

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资 基金

2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十八日

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。本半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 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45

8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
11 备查文件目录	50
11.1 备查文件目录	50
11.2 存放地点	50
11.3 查阅方式	51

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	全指材料
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	邱春杨	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	qcy@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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-1,478,870.73
本期利润	2,799,493.30
加权平均基金份额本期利润	0.0908
本期加权平均净值利润率	12.59%
本期基金份额净值增长率	19.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-8,117,701.39
期末可供分配基金份额利润	-0.2742
期末基金资产净值	21,490,640.61
期末基金份额净值	0.7258
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-27.42%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

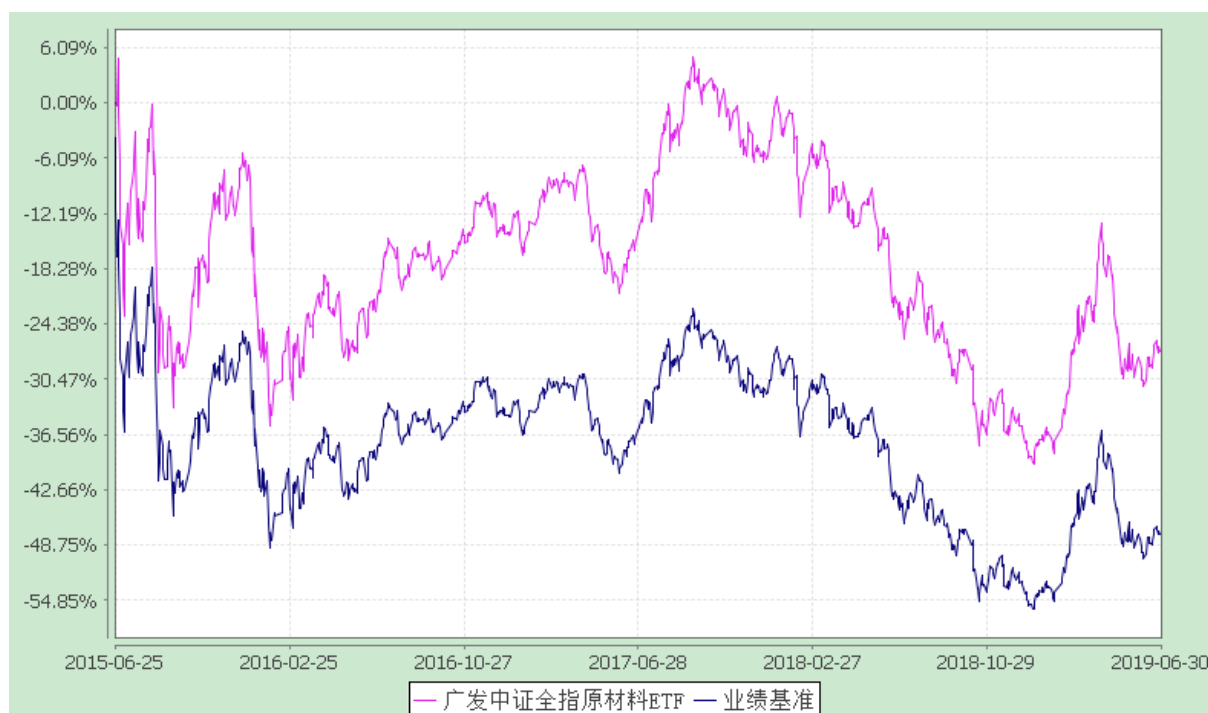
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.54%	1.24%	1.03%	1.27%	0.51%	-0.03%
过去三个月	-6.55%	1.88%	-8.37%	1.90%	1.82%	-0.02%
过去六个月	19.00%	1.76%	17.24%	1.79%	1.76%	-0.03%
过去一年	-6.98%	1.64%	-7.36%	1.68%	0.38%	-0.04%
过去三年	-8.05%	1.33%	-15.58%	1.36%	7.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-27.42%	1.86%	-47.55%	1.88%	20.13%	-0.02%

注：业绩比较基准：中证全指原材料指数。

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

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015 年 6 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、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、受托管理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、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国

际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

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；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	2015-06-25	-	20 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、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

	<p>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；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的基金经理；量化投资部副总经理</p>				<p>(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该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，未发现该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，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本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。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2019 年上半年，政府采取措施排解上市企业质押问题、采用基建补短板的方式拉动经济增长、实施减税降费等政策来稳定经济增长预期，一季度市场呈现出上涨行情。但二季度，受中美贸易问题反复、上市公司年报和一季报的财报数据偏弱以及预期流动性不再宽松等因素的影响，市场出现了一定程度下跌。上半年，市场最终以红盘结束，上证综指上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，创业板指上涨 20.87%，中小板指上涨 20.75%，而中证全指原材料指数上涨 17.24%。上半年，材料行业维持供需紧旺的格局，这给企业的盈利带来一定的保障。

