

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
2019 年年度报告
2019 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年三月二十七日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	67
§9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末上市基金前十名持有人	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	68
§10 开放式基金份额变动	69
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指工业 ETF
场内简称	工业 ETF
基金主代码	159953
交易代码	159953
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 13 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	27,166,421.00 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	2017-07-14

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工业指数。
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	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,129,850.97	-2,431,582.30	-1,115,984.69
本期利润	3,648,320.57	-10,764,998.34	-2,939,856.56
加权平均基金份额本期利润	0.1262	-0.3266	-0.0249
本期加权平均净值利润率	17.08%	-41.22%	-2.48%
本期基金份额净值增长率	17.88%	-33.44%	-3.60%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-6,619,661.59	-11,169,204.85	-1,338,405.03
期末可供分配基金份额利润	-0.2437	-0.3584	-0.0360
期末基金资产净值	20,546,759.41	19,997,216.15	35,828,015.97
期末基金份额净值	0.7563	0.6416	0.9640
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-24.36%	-35.84%	-3.60%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.42%	0.80%	4.64%	0.82%	-0.22%	-0.02%
过去六个月	1.20%	0.97%	0.82%	0.98%	0.38%	-0.01%
过去一年	17.88%	1.36%	17.27%	1.37%	0.61%	-0.01%
自基金合同生	-24.36%	1.25%	-23.38%	1.27%	-0.98%	-0.02%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：业绩比较基准：中证全指工业指数。

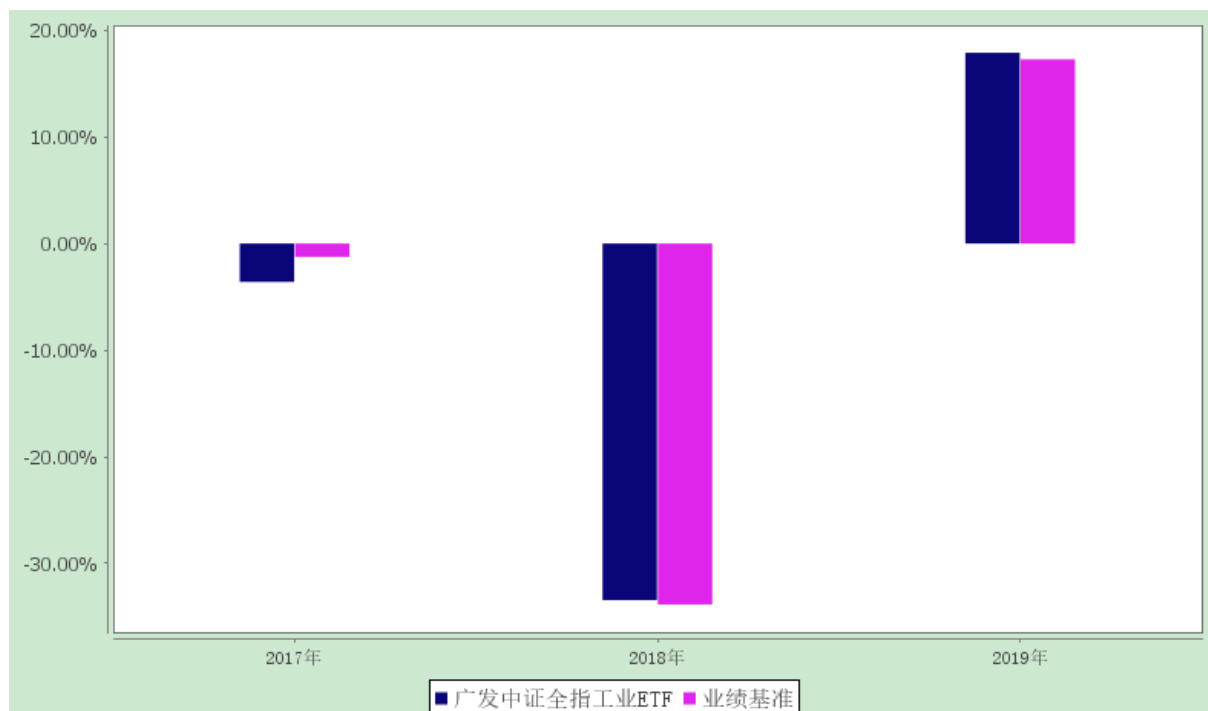
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017 年 6 月 13 日至 2019 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年（2017 年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2017 年 6 月 13 日）至报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 日，公司管理 207 只开放式基金，管理公募基金规模为 5025.61 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	2017-06-13	-	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)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指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

	消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指金融地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发起式联接基金的基金经理；量化投资部副总经理				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)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)。
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度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。

4.3.3 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 5 次，其中 4 次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,1 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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,全年市场表现较好,各大指数均有正的涨幅。上证综指上涨 22.30%,深证成指上涨 44.08%,创业板指上涨 43.79%,中小板指上涨 41.03%,而中证全指工业指数上涨 17.27%。从工业企业基本面的角度看,国家统计局发布的规模以上工业企业利润同比下降 3.3%,但工业销售实现增长,企业效益呈现结构性改善。

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 17.88%,同期业绩比较基准收益率为 17.27%。

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 2020 年,虽然外部政治经济情况复杂多变,但中国经济的内生增长动力并没有改变,预计 2020 年中国经济依然可以平稳增长,并且经济结构将进一步得到改善。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。未来,工业企业效益的结构得到进一步改善,高技术制造业和战略性新兴产业利润保持增长,私营企业和小型企业利润将进一步释放。长期来看,工业是国民经济的支柱,工业的发展代表着国家的未来,高端装备、智能制造、绿色制造将是未来工业的发展方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据法律法规、监管规则的变化和业务发展情况,坚持从保护基金份额持有人利益出发,积极推动主动、全面合规管理,持续完善内控机制,进一步加强内部风险的控制与防范,有效保障了法律法规、监管要求和各项规章制度的落实,保证了基金合同得到严格履行。

