

广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投
资基金
2018 年半年度报告
2018 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
报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

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 2018 年 8 月 22 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 2018 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	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的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
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	45
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	46
8 基金份额持有人信息	47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 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	48
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	49
11 影响投资者决策的其他重要信息	50
12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 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	69,608,342.00 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	段西军
	联系电话	020-83936666
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn
客户服务电话	95105828,020-83936999	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	陈四清

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、上海证券报、证券时报
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、北京市西城区复兴门内大街 1 号

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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-541,431.71
本期利润	-11,510,541.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1761
本期加权平均净值利润率	-19.47%
本期基金份额净值增长率	-18.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-15,292,518.02
期末可供分配基金份额利润	-0.2197
期末基金资产净值	54,315,823.98
期末基金份额净值	0.7803
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.97%

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	-7.90%	1.73%	-8.43%	1.75%	0.53%	-0.02%
过去三个月	-13.97%	1.34%	-14.73%	1.37%	0.76%	-0.03%
过去六个月	-18.56%	1.42%	-18.46%	1.47%	-0.10%	-0.05%
过去一年	-9.70%	1.30%	-12.09%	1.33%	2.39%	-0.03%
过去三年	-25.63%	1.92%	-34.98%	1.90%	9.35%	0.02%
自基金合同生 效起至今	-21.97%	1.93%	-43.38%	1.95%	21.41%	-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 2018 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30个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、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、养老金与战略业务部、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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 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）及基金经理助理的简介

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 ETF 基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发中证全指信息技术 ETF 基金的基金经理；广发信息技术联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源 ETF 基金的基金经理；广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理；广发金融地产联接基金的基金经理；广发能源联接基金的基金经理；广发原材料联接基金的基金经理	2015-06-25	-	19 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金管理从业证书。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）。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 6 月 3 日起任职）、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 12 月 1 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 1 月 8 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 1 月 29 日起任职）、广发中证全指金融地产交易型开放式

	基金经理；广发主要消费联接基金的基金经理；广发中证全指工业 ETF 基金的基金经理；广发中证全指工业 ETF 联接基金的基金经理；量化投资部副总经理			指数证券投资基金管理人（自 2015 年 3 月 23 日起任职）、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 4 月 15 日起任职）、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 5 月 6 日起任职）、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 25 日起任职）、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 25 日起任职）、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 日起任职）、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 日起任职）、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 7 月 9 日起任职）、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 日起任职）、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 日起任职）、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 6 月 13 日起任职）、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 日起任职）。
--	--	--	--	--

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》及其配套法规、《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》和其他有关法律法规的规定，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，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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

（1）投资策略

作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回

等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

(2) 运作分析

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。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素，作为 ETF 基金，由于本基金规模较小，申购赎回对本基金的跟踪效果有较大影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-18.56%，同期业绩基准收益率为-18.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，A 股市场受中美贸易战的反复无常、金融去杠杆的严厉执行以及信用违约事件频发影响，权益市场有较大幅度的调整。从政府公告的经济数据来看，投资增速特别是基建投资出现了一定程度的下滑，消费增长也有一定的回落，中美贸易战也为出口的增长蒙上了阴影。下半年，政府针对外部环境的变化，将实施积极的财政政策和稳健的货币政策，保持经济运行在合理区间，要做好稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期的工作。经过上半年权益市场的大幅调整，风险得到释放，A 股的估值水平合理偏低，无论从破净的公司数量、公司的业绩增长、增持与回购的企业数量上进行判断，A 股是不错的投资标的之一。

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、估值的副总经理、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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”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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	649,915.27	828,840.07
结算备付金		-	25,929.57
存出保证金		576.75	3,144.78
交易性金融资产	6.4.7.2	53,877,882.25	64,175,966.26
其中：股票投资		53,877,882.25	64,175,966.26
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	121.34	172.97
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		54,528,495.61	65,034,053.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		22,925.20	28,146.81
应付托管费		4,585.03	5,629.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,357.69	11,828.90

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	177,803.71	213,435.18
负债合计		212,671.63	259,040.27
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	69,608,342.00	67,608,342.00
未分配利润	6.4.7.10	-15,292,518.02	-2,833,328.62
所有者权益合计		54,315,823.98	64,775,013.38
负债和所有者权益总计		54,528,495.61	65,034,053.65

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值人民币 0.7803 元, 基金份额总额 69,608,342.00 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: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-11,162,305.06	-1,097,343.57
1.利息收入		4,491.93	10,295.67
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	4,491.93	10,295.67
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)		-184,252.61	337,610.32
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-838,059.20	-459,644.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	653,806.59	797,255.11
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-10,969,109.51	-1,483,513.24
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	-13,434.87	38,263.68
减: 二、费用		348,236.16	554,109.51

1. 管理人报酬		146,332.87	290,275.35
2. 托管费		29,266.58	58,055.09
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	13,144.80	44,901.92
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	159,491.91	160,877.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,510,541.22	-1,651,453.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,510,541.22	-1,651,453.08

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	107,608,342.00	-15,555,238.74	92,053,103.26

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,651,453.08	-1,651,453.08
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）	66,000,000.00	-6,383,847.90	59,616,152.10
其中：1.基金申购款	126,000,000.00	-13,588,704.36	112,411,295.64
2.基金赎回款	-60,000,000.00	7,204,856.46	-52,795,143.54
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）	173,608,342.00	-23,590,539.72	150,017,802.28

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，有效认购房户数为 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：中证全指原材料指数的成份股、备选成份股，少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券、权证、股指期货、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。在建

仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：中证全指原材料指数。

本基金的财务报表于 2018 年 8 月 22 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。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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、债券免征营业税或增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2、对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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣缴税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

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 2018年6月30日
活期存款	649,915.27
定期存款	-
其他存款	-
合计	649,915.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,598,164.41	53,877,882.25	-9,720,282.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	63,598,164.41	53,877,882.25	-9,720,282.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	92.00
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.27
应收结算备付金利息	29.07
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	121.34

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,357.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,357.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	138,846.91
应付替代款	763.88
可退替代款	28,192.92
应付指数使用费	10,000.00
合计	177,803.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	67,608,342.00	67,608,342.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	69,608,342.00	69,608,342.00

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	-1,951,250.18	-882,078.44	-2,833,328.62
本期利润	-541,431.71	-10,969,109.51	-11,510,541.22
本期基金份额交易产生的变动数	-73,785.59	-874,862.59	-948,648.18
其中：基金申购款	-403,341.03	-1,167,084.15	-1,570,425.18
基金赎回款	329,555.44	292,221.56	621,777.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,566,467.48	-12,726,050.54	-15,292,518.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
活期存款利息收入		4,239.25
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		18.33
结算备付金利息收入		234.35
其他		-
合计		4,491.93

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 2018年1月1日至2018年6月30日	

股票投资收益——买卖股票差价收入	-900,469.80
股票投资收益——赎回差价收入	62,410.60
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-838,059.20

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	4,585,869.89
减：卖出股票成本总额	5,486,339.69
买卖股票差价收入	-900,469.80

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 2018年1月1日至2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	11,378,223.00
减：现金支付赎回款总额	705,107.00
减：赎回股票成本总额	10,610,705.40
赎回差价收入	62,410.60

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	653,806.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	653,806.59

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-10,969,109.51
——股票投资	-10,969,109.51
——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	-10,969,109.51

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
手续费返还	-
基金转换费收入	-
印花税返还	-
替代损益	-13,434.87
其他	-
合计	-13,434.87

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 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	13,144.80
银行间市场交易费用	-
合计	13,144.80

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	89,258.34
银行汇划费	645.00
上市费	29,752.78
指数使用费	20,000.00

合计	159,491.91
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或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
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	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,332.87	290,275.35
其中：支付销售机构的客户维护费	2,285.42	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月 30日	2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,266.58	58,055.09

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资	41,232,255.00	59.23%	36,210,698.00	53.56%

基金发起式联接 基金				
---------------	--	--	--	--

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		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
中国银行股份有限公司	649,915.27	4,239.25	2,858,075.13	8,888.33

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
00069	*ST 华泽	2018-05-02	重大事项停牌	3.31	-	-	10,900.00	216,526.33	36,079.00	-
60329	井神股份	2018-06-28	重大事项停牌	8.25	2018-07-05	8.48	6,500.00	73,687.86	53,625.00	-
00222	江南化工	2018-05-02	重大事项停牌	5.42	-	-	10,600.00	80,832.39	57,452.00	-
00208	万邦德	2017-12-18	重大事项停牌	13.97	2018-07-19	15.37	4,200.00	70,286.52	58,674.00	-
00054	金浦钛业	2018-06-11	重大事项停牌	3.76	-	-	16,100.00	93,513.74	60,536.00	-
60067	四川金顶	2018-04-18	重大事项停牌	10.24	-	-	6,404.00	82,594.27	65,576.96	-
00217	楚江新材	2018-06-07	重大事项停牌	6.78	-	-	10,120.00	81,193.73	68,613.60	-
00226	*ST 东南	2018-02-26	重大事项停牌	2.96	-	-	24,500.00	83,638.50	72,520.00	-

00225 6	兆新股 份	2018-03 -02	重大事 项停牌	4.52	2018-0 7-02	4.07	16,300.00	85,831.35	73,676.00	-
60032 8	兰太实 业	2018-06 -04	重大事 项停牌	8.99	2018-0 7-03	8.09	8,800.00	106,031.68	79,112.00	-
00060 3	盛达矿 业	2018-06 -11	重大事 项停牌	10.83	-	-	8,900.00	126,477.39	96,387.00	-
60039 9	*ST 抚 钢	2018-01 -31	重大事 项停牌	5.50	-	-	18,500.00	131,691.30	101,750.00	-
00042 6	兴业矿 业	2018-06 -19	重大事 项停牌	7.21	-	-	16,900.00	148,759.42	121,849.00	-
00058 4	哈工智 能	2018-03 -29	重大事 项停牌	13.87	2018-0 7-16	12.48	9,500.00	124,618.26	131,765.00	-
60022 6	瀚叶股 份	2017-11 -28	重大事 项停牌	4.56	-	-	29,421.00	161,193.80	134,159.76	-
00271 6	金贵银 业	2018-05 -03	重大事 项停牌	16.84	-	-	8,100.00	147,956.39	136,404.00	-
60016 5	新日恒 力	2018-02 -13	重大事 项停牌	16.51	2018-0 7-05	14.86	8,351.00	116,210.73	137,875.01	-
60111 8	海南橡 胶	2018-05 -24	重大事 项停牌	6.62	-	-	35,700.00	207,728.98	236,334.00	-
00240 8	齐翔腾 达	2018-06 -19	重大事 项停牌	12.28	-	-	20,681.00	231,674.43	253,962.68	-
60049 0	鹏欣资 源	2018-04 -17	重大事 项停牌	8.67	-	-	29,400.00	277,114.50	254,898.00	-
60002 2	山东钢 铁	2018-03 -27	重大事 项停牌	2.02	2018-0 8-16	1.83	142,019.00	319,814.95	286,878.38	-
00082 5	太钢不 锈	2018-04 -16	重大事 项停牌	6.00	-	-	50,299.00	260,034.23	301,794.00	-
00207 5	沙钢股 份	2016-09 -19	重大事 项停牌	16.12	-	-	20,900.00	278,832.51	336,908.00	-
30007 2	三聚环 保	2018-06 -19	重大事 项停牌	23.28	2018-0 7-10	24.00	20,441.00	652,110.98	475,866.48	-
00245 0	康得新	2018-06 -04	重大事 项停牌	17.08	-	-	48,015.00	960,996.59	820,096.20	-