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 19.00%，同期业绩比较基准收益率为 17.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，贸易保护政策对全球经济的负面影响逐渐显现，全球经济可能已经触及本轮增长周期的顶点，预计逐渐进入下行阶段。在全球经济增长普遍放缓的大背景下，中国经济仍有不错表现。随着国内稳基建、减税增加企业活力等政策的推进，国内经济有望继续稳步前进。目前 A 股的估值水平合理偏低，考虑到国内经济的稳速增长，A 股是不错的长期投资标的之一。从供给端来看，预计环保政策持续高压，供给侧改革持续执行，去产能依然在继续，抑制了材料行业的供给。从需求端来看，预计房地产行业仍然处在平稳增长阶段，有力地支撑了钢材等材料的需求；另外在全球主要国家出台政策提高新能源车比例的大背景下，预计新能源汽车呈现爆发式增长，使得镍、钴、锂等稀有有色金属需求大增。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 6 月 28 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”）在对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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	305,192.22	323,803.65
结算备付金		4,210.95	622.38
存出保证金		572.94	1,383.30
交易性金融资产	6.4.7.2	21,241,664.50	17,890,199.81
其中: 股票投资		21,241,664.50	17,890,199.81
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	54.02	65.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,551,694.63	18,216,074.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,947.31	8,019.15
应付托管费		1,789.48	1,603.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,885.50	1,962.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	48,431.73	145,360.46
负债合计		61,054.02	156,946.38
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	29,608,342.00	29,608,342.00
未分配利润	6.4.7.10	-8,117,701.39	-11,549,213.72
所有者权益合计		21,490,640.61	18,059,128.28

负债和所有者权益总计		21,551,694.63	18,216,074.66
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7258 元，基金份额总额 29,608,342.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,927,493.26	-11,162,305.06
1.利息收入		1,509.46	4,491.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,509.46	4,491.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	0.00
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,328,708.23	-184,252.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,662,915.36	-838,059.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	334,207.13	653,806.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,278,364.03	-10,969,109.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-23,672.00	-13,434.87
减：二、费用		127,999.96	348,236.16
1. 管理人报酬		54,893.78	146,332.87
2. 托管费		10,978.75	29,266.58
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,380.70	13,144.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	58,746.73	159,491.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		2,799,493.30	-11,510,541.22

列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,799,493.30	-11,510,541.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29,608,342.00	-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）	-	2,799,493.30	2,799,493.30
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	-8,117,701.39	21,490,640.61
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	67,608,342.00	-2,833,328.62	64,775,013.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,510,541.22	-11,510,541.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-948,648.18	1,051,351.82
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	-1,570,425.18	12,429,574.82
2.基金赎回款	-12,000,000.00	621,777.00	-11,378,223.00
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	69,608,342.00	-15,292,518.02	54,315,823.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核

算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	305,192.22

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	305,192.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		24,995,588.64	21,241,664.50	-3,753,924.14
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		24,995,588.64	21,241,664.50	-3,753,924.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	52.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.18
应收结算备付金利息	1.71
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-

合计	54.02
----	-------

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,885.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,885.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	38,431.73
应付指数使用费	10,000.00
合计	48,431.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,608,342.00	29,608,342.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	29,608,342.00	29,608,342.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,165,636.25	-5,383,577.47	-11,549,213.72
本期利润	-1,478,870.73	4,278,364.03	2,799,493.30
本期基金份额交易产生的变动数	32,402.42	599,616.61	632,019.03
其中：基金申购款	-1,776,944.06	599,399.28	-1,177,544.78
基金赎回款	1,809,346.48	217.33	1,809,563.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,612,104.56	-505,596.83	-8,117,701.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,442.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4.62
结算备付金利息收入	62.08
其他	-
合计	1,509.46

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,008,033.23
股票投资收益——赎回差价收入	-654,882.13
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,662,915.36

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,191,673.10
减：卖出股票成本总额	2,199,706.33
买卖股票差价收入	-1,008,033.23

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	6,190,436.19
减：现金支付赎回款总额	229,869.19
减：赎回股票成本总额	6,615,449.13
赎回差价收入	-654,882.13

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	334,207.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	334,207.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	4,278,364.03
——股票投资	4,278,364.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	4,278,364.03

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-23,672.00
合计	-23,672.00

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购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确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	3,380.70
银行间市场交易费用	-
合计	3,380.70

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	8,678.95
信息披露费	-
银行汇划费	315.00
上市费	29,752.78
指数使用费	20,000.00
合计	58,746.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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已于 2018 年 12 月 20 日公告《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清算报告》，已完成清算程序，不再作为本基金的关联方，除此之外，本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	54,893.78	146,332.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,904.21	2,285.42

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,978.75	29,266.58

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	305,192.22	1,442.76	649,915.27	4,239.25

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

6.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年6月30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
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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
-	-	-	-	-	-

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	1,000.00	3,460.00	3,460.00	-

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或所投资证券之发行人出现违约、

无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，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。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	305,192.22	-	-	-	305,192.22
结算备付金	4,210.95	-	-	-	4,210.95
存出保证金	572.94	-	-	-	572.94
交易性金融资产	-	-	-	21,241,664.50	21,241,664.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	54.02	54.02
资产总计	309,976.11	-	-	21,241,718.52	21,551,694.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,947.31	8,947.31
应付托管费	-	-	-	1,789.48	1,789.48
应付交易费用	-	-	-	1,885.50	1,885.50
其他负债	-	-	-	48,431.73	48,431.73
负债总计	-	-	-	61,054.02	61,054.02
利率敏感度缺口	309,976.11	-	-	21,180,664.50	21,490,640.61
上年度末 2018 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	323,803.65	-	-	-	323,803.65
结算备付金	622.38	-	-	-	622.38
存出保证金	1,383.30	-	-	-	1,383.30
交易性金融资产	-	-	-	17,890,199.81	17,890,199.81
应收利息	-	-	-	65.52	65.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	325,809.33	-	-	17,890,265.33	18,216,074.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,019.15	8,019.15