本年度主要的监察稽核工作如下:

(1) 认真贯彻落实易会满主席在证券基金行业文化建设动员大会上的讲话精神，积极践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，在公司成立企业文化建设领导小组与企业文化建设工作小组，研究制定工作方案，全力推进公司企业文化建设工作。

(2) 健全公司制度体系，夯实合规内控制度基础，应新发布、修订的法律、法规及监管规定以及新开展的科创板股票交易、商品期货投资等业务需要，及时建立、完善各项管理制度及业务流程，确保所有业务有章可循、依法合规。

(3) 从实用性出发采取多种形式组织开展合规教育和培训，内容涵盖信息披露新规、资管新规、内幕交易、债券违约风险处置及策略应对等法律法规和业务知识，及时传达监管要求和监管精神，切实提升了公司员工合规意识和遵规守法能力。

(4) 健全各业务、产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 按照审慎经营原则，对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 严守合规底线，强化对投资、研究、交易等关键环节实时监控，严格落实公平交易、关联交易、异常交易管控要求，严防内幕交易、利益输送、市场操纵等违法违规行为。

(7) 加强对投资组合日常合规风险监控，大力推进合规、风控系统建设，提升信息化管理水平，实现精细化管理。

(8) 完善信息披露工作机制，优化基金定期报告工作流程。为确保定期报告工作的有序开展，公司全面梳理和优化定期报告信息披露工作流程，进一步提高信息披露工作效率和质量。

(9) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，不断完善发现问题、整改落实、制度流程优化的内部监督与反馈改进机制，主动发现自身管理中的不足，促进相关业务依法、合规开展。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽

核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 12 月 31 日出现了基金资产净值低于五千万的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持

有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”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。

86 审计报告

安永华明（2020）审字第 60873695_G151 号

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

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

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

治理层负责监督广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在

审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2020 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	284,969.47	309,393.89
结算备付金		-	-
存出保证金		324.14	197.66
交易性金融资产	7.4.7.2	20,301,985.50	19,847,315.86
其中：股票投资		20,301,985.50	19,847,315.86
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	52.51	61.90
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		20,587,331.62	20,156,969.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,411.59	8,790.21
应付托管费		1,682.29	1,758.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,978.33	1,704.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	27,500.00	147,500.00
负债合计		40,572.21	159,753.16
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	27,166,421.00	31,166,421.00
未分配利润	7.4.7.10	-6,619,661.59	-11,169,204.85
所有者权益合计		20,546,759.41	19,997,216.15
负债和所有者权益总计		20,587,331.62	20,156,969.31

注: 报告截止日 2019 年 12 月 31 日, 基金份额净值人民币 0.7563 元, 基金份额总额 27,166,421.00 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证全指工业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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		3,904,338.40	-10,359,100.12
1.利息收入		2,757.13	4,273.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,757.13	4,273.65
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,876,590.27	-2,030,227.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,161,944.05	-2,342,741.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	285,353.78	312,514.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,778,171.54	-8,333,416.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	269.59
减：二、费用		256,017.83	405,898.22
1. 管理人报酬		106,598.80	130,637.22

2. 托管费		21,319.73	26,127.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	10,099.30	11,118.62
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	7.4.7.19	118,000.00	238,015.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,648,320.57	-10,764,998.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,648,320.57	-10,764,998.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指工业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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	31,166,421.00	-11,169,204.85	19,997,216.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,648,320.57	3,648,320.57
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）	-4,000,000.00	901,222.69	-3,098,777.31
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-4,000,000.00	901,222.69	-3,098,777.31

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）	27,166,421.00	-6,619,661.59	20,546,759.41
项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	37,166,421.00	-1,338,405.03	35,828,015.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,764,998.34	-10,764,998.34
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）	-6,000,000.00	934,198.52	-5,065,801.48
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-6,000,000.00	934,198.52	-5,065,801.48
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）	31,166,421.00	-11,169,204.85	19,997,216.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发中证全指工业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[2015] 1447 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《广发中证全指工业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 2017 年 6 月 13 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 2017 年 5 月 3 日至 2017 年 6 月 5 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 291,166,421.00 元,有效认购户数为 3,345 户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 20,306.00 元,折合基金份额 291,166,421.00 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 2020 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，

终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交

易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

（6）债券投资收益/（损失）

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。
- 2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；
- 3、本基金的收益分配采取现金分红的方式；
- 4、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

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

格作为买入价计算销售额。

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	284,969.47	309,393.89
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	284,969.47	309,393.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		24,681,101.87	20,301,985.50	-4,379,116.37
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		24,681,101.87	20,301,985.50	-4,379,116.37
项目		上年度末		
		2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		30,004,603.77	19,847,315.86	-10,157,287.91
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		30,004,603.77	19,847,315.86	-10,157,287.91

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	52.41	61.90
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	0.10	-
应收结算备付金利息	-	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	52.51	61.90

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,978.33	1,704.94
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,978.33	1,704.94

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	17,500.00	137,500.00
应付指数使用费	10,000.00	10,000.00
合计	27,500.00	147,500.00

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,166,421.00	31,166,421.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-4,000,000.00	-4,000,000.00
本期末	27,166,421.00	27,166,421.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,818,595.31	-9,350,609.54	-11,169,204.85
本期利润	-2,129,850.97	5,778,171.54	3,648,320.57
本期基金份额交易产生的变动数	304,860.52	596,362.17	901,222.69
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	304,860.52	596,362.17	901,222.69
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-3,643,585.76	-2,976,075.83	-6,619,661.59
-----	---------------	---------------	---------------

