

广发品牌消费股票型发起式证券投资基金

2019 年半年度报告摘要

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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

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。

基金托管人招商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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 广发品牌消费股票 |
| 基金主代码 | 004995 |
| 交易代码 | 004995 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 12 月 14 日 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 37,741,745.13 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金重点关注在消费升级过程中消费品行业中优质的、具有一定品牌影响力的上市公司的投资机会，通过自下而上的深度挖掘，精选个股，力争为基金份额持有人获取长期稳健的超额回报。 |
| 投资策略 | 本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指主要消费指数收益率×20%+中证全指可选消费指数收益率×70%+银行活期存款利率（税后）×10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于高风险高收益特征的基金。 |

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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 邱春杨 | 张燕 |
| | 联系电话 | 020-83936666 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | qcy@gffunds.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 95105828 | 95555 |
| 传真 | | 020-89899158 | 0755-83195201 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-------------------------------------------------------------------|
| 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 |
|--|-------------|

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 | 6,065,769.80 |
| 本期利润 | 13,095,204.47 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2903 |
| 本期基金份额净值增长率 | 42.15% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1691 |
| 期末基金资产净值 | 37,992,821.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.0067 |

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 | 2.63% | 1.49% | 1.83% | 1.10% | 0.80% | 0.39% |
| 过去三个月 | 6.38% | 1.82% | -4.31% | 1.54% | 10.69% | 0.28% |
| 过去六个月 | 42.15% | 1.63% | 22.15% | 1.47% | 20.00% | 0.16% |
| 过去一年 | 6.23% | 1.71% | -3.11% | 1.43% | 9.34% | 0.28% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.67% | 1.63% | -12.73% | 1.32% | 13.40% | 0.31% |

注：（1）业绩比较基准：中证全指主要消费指数收益率×20%+中证全指可选消费指数收益率×70%+银行活期存款利率（税后）×10%。

（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发品牌消费股票型发起式证券投资基金
 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
 (2017 年 12 月 14 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 | | |
| 孙迪 | 本基金的基金经理；广发资源优选股票型发起式证券投资基金的基金经理；广发高端制造股票型发起式证券投资基金的基金经理；研究发展部总经理 | 2017-12-14 | - | 10 年 | 孙迪先生，金融学和工程学双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、部门总经理助理、副总经理。 |

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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

2019 年上半年，A 股市场整体表现较好，上证综指、沪深 300、中小板和创业板分别上涨 19.45%、27.07%、20.75% 和 20.87%。各行业板块普涨，但也出现较大分化，在本基金投资范围内的各消费类子行业中，食品饮料一枝独秀，板块上涨了 61%，农林牧渔、家电也表现突出，分别上涨 42% 和 38%，而传媒、纺织服装、汽车等行业表现相对较弱，涨幅不足 10%，跑输市场。本基金的业绩比较基准上涨 21.42%，基金业绩取得了明显的超额收益。

我们认为今年上半年市场的上涨，主要反映了在较为宽松的货币和财政环境下，投资者对于经济快速下滑和中美贸易摩擦等不利因素过度担忧的逐步修复。消费行业的上涨，除了市场的整体因素，更多的反映了行业的高景气度和海内外投资者对于竞争格局好、资产质量高、盈利能力强、业绩稳定增长和现金流充沛这一类型优质资产的偏好。从各行业一季报的情况看，食品饮料、医药、休闲服务等消费行业保持了很高的行业景气度和收入增长，其中白酒、医疗服务、免税等子行业龙头企业业绩持续超预期，大众消费品、零售、白电等行业也保持了稳定的增长。

在上半年，本基金重点配置的食品饮料、家电和医药等消费板块的白马龙头企业取得了明显的

超额收益，阶段性配置的养殖龙头公司在存栏减少、猪价有强烈上涨预期的背景下，也取得了良好的投资回报。我们相信受益于广阔的内需市场和消费升级潜力，行业空间大、竞争优势突出、业绩稳定增长且估值合理的优秀消费品龙头企业中长期仍将继续为投资者带来良好的投资回报。

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 42.15%，同期业绩比较基准收益率为 22.15%。

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，我们预计随着中美贸易摩擦反复、海外经济长放缓、地产投资见顶回落，国内的经济数据将面临较大下滑压力，市场难以复制上半年的大幅上涨，但在货币和财政整体宽松的大环境下，权益资产也无需过于悲观，仍然会有很多结构性机会可以把握。