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 2018 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 2018 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裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券，因此与债券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。

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 2018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	649,915.27	-	-	-	649,915.27
存出保证金	576.75	-	-	-	576.75
交易性金融资产	0.00	-	-	53,877,882.25	53,877,882.25
应收利息	-	-	-	121.34	121.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	650,492.02	-	-	53,878,003.59	54,528,495.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,925.20	22,925.20
应付托管费	-	-	-	4,585.03	4,585.03
应付交易费用	-	-	-	7,357.69	7,357.69

其他负债				177,803.71	177,803.71
负债总计				212,671.63	212,671.63
利率敏感度缺口	650,492.02			53,665,331.96	54,315,823.98
上年度末 2017 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	828,840.07				828,840.07
结算备付金	25,929.57				25,929.57
存出保证金	3,144.78				3,144.78
交易性金融资产	0.00			64,175,966.26	64,175,966.26
应收利息				172.97	172.97
其他资产					-
资产总计	857,914.42			64,176,139.23	65,034,053.65
负债					
应付管理人报酬				28,146.81	28,146.81
应付托管费				5,629.38	5,629.38
应付交易费用				11,828.90	11,828.90
其他负债				213,435.18	213,435.18
负债总计				259,040.27	259,040.27
利率敏感度缺口	857,914.42			63,917,098.96	64,775,013.38

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。

6.4.13.4.3 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。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		上年度末	
	2018年6月30日	占基金资产净值比例(%)	2017年12月31日	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	53,877,882.25	99.19	64,175,966.26	99.08
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	53,877,882.25	99.19	64,175,966.26	99.08

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
		2018年6月30日	2017年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	2,715,791.20	3,212,276.46
	业绩比较基准下降 5%	-2,715,791.20	-3,212,276.46

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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 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 49,425,090.18 元，属于第二层级的余额为 4,452,792.07 元，无属于第三层级的金额（2017 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 56,568,704.85 元，属于第二层级的余额为 7,607,261.41 元，无属于第三层级的金额）。

(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	53,877,882.25	98.81
	其中：股票	53,877,882.25	98.81
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	649,915.27	1.19
8	其他各项资产	698.09	0.00
9	合计	54,528,495.61	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	358,459.00	0.66
B	采矿业	4,333,475.81	7.98
C	制造业	49,007,164.97	90.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	56,060.05	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	21,439.60	0.04
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	101,282.82	0.19
	合计	53,877,882.25	99.19

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	600309	万华化学	38,162	1,733,318.04	3.19
2	600019	宝钢股份	207,172	1,613,869.88	2.97
3	600585	海螺水泥	46,600	1,560,168.00	2.87
4	601899	紫金矿业	241,275	871,002.75	1.60
5	002450	康得新	48,015	820,096.20	1.51
6	603799	华友钴业	8,202	799,448.94	1.47
7	002466	天齐锂业	15,915	789,224.85	1.45
8	600352	浙江龙盛	60,600	724,170.00	1.33
9	002460	赣锋锂业	18,101	698,336.58	1.29
10	600516	方大炭素	24,900	607,062.00	1.12
11	601600	中国铝业	152,900	587,136.00	1.08
12	600111	北方稀土	50,722	577,216.36	1.06
13	600176	中国巨石	48,868	499,919.64	0.92
14	600010	包钢股份	318,010	492,915.50	0.91
15	300072	三聚环保	20,441	475,866.48	0.88
16	600426	华鲁恒升	26,382	464,059.38	0.85
17	600547	山东黄金	17,301	413,839.92	0.76
18	002493	荣盛石化	39,951	412,294.32	0.76
19	000830	鲁西化工	23,900	408,212.00	0.75
20	000703	恒逸石化	26,820	399,081.60	0.73
21	000786	北新建材	20,800	385,424.00	0.71
22	600362	江西铜业	24,137	382,571.45	0.70
23	002340	格林美	62,156	376,043.80	0.69
24	601233	桐昆股份	21,191	364,909.02	0.67
25	600673	东阳光科	34,400	355,352.00	0.65
26	002271	东方雨虹	20,831	354,335.31	0.65
27	002078	太阳纸业	36,199	350,768.31	0.65
28	000792	盐湖股份	32,401	350,578.82	0.65
29	600219	南山铝业	129,100	349,861.00	0.64
30	002075	沙钢股份	20,900	336,908.00	0.62
31	603993	洛阳钼业	53,500	336,515.00	0.62
32	000630	铜陵有色	146,898	324,644.58	0.60
33	600497	驰宏锌锗	59,199	322,634.55	0.59
34	600392	盛和资源	18,751	304,328.73	0.56
35	000825	太钢不锈	50,299	301,794.00	0.56
36	600549	厦门钨业	19,708	299,167.44	0.55
37	000709	河钢股份	98,795	291,445.25	0.54
38	002092	中泰化学	30,000	289,200.00	0.53
39	600567	山鹰纸业	74,473	287,465.78	0.53
40	600022	山东钢铁	142,019	286,878.38	0.53
41	000060	中金岭南	58,115	282,438.90	0.52
42	601168	西部矿业	44,300	278,204.00	0.51
43	600489	中金黄金	40,155	273,857.10	0.50
44	000488	晨鸣纸业	20,701	267,456.92	0.49

