

**广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
2020 年年度报告
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	13
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
§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	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	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	72
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	72
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	72
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	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末上市基金前十名持有人	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
§10 开放式基金份额变动	75
§11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指可选消费 ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	194,156,094.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 6 月 25 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	2,797,311.74	-4,624,504.56	-22,336,488.26
本期利润	113,095,114.70	74,172,663.65	-109,862,593.56
加权平均基金份额本期利润	0.5235	0.3429	-0.5312
本期加权平均净值利润率	32.76%	26.41%	-38.15%
本期基金份额净值增长率	39.40%	31.95%	-33.19%
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	26,860,909.69	22,703,115.22	17,438,713.18
期末可供分配基金份额利润	0.1383	0.1031	0.0838
期末基金资产净值	387,050,474.55	314,854,698.33	225,594,807.18
期末基金份额净值	1.9935	1.4301	1.0838
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	99.35%	43.01%	8.38%

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）。

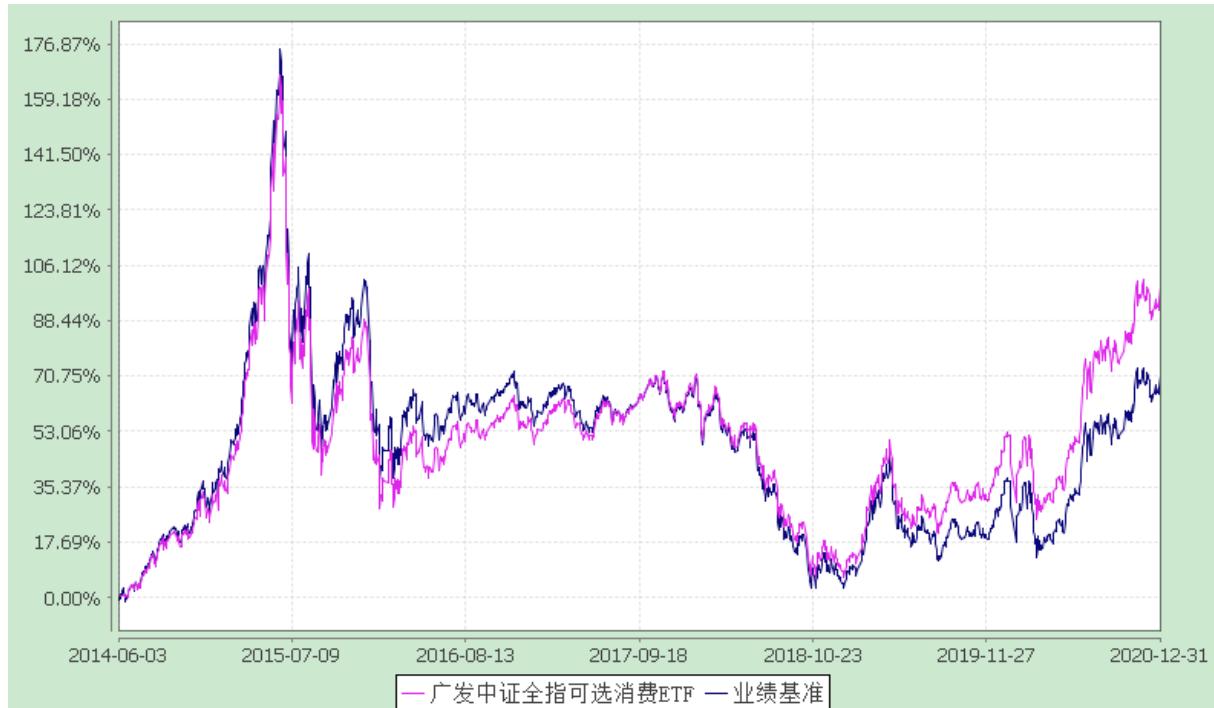
3.2 基金净值表现

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	13.43%	1.22%	12.71%	1.22%	0.72%	0.00%
过去六个月	31.53%	1.47%	26.95%	1.47%	4.58%	0.00%
过去一年	39.40%	1.62%	31.88%	1.63%	7.52%	-0.01%
过去三年	22.89%	1.45%	6.05%	1.47%	16.84%	-0.02%
过去五年	8.42%	1.41%	-12.97%	1.43%	21.39%	-0.02%
自基金合同生效起至今	99.35%	1.60%	70.91%	1.64%	28.44%	-0.04%

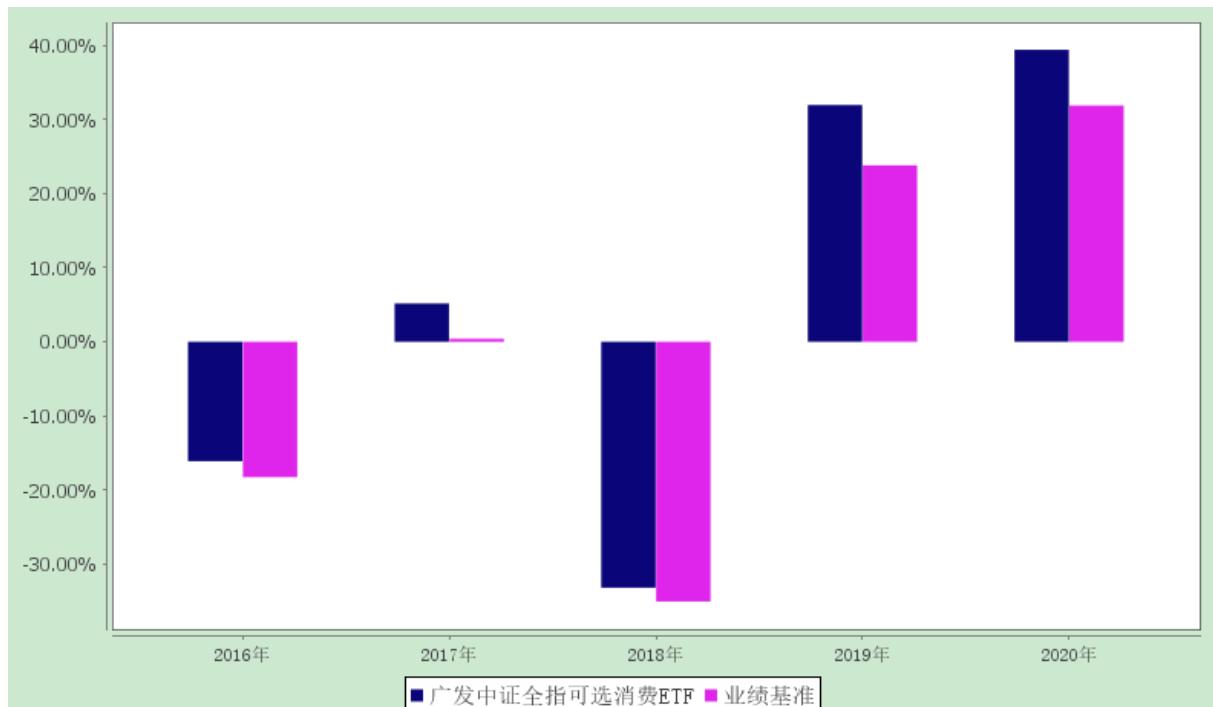
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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的历史走势对比图
(2014 年 6 月 3 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

广发中证全指可选消费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	本基金的基金经理	2014-06-0	-	22年	陆志明先生，经济学硕士，持有

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；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指金融地	3			中国证券投资基金管理业从业证书。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)。
---	---	--	--	---

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遵规守信情况的说明

本报告期内，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的投资策略跟踪指数，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%，中证全指可选消费指数上涨 31.88%。数据显示，2020 年全年我国社会消费品零售总额累计同比下降 3.9%。

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 39.40%，同期业绩比较基准收益率为 31.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 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。从国家经济发展的角度看，受国内房地产调控与劳动力成本提高的影响，投资与出口对我国经济增长的作用逐步减弱，经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动，未来随着居民收入的提高，消费升级是大势所趋。预计 2021 年可选消费行业中，网上零售业依然将维持高速增长，受疫情影响严重的餐饮业恢复较快。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