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,715.15	3,956.22
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	4.83	239.77
结算备付金利息收入	37.15	77.66
其他	-	-
合计	2,757.13	4,273.65

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,498,539.92	-1,496,531.62
股票投资收益——赎回差价收入	-663,404.13	-846,210.14
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-2,161,944.05	-2,342,741.76

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,788,789.39	4,174,178.64
减：卖出股票成本总额	5,287,329.31	5,670,710.26
买卖股票差价收入	-1,498,539.92	-1,496,531.62

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	3,098,777.31	5,065,801.48
减：现金支付赎回款总额	373,610.31	616,067.48
减：赎回股票成本总额	3,388,571.13	5,295,944.14
赎回差价收入	-663,404.13	-846,210.14

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	285,353.78	312,514.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	285,353.78	312,514.44

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1.交易性金融资产	5,778,171.54	-8,333,416.04
——股票投资	5,778,171.54	-8,333,416.04
——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	5,778,171.54	-8,333,416.04

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	269.59
合计	-	269.59

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	10,099.30	11,118.62
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
合计	10,099.30	11,118.62

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	17,500.00	17,500.00

信息披露费	-	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	500.00	515.00
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	40,000.00	40,000.00
合计	118,000.00	238,015.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人控股子公司的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理（英国）有限公司)	基金管理人全资子公司的全资子公司
广发纳正（上海）资产管理有限公司	基金管理人全资子公司的全资子公司
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	本基金的联接基金

注：根据广发基金管理有限公司于 2019 年 11 月 14 日发布的公告，经股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1948 号文核准，广发基金管理有限公司原股东康美药业股份有限公司将其持有的公司 9.458% 股权转让给广发证券股份有限公司，康美药业股份有限公司不再持有广发基金管理有限公司的股权。广发纳正（上海）资产管理有限公司于 2019 年 11 月 28 日经上海市市场监督管理局批准注销登记。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	3,986,933.77	56.73%	3,518,934.62	46.14%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	3,529.59	61.34%	1,789.50	60.08%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	3,277.33	52.17%	841.15	49.34%

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	106,598.80	130,637.22
其中：支付销售机构的客户维护费	378.47	616.02

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,319.73	26,127.38

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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
广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	12,587,457.00	46.33%	13,276,457.00	42.60%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	284,969.47	2,715.15	309,393.89	3,956.22

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300391	康跃科技	2019-12-30	重大事项停牌	7.27	2020-01-07	8.00	900.00	6,660.00	6,543.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基

金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	284,969.47	-	-	-	284,969.47
存出保证金	324.14	-	-	-	324.14
交易性金融资产	-	-	-	20,301,985.50	20,301,985.50
应收利息	-	-	-	52.51	52.51
资产总计	285,293.61	-	-	20,302,038.01	20,587,331.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,411.59	8,411.59
应付托管费	-	-	-	1,682.29	1,682.29
应付交易费用	-	-	-	2,978.33	2,978.33
其他负债	-	-	-	27,500.00	27,500.00
负债总计	-	-	-	40,572.21	40,572.21
利率敏感度缺口	285,293.61	-	-	20,261,465.80	20,546,759.41
上年度末					
2018 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
日					
资产					
银行存款	309,393.89	-	-	-	309,393.89
存出保证金	197.66	-	-	-	197.66
交易性金融资产	-	-	-	19,847,315.86	19,847,315.86
应收利息	-	-	-	61.90	61.90
资产总计	309,591.55	-	-	19,847,377.76	20,156,969.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,790.21	8,790.21
应付托管费	-	-	-	1,758.01	1,758.01
应付交易费用	-	-	-	1,704.94	1,704.94
其他负债	-	-	-	147,500.00	147,500.00
负债总计	-	-	-	159,753.16	159,753.16
利率敏感度缺口	309,591.55	-	-	19,687,624.60	19,997,216.15

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	20,301,985.50	98.81	19,847,315.86	99.25
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	20,301,985.50	98.81	19,847,315.86	99.25

7.4.13.4.3.2 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	1,093,967.04	869,878.90
	业绩比较基准下降 5%	-1,093,967.04	-869,878.90

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 20,295,442.50 元，属于第二层级的余额为人民币 6,543.00 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 19,747,379.86 元，属于第二层级的余额为人民币 99,936.00 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	20,301,985.50	98.61

	其中：股票	20,301,985.50	98.61
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	284,969.47	1.38
8	其他各项资产	376.65	0.00
9	合计	20,587,331.62	100.00

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

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,024.00	0.04
B	采矿业	48,741.90	0.24
C	制造业	11,545,820.56	56.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,243.22	0.32
E	建筑业	2,684,450.12	13.07
F	批发和零售业	623,840.42	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,359,253.20	16.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	288,934.00	1.41
J	金融业	34,343.82	0.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	450,111.85	2.19

M	科学研究和技术服务业	406,827.55	1.98
N	水利、环境和公共设施管理业	556,775.26	2.71
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	24,054.00	0.12
S	综合	204,565.60	1.00
	合计	20,301,985.50	98.81