45	601216	君正集团	78,540	264,679.80	0.49
46	600346	恒力股份	17,600	258,016.00	0.48
47	002110	三钢闽光	16,000	256,480.00	0.47
48	600490	鹏欣资源	29,400	254,898.00	0.47
49	601992	金隅集团	77,610	254,560.80	0.47
50	002408	齐翔腾达	20,681	253,962.68	0.47
51	002470	金正大	36,618	251,931.84	0.46
52	600808	马钢股份	69,378	249,067.02	0.46
53	000887	中鼎股份	17,200	247,852.00	0.46
54	000898	鞍钢股份	42,897	238,936.29	0.44
55	000778	新兴铸管	55,700	238,396.00	0.44
56	601118	海南橡胶	35,700	236,334.00	0.44
57	000975	银泰资源	23,123	234,467.22	0.43
58	600486	扬农化工	4,180	233,787.40	0.43
59	600160	巨化股份	31,850	233,142.00	0.43
60	000960	锡业股份	19,410	233,114.10	0.43
61	600143	金发科技	44,200	230,724.00	0.42
62	600282	南钢股份	51,297	226,732.74	0.42
63	600596	新安股份	13,200	213,444.00	0.39
64	603077	和邦生物	123,280	213,274.40	0.39
65	002407	多氟多	14,951	209,613.02	0.39
66	300285	国瓷材料	10,402	207,415.88	0.38
67	600409	三友化工	24,002	206,657.22	0.38
68	000401	冀东水泥	21,902	194,270.74	0.36
69	000878	云南铜业	19,800	188,892.00	0.35
70	000807	云铝股份	36,416	188,634.88	0.35
71	002440	闰土股份	16,100	188,209.00	0.35
72	002497	雅化集团	17,800	187,612.00	0.35
73	000831	五矿稀土	16,000	186,240.00	0.34
74	000717	韶钢松山	28,100	184,336.00	0.34
75	002601	龙蟠科技	14,201	183,618.93	0.34
76	000683	远兴能源	64,620	182,874.60	0.34
77	600507	方大特钢	16,900	180,661.00	0.33
78	300618	寒锐钴业	1,340	171,975.60	0.32
79	600801	华新水泥	11,300	169,839.00	0.31
80	002004	华邦健康	33,170	168,503.60	0.31
81	000553	沙隆达 A	10,601	167,601.81	0.31
82	601636	旗滨集团	37,550	167,097.50	0.31
83	600277	亿利洁能	31,800	166,632.00	0.31
84	600782	新钢股份	29,700	165,726.00	0.31
85	600500	中化国际	24,210	165,112.20	0.30
86	600803	新奥股份	14,251	164,456.54	0.30
87	600273	嘉化能源	17,300	156,738.00	0.29
88	601678	滨化股份	25,101	155,124.18	0.29

89	002597	金禾实业	7,600	154,128.00	0.28
90	002596	海南瑞泽	15,000	153,900.00	0.28
91	600307	酒钢宏兴	72,800	152,880.00	0.28
92	000959	首钢股份	36,900	151,659.00	0.28
93	002709	天赐材料	3,900	150,306.00	0.28
94	000818	航锦科技	12,902	150,050.26	0.28
95	002701	奥瑞金	27,440	149,822.40	0.28
96	000758	中色股份	32,000	144,000.00	0.27
97	300180	华峰超纤	13,180	142,739.40	0.26
98	300037	新宙邦	5,301	142,013.79	0.26
99	601958	金钼股份	22,604	141,727.08	0.26
100	600881	亚泰集团	37,799	140,990.27	0.26
101	600614	鹏起科技	24,600	140,466.00	0.26
102	002501	利源精制	22,600	140,120.00	0.26
103	002831	裕同科技	2,800	140,000.00	0.26
104	000902	新洋丰	15,100	138,920.00	0.26
105	600165	新日恒力	8,351	137,875.01	0.25
106	300054	鼎龙股份	15,660	136,555.20	0.25
107	002716	金贵银业	8,100	136,404.00	0.25
108	002108	沧州明珠	23,084	135,503.08	0.25
109	600226	瀚叶股份	29,421	134,159.76	0.25
110	002155	湖南黄金	19,601	134,070.84	0.25
111	002250	联化科技	15,000	132,300.00	0.24
112	000584	哈工智能	9,500	131,765.00	0.24
113	603399	吉翔股份	7,600	128,440.00	0.24
114	000012	南玻 A	25,869	128,051.55	0.24
115	002812	创新股份	2,600	127,738.00	0.24
116	000933	神火股份	26,500	127,465.00	0.23
117	603260	合盛硅业	1,800	127,026.00	0.23
118	002233	塔牌集团	11,102	127,006.88	0.23
119	600230	沧州大化	5,700	126,312.00	0.23
120	600206	有研新材	13,800	122,130.00	0.22
121	000426	兴业矿业	16,900	121,849.00	0.22
122	300409	道氏技术	3,001	120,370.11	0.22
123	600529	山东药玻	4,901	119,241.33	0.22
124	600141	兴发集团	10,140	118,131.00	0.22
125	002258	利尔化学	6,100	118,096.00	0.22
126	300699	光威复材	2,600	117,520.00	0.22
127	000612	焦作万方	22,149	116,282.25	0.21
128	002237	恒邦股份	12,700	115,951.00	0.21
129	002240	威华股份	8,800	114,400.00	0.21
130	002254	泰和新材	9,940	113,117.20	0.21
131	002064	华峰氨纶	27,300	112,749.00	0.21
132	002382	蓝帆医疗	5,800	111,940.00	0.21