- (1) 推进实施公司企业文化建设，将企业文化建设的基本要求制度化、规范化，加大内部合规培训、品牌宣传及投资者教育的力度。
- (2) 持续加强制度建设，积极推进公司内部管理进一步精细化、规范化、科学化。
- (3) 逐步提高专兼职合规管理人员工作质量，推动形成合规稽核部门与专兼职合规管理员的信息及资源互动机制，确保合规管理覆盖公司所有重要业务流程和风险点。
- (4) 深入完善宣传推介材料管理机制，努力提高材料的制作质量与审核效率，推进宣传材料规范化。
- (5) 根据监管精神和要求，逐条逐项研究制定整改办法和整改措施，稳步推进资管新规及销售新规的整改工作。
- (6) 针对投研交业务、基金销售业务、中后台运营业务的不同特点，结合监管最新颁布的监管要求、行业及公司发生的热点合规风险事件，开展差别化培训。
- (7) 认真做好合规审核及咨询服务，对公司内部重大决策、新产品和新业务方案、产品运作过程中的重要法律文本等进行审查，通过及时有效的事前事中审核把关，监督防范业务中可能存在的风险。
- (8) 平稳推进信息披露与监管报送工作，包括报送历史信息披露文件、完成存量公募基金产品资料概要制作及复核、改造信息披露及销售系统、完成信息披露和监管定期数据常规工作等。
- (9) 强化投资组合日常的合规风险监控，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平。
- (10) 持续夯实反洗钱工作基础，不断完善客户身份识别工作，不断优化公司反洗钱系统，并

积极尝试运用新技术提升反洗钱工作质量。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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_G171 号

广发中证全指可选消费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可选消费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可选消费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可选消费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可选消费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

广发中证全指可选消费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可选消费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可选消费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可选消费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可选消费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：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
		2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	4,048,580.78	2,954,241.40
结算备付金		69,894.04	20,262.49
存出保证金		31,289.80	15,556.53
交易性金融资产	7.4.7.2	383,185,669.49	312,213,230.90
其中：股票投资		383,148,876.97	312,168,930.90

基金投资		-	-
债券投资		36,792.52	44,300.00
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		101,083.43	-
应收利息	7.4.7.5	23,599.70	588.94
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		387,460,117.24	315,203,880.26
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2020年12月31日	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		159,228.40	128,679.61
应付托管费		31,845.67	25,735.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	33,127.52	18,555.48
应交税费		1,841.82	0.05
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	183,599.28	176,210.87
负债合计		409,642.69	349,181.93
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	194,156,094.00	220,156,094.00
未分配利润	7.4.7.10	192,894,380.55	94,698,604.33
所有者权益合计		387,050,474.55	314,854,698.33
负债和所有者权益总计		387,460,117.24	315,203,880.26

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.9935 元，基金份额总额 194,156,094.00 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 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		115,815,890.34	76,332,568.75
1.利息收入		213,779.26	28,044.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,778.41	28,043.37
债券利息收入		264.83	1.41
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		194,736.02	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,086,421.27	-2,498,142.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,020,759.56	-8,189,058.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	118,507.85	-

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	5,988,672.98	5,690,916.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	110,297,802.96	78,797,168.21
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	217,886.85	5,497.79
减：二、费用		2,720,775.64	2,159,905.10
1. 管理人报酬		1,721,479.87	1,400,921.88
2. 托管费		344,295.93	280,184.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	389,505.96	178,053.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		701.92	-
7. 其他费用	7.4.7.19	264,791.96	300,745.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		113,095,114.70	74,172,663.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		113,095,114.70	74,172,663.65

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 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	220,156,094.00	94,698,604.33	314,854,698.33

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	113,095,114.70	113,095,114.70
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）	-26,000,000.00	-14,899,338.48	-40,899,338.48
其中：1.基金申购款	78,000,000.00	45,596,889.09	123,596,889.09
2.基金赎回款	-104,000,000.00	-60,496,227.57	-164,496,227.57
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)	194,156,094.00	192,894,380.55	387,050,474.55
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)	208,156,094.00	17,438,713.18	225,594,807.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,172,663.65	74,172,663.65
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）	12,000,000.00	3,087,227.50	15,087,227.50
其中：1.基金申购款	24,000,000.00	6,559,938.91	30,559,938.91
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-3,472,711.41	-15,472,711.41

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	94,698,604.33	314,854,698.33

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 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，不予以相互抵销。

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) 转融通证券出借业务利息收入，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 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；

(7) 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；

（8）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；

（9）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；

（10）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；

（11）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，基金管理人对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	上年度末
	2020年12月31日	2019年12月31日
活期存款	4,048,580.78	2,954,241.40
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	4,048,580.78	2,954,241.40

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
股票	320,323,989.36	383,148,876.97	62,824,887.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	36,500.00	36,792.52
	银行间市场	-	-
	合计	36,500.00	36,792.52
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	320,360,489.36	383,185,669.49	62,825,180.13

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	359,641,553.73	312,168,930.90	-47,472,622.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,300.00	44,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	44,300.00	44,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	359,685,853.73	312,213,230.90	-47,472,622.83

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	上年度末
	2020年12月31日	2019年12月31日
应收活期存款利息	325.75	571.38
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	14.10	7.00

应收结算备付金利息	31.40	9.10
应收债券利息	8.56	1.46
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	23,219.89	-
其他	-	-
合计	23,599.70	588.94

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	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	33,127.52	18,555.48
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	33,127.52	18,555.48

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	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	156,000.00	154,000.00
应付指数使用费	27,599.28	22,210.87
可退替代款	-	-

合计	183,599.28	176,210.87
----	------------	------------

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	220,156,094.00	220,156,094.00
本期申购	78,000,000.00	78,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-104,000,000.00	-104,000,000.00
本期末	194,156,094.00	194,156,094.00

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	22,703,115.22	71,995,489.11	94,698,604.33
本期利润	2,797,311.74	110,297,802.96	113,095,114.70
本期基金份额交易产生的变动数	1,360,482.73	-16,259,821.21	-14,899,338.48
其中：基金申购款	7,983,947.24	37,612,941.85	45,596,889.09
基金赎回款	-6,623,464.51	-53,872,763.06	-60,496,227.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,860,909.69	166,033,470.86	192,894,380.55

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	16,788.27		26,940.41

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	323.80	118.49
结算备付金利息收入	1,666.34	984.47
其他	-	-
合计	18,778.41	28,043.37

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	-3,230,173.26	-3,609,563.95
股票投资收益——赎回差价收入	2,209,413.70	-4,579,494.91
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	-1,020,759.56	-8,189,058.86

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	148,395,838.64	57,902,651.09
减： 卖出股票成本总额	151,626,011.90	61,512,215.04
买卖股票差价收入	-3,230,173.26	-3,609,563.95

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	164,496,227.57	15,472,711.41
减： 现金支付赎回款总额	59,569,158.57	81,339.41
减： 赎回股票成本总额	102,717,655.30	19,970,866.91
赎回差价收入	2,209,413.70	-4,579,494.91

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	118,507.85	-
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	118,507.85	-

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	1,046,573.90	-
减： 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	927,800.00	-
减： 应收利息总额	266.05	-
买卖债券差价收入	118,507.85	-

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金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	5,988,672.98	5,690,916.83
其中： 证券出借权益补偿收入	250,295.33	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,988,672.98	5,690,916.83

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	110,297,802.96	78,796,191.01
——股票投资	110,297,510.44	78,796,191.01
——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	-	977.20
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	110,297,802.96	78,797,168.21

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

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	217,886.85	5,497.79
手续费返还	-	-
其他	-	-
基金转换费收入	-	-
印花税返还	-	-
合计	217,886.85	5,497.79

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	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
交易所市场交易费用	389,505.96	178,053.52
银行间市场交易费用	-	-
合计	389,505.96	178,053.52

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	36,000.00	34,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	5,503.18	2,690.09
指数使用费	103,288.78	84,055.29
其他	-	-
上市费	-	60,000.00
合计	264,791.96	300,745.38

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
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

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	成交金额	占当期股

		票成交总额的比例		票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	177,063.38	0.07%	-	-

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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年12月31日	成交金额	2019年1月1日至2019年12月31日	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	434,000.00	22.07%	44,300.00	100.00%

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

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			
当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
广发证券股份有限公司	84.80	0.05%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2019年1月1日至2019年12月31日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
广发证券股份有限公司	-	-	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；
 2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；
 3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,721,479.87	1,400,921.88
其中：支付销售机构的客户维护费	4,077.35	1,035.78

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 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托管费	344,295.93	280,184.32

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2020 年 12 月 31 日		2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	169,664,668.00	87.39%	211,408,868.00	96.03%

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	4,048,580.78	16,788.27	2,954,241.40	26,940.41

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688561	奇安信-U	2020-07-16	2021-01-22	新股流通受限	56.10	122.83	4,464.00	250,430.40	548,313.12	-
688289	圣湘生物	2020-08-20	2021-03-01	新股流通受限	50.48	109.84	2,665.00	134,529.20	292,723.60	2020-12-03除权除息，派息比例0.7500(含税)