应付托管费	-	-	-	1,603.83	1,603.83
应付交易费用	-	-	-	1,962.94	1,962.94
其他负债	-	-	-	145,360.46	145,360.46
负债总计	-	-	-	156,946.38	156,946.38
利率敏感度缺口	325,809.33	-	-	17,733,318.95	18,059,128.28

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	21,241,664.50	98.84	17,890,199.81	99.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	21,241,664.50	98.84	17,890,199.81	99.06
----	---------------	-------	---------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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	上年度末
		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,233,372.53	857,808.59
	业绩比较基准下降 5%	-1,233,372.53	-857,808.59

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

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

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（ii）各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 21,238,204.50 元，属于第二层级的余额为人民币 3,460.00 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 17,855,259.81 元，属于第二层级的余额为人民币 34,940.00 元，属于第三层级的余额为人民币 0.00 元）。

（iii）公允价值所属层级间的重大变动

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级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	21,241,664.50	98.56
	其中：股票	21,241,664.50	98.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	309,403.17	1.44
8	其他各项资产	626.96	0.00
9	合计	21,551,694.63	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	133,152.60	0.62
B	采矿业	2,238,740.39	10.42
C	制造业	18,506,474.31	86.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	48,640.00	0.23
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	34,641.50	0.16
J	金融业	3,460.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	91,113.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	28,896.42	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	46,646.28	0.22
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	109,900.00	0.51
	合计	21,241,664.50	98.84

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	18,500	767,750.00	3.57
2	600309	万华化学	14,562	623,107.98	2.90
3	600019	宝钢股份	82,672	537,368.00	2.50
4	601899	紫金矿业	112,275	423,276.75	1.97
5	600352	浙江龙盛	24,200	381,634.00	1.78
6	600547	山东黄金	6,901	284,114.17	1.32
7	600010	包钢股份	166,710	281,739.90	1.31
8	600111	北方稀土	20,322	260,934.48	1.21
9	603993	洛阳钼业	63,800	252,648.00	1.18
10	601600	中国铝业	60,800	238,336.00	1.11
11	002271	东方雨虹	8,331	188,780.46	0.88
12	600176	中国巨石	19,468	185,530.04	0.86
13	600516	方大炭素	15,049	184,952.21	0.86

14	002460	赣锋锂业	7,301	171,062.43	0.80
15	600489	中金黄金	16,055	164,884.85	0.77
16	002466	天齐锂业	6,415	162,171.20	0.75
17	000401	冀东水泥	8,802	155,003.22	0.72
18	600426	华鲁恒升	10,382	154,276.52	0.72
19	600362	江西铜业	9,637	151,686.38	0.71
20	600219	南山铝业	66,530	150,357.80	0.70
21	000703	恒逸石化	10,720	146,435.20	0.68
22	601233	桐昆股份	9,391	145,654.41	0.68
23	000630	铜陵有色	58,598	144,151.08	0.67
24	000786	北新建材	7,900	143,227.00	0.67
25	002493	荣盛石化	11,751	141,717.06	0.66
26	000975	银泰资源	10,723	141,436.37	0.66
27	000629	攀钢钒钛	39,900	135,261.00	0.63
28	002340	格林美	28,356	133,556.76	0.62
29	603799	华友钴业	6,108	130,161.48	0.61
30	600801	华新水泥	6,360	128,790.00	0.60
31	002075	沙钢股份	16,400	128,576.00	0.60
32	600497	驰宏锌锗	23,699	120,390.92	0.56
33	600346	恒力石化	9,800	119,168.00	0.55
34	000709	河钢股份	39,495	118,090.05	0.55
35	601992	金隅集团	30,910	116,221.60	0.54
36	000778	新兴铸管	26,000	115,440.00	0.54
37	601168	西部矿业	17,800	113,564.00	0.53
38	002092	中泰化学	13,900	110,644.00	0.51
39	600549	厦门钨业	7,708	110,301.48	0.51
40	600673	东阳光	14,000	109,900.00	0.51
41	601005	重庆钢铁	54,400	109,344.00	0.51
42	000060	中金岭南	23,215	108,878.35	0.51
43	600392	盛和资源	9,776	108,122.56	0.50
44	300285	国瓷材料	6,353	108,064.53	0.50
45	000960	锡业股份	9,310	103,992.70	0.48
46	000830	鲁西化工	9,500	103,360.00	0.48
47	601216	君正集团	31,240	102,779.60	0.48
48	600022	山东钢铁	61,019	101,901.73	0.47
49	600567	山鹰纸业	29,773	100,335.01	0.47
50	600881	亚泰集团	29,999	97,496.75	0.45
51	002078	太阳纸业	14,199	96,695.19	0.45
52	600808	马钢股份	27,778	94,722.98	0.44
53	603077	和邦生物	49,180	93,442.00	0.43
54	600273	嘉化能源	8,000	92,480.00	0.43
55	600486	扬农化工	1,680	91,896.00	0.43
56	600160	巨化股份	12,850	91,363.50	0.43
57	002010	传化智联	12,100	91,113.00	0.42