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	104,900	589,538.00	2.87
2	300750	宁德时代	5,500	585,200.00	2.85
3	600031	三一重工	29,500	502,975.00	2.45
4	000338	潍柴动力	23,900	379,532.00	1.85
5	600009	上海机场	4,800	378,000.00	1.84
6	601766	中国中车	48,600	347,004.00	1.69
7	601012	隆基股份	13,214	328,103.62	1.60
8	601006	大秦铁路	29,700	243,837.00	1.19
9	600406	国电南瑞	11,500	243,570.00	1.19
10	601989	中国重工	45,700	239,468.00	1.17
11	601186	中国铁建	23,000	233,220.00	1.14
12	601390	中国中铁	35,400	210,276.00	1.02
13	601669	中国电建	38,200	165,788.00	0.81
14	002202	金风科技	13,748	164,288.60	0.80
15	000157	中联重科	24,500	163,660.00	0.80
16	002352	顺丰控股	4,400	163,636.00	0.80
17	300124	汇川技术	5,200	159,328.00	0.78
18	601111	中国国航	14,500	140,505.00	0.68
19	600029	南方航空	18,800	134,984.00	0.66
20	600018	上港集团	23,200	133,864.00	0.65
21	601877	正泰电器	4,800	128,640.00	0.63

22	000425	徐工机械	23,500	128,545.00	0.63
23	600115	东方航空	21,500	124,915.00	0.61
24	600089	特变电工	18,600	123,690.00	0.60
25	300014	亿纬锂能	2,400	120,384.00	0.59
26	002050	三花智控	6,920	119,923.60	0.58
27	300450	先导智能	2,596	116,664.24	0.57
28	000768	中航飞机	6,900	113,022.00	0.55
29	002120	韵达股份	3,370	112,221.00	0.55
30	601800	中国交建	11,700	107,172.00	0.52
31	300207	欣旺达	5,400	105,408.00	0.51
32	601919	中远海控	19,300	101,711.00	0.50
33	601618	中国中冶	35,700	99,960.00	0.49
34	601872	招商轮船	12,100	99,946.00	0.49
35	600221	海航控股	57,500	99,475.00	0.48
36	002129	中环股份	8,400	99,204.00	0.48
37	300012	华测检测	6,600	98,406.00	0.48
38	600893	航发动力	4,500	97,560.00	0.47
39	002127	南极电商	8,600	93,826.00	0.46
40	600739	辽宁成大	6,100	92,903.00	0.45
41	600068	葛洲坝	13,800	92,184.00	0.45
42	601727	上海电气	18,300	91,134.00	0.44
43	600004	白云机场	5,165	90,129.25	0.44
44	603899	晨光文具	1,800	87,732.00	0.43
45	002506	协鑫集成	13,600	80,376.00	0.39
46	000009	中国宝安	12,840	79,479.60	0.39
47	601021	春秋航空	1,800	79,002.00	0.38
48	600170	上海建工	22,200	78,588.00	0.38
49	300024	机器人	5,500	77,000.00	0.37
50	600885	宏发股份	2,220	76,479.00	0.37
51	601018	宁波港	19,700	74,860.00	0.36
52	600150	中国船舶	3,400	73,984.00	0.36
53	300070	碧水源	9,500	72,200.00	0.35
54	600038	中直股份	1,500	71,565.00	0.35
55	002081	金螳螂	8,000	70,560.00	0.34
56	601117	中国化学	10,900	70,196.00	0.34
57	600760	中航沈飞	2,100	66,360.00	0.32
58	600704	物产中大	12,600	66,150.00	0.32
59	600482	中国动力	3,300	66,000.00	0.32
60	601100	恒立液压	1,320	65,670.00	0.32
61	600879	航天电子	10,900	65,182.00	0.32
62	600118	中国卫星	3,000	64,110.00	0.31
63	600153	建发股份	7,100	63,829.00	0.31
64	600528	中铁工业	5,500	63,250.00	0.31
65	002013	中航机电	9,000	62,460.00	0.30

66	603659	璞泰来	700	59,605.00	0.29
67	002074	国轩高科	3,990	58,054.50	0.28
68	000547	航天发展	5,600	57,232.00	0.28
69	600820	隧道股份	9,400	56,776.00	0.28
70	002212	南洋股份	2,900	55,129.00	0.27
71	300274	阳光电源	5,100	53,703.00	0.26
72	601333	广深铁路	17,300	52,938.00	0.26
73	600884	杉杉股份	3,900	52,689.00	0.26
74	600415	小商品城	13,600	52,632.00	0.26
75	000039	中集集团	5,340	52,438.80	0.26
76	601866	中远海发	19,800	51,282.00	0.25
77	300316	晶盛机电	3,240	50,932.80	0.25
78	600875	东方电气	5,500	50,545.00	0.25
79	000089	深圳机场	5,100	49,827.00	0.24
80	002191	劲嘉股份	4,300	49,063.00	0.24
81	300001	特锐德	2,800	48,104.00	0.23
82	600755	厦门国贸	6,400	46,976.00	0.23
83	300073	当升科技	1,700	46,410.00	0.23
84	603338	浙江鼎力	644	46,046.00	0.22
85	300457	赢合科技	1,350	45,832.50	0.22
86	600967	内蒙一机	4,200	44,646.00	0.22
87	600580	卧龙电驱	3,700	44,474.00	0.22
88	603885	吉祥航空	2,900	43,500.00	0.21
89	600026	中远海能	6,800	43,384.00	0.21
90	600435	北方导航	5,200	43,264.00	0.21
91	002372	伟星新材	3,124	41,143.08	0.20
92	600323	瀚蓝环境	2,300	40,342.00	0.20
93	603806	福斯特	827	40,192.20	0.20
94	601106	中国一重	13,700	39,867.00	0.19
95	300118	东方日升	2,800	38,780.00	0.19
96	601000	唐山港	14,830	38,558.00	0.19
97	002595	豪迈科技	2,000	37,800.00	0.18
98	601179	中国西电	10,200	37,128.00	0.18
99	600372	中航电子	2,600	37,024.00	0.18
100	600970	中材国际	5,200	36,244.00	0.18
101	600388	龙净环保	3,700	36,075.00	0.18
102	000528	柳工	5,190	36,018.60	0.18
103	600320	振华重工	9,920	36,009.60	0.18
104	600711	盛屯矿业	6,800	35,972.00	0.18
105	002028	思源电气	2,600	35,802.00	0.17
106	601228	广州港	9,300	35,619.00	0.17
107	600233	圆通速递	2,800	35,420.00	0.17
108	000415	渤海租赁	9,300	35,340.00	0.17
109	000738	航发控制	2,700	35,289.00	0.17