68812 7	蓝特 光学	2020-0 9-14	2021-0 3-22	新股 流通 受限	15.41	33.60	5,322. 00	82,012 .02	178,81 9.20	-
68837 7	迪威 尔	2020-0 6-29	2021-0 1-08	新股 流通 受限	16.42	18.68	7,894. 00	129,61 9.48	147,45 9.92	-
68833 0	宏力 达	2020-0 9-28	2021-0 4-15	新股 流通 受限	88.23	75.87	1,377. 00	121,49 2.71	104,47 2.99	-
68830 9	恒誉 环保	2020-0 7-07	2021-0 1-14	新股 流通 受限	24.79	32.53	2,880. 00	71,395 .20	93,686 .40	-
68801 3	天臣 医疗	2020-0 9-21	2021-0 3-29	新股 流通 受限	18.62	28.68	3,022. 00	56,269 .64	86,670 .96	-
30092 7	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 1-07	新股 流通 受限	13.39	13.39	2,163. 00	28,962 .57	28,962 .57	-
30091 9	中伟 股份	2020-1 2-15	2021-0 6-23	新股 流通 受限	24.60	61.51	326.00	8,019. 60	20,052 .26	-
30089 4	火星 人	2020-1 2-24	2021-0 6-30	新股 流通 受限	14.07	36.97	540.00	7,597. 80	19,963 .80	-
30089 8	熊猫 乳品	2020-1 0-09	2021-0 4-16	新股 流通 受限	10.78	33.03	496.00	5,346. 88	16,382 .88	-
30090 9	汇创 达	2020-1 1-11	2021-0 5-18	新股 流通 受限	29.57	40.67	299.00	8,841. 43	12,160 .33	-
30092 5	法本 信息	2020-1 2-21	2021-0 6-30	新股 流通 受限	20.08	37.33	272.00	5,461. 76	10,153 .76	-
30091 8	南山 智尚	2020-1 2-15	2021-0 6-22	新股 流通 受限	4.97	8.94	1,063. 00	5,283. 11	9,503. 22	-
30091 7	特发 服务	2020-1 2-14	2021-0 6-21	新股 流通 受限	18.78	31.94	281.00	5,277. 18	8,975. 14	-
60527 7	新亚 电子	2020-1 2-25	2021-0 1-06	新股 流通 受限	16.95	16.95	507.00	8,593. 65	8,593. 65	-
00303 0	祖名 股份	2020-1 2-25	2021-0 1-06	新股 流通	15.18	15.18	480.00	7,286. 40	7,286. 40	-

				受限						
00303 1	中瓷 电子	2020-1 2-24	2021-0 1-04	新股 流通 受限	15.27	15.27	387.00	5,909. 49	5,909. 49	-

7.4.12.1.2 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
12308 8	威唐 转债	2020-1 2-15	2021-0 1-06	新债 流通 受限	100.00	100.00	159.00	15,900 .00	15,900 .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权证。

7.4.12.2 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 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
30018 2	捷成股 份	2020-12 -30	重大事 项停牌	3.23	2021-0 1-07	3.40	213,300.00	1,263,527.76	688,959.00-	

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

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
2020120400002936	000800	一汽解放	2020-12-04	2021-01-04	11.68	10,000.00	116,800.00
2020120400002942	002400	省广集团	2020-12-04	2021-01-04	5.31	10,000.00	53,100.00
2020120400002956	600733	北汽蓝谷	2020-12-04	2021-01-04	8.67	50,000.00	433,500.00
2020120400002966	600037	歌华有线	2020-12-04	2021-01-04	9.20	10,000.00	92,000.00
2020120400002970	600418	江淮汽车	2020-12-04	2021-01-04	12.23	10,000.00	122,300.00
2020120400002974	601058	赛轮轮胎	2020-12-04	2021-01-04	6.04	50,000.00	302,000.00
2020120700002452	002537	海联金汇	2020-12-07	2021-01-04	7.36	10,000.00	73,600.00
2020120700002476	002400	省广集团	2020-12-07	2021-01-04	5.31	10,000.00	53,100.00
2020120700002480	002594	比亚迪	2020-12-07	2021-01-04	194.30	10,000.00	1,943,000.00
2020120700002484	600166	福田汽车	2020-12-07	2021-01-04	3.15	90,000.00	283,500.00
2020120700004032	600609	金杯汽车	2020-12-07	2021-01-04	5.73	10,000.00	57,300.00
2020120700004034	600335	国机汽车	2020-12-07	2021-01-04	4.97	10,000.00	49,700.00
2020120700004046	002400	省广集团	2020-12-07	2021-01-04	5.31	10,000.00	53,100.00
2020120700004458	300133	华策影视	2020-12-07	2021-01-04	6.18	19,000.00	117,420.00

202012 070000 4460	300251	光线传媒	2020-12-07	2021-01- 04	12.07	16,000.00	193,120.00
202012 080000 1844	601717	郑煤机	2020-12-08	2021-01- 05	10.93	10,000.00	109,300.00
202012 080000 1918	601689	拓普集团	2020-12-08	2021-01- 05	38.43	10,000.00	384,300.00
202012 080000 3682	600831	广电网络	2020-12-08	2021-01- 05	6.75	10,000.00	67,500.00
202012 080000 3696	002488	金固股份	2020-12-08	2021-01- 05	6.07	10,000.00	60,700.00
202012 080000 3704	000700	模塑科技	2020-12-08	2021-01- 05	5.45	10,000.00	54,500.00
202012 080000 3738	000651	格力电器	2020-12-08	2021-01- 05	61.94	135,000.00	8,361,900.0 0
202012 090000 0905	600261	阳光照明	2020-12-09	2021-01- 06	3.68	10,000.00	36,800.00
202012 090000 2726	600166	福田汽车	2020-12-09	2021-01- 06	3.15	10,000.00	31,500.00
202012 090000 2738	002239	奥特佳	2020-12-09	2021-01- 06	4.88	30,000.00	146,400.00
202012 100000 2338	601717	郑煤机	2020-12-10	2021-01- 07	10.93	10,000.00	109,300.00
202012 100000 2564	600303	曙光股份	2020-12-10	2021-01- 07	4.45	10,000.00	44,500.00
202012 100000 2566	600220	江苏阳光	2020-12-10	2021-01- 07	2.85	10,000.00	28,500.00
202012 100000 2568	600336	澳柯玛	2020-12-10	2021-01- 07	9.95	10,000.00	99,500.00
202012 100000	000802	北京文化	2020-12-10	2021-01- 07	5.87	10,000.00	58,700.00

2570							
202012 100000 2572	002662	京威股份	2020-12-10	2021-01-07	3.56	10,000.00	35,600.00
202012 100000 2694	002239	奥特佳	2020-12-10	2021-01-07	4.88	10,000.00	48,800.00
202012 140000 6345	002640	跨境通	2020-12-14	2021-01-11	5.14	10,000.00	51,400.00
202012 140000 7515	000589	贵州轮胎	2020-12-14	2021-01-11	6.58	10,000.00	65,800.00
202012 140000 7517	002131	利欧股份	2020-12-14	2021-01-11	3.03	90,000.00	272,700.00
202012 140000 7519	002351	漫步者	2020-12-14	2021-01-11	13.42	10,000.00	134,200.00
202012 140000 7521	600006	东风汽车	2020-12-14	2021-01-11	9.44	20,000.00	188,800.00
202012 140000 7523	601339	百隆东方	2020-12-14	2021-01-11	4.00	10,000.00	40,000.00
202012 150000 0921	300182	捷成股份	2020-12-15	2021-01-12	3.23	10,000.00	32,300.00
202012 150000 1010	000156	华数传媒	2020-12-15	2021-01-12	8.56	10,000.00	85,600.00
202012 150000 1071	000581	威孚高科	2020-12-15	2021-01-12	23.19	10,000.00	231,900.00
202012 150000 1209	000887	中鼎股份	2020-12-15	2021-01-12	11.71	10,000.00	117,100.00
202012 150000 1524	002416	爱施德	2020-12-15	2021-01-12	7.46	10,000.00	74,600.00
202012 150000 1537	002429	兆驰股份	2020-12-15	2021-01-12	6.20	10,000.00	62,000.00
202012	002434	万里扬	2020-12-15	2021-01-	8.92	10,000.00	89,200.00