58	000831	五矿稀土	5,500	89,265.00	0.42
59	600529	山东药玻	3,867	88,090.26	0.41
60	600143	金发科技	17,700	86,730.00	0.40
61	300072	三聚环保	10,873	86,222.89	0.40
62	600282	南钢股份	24,497	85,739.50	0.40
63	002110	三钢闽光	9,200	85,560.00	0.40
64	002237	恒邦股份	5,100	85,221.00	0.40
65	000825	太钢不锈	20,899	85,058.93	0.40
66	002601	龙蟠佰利	5,701	84,545.83	0.39
67	000898	鞍钢股份	21,966	83,251.14	0.39
68	000878	云南铜业	7,800	82,914.00	0.39
69	002002	鸿达兴业	13,189	81,639.91	0.38
70	002440	闰土股份	6,500	80,990.00	0.38
71	002233	塔牌集团	6,602	77,111.36	0.36
72	002155	湖南黄金	7,601	76,542.07	0.36
73	002250	联化科技	6,900	76,521.00	0.36
74	000932	华菱钢铁	15,600	74,412.00	0.35
75	300180	华峰超纤	5,180	72,623.60	0.34
76	600500	中化国际	9,710	72,533.70	0.34
77	601118	海南橡胶	14,000	72,100.00	0.34
78	000758	中色股份	12,900	70,821.00	0.33
79	000877	天山股份	5,901	68,569.62	0.32
80	000807	云铝股份	14,416	67,611.04	0.31
81	601678	滨化股份	10,001	67,606.76	0.31
82	002004	华邦健康	13,870	67,408.20	0.31
83	000683	远兴能源	25,720	67,129.20	0.31
84	600782	新钢股份	13,300	66,500.00	0.31
85	000488	晨鸣纸业	12,351	66,201.36	0.31
86	600206	有研新材	5,500	65,725.00	0.31
87	600409	三友化工	11,602	65,667.32	0.31
88	600507	方大特钢	6,700	65,526.00	0.30
89	002648	卫星石化	4,400	65,472.00	0.30
90	000902	新洋丰	6,100	65,453.00	0.30
91	002408	齐翔腾达	8,281	64,177.75	0.30
92	600277	亿利洁能	12,800	62,336.00	0.29
93	000301	东方盛虹	11,200	61,488.00	0.29
94	600490	鹏欣资源	12,400	61,256.00	0.29
95	601958	金钼股份	9,104	60,996.80	0.28
96	002407	多氟多	5,151	60,987.84	0.28
97	002812	恩捷股份	1,300	60,775.00	0.28
98	600803	新奥股份	5,751	60,097.95	0.28
99	002203	海亮股份	5,501	59,520.82	0.28
100	600307	酒钢宏兴	29,100	59,073.00	0.27
101	601636	旗滨集团	15,050	58,544.50	0.27

102	600366	宁波韵升	6,280	57,650.40	0.27
103	600596	新安股份	5,300	57,028.00	0.27
104	002597	金禾实业	3,100	56,544.00	0.26
105	600259	广晟有色	1,400	56,420.00	0.26
106	300618	寒锐钴业	940	56,400.00	0.26
107	600988	赤峰黄金	9,200	56,304.00	0.26
108	002701	奥瑞金	11,940	55,759.80	0.26
109	002470	金正大	15,318	55,757.52	0.26
110	300699	光威复材	1,680	54,936.00	0.26
111	002064	华峰氨纶	10,900	54,718.00	0.25
112	000959	首钢股份	14,800	52,096.00	0.24
113	600226	瀚叶股份	16,121	51,264.78	0.24
114	002643	万润股份	5,050	51,005.00	0.24
115	600720	祁连山	5,801	50,990.79	0.24
116	600459	贵研铂业	2,808	50,740.56	0.24
117	000717	韶钢松山	11,300	50,059.00	0.23
118	300054	鼎龙股份	6,260	49,767.00	0.23
119	000592	平潭发展	14,200	49,700.00	0.23
120	002716	金贵银业	6,320	49,296.00	0.23
121	000420	吉林化纤	18,400	49,128.00	0.23
122	000818	航锦科技	4,602	49,011.30	0.23
123	000969	安泰科技	5,800	48,952.00	0.23
124	600326	西藏天路	6,400	48,640.00	0.23
125	000012	南玻 A	11,516	47,906.56	0.22
126	000612	焦作万方	8,949	47,787.66	0.22
127	002497	雅化集团	6,700	46,833.00	0.22
128	002302	西部建设	4,200	46,788.00	0.22
129	002831	裕同科技	2,440	46,774.80	0.22
130	000672	上峰水泥	3,803	46,662.81	0.22
131	600210	紫江企业	11,299	45,760.95	0.21
132	600141	兴发集团	4,440	45,643.20	0.21
133	600456	宝钛股份	2,000	45,620.00	0.21
134	000408	藏格控股	5,500	45,485.00	0.21
135	600425	青松建化	10,200	45,288.00	0.21
136	002565	顺灏股份	5,900	45,194.00	0.21
137	000553	安道麦 A	4,201	45,034.72	0.21
138	000933	神火股份	10,500	44,205.00	0.21
139	600338	西藏珠峰	2,520	44,049.60	0.20
140	000789	万年青	4,381	43,897.62	0.20
141	300037	新宙邦	2,101	43,784.84	0.20
142	000936	华西股份	4,900	43,757.00	0.20
143	002596	海南瑞泽	5,400	43,632.00	0.20
144	002683	宏大爆破	3,701	43,301.70	0.20
145	002057	中钢天源	3,200	42,624.00	0.20