110	000008	神州高铁	9,700	35,211.00	0.17
111	300474	景嘉微	600	35,148.00	0.17
112	002023	海特高新	2,900	34,945.00	0.17
113	000090	天健集团	6,518	34,545.40	0.17
114	002025	航天电器	1,300	34,541.00	0.17
115	600120	浙江东方	3,934	34,343.82	0.17
116	600039	四川路桥	10,100	33,936.00	0.17
117	601717	郑煤机	5,200	33,644.00	0.16
118	002310	东方园林	6,700	33,634.00	0.16
119	600491	龙元建设	4,600	33,626.00	0.16
120	601598	中国外运	7,874	33,543.24	0.16
121	000826	启迪环境	3,600	33,048.00	0.16
122	600648	外高桥	1,900	33,003.00	0.16
123	002056	横店东磁	4,000	32,800.00	0.16
124	002266	浙富控股	7,900	32,548.00	0.16
125	300068	南都电源	3,000	32,340.00	0.16
126	601608	中信重工	8,671	32,256.12	0.16
127	002665	首航高科	9,600	32,256.00	0.16
128	601880	大连港	15,500	31,465.00	0.15
129	000400	许继电气	2,900	31,233.00	0.15
130	002183	怡亚通	7,400	31,154.00	0.15
131	600717	天津港	4,960	31,148.80	0.15
132	600862	中航高科	2,800	30,856.00	0.15
133	000035	中国天楹	5,000	30,850.00	0.15
134	600525	长园集团	5,200	30,836.00	0.15
135	600093	易见股份	2,200	30,712.00	0.15
136	300724	捷佳伟创	800	30,312.00	0.15
137	600072	中船科技	2,200	29,436.00	0.14
138	002413	雷科防务	5,400	29,376.00	0.14
139	000951	中国重汽	1,300	29,250.00	0.14
139	002468	申通快递	1,500	29,250.00	0.14
140	002276	万马股份	3,500	29,085.00	0.14
141	000967	盈峰环境	4,700	28,999.00	0.14
142	002444	巨星科技	2,700	28,998.00	0.14
143	002610	爱康科技	17,900	28,819.00	0.14
144	600545	卓郎智能	4,700	28,529.00	0.14
145	601975	招商南油	10,000	28,100.00	0.14
146	600377	宁沪高速	2,500	28,050.00	0.14
147	600517	置信电气	3,400	28,016.00	0.14
148	600984	建设机械	2,710	27,994.30	0.14
149	300284	苏交科	3,424	27,974.08	0.14
150	600546	山煤国际	4,000	27,920.00	0.14
151	002531	天顺风能	4,400	27,808.00	0.14
152	601611	中国核建	3,900	27,807.00	0.14

153	002389	航天彩虹	2,500	27,750.00	0.14
154	000697	炼石航空	2,600	27,560.00	0.13
155	600316	洪都航空	2,100	27,363.00	0.13
156	600499	科达洁能	6,300	27,279.00	0.13
157	600869	智慧能源	5,500	26,950.00	0.13
158	600125	铁龙物流	4,500	26,910.00	0.13
159	002733	雄韬股份	1,000	26,880.00	0.13
160	002091	江苏国泰	3,900	26,793.00	0.13
161	600017	日照港	9,200	26,772.00	0.13
162	300203	聚光科技	1,600	26,736.00	0.13
163	600110	诺德股份	5,700	26,676.00	0.13
164	000519	中兵红箭	3,500	26,670.00	0.13
165	600765	中航重机	2,600	26,598.00	0.13
166	600835	上海机电	1,600	26,512.00	0.13
167	600312	平高电气	4,100	26,486.00	0.13
168	600582	天地科技	8,300	26,477.00	0.13
169	601567	三星医疗	3,500	25,900.00	0.13
170	601222	林洋能源	5,300	25,758.00	0.13
171	002430	杭氧股份	1,900	25,574.00	0.12
172	002249	大洋电机	6,600	25,476.00	0.12
173	002168	惠程科技	3,100	25,420.00	0.12
174	002851	麦格米特	1,225	25,382.00	0.12
175	002097	山河智能	4,300	25,284.00	0.12
176	002192	融捷股份	1,000	25,140.00	0.12
177	600761	安徽合力	2,580	25,103.40	0.12
178	601200	上海环境	2,260	25,086.00	0.12
179	600478	科力远	5,700	25,080.00	0.12
180	600317	营口港	9,700	24,735.00	0.12
181	000976	华铁股份	4,800	24,672.00	0.12
182	001965	招商公路	2,800	24,556.00	0.12
183	000049	德赛电池	600	24,444.00	0.12
184	002051	中工国际	2,500	24,300.00	0.12
185	600284	浦东建设	3,800	24,130.00	0.12
186	600269	赣粤高速	5,800	23,954.00	0.12
187	600151	航天机电	5,000	23,700.00	0.12
188	002117	东港股份	1,900	23,655.00	0.12
189	600783	鲁信创投	1,500	23,610.00	0.11
190	600685	中船防务	1,600	23,600.00	0.11
191	002611	东方精工	5,540	23,545.00	0.11
192	300159	新研股份	6,000	23,520.00	0.11
193	300185	通裕重工	13,100	23,449.00	0.11
194	600846	同济科技	2,500	23,275.00	0.11
195	000900	现代投资	5,300	23,108.00	0.11
196	002047	宝鹰股份	4,000	23,080.00	0.11