目前消费行业整体估值尚处于合理区间，基本处于过去十年历史平均或略高水平，整体风险并不大。我们认为随着宏观经济和企业盈利增速中枢的缓慢下行，同时外资和机构投资者这些中长期资金持续流入，盈利的稳定性将被给与更高的溢价，消费行业仍将有明显的比较优势。我们将一方面对持仓品种保持紧密跟踪，另一方面将积极在一些下半年可能景气度触底回升或受益于消费政策刺激的方向寻找投资机会，争取为投资者带来更多的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：广发品牌消费股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 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 | 5,030,278.82 | 5,186,959.42 |
| 结算备付金 | 14,888.80 | 74,343.83 |
| 存出保证金 | 18,607.66 | 25,397.89 |
| 交易性金融资产 | 33,286,281.01 | 30,330,618.36 |
| 其中：股票投资 | 33,286,281.01 | 30,330,618.36 |
| 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 1,096.71 | 1,143.44 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 131,675.32 | 6,518.67 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 38,482,828.32 | 35,624,981.61 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2019 年 6 月 30 日 | 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 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 191.76 | - |
| 应付赎回款 | 346,606.70 | 12,654.28 |
| 应付管理人报酬 | 52,231.04 | 46,395.34 |
| 应付托管费 | 8,705.16 | 7,732.52 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 50,725.39 | 56,547.18 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 31,546.61 | 17,521.51 |
| 负债合计 | 490,006.66 | 140,850.83 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 37,741,745.13 | 50,106,942.18 |
| 未分配利润 | 251,076.53 | -14,622,811.40 |
| 所有者权益合计 | 37,992,821.66 | 35,484,130.78 |

| | | |
|------------|---------------|---------------|
| 负债和所有者权益总计 | 38,482,828.32 | 35,624,981.61 |
|------------|---------------|---------------|

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0067 元，基金份额总额 37,741,745.13 份。

6.2 利润表

会计主体：广发品牌消费股票型发起式证券投资基金

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 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入 | 13,638,960.04 | -4,556,202.07 |
| 1.利息收入 | 17,676.39 | 23,715.01 |
| 其中：存款利息收入 | 17,495.58 | 23,715.01 |
| 债券利息收入 | 180.81 | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 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） | 6,479,976.10 | -5,253,294.03 |
| 其中：股票投资收益 | 6,092,907.66 | -5,774,550.63 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 51,698.31 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 335,370.13 | 521,256.60 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7,029,434.67 | 587,912.63 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 111,872.88 | 85,464.32 |
| 减：二、费用 | 543,755.57 | 826,178.60 |
| 1. 管理人报酬 | 296,466.37 | 411,517.18 |
| 2. 托管费 | 49,411.04 | 68,586.22 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 164,770.54 | 322,098.90 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 税金及附加 | 0.62 | - |
| 7. 其他费用 | 33,107.00 | 23,976.30 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号 | 13,095,204.47 | -5,382,380.67 |

| | | |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 填列) | | |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 13,095,204.47 | -5,382,380.67 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发品牌消费股票型发起式证券投资基金

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） | 50,106,942.18 | -14,622,811.40 | 35,484,130.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 13,095,204.47 | 13,095,204.47 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -12,365,197.05 | 1,778,683.46 | -10,586,513.59 |
| 其中：1. 基金申购款 | 27,773,567.43 | -1,550,021.23 | 26,223,546.20 |
| 2. 基金赎回款 | -40,138,764.48 | 3,328,704.69 | -36,810,059.79 |
| 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） | 37,741,745.13 | 251,076.53 | 37,992,821.66 |
| 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） | 14,480,918.80 | -64,056.24 | 14,416,862.56 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -5,382,380.67 | -5,382,380.67 |
| 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） | 41,078,599.07 | 2,540,657.71 | 43,619,256.78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 58,827,048.03 | 2,109,570.28 | 60,936,618.31 |
| 2. 基金赎回款 | -17,748,448.96 | 431,087.43 | -17,317,361.53 |

| | | | |
|----------------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 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） | 55,559,517.87 | -2,905,779.20 | 52,653,738.67 |

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

广发品牌消费股票型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可〔2017〕1235 号《关于准予广发品牌消费股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发品牌消费股票型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2017 年 12 月 1 日向社会公开发行募集并于 2017 年 12 月 14 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2017 年 12 月 1 日至 2017 年 12 月 8 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 14,480,918.80 元，有效认购户数为 190 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 906.83 元，折合基金份额 906.83 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 关联方关系

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

本基金本报告期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。

6.4.7.2 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 |
|------------|----------------------------|
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构 |
| 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 |
| 广发证券股份有限公司 | 基金管理人母公司、代销机构 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：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 | |
|------------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的 比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 104,876,201.24 | 100.00% | 226,253,138.52 | 100.00% |

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：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 | |
|-------|----------------------------|------|---------------------------------|------|
| | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额 | 占当期债 |

| | | | | |
|------------|--------------|--------------|---|--------------|
| | | 券成交总 额的比例 | | 券成交总 额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 1,032,823.76 | 100.00% | - | - |