146	002145	中核钛白	10,316	42,605.08	0.20
147	600458	时代新材	4,080	42,391.20	0.20
148	603260	合盛硅业	900	42,354.00	0.20
149	002080	中材科技	4,674	42,346.44	0.20
150	600331	宏达股份	13,100	42,051.00	0.20
151	002254	泰和新材	3,940	41,685.20	0.19
152	000546	金圆股份	4,302	41,471.28	0.19
153	002326	永太科技	5,000	41,000.00	0.19
154	600668	尖峰集团	3,200	40,960.00	0.19
155	002171	楚江新材	6,320	40,195.20	0.19
156	002709	天赐材料	1,600	38,720.00	0.18
157	600966	博汇纸业	10,000	38,100.00	0.18
158	600531	豫光金铅	7,600	38,076.00	0.18
159	000990	诚志股份	2,300	37,743.00	0.18
160	002428	云南锗业	4,900	37,387.00	0.17
161	603399	吉翔股份	3,300	37,125.00	0.17
162	601677	明泰铝业	3,600	37,116.00	0.17
163	000795	英洛华	5,151	37,087.20	0.17
164	000426	兴业矿业	6,900	37,053.00	0.17
165	601069	西部黄金	2,400	36,960.00	0.17
166	000751	锌业股份	10,301	36,362.53	0.17
167	603026	石大胜华	1,200	36,312.00	0.17
168	000603	盛达矿业	3,200	35,776.00	0.17
169	002215	诺普信	5,100	35,700.00	0.17
170	002067	景兴纸业	10,300	35,432.00	0.16
171	002108	沧州明珠	9,084	35,427.60	0.16
172	002167	东方锆业	4,700	35,203.00	0.16
173	600063	皖维高新	12,500	35,000.00	0.16
174	002274	华昌化工	5,300	34,874.00	0.16
175	002235	安妮股份	3,950	34,641.50	0.16
176	002522	浙江众成	4,600	34,546.00	0.16
177	002318	久立特材	4,702	34,371.62	0.16
178	002303	美盈森	7,100	34,293.00	0.16
179	000910	大亚圣象	3,078	34,288.92	0.16
180	600586	金晶科技	10,600	34,238.00	0.16
181	000688	国城矿业	3,200	34,112.00	0.16
182	600308	华泰股份	7,600	33,896.00	0.16
183	000935	四川双马	2,100	33,579.00	0.16
184	601212	白银有色	7,600	33,364.00	0.16
185	300236	上海新阳	1,000	32,440.00	0.15
186	002585	双星新材	6,410	32,434.60	0.15
187	002206	海利得	7,852	32,428.76	0.15
188	603599	广信股份	2,200	32,274.00	0.15
189	000731	四川美丰	5,528	32,117.68	0.15

190	002182	云海金属	4,200	31,962.00	0.15
191	600255	梦舟股份	16,496	31,837.28	0.15
192	600636	三爱富	2,900	31,813.00	0.15
193	600096	云天化	5,301	31,593.96	0.15
194	300174	元力股份	1,600	31,488.00	0.15
195	600963	岳阳林纸	6,450	31,218.00	0.15
196	600433	冠豪高新	8,267	31,083.92	0.14
197	600810	神马股份	2,500	30,875.00	0.14
198	002256	兆新股份	10,600	30,634.00	0.14
199	603737	三棵树	700	30,478.00	0.14
200	002228	合兴包装	6,000	30,180.00	0.14
201	000155	川能动力	7,100	30,175.00	0.14
202	600076	康欣新材	6,700	30,150.00	0.14
203	600230	沧州大化	2,200	30,030.00	0.14
204	002258	利尔化学	2,300	30,015.00	0.14
205	600311	荣华实业	6,200	29,698.00	0.14
206	000973	佛塑科技	7,200	29,664.00	0.14
207	600389	江山股份	1,400	29,540.00	0.14
208	002240	威华股份	3,500	29,365.00	0.14
209	600378	昊华科技	1,900	29,260.00	0.14
210	600075	新疆天业	5,501	29,210.31	0.14
211	601388	怡球资源	12,979	29,072.96	0.14
212	603188	亚邦股份	3,700	29,045.00	0.14
213	600691	阳煤化工	11,000	28,930.00	0.13
214	002398	建研集团	4,501	28,896.42	0.13
215	000762	西藏矿业	3,701	28,867.80	0.13
216	601113	华鼎股份	4,100	28,741.00	0.13
217	002476	宝莫股份	4,600	28,704.00	0.13
218	002043	兔宝宝	4,750	28,690.00	0.13
219	600569	安阳钢铁	9,800	28,616.00	0.13
220	002226	江南化工	5,300	28,514.00	0.13
221	000525	红太阳	2,200	28,402.00	0.13
222	300487	蓝晓科技	900	28,368.00	0.13
223	300107	建新股份	3,100	28,117.00	0.13
224	601003	柳钢股份	4,800	27,792.00	0.13
225	300224	正海磁材	3,100	27,497.00	0.13
226	300596	利安隆	900	27,360.00	0.13
227	002392	北京利尔	7,800	27,300.00	0.13
228	002478	常宝股份	4,500	27,225.00	0.13
229	600888	新疆众和	5,560	27,188.40	0.13
230	000859	国风塑业	5,500	27,005.00	0.13
231	300325	德威新材	5,200	26,936.00	0.13
232	002132	恒星科技	9,350	26,928.00	0.13
233	002386	天原集团	4,400	26,884.00	0.13