150000 1541				12			
202012 150000 1580	002503	搜于特	2020-12-15	2021-01- 12	2.24	10,000.00	22,400.00
202012 150000 1600	002572	索菲亚	2020-12-15	2021-01- 12	25.90	10,000.00	259,000.00
202012 150000 1615	002563	森马服饰	2020-12-15	2021-01- 12	10.02	10,000.00	100,200.00
202012 150000 1619	002640	跨境通	2020-12-15	2021-01- 12	5.14	10,000.00	51,400.00
202012 150000 1706	601718	际华集团	2020-12-15	2021-01- 12	3.03	10,000.00	30,300.00
202012 150000 1763	600418	江淮汽车	2020-12-15	2021-01- 12	12.23	10,000.00	122,300.00
202012 150000 1813	600699	均胜电子	2020-12-15	2021-01- 12	25.36	10,000.00	253,600.00
202012 150000 1883	600373	中文传媒	2020-12-15	2021-01- 12	10.09	10,000.00	100,900.00
202012 150000 1930	601966	玲珑轮胎	2020-12-15	2021-01- 12	35.17	10,000.00	351,700.00
202012 150000 1995	600839	四川长虹	2020-12-15	2021-01- 12	2.90	10,000.00	29,000.00
202012 150000 2385	600037	歌华有线	2020-12-15	2021-01- 12	9.20	10,000.00	92,000.00
202012 150000 5833	000839	中信国安	2020-12-15	2021-01- 12	2.36	30,000.00	70,800.00
202012 170000 9843	600448	华纺股份	2020-12-17	2021-01- 14	3.67	10,000.00	36,700.00
202012 170000 9845	002292	奥飞娱乐	2020-12-17	2021-01- 14	6.09	20,000.00	121,800.00

202012 170000 9855	002277	友阿股份	2020-12-17	2021-01- 14	3.68	20,000.00	73,600.00
202012 170000 9861	000726	鲁泰 A	2020-12-17	2021-01- 14	6.67	10,000.00	66,700.00
202012 170000 9863	601717	郑煤机	2020-12-17	2021-01- 14	10.93	10,000.00	109,300.00
202012 170001 0219	000625	长安汽车	2020-12-17	2021-01- 14	21.88	59,000.00	1,290,920.0 0
202012 170001 0241	002400	省广集团	2020-12-17	2021-01- 14	5.31	10,000.00	53,100.00
202012 170001 0255	601633	长城汽车	2020-12-17	2021-01- 14	37.81	20,000.00	756,200.00
202012 170001 0767	300058	蓝色光标	2020-12-17	2021-01- 14	6.00	50,000.00	300,000.00
202012 180000 8049	600166	福田汽车	2020-12-18	2021-01- 04	3.15	20,000.00	63,000.00
202012 210000 1312	002488	金固股份	2020-12-21	2021-01- 18	6.07	10,000.00	60,700.00
202012 210000 1435	600825	新华传媒	2020-12-21	2021-01- 18	4.46	10,000.00	44,600.00
202012 210000 1828	600653	申华控股	2020-12-21	2021-01- 18	1.81	10,000.00	18,100.00
202012 210000 3799	002503	搜于特	2020-12-21	2021-01- 18	2.24	20,000.00	44,800.00
202012 210000 3807	000957	中通客车	2020-12-21	2021-01- 18	8.73	10,000.00	87,300.00
202012 210000 4149	601718	际华集团	2020-12-21	2021-01- 04	3.03	12,000.00	36,360.00
202012 210000	601801	皖新传媒	2020-12-21	2021-01- 04	4.75	12,000.00	57,000.00

4151							
202012 210000 4157	601928	凤凰传媒	2020-12-21	2021-01-04	6.33	12,000.00	75,960.00
202012 210000 4163	603766	隆鑫通用	2020-12-21	2021-01-04	3.50	12,000.00	42,000.00
202012 210000 5417	000559	万向钱潮	2020-12-21	2021-01-04	5.35	12,000.00	64,200.00
202012 210000 5463	600757	长江传媒	2020-12-21	2021-01-04	5.29	12,000.00	63,480.00
202012 210000 5477	600839	四川长虹	2020-12-21	2021-01-04	2.90	12,000.00	34,800.00
202012 210000 5491	600959	江苏有线	2020-12-21	2021-01-04	3.31	12,000.00	39,720.00
202012 210000 5503	601098	中南传媒	2020-12-21	2021-01-04	9.53	12,000.00	114,360.00
202012 210000 5569	000800	一汽解放	2020-12-21	2021-01-04	11.68	12,000.00	140,160.00
202012 210000 5609	002085	万丰奥威	2020-12-21	2021-01-04	6.56	12,000.00	78,720.00
202012 210000 5615	002131	利欧股份	2020-12-21	2021-01-04	3.03	14,500.00	43,935.00
202012 210000 5661	002429	兆驰股份	2020-12-21	2021-01-04	6.20	12,000.00	74,400.00
202012 210000 5713	600138	中青旅	2020-12-21	2021-01-04	10.26	12,000.00	123,120.00
202012 210000 5785	600623	华谊集团	2020-12-21	2021-01-04	5.80	12,000.00	69,600.00
202012 210000 5845	300058	蓝色光标	2020-12-21	2021-01-04	6.00	10,000.00	60,000.00
202012	300182	捷成股份	2020-12-21	2021-01-	3.23	12,000.00	38,760.00

210000 5855				04			
202012 240000 3510	002503	搜于特	2020-12-24	2021-01- 21	2.24	25,000.00	56,000.00
202012 240000 4089	600418	江淮汽车	2020-12-24	2021-01- 21	12.23	15,000.00	183,450.00
202012 240000 4460	600707	彩虹股份	2020-12-24	2021-01- 21	6.66	20,000.00	133,200.00
202012 240000 4752	600609	金杯汽车	2020-12-24	2021-01- 21	5.73	10,000.00	57,300.00
202012 240000 4943	600733	北汽蓝谷	2020-12-24	2021-01- 21	8.67	10,000.00	86,700.00
202012 240000 5486	600166	福田汽车	2020-12-24	2021-01- 21	3.15	15,000.00	47,250.00
202012 240000 6456	601633	长城汽车	2020-12-24	2021-01- 21	37.81	10,000.00	378,100.00
202012 240000 6693	600859	王府井	2020-12-24	2021-01- 21	32.58	10,000.00	325,800.00
202012 240001 2735	600977	中国电影	2020-12-24	2021-01- 07	12.46	20,000.00	249,200.00
202012 280000 6051	601238	广汽集团	2020-12-28	2021-01- 25	13.29	25,000.00	332,250.00
202012 280000 6053	002594	比亚迪	2020-12-28	2021-01- 25	194.30	10,000.00	1,943,000.0 0
202012 290000 0760	000501	鄂武商 A	2020-12-29	2021-01- 26	11.65	10,000.00	116,500.00
202012 290000 0783	000681	视觉中国	2020-12-29	2021-01- 26	13.00	10,000.00	130,000.00
202012 290000 0915	002048	宁波华翔	2020-12-29	2021-01- 26	15.57	10,000.00	155,700.00

202012 290000 1081	002434	万里扬	2020-12-29	2021-01- 26	8.92	10,000.00	89,200.00
202012 290000 1093	002429	兆驰股份	2020-12-29	2021-01- 26	6.20	18,500.00	114,700.00
202012 290000 1118	002563	森马服饰	2020-12-29	2021-01- 26	10.02	10,000.00	100,200.00
202012 290000 1148	002640	跨境通	2020-12-29	2021-01- 26	5.14	13,700.00	70,418.00
202012 290000 1463	600258	首旅酒店	2020-12-29	2021-01- 26	21.22	10,000.00	212,200.00
202012 290000 1566	600699	均胜电子	2020-12-29	2021-01- 26	25.36	10,000.00	253,600.00
202012 290000 2045	600839	四川长虹	2020-12-29	2021-01- 26	2.90	39,700.00	115,130.00
202012 290000 2073	600060	海信视像	2020-12-29	2021-01- 12	11.48	10,000.00	114,800.00
202012 290000 5657	600986	浙文互联	2020-12-29	2021-01- 05	4.29	10,000.00	42,900.00
202012 300000 6935	002154	报喜鸟	2020-12-30	2021-01- 13	3.33	20,000.00	66,600.00
202012 300000 6941	000850	华茂股份	2020-12-30	2021-01- 13	3.93	10,000.00	39,300.00
合计	-	-	-	-	-	1,845,400.0 0	26,247,433. 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。

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	36,792.52		44,300.00
未评级	-		-
合计	36,792.52		44,300.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为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最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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
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	2,954,241.40	-	-	-	2,954,241.40
结算备付金	20,262.49	-	-	-	20,262.49
存出保证金	15,556.53	-	-	-	15,556.53
交易性金融资产	44,300.00	-	-	312,168,930.90	312,213,230.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	588.94	588.94
资产总计	3,034,360.42	-	-	312,169,519.84	315,203,880.26
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	128,679.61	128,679.61
应付托管费	-	-	-	25,735.92	25,735.92
应付交易费用	-	-	-	18,555.48	18,555.48
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	176,210.87	176,210.87
负债总计	-	-	-	349,181.93	349,181.93
利率敏感度缺口	3,034,360.42	-	-	311,820,337.91	314,854,698.3 3

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		上年度末	
	2020 年 12 月 31 日	占基金资产净值比例	2019 年 12 月 31 日	占基金资产净值比例
	公允价值	资产净值比例	公允价值	资产净值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	383,148,876.97	98.99	312,168,930.90	99.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	36,792.52	0.01	44,300.00	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	383,185,669.49	99.00	312,213,230.90	99.16