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|------------|---------------------------------|----------------|------------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 97,669.42 | 100.00% | 50,725.39 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 210,709.09 | 100.00% | 120,897.55 | 100.00% |

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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 | 296,466.37 | 411,517.18 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 62,585.73 | 98,719.93 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 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 | 49,411.04 | 68,586.22 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 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 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额 | 14,941,993.99 | 10,000,800.08 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 9,882,387.82 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 2,282,045.95 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 12,659,948.04 | 19,883,187.90 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 33.54% | 35.79% |

注：基金管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 | |
|------------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 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 |
| 招商银行股份有限公司 | 5,030,278.82 | 16,712.09 | 4,141,195.09 | 21,785.46 |

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

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

| 6.4.9.1.1 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 | 2019-06-26 | 2019-07-05 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789.00 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |

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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 33,252,411.07 元，属于第二层级的余额为人民币 33,869.94 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 30,330,618.36 元，无属于第二层级和第三层级的金额)。

(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 | 33,286,281.01 | 86.50 |
| | 其中：股票 | 33,286,281.01 | 86.50 |
| 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 | 5,045,167.62 | 13.11 |
| 8 | 其他各项资产 | 151,379.69 | 0.39 |
| 9 | 合计 | 38,482,828.32 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,038,956.00 | 5.37 |
| B | 采矿业 | 27,956.25 | 0.07 |
| C | 制造业 | 25,445,486.42 | 66.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| F | 批发和零售业 | 1,365,077.00 | 3.59 |
| 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 | 19,799.92 | 0.05 |
| J | 金融业 | 1,469,351.94 | 3.87 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,713,781.80 | 4.51 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 1,205,871.68 | 3.17 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 33,286,281.01 | 87.61 |

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前十名股票投资明细

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 | 600519 | 贵州茅台 | 2,895 | 2,848,680.00 | 7.50 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 40,551 | 2,230,305.00 | 5.87 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 16,700 | 1,969,765.00 | 5.18 |
| 4 | 000596 | 古井贡酒 | 16,200 | 1,919,862.00 | 5.05 |
| 5 | 603369 | 今世缘 | 68,600 | 1,913,254.00 | 5.04 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 22,800 | 1,842,924.00 | 4.85 |
| 7 | 000661 | 长春高新 | 5,252 | 1,775,176.00 | 4.67 |
| 8 | 603711 | 香飘飘 | 51,800 | 1,759,646.00 | 4.63 |
| 9 | 601888 | 中国国旅 | 19,332 | 1,713,781.80 | 4.51 |
| 10 | 002557 | 洽洽食品 | 65,063 | 1,642,840.75 | 4.32 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年

度报告正文。

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 | 601601 | 中国太保 | 2,825,245.00 | 7.96 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,663,818.00 | 7.51 |
| 3 | 600438 | 通威股份 | 2,393,063.00 | 6.74 |
| 4 | 600975 | 新五丰 | 2,246,542.00 | 6.33 |
| 5 | 603369 | 今世缘 | 2,221,550.00 | 6.26 |
| 6 | 000596 | 古井贡酒 | 2,189,033.00 | 6.17 |
| 7 | 603711 | 香飘飘 | 1,804,359.00 | 5.08 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 1,725,319.00 | 4.86 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 1,625,425.00 | 4.58 |
| 10 | 601098 | 中南传媒 | 1,571,772.00 | 4.43 |
| 11 | 000625 | 长安汽车 | 1,571,185.05 | 4.43 |
| 12 | 002124 | 天邦股份 | 1,470,653.50 | 4.14 |
| 13 | 601336 | 新华保险 | 1,446,589.00 | 4.08 |
| 14 | 601888 | 中国国旅 | 1,411,911.38 | 3.98 |
| 15 | 000921 | 海信家电 | 1,322,824.00 | 3.73 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 1,203,473.00 | 3.39 |
| 17 | 300144 | 宋城演艺 | 1,173,243.84 | 3.31 |
| 18 | 300498 | 温氏股份 | 1,138,870.00 | 3.21 |
| 19 | 600977 | 中国电影 | 1,102,827.00 | 3.11 |
| 20 | 603444 | 吉比特 | 1,087,255.00 | 3.06 |
| 21 | 600104 | 上汽集团 | 1,058,341.00 | 2.98 |
| 22 | 002157 | 正邦科技 | 1,046,172.00 | 2.95 |
| 23 | 002714 | 牧原股份 | 1,043,184.00 | 2.94 |
| 24 | 601933 | 永辉超市 | 1,025,325.00 | 2.89 |
| 25 | 002661 | 克明面业 | 936,252.00 | 2.64 |
| 26 | 600996 | 贵广网络 | 872,438.00 | 2.46 |
| 27 | 000681 | 视觉中国 | 871,100.00 | 2.45 |
| 28 | 603886 | 元祖股份 | 802,569.00 | 2.26 |
| 29 | 603517 | 绝味食品 | 799,196.00 | 2.25 |
| 30 | 601019 | 山东出版 | 762,650.00 | 2.15 |
| 31 | 002299 | 圣农发展 | 712,872.00 | 2.01 |