234	002243	通产丽星	1,700	26,860.00	0.12
235	300398	飞凯材料	2,160	26,805.60	0.12
236	300409	道氏技术	2,122	26,800.86	0.12
237	000708	大冶特钢	2,100	26,670.00	0.12
238	002443	金洲管道	3,700	26,603.00	0.12
239	300021	大禹节水	4,500	26,595.00	0.12
240	600581	八一钢铁	7,100	26,199.00	0.12
241	002224	三力士	4,401	26,053.92	0.12
242	600172	黄河旋风	8,082	26,024.04	0.12
243	000510	新金路	5,700	25,992.00	0.12
244	000545	金浦钛业	6,500	25,675.00	0.12
245	000822	山东海化	5,000	25,400.00	0.12
246	600103	青山纸业	10,803	25,279.02	0.12
247	002768	国恩股份	1,000	25,250.00	0.12
248	600231	凌钢股份	7,710	24,826.20	0.12
249	002088	鲁阳节能	2,000	24,500.00	0.11
250	002588	史丹利	5,420	24,173.20	0.11
251	300748	金力永磁	400	24,032.00	0.11
252	000506	中润资源	6,101	23,915.92	0.11
253	300225	金力泰	4,401	23,809.41	0.11
254	600328	兰太实业	2,900	23,751.00	0.11
255	600527	江南高纤	10,750	23,650.00	0.11
256	603980	吉华集团	2,600	23,556.00	0.11
257	000657	中钨高新	3,321	23,247.00	0.11
258	000881	中广核技	2,900	23,229.00	0.11
259	000815	美利云	2,500	23,175.00	0.11
260	300041	回天新材	2,402	23,059.20	0.11
261	002225	濮耐股份	5,000	22,950.00	0.11
262	600449	宁夏建材	2,701	22,904.48	0.11
263	300057	万顺新材	4,300	22,876.00	0.11
264	603360	百傲化学	900	22,680.00	0.11
265	002012	凯恩股份	4,400	22,572.00	0.11
266	002734	利民股份	1,502	22,469.92	0.10
267	002361	神剑股份	5,502	22,283.10	0.10
268	002378	章源钨业	3,001	22,147.38	0.10
269	002149	西部材料	2,301	22,135.62	0.10
270	300064	豫金刚石	5,001	21,854.37	0.10
271	002539	云图控股	4,690	21,808.50	0.10
272	300067	安诺其	4,761	21,757.77	0.10
273	600126	杭钢股份	4,760	21,705.60	0.10
274	300737	科顺股份	2,300	21,620.00	0.10
275	300230	永利股份	4,900	21,609.00	0.10
276	600295	鄂尔多斯	2,600	21,554.00	0.10
277	002783	凯龙股份	1,680	21,504.00	0.10

278	002842	翔鹭钨业	1,236	21,395.16	0.10
279	300328	宜安科技	2,180	21,255.00	0.10
280	300082	奥克股份	3,200	21,088.00	0.10
281	601969	海南矿业	3,575	21,021.00	0.10
282	600558	大西洋	5,875	20,973.75	0.10
283	002631	德尔未来	2,500	20,725.00	0.10
284	600802	福建水泥	2,500	20,625.00	0.10
285	603505	金石资源	1,100	20,603.00	0.10
286	002082	万邦德	2,200	20,570.00	0.10
287	002538	司尔特	4,000	20,560.00	0.10
288	000923	河北宣工	1,200	20,532.00	0.10
289	002741	光华科技	1,700	20,281.00	0.09
290	000576	广东甘化	2,201	20,139.15	0.09
291	002455	百川股份	3,202	20,108.56	0.09
292	603225	新凤鸣	1,596	19,934.04	0.09
293	000962	东方钨业	2,500	19,750.00	0.09
294	002637	赞宇科技	2,801	19,635.01	0.09
295	002391	长青股份	2,550	19,609.50	0.09
296	002756	永兴特钢	1,340	19,564.00	0.09
297	002409	雅克科技	1,300	19,461.00	0.09
298	603826	坤彩科技	1,320	19,390.80	0.09
299	002521	齐峰新材	3,701	19,171.18	0.09
300	600589	广东榕泰	3,900	18,993.00	0.09
301	002170	芭田股份	5,300	18,921.00	0.09
302	002666	德联集团	3,900	18,915.00	0.09
303	600722	金牛化工	3,200	18,656.00	0.09
304	000698	沈阳化工	4,600	18,630.00	0.09
305	000920	南方汇通	2,400	18,600.00	0.09
306	300429	强力新材	1,866	18,585.36	0.09
307	600069	银鸽投资	7,600	18,468.00	0.09
308	000677	恒天海龙	5,600	18,368.00	0.09
309	300221	银禧科技	2,801	18,066.45	0.08
310	002054	德美化工	2,301	17,993.82	0.08
311	603429	集友股份	702	17,971.20	0.08
312	002632	道明光学	2,600	17,940.00	0.08
313	300135	宝利国际	6,000	17,640.00	0.08
314	601020	华钰矿业	1,502	17,603.44	0.08
315	002037	久联发展	2,300	17,595.00	0.08
316	002319	乐通股份	1,500	17,520.00	0.08
317	002381	双箭股份	2,200	17,490.00	0.08
318	300684	中石科技	864	17,452.80	0.08
319	002803	吉宏股份	850	17,348.50	0.08
320	002669	康达新材	1,400	17,094.00	0.08
321	601028	玉龙股份	3,400	17,068.00	0.08