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%	19,323,238.13	16,044,683.41
	下降 5%	-19,323,238.13	-16,044,683.41

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 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额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 306,504,448.65 元，属于第二层次的余额为人民币 5,708,782.25 元，无属于第三层次的金额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	383,148,876.97	98.89
	其中：股票	383,148,876.97	98.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,792.52	0.01
	其中：债券	36,792.52	0.01
	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	4,118,474.82	1.06
8	其他各项资产	155,972.93	0.04
9	合计	387,460,117.24	100.00

注：（1）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。

（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 26,247,433.00 元，占基金资产净值比例 6.78%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	269,805,762.93	69.71
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	20,471,523.87	5.29
G	交通运输、仓储和邮政业	499,271.55	0.13
H	住宿和餐饮业	3,596,485.55	0.93
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,663,830.65	3.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	45,764,019.15	11.82
M	科学研究和技术服务业	809,924.72	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	1,437,399.25	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,893,226.46	1.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	24,198,457.70	6.25
S	综合	-	-
	合计	383,148,876.97	98.99

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	000333	美的集团	427,852	42,117,750.88	10.88
2	000651	格力电器	498,302	30,864,825.88	7.97
3	601888	中国中免	101,050	28,541,572.50	7.37
4	002594	比亚迪	93,821	18,229,420.30	4.71
5	600690	海尔智家	391,846	11,445,821.66	2.96
6	002027	分众传媒	1,063,770	10,499,409.90	2.71
7	000100	TCL 科技	1,452,655	10,284,797.40	2.66
8	600104	上汽集团	362,934	8,870,106.96	2.29
9	600660	福耀玻璃	145,140	6,973,977.00	1.80
10	300413	芒果超媒	73,712	5,344,120.00	1.38
11	000625	长安汽车	231,001	5,054,301.88	1.31
12	601633	长城汽车	125,791	4,756,157.71	1.23
13	600741	华域汽车	163,212	4,703,769.84	1.22
14	002024	苏宁易购	385,543	2,972,536.53	0.77
15	300144	宋城演艺	162,397	2,877,674.84	0.74
16	601799	星宇股份	14,300	2,867,150.00	0.74
17	601966	玲珑轮胎	71,118	2,501,220.06	0.65
18	603833	欧派家居	18,547	2,494,571.50	0.64
19	002625	光启技术	111,507	2,481,030.75	0.64
20	002607	中公教育	70,282	2,469,006.66	0.64
21	600066	宇通客车	137,527	2,326,956.84	0.60
22	603816	顾家家居	32,763	2,310,119.13	0.60
23	600699	均胜电子	84,940	2,154,078.40	0.56
24	002131	利欧股份	699,326	2,118,957.78	0.55
25	603486	科沃斯	23,380	2,068,896.20	0.53
26	600177	雅戈尔	287,551	2,067,491.69	0.53
27	002508	老板电器	49,175	2,005,356.50	0.52
28	600637	东方明珠	212,147	1,896,594.18	0.49
29	600733	北汽蓝谷	217,000	1,881,390.00	0.49
30	002572	索菲亚	66,086	1,711,627.40	0.44
31	600754	锦江酒店	33,203	1,710,950.59	0.44
32	601689	拓普集团	43,738	1,680,851.34	0.43
33	600418	江淮汽车	137,251	1,678,579.73	0.43
34	002739	万达电影	92,400	1,670,592.00	0.43
35	600166	福田汽车	476,500	1,500,975.00	0.39
36	300251	光线传媒	121,517	1,466,710.19	0.38
37	002920	德赛西威	17,100	1,438,794.00	0.37
38	600655	豫园股份	160,800	1,429,512.00	0.37
39	002705	新宝股份	33,200	1,402,700.00	0.36
40	002032	苏泊尔	17,000	1,325,830.00	0.34
41	600859	王府井	40,212	1,310,106.96	0.34

42	601238	广汽集团	96,121	1,277,448.09	0.33
43	603195	公牛集团	6,200	1,272,798.00	0.33
44	300058	蓝色光标	206,366	1,238,196.00	0.32
45	603129	春风动力	7,000	1,219,330.00	0.32
46	000581	威孚高科	51,988	1,205,601.72	0.31
47	600297	广汇汽车	419,801	1,200,630.86	0.31
48	601058	赛轮轮胎	195,605	1,181,454.20	0.31
49	601717	郑煤机	107,900	1,179,347.00	0.30
50	002429	兆驰股份	187,502	1,162,512.40	0.30
51	002126	银轮股份	82,006	1,129,222.62	0.29
52	000800	一汽解放	95,449	1,114,844.32	0.29
53	600839	四川长虹	382,334	1,108,768.60	0.29
54	600258	首旅酒店	51,168	1,085,784.96	0.28
55	002085	万丰奥威	158,456	1,039,471.36	0.27
56	002242	九阳股份	31,759	1,017,558.36	0.26
57	600977	中国电影	77,300	963,158.00	0.25
58	002239	奥特佳	194,499	949,155.12	0.25
59	600060	海信视像	81,279	933,082.92	0.24
60	600037	歌华有线	100,901	928,289.20	0.24
61	002925	盈趣科技	14,200	913,486.00	0.24
62	000887	中鼎股份	75,800	887,618.00	0.23
63	600398	海澜之家	134,204	861,589.68	0.22
64	002563	森马服饰	83,800	839,676.00	0.22
65	300770	新媒股份	11,940	839,382.00	0.22
66	002048	宁波华翔	51,845	807,226.65	0.21
67	002867	周大生	30,250	806,162.50	0.21
68	300133	华策影视	127,242	786,355.56	0.20
69	600682	南京新百	69,653	784,292.78	0.20
70	600006	东风汽车	82,800	781,632.00	0.20
71	002400	省广集团	144,367	766,588.77	0.20
72	000016	深康佳 A	115,712	764,856.32	0.20
73	000559	万向钱潮	136,869	732,249.15	0.19
74	603596	伯特利	21,100	722,042.00	0.19
75	000913	钱江摩托	28,200	721,638.00	0.19
76	601098	中南传媒	74,400	709,032.00	0.18
77	600373	中文传媒	70,098	707,288.82	0.18
78	603489	八方股份	3,700	704,110.00	0.18
79	300182	捷成股份	213,300	688,959.00	0.18
80	601718	际华集团	227,300	688,719.00	0.18
81	600959	江苏有线	207,061	685,371.91	0.18
82	300280	紫天科技	13,400	676,030.00	0.17
83	000921	海信家电	46,756	673,753.96	0.17
84	000839	中信国安	284,050	670,358.00	0.17
85	002640	跨境通	129,050	663,317.00	0.17

86	300792	壹网壹创	6,000	662,460.00	0.17
87	300616	尚品宅配	8,240	656,398.40	0.17
88	601311	骆驼股份	69,720	651,882.00	0.17
89	000564	*ST 大集	247,700	641,543.00	0.17
90	002035	华帝股份	71,980	635,583.40	0.16
91	002434	万里扬	69,388	618,940.96	0.16
92	002291	星期六	38,200	617,312.00	0.16
93	600138	中青旅	59,973	615,322.98	0.16
94	002605	姚记科技	25,009	613,720.86	0.16
95	600729	重庆百货	21,026	607,651.40	0.16
96	601965	中国汽研	40,905	605,803.05	0.16
97	002614	奥佳华	44,788	602,398.60	0.16
98	002292	奥飞娱乐	98,400	599,256.00	0.15
99	600612	老凤祥	13,116	594,548.28	0.15
100	600986	浙文互联	137,140	588,330.60	0.15
101	600337	美克家居	128,000	584,960.00	0.15
102	000901	航天科技	57,805	580,940.25	0.15
103	000917	电广传媒	117,386	569,322.10	0.15
104	000681	视觉中国	43,500	565,500.00	0.15
105	603650	彤程新材	18,200	564,200.00	0.15
106	600742	一汽富维	55,407	556,286.28	0.14
107	000501	鄂武商 A	47,720	555,938.00	0.14
108	000796	凯撒旅业	41,600	555,776.00	0.14
109	603179	新泉股份	16,366	554,807.40	0.14
110	688561	奇安信-U	4,464	548,313.12	0.14
111	001696	宗申动力	71,100	548,181.00	0.14
112	002959	小熊电器	4,800	544,080.00	0.14
113	603008	喜临门	28,096	542,814.72	0.14
114	300526	中潜股份	8,444	536,194.00	0.14
115	000030	富奥股份	73,039	536,106.26	0.14
116	601163	三角轮胎	33,100	531,917.00	0.14
117	000793	华闻集团	206,800	527,340.00	0.14
118	000156	华数传媒	59,340	507,950.40	0.13
119	601928	凤凰传媒	79,000	500,070.00	0.13
120	603313	梦百合	15,350	497,647.00	0.13
121	600707	彩虹股份	74,302	494,851.32	0.13
122	002351	漫步者	36,863	494,701.46	0.13
123	600336	澳柯玛	49,600	493,520.00	0.13
124	002416	爱施德	64,106	478,230.76	0.12
125	002537	海联金汇	64,120	471,923.20	0.12
126	603515	欧普照明	15,620	471,880.20	0.12
127	603377	东方时尚	24,340	471,222.40	0.12
128	300432	富临精工	45,920	470,680.00	0.12
129	600609	金杯汽车	81,475	466,851.75	0.12

