293	600802	福建水泥	2,700	22,032.00	0.08
294	300684	中石科技	964	22,017.76	0.08
295	300109	新开源	1,600	21,920.00	0.08
296	002783	凯龙股份	2,180	21,909.00	0.08
297	601003	柳钢股份	4,200	21,798.00	0.07
298	600076	康欣新材	6,000	21,780.00	0.07
299	002735	王子新材	600	21,774.00	0.07
300	002443	金洲管道	3,400	21,556.00	0.07
301	002538	司尔特	3,600	21,492.00	0.07
302	600328	中盐化工	3,200	21,344.00	0.07
303	000893	亚钾国际	2,500	20,975.00	0.07
304	002012	凯恩股份	3,900	20,943.00	0.07
305	002057	中钢天源	2,900	20,706.00	0.07
306	300067	安诺其	4,661	20,694.84	0.07
307	300080	易成新能	3,300	20,196.00	0.07
308	603078	江化微	585	20,053.80	0.07
309	002381	双箭股份	2,400	19,992.00	0.07
310	002088	鲁阳节能	1,800	19,962.00	0.07
311	300057	万顺新材	3,900	19,812.00	0.07
312	601969	海南矿业	3,275	19,584.50	0.07
313	002160	常铝股份	4,300	19,565.00	0.07
314	002201	九鼎新材	1,600	19,472.00	0.07
315	000698	沈阳化工	4,100	19,311.00	0.07
316	000655	金岭矿业	2,500	19,300.00	0.07
317	002632	道明光学	2,600	19,292.00	0.07
318	002068	黑猫股份	3,076	19,040.44	0.07
319	300019	硅宝科技	1,100	19,019.00	0.07
320	600961	株冶集团	2,600	18,928.00	0.06
321	603867	新化股份	800	18,672.00	0.06
322	000420	吉林化纤	9,800	18,522.00	0.06
322	000962	东方钽业	2,100	18,522.00	0.06
323	002978	安宁股份	400	18,340.00	0.06
324	300530	达志科技	500	18,225.00	0.06
325	603330	上海天洋	600	18,198.00	0.06
326	600230	沧州大化	2,000	18,180.00	0.06

327	300192	科德教育	1,200	18,036.00	0.06
328	002378	章源钨业	3,101	17,985.80	0.06
329	603227	雪峰科技	3,801	17,978.73	0.06
330	002521	齐峰新材	3,301	17,924.43	0.06
331	300337	银邦股份	3,400	17,816.00	0.06
332	002455	百川股份	3,002	17,741.82	0.06
333	600295	鄂尔多斯	1,700	17,714.00	0.06
334	300214	日科化学	2,100	17,619.00	0.06
335	002235	安妮股份	3,850	17,479.00	0.06
336	002379	宏创控股	6,100	17,446.00	0.06
337	000822	山东海化	4,400	17,424.00	0.06
338	002476	宝莫股份	4,000	17,400.00	0.06
339	600731	湖南海利	2,100	17,157.00	0.06
340	002054	德美化工	2,101	17,123.15	0.06
341	603360	百傲化学	1,120	17,091.20	0.06
342	002613	北玻股份	3,900	17,043.00	0.06
343	002246	北化股份	2,302	16,873.66	0.06
344	002584	西陇科学	2,901	16,854.81	0.06
345	603876	鼎胜新材	1,100	16,819.00	0.06
346	002243	力合科创	1,500	16,455.00	0.06
347	600558	大西洋	5,175	16,404.75	0.06
348	603639	海利尔	796	16,230.44	0.06
349	603002	宏昌电子	3,050	16,165.00	0.06
350	002666	德联集团	3,100	16,027.00	0.06
351	300179	四方达	2,500	15,925.00	0.05
352	300522	世名科技	700	15,848.00	0.05
353	603995	甬金股份	600	15,612.00	0.05
354	000815	美利云	2,900	15,515.00	0.05
355	600727	鲁北化工	2,200	15,422.00	0.05
356	603823	百合花	1,040	15,277.60	0.05
357	300537	广信材料	900	14,814.00	0.05
358	000525	红太阳	2,400	14,520.00	0.05
359	002886	沃特股份	600	14,094.00	0.05
360	600678	四川金顶	2,300	14,030.00	0.05
361	603969	银龙股份	3,502	13,902.94	0.05
362	600618	氯碱化工	1,900	13,889.00	0.05
363	300107	建新股份	2,300	13,823.00	0.05
364	000677	恒天海龙	5,000	13,800.00	0.05
365	002172	澳洋健康	4,500	13,455.00	0.05
366	603968	醋化股份	800	13,368.00	0.05
367	600589	广东榕泰	4,100	13,366.00	0.05
368	600078	澄星股份	3,300	13,035.00	0.04
369	600722	金牛化工	2,800	13,020.00	0.04
370	000506	中润资源	5,401	12,962.40	0.04