322	000819	岳阳兴长	1,798	17,027.06	0.08
323	002068	黑猫股份	3,376	16,846.24	0.08
324	603639	海利尔	640	16,659.20	0.08
325	002749	国光股份	1,422	16,594.74	0.08
326	300481	濮阳惠成	1,300	16,588.00	0.08
327	600470	六国化工	3,900	16,575.00	0.08
328	600618	氯碱化工	2,100	16,506.00	0.08
329	603612	索通发展	1,540	16,493.40	0.08
330	603227	雪峰科技	4,301	16,472.83	0.08
331	603688	石英股份	1,300	16,380.00	0.08
332	600367	红星发展	1,900	16,302.00	0.08
333	300320	海达股份	3,400	16,184.00	0.08
334	600078	澄星股份	3,800	16,036.00	0.07
335	002246	北化股份	2,002	15,855.84	0.07
336	603181	皇马科技	1,060	15,741.00	0.07
337	000761	本钢板材	3,600	15,480.00	0.07
338	300575	中旗股份	540	15,422.40	0.07
339	600678	四川金顶	2,604	15,415.68	0.07
340	002125	湘潭电化	2,600	15,314.00	0.07
341	002211	宏达新材	2,403	15,283.08	0.07
342	002109	兴化股份	3,950	15,207.50	0.07
343	002360	同德化工	2,800	15,092.00	0.07
344	002584	西陇科学	3,001	15,005.00	0.07
345	002172	澳洋健康	3,600	14,760.00	0.07
346	002752	昇兴股份	2,300	14,674.00	0.07
347	600727	鲁北化工	2,200	14,652.00	0.07
348	002114	罗平锌电	1,800	14,580.00	0.07
349	603010	万盛股份	1,300	14,417.00	0.07
350	300109	新开源	860	14,405.00	0.07
351	603968	醋化股份	900	14,373.00	0.07
352	603969	银龙股份	3,102	14,331.24	0.07
353	300121	阳谷华泰	1,790	14,320.00	0.07
354	300437	清水源	1,200	14,232.00	0.07
355	600968	海油发展	4,000	14,200.00	0.07
356	000565	渝三峡 A	2,401	14,069.86	0.07
357	300337	银邦股份	3,800	14,022.00	0.07
358	600117	西宁特钢	3,700	13,875.00	0.06
359	603002	宏昌电子	3,450	13,765.50	0.06
360	300637	扬帆新材	1,040	13,374.40	0.06
361	600165	新日恒力	3,351	13,269.96	0.06
362	603078	江化微	550	13,211.00	0.06
363	300192	科斯伍德	1,300	13,091.00	0.06
364	603916	苏博特	1,000	12,900.00	0.06
365	002895	川恒股份	1,100	12,771.00	0.06

366	603876	鼎胜新材	800	12,656.00	0.06
367	603067	振华股份	2,008	12,248.80	0.06
368	002160	常铝股份	3,400	12,138.00	0.06
369	000635	英力特	1,400	12,082.00	0.06
370	603878	武进不锈	1,120	12,040.00	0.06
371	002827	高争民爆	700	11,578.00	0.05
372	300537	广信材料	900	11,565.00	0.05
373	603978	深圳新星	500	11,495.00	0.05
374	603585	苏利股份	480	11,462.40	0.05
375	603086	先达股份	400	11,444.00	0.05
376	002679	福建金森	630	11,352.60	0.05
377	603938	三孚股份	600	11,118.00	0.05
378	002742	三圣股份	1,600	11,104.00	0.05
379	300655	晶瑞股份	700	11,053.00	0.05
380	603823	百合花	600	11,052.00	0.05
381	300599	雄塑科技	1,000	10,940.00	0.05
382	002442	龙星化工	1,900	10,640.00	0.05
383	002809	红墙股份	600	10,164.00	0.05
384	300700	岱勒新材	500	10,025.00	0.05
385	300261	雅本化学	1,900	9,842.00	0.05
386	600532	宏达矿业	1,800	9,648.00	0.04
387	603928	兴业股份	700	9,639.00	0.04
388	300522	世名科技	580	9,604.80	0.04
389	603499	翔港科技	420	9,567.60	0.04
390	300586	美联新材	700	9,534.00	0.04
391	601208	东材科技	2,100	9,408.00	0.04
392	603378	亚士创能	700	9,289.00	0.04
393	603278	大业股份	840	9,198.00	0.04
394	603733	仙鹤股份	600	9,102.00	0.04
395	603856	东宏股份	890	9,078.00	0.04
396	300505	川金诺	400	9,032.00	0.04
397	002915	中欣氟材	400	8,756.00	0.04
398	002886	沃特股份	400	8,640.00	0.04
399	603165	荣晟环保	460	8,634.20	0.04
400	300715	凯伦股份	400	8,416.00	0.04
401	002802	洪汇新材	400	8,368.00	0.04
402	002753	永东股份	925	7,992.00	0.04
403	002787	华源控股	1,102	7,890.32	0.04
404	002917	金奥博	540	7,522.20	0.04
405	300214	日科化学	1,200	7,344.00	0.03
406	603722	阿科力	300	6,690.00	0.03
407	603650	彤程新材	300	6,552.00	0.03
408	002846	英联股份	500	6,330.00	0.03
409	002909	集泰股份	600	5,802.00	0.03