197	600787	中储股份	4,400	22,924.00	0.11
198	002706	良信电器	2,700	22,680.00	0.11
199	300055	万邦达	3,400	22,678.00	0.11
200	601326	秦港股份	7,100	22,649.00	0.11
201	601369	陕鼓动力	3,400	22,610.00	0.11
202	000062	深圳华强	1,585	22,570.40	0.11
203	002176	江特电机	6,000	22,560.00	0.11
204	600057	厦门象屿	5,399	22,405.85	0.11
205	000582	北部湾港	2,500	22,375.00	0.11
206	600611	大众交通	5,500	22,330.00	0.11
207	600990	四创电子	500	22,290.00	0.11
208	300145	中金环境	6,380	22,138.60	0.11
209	603638	艾迪精密	724	22,053.04	0.11
210	300664	鹏鹞环保	1,700	22,032.00	0.11
211	002073	软控股份	4,700	21,996.00	0.11
212	603606	东方电缆	2,000	21,960.00	0.11
213	002301	齐心集团	1,800	21,888.00	0.11
214	002479	富春环保	3,100	21,731.00	0.11
215	600592	龙溪股份	1,400	21,686.00	0.11
216	300470	中密控股	800	21,616.00	0.11
217	002698	博实股份	2,050	21,566.00	0.10
218	601828	美凯龙	1,900	21,527.00	0.10
219	000429	粤高速 A	2,600	21,476.00	0.10
220	300438	鹏辉能源	800	21,440.00	0.10
221	300197	铁汉生态	7,000	21,420.00	0.10
222	000088	盐田港	3,800	21,394.00	0.10
223	300177	中海达	2,400	21,312.00	0.10
224	002639	雪人股份	2,500	21,300.00	0.10
225	002130	沃尔核材	4,300	21,242.00	0.10
226	603568	伟明环保	924	21,196.56	0.10
227	300568	星源材质	700	21,147.00	0.10
228	600114	东睦股份	2,460	21,106.80	0.10
229	002717	岭南股份	4,490	21,103.00	0.10
230	300376	易事特	4,600	21,068.00	0.10
231	002169	智光电气	3,100	21,018.00	0.10
232	600169	太原重工	9,000	20,970.00	0.10
233	002375	亚厦股份	3,600	20,880.00	0.10
234	600502	安徽建工	5,120	20,787.20	0.10
235	300397	天和防务	700	20,657.00	0.10
236	002573	清新环境	3,200	20,640.00	0.10
237	300222	科大智能	2,200	20,526.00	0.10
238	600496	精工钢构	7,100	20,519.00	0.10
239	002850	科达利	450	20,475.00	0.10
240	300527	中国应急	1,838	20,107.72	0.10

241	600575	淮河能源	7,800	20,046.00	0.10
242	601700	风范股份	3,100	20,026.00	0.10
243	002498	汉缆股份	6,600	19,866.00	0.10
244	002822	中装建设	2,000	19,780.00	0.10
245	002364	中恒电气	1,700	19,669.00	0.10
246	000682	东方电子	3,900	19,656.00	0.10
247	000507	珠海港	3,200	19,648.00	0.10
248	603012	创力集团	2,200	19,624.00	0.10
249	300045	华力创通	2,102	19,590.64	0.10
250	000652	泰达股份	5,200	19,552.00	0.10
251	600175	美都能源	10,700	19,474.00	0.09
252	600200	江苏吴中	3,600	19,368.00	0.09
253	600020	中原高速	4,400	19,360.00	0.09
254	603018	中设集团	1,868	19,221.72	0.09
255	300034	钢研高纳	1,200	19,164.00	0.09
256	002747	埃斯顿	1,700	19,142.00	0.09
257	300355	蒙草生态	5,600	19,096.00	0.09
258	002367	康力电梯	2,400	19,080.00	0.09
259	002320	海峡股份	1,485	19,008.00	0.09
260	000061	农产品	3,400	19,006.00	0.09
261	603588	高能环境	2,000	19,000.00	0.09
262	603128	华贸物流	3,000	18,930.00	0.09
263	002545	东方铁塔	2,500	18,875.00	0.09
264	002358	森源电气	2,700	18,873.00	0.09
265	300510	金冠股份	2,686	18,802.00	0.09
266	300125	易世达	1,100	18,711.00	0.09
267	603686	龙马环卫	1,700	18,564.00	0.09
268	300257	开山股份	1,700	18,496.00	0.09
269	300477	合纵科技	2,488	18,411.20	0.09
270	002791	坚朗五金	600	18,294.00	0.09
271	600577	精达股份	6,700	18,291.00	0.09
272	600477	杭萧钢构	6,476	18,262.32	0.09
273	000777	中核科技	1,500	18,255.00	0.09
274	000680	山推股份	5,000	18,250.00	0.09
275	300101	振芯科技	2,000	18,220.00	0.09
276	002663	普邦股份	6,200	18,104.00	0.09
277	002366	台海核电	2,600	18,096.00	0.09
278	603308	应流股份	1,200	18,012.00	0.09
279	002672	东江环保	2,000	18,000.00	0.09
280	002431	棕榈股份	5,900	17,995.00	0.09
281	600512	腾达建设	6,400	17,984.00	0.09
282	600217	中再资环	3,500	17,920.00	0.09
283	002617	露笑科技	3,300	17,886.00	0.09
284	603583	捷昌驱动	400	17,812.00	0.09