130	603208	江山欧派	4,330	455,732.50	0.12
131	002251	步步高	53,640	453,258.00	0.12
132	601010	文峰股份	153,100	451,645.00	0.12
133	601929	吉视传媒	225,490	450,980.00	0.12
134	002612	朗姿股份	18,302	450,778.26	0.12
135	000955	欣龙控股	55,700	446,714.00	0.12
136	601127	小康股份	26,100	445,788.00	0.12
137	000550	江铃汽车	21,500	443,760.00	0.11
138	603306	华懋科技	19,200	441,216.00	0.11
139	002488	金固股份	72,551	440,384.57	0.11
140	002832	比音勒芬	27,115	440,347.60	0.11
141	002283	天润工业	81,704	439,567.52	0.11
142	000810	创维数字	55,000	439,450.00	0.11
143	002489	浙江永强	112,652	437,089.76	0.11
144	000589	贵州轮胎	66,100	434,938.00	0.11
145	002503	搜于特	192,114	430,335.36	0.11
146	002042	华孚时尚	96,513	429,482.85	0.11
147	000957	中通客车	49,110	428,730.30	0.11
148	002293	罗莱生活	34,300	427,035.00	0.11
149	002677	浙江美大	26,800	426,924.00	0.11
150	000829	天音控股	64,100	423,060.00	0.11
151	600628	新世界	53,555	417,729.00	0.11
152	600933	爱柯迪	26,700	416,520.00	0.11
153	600480	凌云股份	47,512	412,404.16	0.11
154	002798	帝欧家居	20,089	411,824.50	0.11
155	600936	广西广电	121,100	403,263.00	0.10
156	300258	精锻科技	24,900	402,384.00	0.10
157	603801	志邦家居	11,560	398,935.60	0.10
158	600831	广电网络	58,800	396,900.00	0.10
159	000801	四川九洲	63,540	393,312.60	0.10
160	000521	长虹美菱	63,901	387,240.06	0.10
161	002510	天汽模	75,708	384,596.64	0.10
162	002362	汉王科技	15,702	383,756.88	0.10
163	605168	三人行	2,100	380,835.00	0.10
164	002419	天虹股份	49,700	379,708.00	0.10
165	601366	利群股份	53,500	372,360.00	0.10
166	603766	隆鑫通用	106,258	371,903.00	0.10
167	002277	友阿股份	101,012	371,724.16	0.10
168	600694	大商股份	18,264	370,759.20	0.10
169	600220	江苏阳光	129,200	368,220.00	0.10
170	601019	山东出版	64,800	366,120.00	0.09
171	603096	新经典	7,000	364,070.00	0.09
172	000700	模塑科技	66,504	362,446.80	0.09
173	002031	巨轮智能	182,200	360,756.00	0.09

174	002472	双环传动	49,752	358,711.92	0.09
175	002668	奥马电器	89,807	355,635.72	0.09
176	000541	佛山照明	55,816	346,059.20	0.09
177	002540	亚太科技	65,800	342,160.00	0.09
178	603730	岱美股份	11,975	341,886.25	0.09
179	300783	三只松鼠	8,300	341,047.00	0.09
180	002406	远东传动	51,405	339,787.05	0.09
181	300217	东方电热	92,284	339,605.12	0.09
182	300755	华致酒行	12,960	339,292.80	0.09
183	002045	国光电器	38,756	337,952.32	0.09
184	002327	富安娜	44,103	337,828.98	0.09
185	002154	报喜鸟	100,845	335,813.85	0.09
186	600623	华谊集团	57,800	335,240.00	0.09
187	300342	天银机电	26,807	333,211.01	0.09
188	600757	长江传媒	62,871	332,587.59	0.09
189	600261	阳光照明	90,211	331,976.48	0.09
190	002083	孚日股份	75,200	331,632.00	0.09
191	600400	红豆股份	104,880	331,420.80	0.09
192	002003	伟星股份	48,180	328,587.60	0.08
193	603035	常熟汽饰	24,300	327,564.00	0.08
194	600070	浙江富润	37,830	321,555.00	0.08
195	600987	航民股份	55,939	320,530.47	0.08
196	600523	贵航股份	20,965	320,135.55	0.08
197	601949	中国出版	56,600	319,790.00	0.08
198	002512	达华智能	83,001	318,723.84	0.08
199	000526	紫光学大	6,000	314,340.00	0.08
200	600676	交运股份	63,895	312,446.55	0.08
201	300160	秀强股份	38,391	311,734.92	0.08
202	002284	亚太股份	45,835	311,678.00	0.08
203	000996	中国中期	35,769	311,190.30	0.08
204	603786	科博达	4,600	311,052.00	0.08
205	000726	鲁泰 A	46,586	310,728.62	0.08
206	002664	长鹰信质	20,672	308,632.96	0.08
207	000802	北京文化	51,879	304,529.73	0.08
208	603319	湘油泵	7,600	299,744.00	0.08
209	002404	嘉欣丝绸	35,900	294,380.00	0.08
210	601801	皖新传媒	61,789	293,497.75	0.08
211	688289	圣湘生物	2,665	292,723.60	0.08
212	002707	众信旅游	56,342	291,851.56	0.08
213	600653	申华控股	161,217	291,802.77	0.08
214	603305	旭升股份	9,300	290,997.00	0.08
215	603197	保隆科技	10,280	289,176.40	0.07
216	002029	七匹狼	54,800	287,700.00	0.07
217	002087	新野纺织	67,691	287,686.75	0.07

218	002970	锐明技术	5,400	286,254.00	0.07
219	603587	地素时尚	14,960	285,287.20	0.07
220	603348	文灿股份	10,400	284,960.00	0.07
221	300304	云意电气	53,830	283,145.80	0.07
222	002084	海鸥住工	40,150	282,656.00	0.07
223	002328	新朋股份	55,173	281,934.03	0.07
224	002448	中原内配	49,950	281,718.00	0.07
225	300680	隆盛科技	9,000	280,890.00	0.07
226	300063	天龙集团	54,400	280,704.00	0.07
227	600824	益民集团	76,407	280,413.69	0.07
228	603809	豪能股份	13,480	278,901.20	0.07
229	002759	天际股份	16,703	277,603.86	0.07
230	002213	大为股份	21,300	276,474.00	0.07
231	600960	渤海汽车	59,000	273,760.00	0.07
232	600107	美尔雅	29,800	272,670.00	0.07
233	000417	合肥百货	56,492	272,291.44	0.07
234	300464	星徽股份	14,600	269,224.00	0.07
235	002699	美盛文化	47,062	269,194.64	0.07
236	002345	潮宏基	65,601	268,964.10	0.07
237	002516	旷达科技	76,100	266,350.00	0.07
238	002906	华阳集团	9,800	264,208.00	0.07
239	300428	四通新材	18,000	260,100.00	0.07
240	300577	开润股份	9,900	258,192.00	0.07
241	300894	火星人	5,400	258,103.80	0.07
242	603355	莱克电气	8,500	256,955.00	0.07
243	000026	飞亚达	22,425	256,317.75	0.07
244	300242	佳云科技	52,600	255,636.00	0.07
245	002355	兴民智通	51,413	255,522.61	0.07
246	600686	金龙汽车	29,710	255,506.00	0.07
247	002343	慈文传媒	39,386	253,645.84	0.07
248	000599	青岛双星	59,583	253,227.75	0.07
249	688686	奥普特	1,165	252,572.00	0.07
250	300788	中信出版	5,900	250,219.00	0.06
251	600303	曙光股份	55,979	249,106.55	0.06
252	300291	华录百纳	50,800	248,412.00	0.06
253	002654	万润科技	63,400	246,626.00	0.06
254	300176	派生科技	32,094	244,877.22	0.06
255	600088	中视传媒	20,565	244,723.50	0.06
256	600229	城市传媒	36,302	244,675.48	0.06
257	600825	新华传媒	54,100	241,286.00	0.06
258	002621	美吉姆	42,780	240,851.40	0.06
259	600448	华纺股份	65,240	239,430.80	0.06
260	600054	黄山旅游	26,600	238,868.00	0.06
261	002780	三夫户外	12,000	238,560.00	0.06