410	300644	南京聚隆	200	5,654.00	0.03
411	300727	润禾材料	310	5,651.30	0.03
412	603332	苏州龙杰	200	5,638.00	0.03
413	603683	晶华新材	400	5,444.00	0.03
414	002942	新农股份	200	5,220.00	0.02
415	002549	凯美特气	900	5,175.00	0.02
416	603790	雅运股份	300	5,085.00	0.02
417	002591	恒大高新	600	5,058.00	0.02
418	603810	ST 丰山	100	3,780.00	0.02
419	603351	威尔药业	100	3,467.00	0.02
420	601236	红塔证券	1,000	3,460.00	0.02
421	002825	纳尔股份	200	3,244.00	0.02
422	603192	汇得科技	100	2,709.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002075	沙钢股份	140,606.00	0.78
2	000629	攀钢钒钛	139,251.00	0.77
3	002010	传化智联	72,962.00	0.40
4	002565	顺灏股份	48,242.00	0.27
5	600326	西藏天路	45,504.00	0.25
6	002274	华昌化工	37,614.00	0.21
7	002233	塔牌集团	36,213.00	0.20
8	600352	浙江龙盛	33,840.00	0.19
9	300174	元力股份	31,362.00	0.17
10	603188	亚邦股份	28,004.00	0.16
11	000859	国风塑业	27,478.00	0.15
12	300618	寒锐钴业	24,824.00	0.14
13	300748	金力永磁	24,474.00	0.14
14	603360	百傲化学	23,441.00	0.13
15	300057	万顺新材	22,547.00	0.12
16	000962	东方钨业	22,534.00	0.12
17	300082	奥克股份	20,730.00	0.11
18	000553	安道麦 A	20,151.00	0.11
19	603799	华友钴业	19,474.00	0.11
20	002466	天齐锂业	16,920.00	0.09

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换

股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000792	*ST 盐湖	104,447.45	0.58
2	600399	ST 抚钢	83,805.00	0.46
3	002450	*ST 康得	80,257.45	0.44
4	000887	中鼎股份	65,246.00	0.36
5	600309	万华化学	35,045.00	0.19
6	000584	哈工智能	29,126.00	0.16
7	603601	再升科技	28,434.80	0.16
8	002453	华软科技	24,938.00	0.14
9	600614	*ST 鹏起	24,660.00	0.14
10	300132	青松股份	23,459.00	0.13
11	300080	易成新能	22,292.00	0.12
12	601137	博威合金	21,135.00	0.12
13	603299	苏盐井神	20,733.00	0.11
14	002379	宏创控股	20,377.00	0.11
15	002578	闽发铝业	17,916.00	0.10
16	300196	长海股份	17,423.00	0.10
17	600989	宝丰能源	16,800.00	0.09
18	300777	中简科技	16,707.20	0.09
19	601996	丰林集团	16,449.00	0.09
20	002831	裕同科技	16,231.00	0.09

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,521,749.12
卖出股票收入（成交）总额	1,191,673.10

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	572.94

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	626.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,251	23,667.74	394,035.00	1.33%	29,214,307.00	98.67%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	程丽琼	1,000,053.00	3.38%

2	林晓春	704,106.00	2.38%
3	胡毅	600,000.00	2.03%
4	屠建红	500,221.00	1.69%
5	翟春光	500,043.00	1.69%
6	谭惠贞	500,034.00	1.69%
7	何新良	438,029.00	1.48%
8	李国铭	400,015.00	1.35%
9	邹林安	400,000.00	1.35%
10	徐晓红	300,020.00	1.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 25 日）基金份额总额	281,608,342.00
本报告期期初基金份额总额	29,608,342.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
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

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	917,880.44	33.95%	646.25	33.11%	-
安信证券	1	1,785,359.90	66.05%	1,305.68	66.89%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

联讯证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

国融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
2	关于增加国盛证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-25
3	关于旗下完全被动型指数基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-28

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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

11.3 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

二〇一九年八月二十八日