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。

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 | 600438 | 通威股份 | 3,837,648.08 | 10.82 |
| 2 | 002157 | 正邦科技 | 3,341,617.20 | 9.42 |
| 3 | 002624 | 完美世界 | 2,823,231.44 | 7.96 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 2,717,374.20 | 7.66 |
| 5 | 300357 | 我武生物 | 2,437,909.85 | 6.87 |
| 6 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,889,669.86 | 5.33 |
| 7 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,847,819.94 | 5.21 |
| 8 | 600872 | 中炬高新 | 1,842,691.53 | 5.19 |
| 9 | 000625 | 长安汽车 | 1,825,832.00 | 5.15 |
| 10 | 600975 | 新五丰 | 1,752,538.00 | 4.94 |
| 11 | 002124 | 天邦股份 | 1,743,343.00 | 4.91 |
| 12 | 601098 | 中南传媒 | 1,627,685.00 | 4.59 |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 1,595,241.36 | 4.50 |
| 14 | 300662 | 科锐国际 | 1,530,507.00 | 4.31 |
| 15 | 601933 | 永辉超市 | 1,458,870.00 | 4.11 |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 1,458,300.00 | 4.11 |
| 17 | 603444 | 吉比特 | 1,366,798.00 | 3.85 |
| 18 | 601888 | 中国国旅 | 1,337,979.29 | 3.77 |
| 19 | 600104 | 上汽集团 | 1,211,707.65 | 3.41 |
| 20 | 002714 | 牧原股份 | 1,177,674.00 | 3.32 |
| 21 | 000921 | 海信家电 | 1,103,556.00 | 3.11 |
| 22 | 600977 | 中国电影 | 1,092,709.00 | 3.08 |
| 23 | 603899 | 晨光文具 | 1,069,027.85 | 3.01 |
| 24 | 600436 | 片仔癀 | 1,068,278.00 | 3.01 |
| 25 | 300498 | 温氏股份 | 998,780.00 | 2.81 |
| 26 | 300413 | 芒果超媒 | 975,655.00 | 2.75 |
| 27 | 000661 | 长春高新 | 957,543.00 | 2.70 |
| 28 | 000860 | 顺鑫农业 | 952,208.00 | 2.68 |
| 29 | 002661 | 克明面业 | 935,674.85 | 2.64 |
| 30 | 603288 | 海天味业 | 878,147.00 | 2.47 |
| 31 | 000681 | 视觉中国 | 832,889.00 | 2.35 |
| 32 | 600996 | 贵广网络 | 822,093.00 | 2.32 |
| 33 | 601019 | 山东出版 | 775,742.00 | 2.19 |
| 34 | 603886 | 元祖股份 | 768,703.00 | 2.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 35 | 002557 | 洽洽食品 | 718,527.15 | 2.02 |
|----|--------|------|------------|------|

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 | 47,626,798.65 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 57,793,478.33 |

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前十名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 | 18,607.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,096.71 |
| 5 | 应收申购款 | 131,675.32 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 151,379.69 |

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 |
| 1,700 | 22,201.03 | 13,210,720.28 | 35.00% | 24,531,024.85 | 65.00% |

8.2 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 | 46,178.03 | 0.1224% |

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 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总 数 | 持有份额占 基金总份额 比例 | 发起份额总 数 | 发起份额占 基金总份额 比例 | 发起份额承 诺持有期限 |
|-------------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 12,659,948.0 4 | 33.54% | 10,000,800.0 8 | 26.50% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 12,659,948.0 4 | 33.54% | 10,000,800.0 8 | 26.50% | 三年 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2017年12月14日）基金份额总额 | 14,480,918.80 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 50,106,942.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 27,773,567.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 40,138,764.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 37,741,745.13 |

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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 广发证券 | 2 | 104,876,201.24 | 100.00% | 97,669.42 | 100.00% | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、交易席位选择标准：

(1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

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

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

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

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 |
| 广发证券 | 1,032,823.76 | 100.00% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |

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 |
| 机构 | 1 | 20190101-20190611 | 15,905,938.49 | - | 15,500,000.00 | 405,938.49 | 1.08% |
| | 2 | 20190101-20190630 | 14,941,993.99 | - | 2,282,045.95 | 12,659,948.04 | 33.54% |
| 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。

广发基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日