133	000420	吉林化纤	44,500	111,695.00	0.21
134	000546	金圆股份	8,302	110,997.74	0.20
135	000576	广东甘化	6,201	110,005.74	0.20
136	000910	大亚圣象	6,478	109,478.20	0.20
137	002145	中核钛白	29,616	108,986.88	0.20
138	600966	博汇纸业	24,800	106,888.00	0.20
139	002002	鸿达兴业	22,689	104,596.29	0.19
140	600172	黄河旋风	24,082	104,515.88	0.19
141	002067	景兴纸业	26,300	103,096.00	0.19
142	600259	广晟有色	3,500	102,480.00	0.19
143	000592	平潭发展	35,900	101,956.00	0.19
144	600399	*ST 抚钢	18,500	101,750.00	0.19
145	600366	宁波韵升	16,380	99,918.00	0.18
146	000155	川化股份	17,700	99,297.00	0.18
147	601069	西部黄金	5,900	99,061.00	0.18
148	000877	天山股份	14,601	98,556.75	0.18
149	600668	尖峰集团	8,000	97,600.00	0.18
150	600720	祁连山	14,401	97,062.74	0.18
151	600988	赤峰黄金	19,900	96,913.00	0.18
152	000603	盛达矿业	8,900	96,387.00	0.18
153	002302	西部建设	8,900	95,853.00	0.18
154	002203	海亮股份	11,801	95,588.10	0.18
155	002643	万润股份	12,750	95,242.50	0.18
156	600308	华泰股份	19,100	95,118.00	0.18
157	600210	紫江企业	28,199	95,030.63	0.17
158	002303	美盈森	17,900	94,512.00	0.17
159	601003	柳钢股份	11,900	94,248.00	0.17
160	002428	云南锗业	12,200	94,184.00	0.17
161	000688	建新矿业	7,800	94,146.00	0.17
162	000762	西藏矿业	9,701	93,420.63	0.17
163	600338	西藏珠峰	4,500	93,240.00	0.17
164	000789	万年青	8,501	93,000.94	0.17
165	002010	传化智联	7,600	92,340.00	0.17
166	002043	兔宝宝	12,050	92,303.00	0.17
167	600255	梦舟股份	41,196	92,279.04	0.17
168	600810	神马股份	6,200	92,132.00	0.17
169	600581	八一钢铁	17,800	92,026.00	0.17
170	603188	亚邦股份	9,000	91,800.00	0.17
171	000525	红太阳	5,400	91,530.00	0.17
172	300107	建新股份	6,300	90,468.00	0.17
173	600076	康欣新材	18,700	89,760.00	0.17
174	000969	安泰科技	14,300	89,375.00	0.16
175	002215	诺普信	12,800	89,088.00	0.16
176	600075	新疆天业	13,601	88,406.50	0.16

177	600691	阳煤化工	28,600	87,516.00	0.16
178	600569	安阳钢铁	22,200	87,468.00	0.16
179	600531	豫光金铅	17,700	87,438.00	0.16
180	000822	山东海化	12,500	87,125.00	0.16
181	002683	宏大爆破	9,701	86,532.92	0.16
182	000751	锌业股份	26,301	85,741.26	0.16
183	600331	宏达股份	33,100	85,729.00	0.16
184	000672	上峰水泥	9,503	85,622.03	0.16
185	002206	海利得	17,052	85,089.48	0.16
186	600963	岳阳林纸	16,250	84,175.00	0.15
187	600433	冠豪高新	20,667	84,114.69	0.15
188	000935	四川双马	5,400	83,592.00	0.15
189	601388	怡球资源	32,979	83,107.08	0.15
190	300236	上海新阳	2,700	82,701.00	0.15
191	002669	康达新材	3,900	82,563.00	0.15
192	002318	久立特材	13,702	82,486.04	0.15
193	002443	金洲管道	12,200	82,472.00	0.15
194	000990	诚志股份	5,800	81,200.00	0.15
195	002326	永太科技	11,400	79,230.00	0.15
196	600328	兰太实业	8,800	79,112.00	0.15
197	601677	明泰铝业	7,800	78,312.00	0.14
198	300398	飞凯材料	4,000	78,240.00	0.14
199	002386	天原集团	10,900	77,717.00	0.14
200	601212	白银有色	19,000	77,710.00	0.14
201	600586	金晶科技	23,700	77,499.00	0.14
202	002080	中材科技	9,003	76,525.50	0.14
203	600888	新疆众和	13,560	76,342.80	0.14
204	300224	正海磁材	9,600	75,936.00	0.14
205	002088	鲁阳节能	4,900	74,480.00	0.14
206	600069	银鸽投资	18,800	74,448.00	0.14
207	300429	强力新材	2,540	74,168.00	0.14
208	002391	长青股份	5,800	74,124.00	0.14
209	000881	中广核技	7,400	73,926.00	0.14
210	002256	兆新股份	16,300	73,676.00	0.14
211	300225	金力泰	10,001	72,907.29	0.13
212	002263	*ST 东南	24,500	72,520.00	0.13
213	600456	宝钛股份	5,000	72,500.00	0.13
214	600063	皖维高新	26,900	72,361.00	0.13
215	000731	四川美丰	13,728	72,072.00	0.13
216	002585	双星新材	13,410	71,609.40	0.13
217	002768	国恩股份	2,500	71,525.00	0.13
218	002167	东方锆业	11,500	70,610.00	0.13
219	002132	恒星科技	23,350	70,517.00	0.13
220	002756	永兴特钢	4,040	70,174.80	0.13