285	002163	中航三鑫	3,200	17,760.00	0.09
286	601890	亚星锚链	3,100	17,732.00	0.09
287	300266	兴源环境	5,050	17,725.50	0.09
288	300198	纳川股份	4,100	17,712.00	0.09
289	002552	宝鼎科技	700	17,647.00	0.09
290	600495	晋西车轴	4,200	17,640.00	0.09
291	300123	亚光科技	2,320	17,608.80	0.09
292	002341	新纶科技	3,100	17,608.00	0.09
293	600428	中远海特	4,700	17,578.00	0.09
294	600790	轻纺城	5,140	17,476.00	0.09
295	600620	天宸股份	2,700	17,469.00	0.09
296	002523	天桥起重	5,676	17,425.32	0.08
297	002298	中电兴发	2,300	17,388.00	0.08
298	600343	航天动力	1,900	17,385.00	0.08
299	300035	中科电气	2,200	17,314.00	0.08
300	000828	东莞控股	2,100	17,304.00	0.08
301	601615	明阳智能	1,400	17,220.00	0.08
302	002111	威海广泰	1,100	17,204.00	0.08
303	000520	长航凤凰	4,000	16,880.00	0.08
304	600058	五矿发展	2,100	16,842.00	0.08
305	000903	云内动力	6,600	16,830.00	0.08
306	601886	江河集团	2,300	16,698.00	0.08
307	600350	山东高速	3,400	16,694.00	0.08
308	300607	拓斯达	348	16,634.40	0.08
309	300495	美尚生态	1,500	16,620.00	0.08
310	600391	航发科技	1,200	16,572.00	0.08
311	601298	青岛港	2,400	16,488.00	0.08
312	600981	汇鸿集团	4,400	16,368.00	0.08
313	002135	东南网架	3,000	16,350.00	0.08
314	600973	宝胜股份	4,300	16,340.00	0.08
315	603556	海兴电力	1,000	16,300.00	0.08
316	603690	至纯科技	500	16,295.00	0.08
317	600548	深高速	1,400	16,100.00	0.08
318	600794	保税科技	4,200	16,044.00	0.08
319	002309	中利集团	2,600	15,990.00	0.08
320	601330	绿色动力	1,500	15,945.00	0.08
321	002061	浙江交科	2,700	15,849.00	0.08
322	600874	创业环保	2,200	15,818.00	0.08
323	002307	北新路桥	2,680	15,812.00	0.08
324	300726	宏达电子	600	15,792.00	0.08
325	600894	广日股份	2,100	15,771.00	0.08
326	300013	新宁物流	1,700	15,640.00	0.08
327	002526	山东矿机	6,898	15,589.48	0.08
328	603056	德邦股份	1,400	15,554.00	0.08

329	600133	东湖高新	2,900	15,544.00	0.08
330	300091	金通灵	3,770	15,532.40	0.08
331	300190	维尔利	2,260	15,526.20	0.08
332	000099	中信海直	2,100	15,519.00	0.08
333	002339	积成电子	2,400	15,456.00	0.08
334	000687	华讯方舟	2,300	15,433.00	0.08
335	002918	蒙娜丽莎	765	15,315.30	0.07
336	603111	康尼机电	2,900	15,312.00	0.07
337	300215	电科院	2,300	15,249.00	0.07
338	002928	华夏航空	1,250	15,225.00	0.07
339	600805	悦达投资	3,000	15,210.00	0.07
340	600880	博瑞传播	3,800	15,162.00	0.07
341	603167	渤海轮渡	1,400	15,106.00	0.07
342	002564	天沃科技	3,300	15,081.00	0.07
343	000928	中钢国际	3,100	15,035.00	0.07
344	601908	京运通	5,000	15,000.00	0.07
345	600626	申达股份	2,500	14,950.00	0.07
346	002482	广田集团	3,400	14,892.00	0.07
347	002090	金智科技	1,400	14,854.00	0.07
348	600677	航天通信	1,700	14,824.00	0.07
349	600106	重庆路桥	4,739	14,738.29	0.07
350	000811	冰轮环境	2,100	14,721.00	0.07
351	002818	富森美	1,160	14,674.00	0.07
352	600590	泰豪科技	2,520	14,666.40	0.07
353	002459	晶澳科技	1,300	14,534.00	0.07
353	600218	全柴动力	1,300	14,534.00	0.07
354	300388	国祯环保	1,380	14,531.40	0.07
355	600662	强生控股	3,200	14,528.00	0.07
356	002796	世嘉科技	400	14,400.00	0.07
357	300384	三联虹普	800	14,320.00	0.07
358	002541	鸿路钢构	1,350	14,296.50	0.07
359	300751	迈为股份	100	14,145.00	0.07
360	601002	晋亿实业	2,400	14,112.00	0.07
361	002245	澳洋顺昌	3,400	13,906.00	0.07
362	600710	苏美达	2,500	13,875.00	0.07
363	300441	鲍斯股份	1,420	13,830.80	0.07
364	603337	杰克股份	658	13,791.68	0.07
365	002438	江苏神通	1,700	13,753.00	0.07
366	300506	名家汇	1,600	13,712.00	0.07
367	300263	隆华科技	2,500	13,675.00	0.07
368	300208	青岛中程	1,900	13,642.00	0.07
369	300129	泰胜风能	2,800	13,608.00	0.07
369	600184	光电股份	1,200	13,608.00	0.07
370	300193	佳士科技	1,500	13,590.00	0.07