371	600724	宁波富达	3,600	12,888.00	0.04
372	002824	和胜股份	800	12,664.00	0.04
373	002799	环球印务	600	12,594.00	0.04
374	002211	宏达新材	2,103	12,554.91	0.04
375	603878	武进不锈	1,608	12,252.96	0.04
376	603978	深圳新星	700	12,068.00	0.04
377	000819	岳阳兴长	1,777	12,065.83	0.04
378	603681	永冠新材	600	11,940.00	0.04
379	603067	振华股份	1,808	11,914.72	0.04
380	300715	凯伦股份	300	11,910.00	0.04
381	002742	三圣股份	1,800	11,682.00	0.04
382	002842	翔鹭钨业	1,136	11,473.60	0.04
383	002942	新农股份	400	11,316.00	0.04
384	603217	元利科技	420	11,050.20	0.04
385	300387	富邦股份	1,400	11,032.00	0.04
386	603722	阿科力	400	10,956.00	0.04
387	002986	宇新股份	300	10,875.00	0.04
388	603938	三孚股份	500	10,830.00	0.04
389	603856	东宏股份	890	10,742.30	0.04
390	300501	海顺新材	600	10,710.00	0.04
391	300586	美联新材	1,130	10,542.90	0.04
392	300801	泰和科技	500	10,430.00	0.04
393	603863	松炆资源	1,000	10,050.00	0.03
394	603977	国泰集团	1,400	9,870.00	0.03
395	603028	赛福天	900	9,702.00	0.03
396	002846	英联股份	700	9,618.00	0.03
397	002827	高争民爆	900	9,594.00	0.03
398	300848	美瑞新材	200	9,578.00	0.03
399	603351	威尔药业	420	9,576.00	0.03
400	300637	扬帆新材	1,140	9,325.20	0.03
401	600370	三房巷	3,000	9,180.00	0.03
402	603879	永悦科技	1,200	9,108.00	0.03
403	603663	三祥新材	600	9,000.00	0.03
404	002895	川恒股份	800	8,824.00	0.03
405	603022	新通联	700	8,701.00	0.03
406	002809	红墙股份	800	8,600.00	0.03
407	603810	丰山集团	360	8,550.00	0.03
408	002915	中欣氟材	500	8,090.00	0.03
409	605166	聚合顺	800	7,984.00	0.03
410	603948	建业股份	400	7,692.00	0.03
411	002679	福建金森	630	7,257.60	0.02
412	002971	和远气体	400	7,068.00	0.02
413	603192	汇得科技	300	6,948.00	0.02
414	600746	江苏索普	1,100	6,941.00	0.02

415	002917	金奥博	710	6,666.90	0.02
416	603687	大胜达	700	6,377.00	0.02
417	300796	贝斯美	300	5,778.00	0.02
418	603790	雅运股份	500	5,675.00	0.02
419	603226	菲林格尔	556	5,348.72	0.02
420	603332	苏州龙杰	300	5,274.00	0.02
421	002969	嘉美包装	900	5,103.00	0.02
422	300798	锦鸡股份	400	4,348.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	2,417,742.99	10.68
2	600309	万华化学	1,550,651.00	6.85
3	601899	紫金矿业	1,215,611.00	5.37
4	600547	山东黄金	872,593.00	3.86
5	600019	宝钢股份	763,948.00	3.38
6	600352	浙江龙盛	593,538.00	2.62
7	600346	恒力石化	572,631.00	2.53
8	603993	洛阳钼业	495,870.00	2.19
9	603799	华友钴业	473,878.00	2.09
10	600010	包钢股份	461,026.00	2.04
11	600426	华鲁恒升	450,701.00	1.99
12	600143	金发科技	449,018.00	1.98
13	600529	山东药玻	437,987.00	1.94
14	600111	北方稀土	414,673.00	1.83
15	600176	中国巨石	369,915.00	1.63
16	601233	桐昆股份	353,070.00	1.56
17	601600	中国铝业	351,172.00	1.55
18	603737	三棵树	313,042.20	1.38
19	600489	中金黄金	308,922.00	1.37
20	600801	华新水泥	294,580.00	1.30