262	600996	贵广网络	43,600	238,056.00	0.06
263	300651	金陵体育	5,290	236,568.80	0.06
264	603868	飞科电器	5,000	233,900.00	0.06
265	300061	旗天科技	48,500	233,770.00	0.06
266	002616	长青集团	30,700	233,320.00	0.06
267	002454	松芝股份	39,063	233,206.11	0.06
268	601858	中国科传	24,600	232,716.00	0.06
269	600081	东风科技	13,000	230,360.00	0.06
270	000850	华茂股份	58,600	230,298.00	0.06
271	601900	南方传媒	27,800	230,184.00	0.06
272	000888	峨眉山 A	38,202	229,212.00	0.06
273	002238	天威视讯	33,210	228,816.90	0.06
274	600327	大东方	55,000	228,250.00	0.06
275	603158	腾龙股份	11,200	227,360.00	0.06
276	600838	上海九百	33,200	227,088.00	0.06
277	000785	居然之家	27,000	226,530.00	0.06
278	600715	文投控股	95,978	226,508.08	0.06
279	000665	湖北广电	50,807	225,583.08	0.06
280	600335	国机汽车	45,270	224,991.90	0.06
281	002486	嘉麟杰	68,900	223,236.00	0.06
282	002662	京威股份	62,104	221,090.24	0.06
283	300375	鹏翎股份	44,200	218,790.00	0.06
284	603825	华扬联众	11,800	218,654.00	0.06
285	002033	丽江股份	34,155	218,592.00	0.06
286	603579	荣泰健康	7,200	217,224.00	0.06
287	000719	中原传媒	31,800	216,876.00	0.06
288	600730	中国高科	48,600	216,270.00	0.06
289	002634	棒杰股份	33,303	215,137.38	0.06
290	603180	金牌厨柜	4,260	212,787.00	0.05
291	002181	粤传媒	48,100	208,754.00	0.05
292	603600	永艺股份	15,700	208,496.00	0.05
293	603385	惠达卫浴	19,140	208,434.60	0.05
294	603558	健盛集团	25,904	207,750.08	0.05
295	000038	深大通	21,640	207,744.00	0.05
296	600136	当代文体	30,300	207,252.00	0.05
297	600135	乐凯胶片	28,638	207,052.74	0.05
298	000025	特力 A	12,185	205,926.50	0.05
299	002631	德尔未来	27,600	205,896.00	0.05
300	002394	联发股份	20,700	205,758.00	0.05
301	600738	丽尚国潮	32,000	205,440.00	0.05
302	002776	柏堡龙	39,029	204,121.67	0.05
303	601566	九牧王	17,894	203,991.60	0.05
304	600469	风神股份	37,800	202,608.00	0.05
305	601595	上海电影	18,520	202,053.20	0.05

306	300816	艾可蓝	2,500	200,800.00	0.05
307	600693	东百集团	46,500	200,415.00	0.05
308	603239	浙江仙通	11,200	200,256.00	0.05
309	300279	和晶科技	37,220	199,871.40	0.05
310	605288	凯迪股份	1,600	199,840.00	0.05
311	600071	凤凰光学	17,500	199,675.00	0.05
312	300403	汉宇集团	31,224	198,584.64	0.05
313	002059	云南旅游	41,900	198,187.00	0.05
314	002397	梦洁股份	39,300	196,893.00	0.05
315	002186	全聚德	19,200	193,536.00	0.05
316	002101	广东鸿图	27,411	189,958.23	0.05
317	300824	北鼎股份	6,800	189,924.00	0.05
318	002878	元隆雅图	9,154	188,206.24	0.05
319	002627	宜昌交运	35,250	186,825.00	0.05
320	603787	新日股份	6,300	186,417.00	0.05
321	601339	百隆东方	46,600	186,400.00	0.05
322	603358	华达科技	9,700	183,330.00	0.05
323	300625	三雄极光	11,600	182,700.00	0.05
324	300729	乐歌股份	4,300	182,664.00	0.05
325	603808	歌力思	13,795	182,094.00	0.05
326	600178	东安动力	23,900	181,640.00	0.05
327	002659	凯文教育	37,200	181,536.00	0.05
328	002590	万安科技	24,801	180,551.28	0.05
329	600630	龙头股份	30,789	180,423.54	0.05
330	002758	浙农股份	15,200	180,120.00	0.05
331	603081	大丰实业	16,600	180,110.00	0.05
332	688022	瀚川智能	5,416	179,811.20	0.05
333	688127	蓝特光学	5,322	178,819.20	0.05
334	603665	康隆达	8,100	178,038.00	0.05
335	603557	起步股份	19,500	177,450.00	0.05
336	603877	太平鸟	5,900	177,000.00	0.05
337	002712	思美传媒	36,090	176,119.20	0.05
338	002363	隆基机械	25,800	175,440.00	0.05
339	300507	苏奥传感	15,888	174,768.00	0.05
340	600593	大连圣亚	9,300	173,910.00	0.04
341	002676	顺威股份	52,200	172,260.00	0.04
342	603366	日出东方	33,100	171,789.00	0.04
343	002536	飞龙股份	31,121	170,231.87	0.04
344	300580	贝斯特	8,300	168,573.00	0.04
345	603661	恒林股份	3,100	168,454.00	0.04
346	603123	翠微股份	23,200	167,968.00	0.04
347	603982	泉峰汽车	8,300	167,079.00	0.04
348	600865	百大集团	23,345	166,916.75	0.04
349	002105	信隆健康	22,900	166,483.00	0.04

350	000607	华媒控股	42,100	165,874.00	0.04
351	600814	杭州解百	29,600	165,464.00	0.04
352	000524	岭南控股	20,800	164,528.00	0.04
353	603999	读者传媒	29,800	164,496.00	0.04
354	300612	宣亚国际	8,400	162,876.00	0.04
355	603238	诺邦股份	5,100	161,925.00	0.04
356	603303	得邦照明	15,140	160,786.80	0.04
357	600697	欧亚集团	11,500	160,655.00	0.04
358	603788	宁波高发	11,540	160,636.80	0.04
359	603950	长源东谷	7,200	159,840.00	0.04
360	300473	德尔股份	7,100	158,685.00	0.04
361	002853	皮阿诺	6,400	156,608.00	0.04
362	002721	金一文化	49,654	156,410.10	0.04
363	603610	麒盛科技	6,437	155,582.29	0.04
364	000721	西安饮食	36,200	154,936.00	0.04
365	300272	开能健康	30,215	154,398.65	0.04
366	300694	蠡湖股份	13,400	154,234.00	0.04
367	300793	佳禾智能	8,240	154,170.40	0.04
368	000757	浩物股份	34,377	154,008.96	0.04
369	600551	时代出版	20,900	153,824.00	0.04
370	603519	立霸股份	11,500	153,180.00	0.04
371	603598	引力传媒	14,000	152,600.00	0.04
372	600386	北巴传媒	41,754	151,984.56	0.04
373	600712	南宁百货	33,800	151,762.00	0.04
374	603040	新坐标	5,395	151,167.90	0.04
375	002965	祥鑫科技	4,700	150,917.00	0.04
376	603121	华培动力	13,376	150,078.72	0.04
377	601811	新华文轩	16,400	149,076.00	0.04
378	603103	横店影视	7,880	148,538.00	0.04
379	605108	同庆楼	6,200	147,622.00	0.04
380	002708	光洋股份	24,225	147,530.25	0.04
381	688377	迪威尔	7,894	147,459.92	0.04
382	603365	水星家纺	11,000	146,850.00	0.04
383	300660	江苏雷利	8,036	146,094.48	0.04
384	002103	广博股份	33,200	144,752.00	0.04
385	603608	天创时尚	22,240	142,780.80	0.04
386	300745	欣锐科技	7,100	141,645.00	0.04
387	300707	威唐工业	8,100	139,482.00	0.04
388	002953	日丰股份	7,200	139,176.00	0.04
389	000428	华天酒店	52,700	139,128.00	0.04
390	002703	浙江世宝	23,700	138,645.00	0.04
391	300703	创源股份	13,300	137,921.00	0.04
392	600576	祥源文化	38,500	137,830.00	0.04
393	002765	蓝黛科技	23,800	137,802.00	0.04