221	000973	佛塑科技	18,000	69,840.00	0.13
222	002588	史丹利	13,420	69,515.60	0.13
223	600527	江南高纤	26,850	69,273.00	0.13
224	600458	时代新材	9,380	69,036.80	0.13
225	002171	楚江新材	10,120	68,613.60	0.13
226	600231	凌钢股份	19,310	68,164.30	0.13
227	002522	浙江众成	10,500	67,935.00	0.13
228	600389	江山股份	3,500	66,325.00	0.12
229	600678	四川金顶	6,404	65,576.96	0.12
230	002068	黑猫股份	8,376	65,416.56	0.12
231	000510	金路集团	14,200	64,610.00	0.12
232	300487	蓝晓科技	1,900	64,543.00	0.12
233	603026	石大胜华	2,800	63,952.00	0.12
234	002224	三力士	10,701	63,777.96	0.12
235	002453	华软科技	10,600	62,858.00	0.12
236	000936	华西股份	10,300	62,727.00	0.12
237	002409	雅克科技	3,200	62,400.00	0.11
238	600096	云天化	12,301	61,997.04	0.11
239	000795	英洛华	13,151	61,941.21	0.11
240	600595	中孚实业	22,800	61,788.00	0.11
241	600103	青山纸业	20,602	61,599.98	0.11
242	600558	大西洋	14,575	61,215.00	0.11
243	002225	濮耐股份	12,400	61,132.00	0.11
244	000545	金浦钛业	16,100	60,536.00	0.11
245	300121	阳谷华泰	4,290	60,188.70	0.11
246	600459	贵研铂业	5,560	60,048.00	0.11
247	002521	齐峰新材	9,201	59,990.52	0.11
248	002637	赞宇科技	5,901	59,600.10	0.11
249	000657	中钨高新	5,801	59,112.19	0.11
250	300230	永利股份	11,400	58,710.00	0.11
251	002082	万邦德	4,200	58,674.00	0.11
252	300337	银邦股份	7,600	58,216.00	0.11
253	002361	神剑股份	14,002	57,548.22	0.11
254	000949	新乡化纤	19,500	57,525.00	0.11
255	300021	大禹节水	11,100	57,498.00	0.11
256	002496	辉丰股份	21,060	57,493.80	0.11
257	002226	江南化工	10,600	57,452.00	0.11
258	300221	银禧科技	5,801	57,429.90	0.11
259	002235	安妮股份	8,350	56,529.50	0.10
260	002392	北京利尔	16,600	56,440.00	0.10
261	002538	司尔特	11,700	56,394.00	0.10
262	002398	建研集团	11,101	56,060.05	0.10
263	603601	再升科技	6,300	55,188.00	0.10
264	300041	回天新材	6,002	54,918.30	0.10

265	600126	杭钢股份	9,100	54,327.00	0.10
266	002012	凯恩股份	10,600	54,060.00	0.10
267	002319	乐通股份	3,700	53,909.00	0.10
268	002741	光华科技	3,400	53,652.00	0.10
269	603299	井神股份	6,500	53,625.00	0.10
270	000815	美利云	6,500	53,105.00	0.10
271	002182	云海金属	8,700	52,983.00	0.10
272	002648	卫星石化	4,800	52,944.00	0.10
273	600449	宁夏建材	6,701	52,803.88	0.10
274	603968	醋化股份	2,900	52,287.00	0.10
275	300109	新开源	1,502	52,119.40	0.10
276	002632	道明光学	5,800	52,084.00	0.10
277	600295	鄂尔多斯	5,700	51,243.00	0.09
278	601020	华钰矿业	3,702	51,050.58	0.09
279	600117	西宁特钢	9,700	50,828.00	0.09
280	603225	新凤鸣	2,540	50,723.80	0.09
281	601969	海南矿业	9,175	50,279.00	0.09
282	300737	科顺股份	4,200	50,022.00	0.09
283	300437	清水源	3,000	49,860.00	0.09
284	002379	宏创控股	15,000	49,800.00	0.09
285	600985	雷鸣科化	4,800	49,584.00	0.09
286	002037	久联发展	6,100	49,532.00	0.09
287	002476	宝莫股份	11,400	49,134.00	0.09
288	300196	长海股份	4,800	48,912.00	0.09
289	000698	沈阳化工	11,400	48,792.00	0.09
290	600961	株冶集团	7,300	48,764.00	0.09
291	000708	大冶特钢	5,300	48,389.00	0.09
292	000506	中润资源	15,001	48,303.22	0.09
293	601137	博威合金	5,800	46,864.00	0.09
294	300067	安诺其	8,216	46,749.04	0.09
295	300684	中石科技	600	46,662.00	0.09
296	603599	广信股份	3,200	45,952.00	0.08
297	603612	索通发展	1,600	45,760.00	0.08
298	600311	荣华实业	15,400	45,738.00	0.08
299	300064	豫金刚石	8,401	45,113.37	0.08
300	600618	氯碱化工	5,300	45,103.00	0.08
301	002274	华昌化工	7,400	44,770.00	0.08
302	300080	易成新能	9,100	44,590.00	0.08
303	603067	振华股份	3,620	44,526.00	0.08
304	002631	德尔未来	6,000	44,400.00	0.08
305	002578	闽发铝业	11,500	44,275.00	0.08
306	600802	福建水泥	6,200	43,772.00	0.08
307	600589	广东榕泰	9,900	43,758.00	0.08
308	002246	北化股份	5,102	43,724.14	0.08