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按

买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	2,195,986.47	9.70
2	600309	万华化学	1,719,167.00	7.60
3	601899	紫金矿业	1,377,830.00	6.09
4	600547	山东黄金	796,806.00	3.52
5	600019	宝钢股份	776,312.00	3.43
6	600346	恒力石化	632,455.00	2.79
7	600352	浙江龙盛	601,824.00	2.66
8	600426	华鲁恒升	505,575.00	2.23
9	603993	洛阳钼业	493,480.00	2.18
10	603799	华友钴业	489,784.64	2.16
11	600143	金发科技	476,322.00	2.10
12	600010	包钢股份	435,999.00	1.93
13	600111	北方稀土	429,768.00	1.90
14	600176	中国巨石	415,223.00	1.83
15	600529	山东药玻	411,703.00	1.82
16	603737	三棵树	362,927.00	1.60
17	601600	中国铝业	350,718.00	1.55
18	601216	君正集团	314,828.30	1.39
19	600489	中金黄金	301,715.00	1.33
20	601233	桐昆股份	297,520.00	1.31

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	30,162,715.92
卖出股票收入（成交）总额	29,198,794.05

8.5 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）	9,451.60	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,451.60	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	123085	万顺转 2	53	5,151.60	0.02
2	123091	长海转债	23	2,300.00	0.01
3	113612	永冠转债	20	2,000.00	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	624.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	73.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	697.48

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,520	19,479.17	1,627,052.00	5.50%	27,981,290.00	94.50%

9.2 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	程丽琼	1,000,053.00	3.38%
2	颜景	895,500.00	3.02%
3	胡毅	600,000.00	2.03%
4	太平人寿保险有限公司	600,000.00	2.03%
5	吴春海	517,400.00	1.75%
6	叶谓祥	512,500.00	1.73%
7	翟春光	500,043.00	1.69%
8	谭惠贞	500,034.00	1.69%
9	孙焕民	444,300.00	1.50%
10	尹黎明	440,000.00	1.49%

9.3 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%

9.4 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

§10 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	54,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,608,342.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 7 月 11 日发布公告，自 2020 年 7 月 11 日起，邱春杨先生不再担任公司督察长，程才良先生新任公司督察长；于 2020 年 12 月 11 日发布公告，自 2020 年 12 月 11 日起，林传辉先生不再担任公司总经理，王凡先生由公司副总经理转任公司总经理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略新增存托凭证投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	3	31,805.00	0.05%	-	-	-
银河证券	2	5,806,136.82	9.78%	4,224.72	9.74%	-
安信证券	1	7,083,668.64	11.93%	5,180.44	11.95%	-
海通证券	2	46,439,899.51	78.23%	33,961.69	78.31%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
天风证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
大同证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
长江证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择

标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	172,300.00	32.94%	-	-	-	-
银河证券	153,834.38	29.41%	-	-	-	-
安信证券	181,002.75	34.60%	-	-	-	-
海通证券	16,000.00	3.06%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 41 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-01-11
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-01-17
3	关于旗下基金调整申购（含定期定额投资）及转换转入确认业务规则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-02-28
4	关于增加东吴证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-09
5	关于变更旗下部分基金场内简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-12
6	关于增加中信建投证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-12
7	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-27
8	关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金调整标的指数许可使用费并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-31
9	关于增加中信证券（华南）为旗下部分基金场外申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-20
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-21
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-07-20
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-08-27
13	广发基金管理有限公司关于旗下基金基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-08-28
14	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-10-28
15	关于旗下部分基金调整投资范围并相应修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-12-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

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

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- （二）《广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照

13.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

13.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日