394	300585	奥联电子	9,900	135,729.00	0.04
395	603214	爱婴室	5,900	135,346.00	0.03
396	601999	出版传媒	22,800	135,204.00	0.03
397	000892	欢瑞世纪	50,800	132,588.00	0.03
398	300643	万通智控	10,400	132,080.00	0.03
399	603758	秦安股份	13,600	131,784.00	0.03
400	600679	上海凤凰	9,500	131,195.00	0.03
401	603009	北特科技	22,350	130,971.00	0.03
402	603633	徕木股份	13,600	130,968.00	0.03
403	002725	跃岭股份	15,900	129,903.00	0.03
404	600052	浙江广厦	43,700	129,352.00	0.03
405	603398	邦宝益智	12,300	128,043.00	0.03
406	300840	酷特智能	7,500	126,900.00	0.03
407	600232	金鹰股份	22,700	126,212.00	0.03
408	603023	威帝股份	29,054	125,513.28	0.03
409	300622	博士眼镜	8,800	123,288.00	0.03
410	002348	高乐股份	58,804	122,900.36	0.03
411	603839	安正时尚	12,460	122,855.60	0.03
412	002265	西仪股份	16,500	120,285.00	0.03
413	603997	继峰股份	15,900	119,886.00	0.03
414	300833	浩洋股份	2,600	119,002.00	0.03
415	300695	兆丰股份	2,100	118,461.00	0.03
416	603701	德宏股份	13,640	117,986.00	0.03
417	002740	爱迪尔	23,501	117,269.99	0.03
418	603390	通达电气	10,900	114,995.00	0.03
419	603667	五洲新春	15,100	114,458.00	0.03
420	300819	聚杰微纤	3,100	114,297.00	0.03
421	002905	金逸影视	11,660	111,936.00	0.03
422	603166	福达股份	18,400	109,112.00	0.03
423	002723	金莱特	8,000	108,400.00	0.03
424	002591	恒大高新	18,900	105,840.00	0.03
425	300781	因赛集团	3,500	105,805.00	0.03
426	688330	宏力达	1,377	104,472.99	0.03
427	603629	利通电子	3,100	104,377.00	0.03
428	300749	顶固集创	10,600	98,580.00	0.03
429	603949	雪龙集团	6,500	98,345.00	0.03
430	600818	中路股份	12,364	98,046.52	0.03
431	603221	爱丽家居	7,500	97,650.00	0.03
432	603055	台华新材	16,060	97,323.60	0.03
433	300528	幸福蓝海	15,400	96,712.00	0.02
434	603655	朗博科技	4,400	94,864.00	0.02
435	688309	恒誉环保	2,880	93,686.40	0.02
436	600828	茂业商业	25,100	93,623.00	0.02
437	603013	亚普股份	6,400	93,248.00	0.02

438	603726	朗迪集团	7,700	93,093.00	0.02
439	603266	天龙股份	8,200	91,676.00	0.02
440	603136	天目湖	3,615	91,640.25	0.02
441	300805	电声股份	4,800	90,480.00	0.02
442	603326	我乐家居	9,880	88,327.20	0.02
443	601086	国芳集团	20,700	87,975.00	0.02
444	002888	惠威科技	5,200	86,788.00	0.02
445	688013	天臣医疗	3,022	86,670.96	0.02
446	002485	希努尔	16,900	86,190.00	0.02
447	603992	松霖科技	4,600	84,364.00	0.02
448	603721	中广天择	6,700	84,353.00	0.02
449	603408	建霖家居	5,100	83,181.00	0.02
450	300808	久量股份	5,000	82,200.00	0.02
451	603900	莱绅通灵	10,600	74,836.00	0.02
452	603657	春光科技	4,160	72,384.00	0.02
453	603101	汇嘉时代	14,640	69,832.80	0.02
454	603767	中马传动	9,520	68,829.60	0.02
455	603551	奥普家居	4,600	68,586.00	0.02
456	603848	好太太	5,400	67,824.00	0.02
457	603685	晨丰科技	5,200	57,512.00	0.01
458	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
459	300919	中伟股份	326	20,052.26	0.01
460	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
461	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
462	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
463	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
464	300909	汇创达	299	12,160.33	0.00
465	300925	法本信息	272	10,153.76	0.00
466	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
467	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
468	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
469	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
470	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	6,148,933.00	1.95

2	601888	中国中免	3,448,312.44	1.10
3	000333	美的集团	2,561,407.00	0.81
4	000100	TCL 科技	2,383,530.00	0.76
5	600104	上汽集团	2,217,489.00	0.70
6	600690	海尔智家	2,180,201.00	0.69
7	300413	芒果超媒	1,585,477.00	0.50
8	300792	壹网壹创	1,496,403.00	0.48
9	002602	世纪华通	1,309,455.00	0.42
10	603195	公牛集团	1,279,450.55	0.41
11	603816	顾家家居	1,277,430.06	0.41
12	600741	华域汽车	1,228,973.00	0.39
13	002131	利欧股份	1,216,914.00	0.39
14	600733	北汽蓝谷	1,120,185.00	0.36
15	002594	比亚迪	1,102,989.00	0.35
16	600660	福耀玻璃	1,092,347.68	0.35
17	002291	星期六	1,085,251.00	0.34
18	601966	玲珑轮胎	1,046,140.78	0.33
19	603489	八方股份	951,869.00	0.30
20	000625	长安汽车	902,401.00	0.29

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	601888	中国中免	8,850,921.94	2.81
2	000333	美的集团	7,831,458.00	2.49
3	002602	世纪华通	4,606,971.20	1.46
4	600104	上汽集团	4,150,213.00	1.32
5	600690	海尔智家	3,963,032.00	1.26
6	688012	中微公司	3,836,747.80	1.22
7	000651	格力电器	2,521,241.08	0.80
8	600741	华域汽车	2,253,090.42	0.72
9	600660	福耀玻璃	2,018,137.42	0.64

10	600177	雅戈尔	1,786,522.00	0.57
11	600637	东方明珠	1,311,045.74	0.42
12	000158	常山北明	1,288,705.10	0.41
13	600699	均胜电子	1,239,993.00	0.39
14	601799	星宇股份	1,209,833.00	0.38
15	601916	浙商银行	1,137,319.75	0.36
16	600066	宇通客车	1,086,794.00	0.35
17	600859	王府井	1,052,905.00	0.33
18	300027	华谊兄弟	1,009,739.20	0.32
19	600959	江苏有线	985,922.00	0.31
20	600655	豫园股份	938,560.00	0.30

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	112,267,925.15
卖出股票收入（成交）总额	148,395,838.64

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）	36,792.52	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,792.52	0.01

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	128139	祥鑫转债	206	20,892.52	0.01
2	123088	威唐转债	159	15,900.00	0.00

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	31,289.80

2	应收证券清算款	101,083.43
3	应收股利	-
4	应收利息	23,599.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,972.93

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

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	000651	格力电器	8,361,900.00	2.16	转融通流通受限
2	002594	比亚迪	3,886,000.00	1.00	转融通流通受限

§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		广发中证全指可选消 费交易型开放式指数 证券投资基金管理发起式 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
2,752	70,550.91	174,755.59	90.01%	19,400,498.	9.99%	169,664,66	87.39%

		6.00		00		8.00	
--	--	------	--	----	--	------	--

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。

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	中国建设银行股份有限公司-长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	2,112,300.00	1.09%
2	郑州银行股份有限公司	1,000,000.00	0.52%
3	华夏资本-招商银行-武汉农村商业银行股份有限公司	679,100.00	0.35%
4	文华	607,000.00	0.31%
5	中国建设银行股份有限公司-上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	397,200.00	0.20%
6	建信基金-农业银行-建信量化多策略系列1号集合资产管理计划	350,000.00	0.18%
7	朱益	330,000.00	0.17%
8	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	0.15%
9	陈伟杰	289,900.00	0.15%
10	李培山	249,500.00	0.13%
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	169,664,668.00	87.39%

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(2014年6月3日)基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	220,156,094.00
本报告期基金总申购份额	78,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	104,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	194,156,094.00

§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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

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	177,063.38	0.07%	84.80	0.05%	-
银河证券	2	27,193,723.78	10.83%	19,882.99	10.84%	-
长江证券	2	47,408,717.34	18.89%	34,611.61	18.87%	新增 2 个
海通证券	2	84,120,472.41	33.51%	61,492.81	33.52%	-
安信证券	1	92,137,124.46	36.70%	67,380.51	36.73%	-
西南证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
招商证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华金证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

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

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

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	434,000.00	22.07%	-	-	-	-
银河证券	400,114.70	20.35%	-	-	-	-
长江证券	432,836.60	22.01%	-	-	-	-
海通证券	198,000.00	10.07%	-	-	-	-
安信证券	501,622.60	25.51%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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
6	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-27
7	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
8	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
9	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
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-07-20
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-08-27
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-08-28
13	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-10-28

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20200101-20201231	211,408,868.00	66,000,00.00	107,744,200.00	169,664,668.00	87.39%
产品特有风险							

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管理机制，切实保护持有人利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》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管理信息披露管理办法>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》。

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

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