309	002749	国光股份	1,120	43,568.00	0.08
310	603010	万盛股份	2,300	43,401.00	0.08
311	002455	百川股份	7,202	43,212.00	0.08
312	002149	西部材料	6,001	42,907.15	0.08
313	000923	河北宣工	3,000	42,510.00	0.08
314	000761	本钢板材	10,500	42,420.00	0.08
315	002378	章源钨业	6,401	42,310.61	0.08
316	000819	岳阳兴长	4,398	41,824.98	0.08
317	603688	石英股份	3,100	41,664.00	0.08
318	002201	九鼎新材	6,161	41,340.31	0.08
319	600727	鲁北化工	5,700	41,154.00	0.08
320	000859	国风塑业	13,800	41,124.00	0.08
321	603639	海利尔	1,540	41,118.00	0.08
322	300320	海达股份	7,700	41,041.00	0.08
323	002539	云图控股	9,390	41,034.30	0.08
324	601996	丰林集团	11,100	40,959.00	0.08
325	000833	贵糖股份	7,700	40,271.00	0.07
326	300328	宜安科技	5,380	40,242.40	0.07
327	002360	同德化工	7,300	39,785.00	0.07
328	002172	澳洋科技	8,300	39,674.00	0.07
329	300325	德威新材	11,600	39,324.00	0.07
330	300135	宝利国际	15,000	39,300.00	0.07
331	002742	三圣股份	4,000	39,240.00	0.07
332	300596	利安隆	1,600	39,200.00	0.07
333	603980	吉华集团	2,400	38,880.00	0.07
334	600367	红星发展	4,700	38,869.00	0.07
335	002584	西陇科学	5,201	38,695.44	0.07
336	300082	奥克股份	7,900	38,552.00	0.07
337	600992	贵绳股份	4,400	38,500.00	0.07
338	002381	双箭股份	6,000	38,220.00	0.07
339	300505	川金诺	1,100	37,510.00	0.07
340	600538	国发股份	6,500	37,505.00	0.07
341	603978	深圳新星	1,100	37,455.00	0.07
342	002734	利民股份	3,302	37,411.66	0.07
343	002057	中钢天源	5,400	36,990.00	0.07
344	000890	法尔胜	7,100	36,920.00	0.07
345	002211	宏达新材	6,003	36,738.36	0.07
346	002114	罗平锌电	4,500	36,450.00	0.07
347	603002	宏昌电子	8,550	36,337.50	0.07
348	000693	*ST 华泽	10,900	36,079.00	0.07
349	600470	六国化工	9,700	35,890.00	0.07
350	002666	德联集团	8,800	35,816.00	0.07
351	603021	山东华鹏	5,120	35,788.80	0.07
352	603227	雪峰科技	9,201	35,699.88	0.07

353	603826	坤彩科技	3,220	35,130.20	0.06
354	000920	南方汇通	5,600	34,552.00	0.06
355	300481	濮阳惠成	2,900	34,307.00	0.06
356	600722	金牛化工	7,900	34,207.00	0.06
357	002803	吉宏股份	1,000	33,880.00	0.06
358	603969	银龙股份	5,470	33,804.60	0.06
359	002753	永东股份	2,325	33,666.00	0.06
360	000635	英力特	3,500	32,445.00	0.06
361	002136	安纳达	3,500	32,305.00	0.06
362	600078	澄星股份	9,300	32,178.00	0.06
363	002783	凯龙股份	3,880	31,932.40	0.06
364	300700	岱勒新材	600	31,860.00	0.06
365	300522	世名科技	1,080	31,568.40	0.06
366	603916	苏博特	2,200	30,734.00	0.06
367	000023	深天地 A	2,300	30,659.00	0.06
368	002842	翔鹭钨业	1,560	30,388.80	0.06
369	603928	兴业股份	1,800	30,024.00	0.06
370	002054	德美化工	5,901	29,977.08	0.06
371	603722	阿科力	600	29,970.00	0.06
372	601968	宝钢包装	7,702	29,729.72	0.05
373	603165	荣晟环保	1,260	29,206.80	0.05
374	002917	金奥博	800	29,192.00	0.05
375	000565	渝三峡 A	6,001	28,504.75	0.05
376	603429	集友股份	1,240	28,135.60	0.05
377	603181	皇马科技	1,400	27,902.00	0.05
378	002109	兴化股份	7,250	27,550.00	0.05
379	000409	*ST 地矿	8,366	27,356.82	0.05
380	300093	金刚玻璃	3,900	26,949.00	0.05
381	002787	华源控股	2,702	26,884.90	0.05
382	603938	三孚股份	1,000	26,870.00	0.05
383	300727	润禾材料	910	26,644.80	0.05
384	603878	武进不锈	1,900	26,201.00	0.05
385	300537	广信材料	1,800	25,974.00	0.05
386	002915	中欣氟材	800	25,560.00	0.05
387	300019	硅宝科技	3,800	25,536.00	0.05
388	002805	丰元股份	1,100	25,520.00	0.05
389	603278	大业股份	1,400	25,340.00	0.05
390	002802	洪汇新材	1,000	25,200.00	0.05
391	603505	金石资源	1,600	25,168.00	0.05
392	603585	苏利股份	1,180	25,110.40	0.05
393	300599	雄塑科技	2,200	24,508.00	0.05
394	603078	江化微	600	24,366.00	0.04
395	603977	国泰集团	2,780	24,325.00	0.04
396	603856	东宏股份	1,690	24,183.90	0.04

397	002243	通产丽星	4,200	23,730.00	0.04
398	002066	瑞泰科技	3,200	23,648.00	0.04
399	300428	四通新材	2,002	23,603.58	0.04
400	002125	湘潭电化	3,200	23,360.00	0.04
401	603823	百合花	1,500	23,355.00	0.04
402	002827	高争民爆	1,600	22,976.00	0.04
403	603683	晶华新材	900	22,923.00	0.04
404	603360	百傲化学	1,200	22,632.00	0.04
405	300641	正丹股份	3,400	21,794.00	0.04
406	603663	三祥新材	1,200	21,504.00	0.04
407	002549	凯美特气	4,340	21,439.60	0.04
408	002809	红墙股份	1,100	21,362.00	0.04
409	002591	恒大高新	2,800	20,748.00	0.04
410	600746	江苏索普	3,600	20,520.00	0.04
411	603822	嘉澳环保	700	20,265.00	0.04
412	002679	福建金森	900	20,169.00	0.04
413	002748	世龙实业	2,200	20,042.00	0.04
414	300575	中旗股份	500	19,540.00	0.04
415	002735	王子新材	600	19,410.00	0.04
416	002799	环球印务	1,050	19,257.00	0.04
417	603378	亚士创能	1,300	19,019.00	0.04
418	002895	川恒股份	900	18,990.00	0.03
419	300610	晨化股份	1,400	17,934.00	0.03
420	603725	天安新材	1,000	17,190.00	0.03
421	002846	英联股份	1,300	16,510.00	0.03
422	000985	大庆华科	1,200	16,284.00	0.03
423	600793	宜宾纸业	1,150	16,261.00	0.03
424	002824	和胜股份	1,250	14,650.00	0.03
425	603086	先达股份	700	14,049.00	0.03
426	002825	纳尔股份	980	14,014.00	0.03
427	002103	广博股份	99	518.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600346	恒力股份	295,030.00	0.46
2	600309	万华化学	227,005.00	0.35
3	002110	三钢闽光	187,874.00	0.29

4	000703	恒逸石化	173,042.00	0.27
5	600230	沧州大化	161,228.00	0.25
6	603260	合盛硅业	123,137.00	0.19
7	000155	川化股份	119,352.00	0.18
8	300699	光威复材	117,742.00	0.18
9	002382	蓝帆医疗	114,707.00	0.18
10	002010	传化智联	109,018.00	0.17
11	000401	冀东水泥	93,840.00	0.14
12	603799	华友钴业	93,654.00	0.14
13	600549	厦门钨业	91,539.00	0.14
14	600069	银鸽投资	87,081.00	0.13
15	002831	裕同科技	82,994.00	0.13
16	600810	神马股份	80,162.00	0.12
17	002470	金正大	80,147.00	0.12
18	002088	鲁阳节能	80,104.00	0.12
19	600389	江山股份	75,770.00	0.12
20	000807	云铝股份	71,782.00	0.11

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	601600	中国铝业	814,343.00	1.26
2	300459	金科文化	149,783.04	0.23
3	002061	浙江交科	100,822.00	0.16
4	600019	宝钢股份	97,029.00	0.15
5	600673	东阳光科	85,300.00	0.13
6	603993	洛阳钼业	82,254.00	0.13
7	600585	海螺水泥	74,358.00	0.11
8	002565	顺灏股份	70,614.00	0.11
9	000782	美达股份	68,156.00	0.11
10	002562	兄弟科技	64,391.20	0.10
11	601899	紫金矿业	60,175.00	0.09
12	603737	三棵树	56,970.00	0.09
13	002297	博云新材	55,398.68	0.09
14	601028	玉龙股份	54,872.00	0.08
15	000677	恒天海龙	50,508.00	0.08
16	002427	*ST 尤夫	49,206.00	0.08

17	000422	*ST 宜化	47,811.00	0.07
18	002838	道恩股份	44,771.00	0.07
19	002535	林州重机	43,589.00	0.07
20	002810	山东赫达	42,714.00	0.07

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	5,897,468.99
卖出股票收入（成交）总额	4,585,869.89

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	576.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	121.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	698.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002450	康得新	820,096.20	1.51	重大事项停牌

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
1,150	60,528.99	41,871,921.00	60.15%	27,736,421.00	39.85%

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	1.44%
2	芜湖歌斐资产管理有限公司—歌斐诺亚家族专享组合 5 号联接基金	512,959.00	0.74%
3	屠建红	500,221.00	0.72%
4	翟春光	500,043.00	0.72%
5	谭惠贞	500,034.00	0.72%
6	何新良	438,029.00	0.63%
7	李国铭	400,015.00	0.57%
8	林晓春	371,206.00	0.53%
9	徐晓红	300,020.00	0.43%
10	苏祖权	297,023.00	0.43%
11	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	41,232,255.00	59.23%

8.3 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	67,608,342.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期末基金份额总额	69,608,342.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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和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形。

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	佣金	占当期佣 金总量的	

			额的比例		比例	
安信证券	1	5,291,688.43	50.70%	3,869.90	50.72%	-
银河证券	2	5,145,799.05	49.30%	3,760.44	49.28%	-
山西证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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	关于广发中证全指原材料交易型开放式指数	《中国证券报》、《证券时	2018-03-22

	证券投资基金修改基金合同的公告	报》、《上海证券报》	
--	-----------------	------------	--

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20180101-20180630	36,210,698.00	15,695,155.00	10,673,598.00	41,232,255.00	59.23%

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，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，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

二〇一八年八月二十四日