371	002685	华东重机	2,000	13,560.00	0.07
372	600855	航天长峰	1,100	13,519.00	0.07
373	002930	宏川智慧	900	13,518.00	0.07
374	002344	海宁皮城	3,100	13,516.00	0.07
375	300420	五洋停车	2,460	13,505.40	0.07
376	300423	鲁亿通	1,020	13,504.80	0.07
377	601515	东风股份	2,000	13,500.00	0.07
378	601107	四川成渝	3,200	13,472.00	0.07
379	002542	中化岩土	3,600	13,464.00	0.07
380	000065	北方国际	1,550	13,407.50	0.07
381	600897	厦门空港	600	13,404.00	0.07
382	603300	华铁应急	1,720	13,381.60	0.07
383	601126	四方股份	2,400	13,296.00	0.06
384	600481	双良节能	4,000	13,280.00	0.06
385	600405	动力源	2,800	13,244.00	0.06
386	000584	哈工智能	2,100	13,167.00	0.06
387	300111	向日葵	5,600	13,104.00	0.06
388	002011	盾安环境	2,700	13,095.00	0.06
389	000055	方大集团	2,700	13,041.00	0.06
390	000005	世纪星源	4,200	12,978.00	0.06
391	600836	界龙实业	2,600	12,922.00	0.06
392	300400	劲拓股份	900	12,915.00	0.06
393	600382	广东明珠	1,840	12,861.60	0.06
394	002325	洪涛股份	4,000	12,840.00	0.06
395	002518	科士达	1,200	12,804.00	0.06
396	603979	金诚信	1,430	12,769.90	0.06
397	600537	亿晶光电	4,100	12,751.00	0.06
398	600368	五洲交通	2,820	12,746.40	0.06
399	002060	粤水电	4,200	12,726.00	0.06
400	300276	三丰智能	1,600	12,720.00	0.06
401	300662	科锐国际	400	12,716.00	0.06
402	300201	海伦哲	3,100	12,679.00	0.06
403	300427	红相股份	900	12,672.00	0.06
404	000925	众合科技	1,880	12,596.00	0.06
405	002751	易尚展示	500	12,580.00	0.06
406	300422	博世科	1,200	12,552.00	0.06
407	600826	兰生股份	1,100	12,529.00	0.06
408	002334	英威腾	2,900	12,528.00	0.06
409	002556	辉隆股份	2,200	12,496.00	0.06
410	600798	宁波海运	3,500	12,460.00	0.06
411	603359	东珠生态	820	12,291.80	0.06
412	603169	兰石重装	2,100	12,264.00	0.06
413	002204	大连重工	3,800	12,198.00	0.06
414	300228	富瑞特装	2,400	12,192.00	0.06

415	600375	华菱星马	2,600	12,168.00	0.06
416	603063	禾望电气	1,300	12,142.00	0.06
417	603060	国检集团	500	12,140.00	0.06
418	600784	鲁银投资	2,300	12,052.00	0.06
419	601606	长城军工	1,100	12,034.00	0.06
420	002559	亚威股份	2,100	11,949.00	0.06
421	603458	勘设股份	625	11,931.25	0.06
422	002833	弘亚数控	300	11,931.00	0.06
423	000544	中原环保	1,900	11,894.00	0.06
424	002034	旺能环境	800	11,848.00	0.06
425	002738	中矿资源	700	11,802.00	0.06
426	000906	浙商中拓	2,000	11,780.00	0.06
427	300415	伊之密	1,200	11,772.00	0.06
428	002622	融钰集团	3,400	11,662.00	0.06
429	603298	杭叉集团	900	11,592.00	0.06
430	603357	设计总院	1,100	11,572.00	0.06
431	603611	诺力股份	700	11,564.00	0.06
432	002121	科陆电子	2,700	11,556.00	0.06
433	000922	佳电股份	1,500	11,550.00	0.06
434	002935	天奥电子	400	11,440.00	0.06
435	603218	日月股份	550	11,423.50	0.06
436	002335	科华恒盛	700	11,389.00	0.06
436	300769	德方纳米	100	11,389.00	0.06
437	600292	远达环保	2,000	11,340.00	0.06
438	002229	鸿博股份	1,700	11,322.00	0.06
439	300237	美晨生态	4,320	11,275.20	0.05
440	600035	楚天高速	3,300	11,253.00	0.05
441	000498	山东路桥	2,400	11,232.00	0.05
442	002630	华西能源	4,680	11,185.20	0.05
443	300151	昌红科技	1,300	11,128.00	0.05
444	002218	拓日新能	3,700	11,100.00	0.05
445	600550	保变电气	3,600	11,088.00	0.05
446	300173	智慧松德	1,500	11,070.00	0.05
447	000058	深赛格	1,500	11,025.00	0.05
448	600190	锦州港	3,600	11,016.00	0.05
449	000885	城发环境	1,000	10,990.00	0.05
450	300195	长荣股份	1,500	10,950.00	0.05
451	300004	南风股份	1,600	10,944.00	0.05
452	600278	东方创业	1,030	10,928.30	0.05
453	002527	新时达	2,100	10,920.00	0.05
454	002255	海陆重工	3,400	10,846.00	0.05
455	002628	成都路桥	2,300	10,810.00	0.05
456	002009	天奇股份	1,400	10,710.00	0.05
457	002342	巨力索具	3,400	10,676.00	0.05

458	601616	广电电气	3,500	10,675.00	0.05
459	601789	宁波建工	2,800	10,668.00	0.05
460	603901	永创智能	1,000	10,640.00	0.05
461	002451	摩恩电气	1,100	10,637.00	0.05
462	600180	瑞茂通	1,500	10,470.00	0.05
463	601008	连云港	2,700	10,449.00	0.05
464	600468	百利电气	2,820	10,434.00	0.05
465	002441	众业达	1,400	10,430.00	0.05
466	000821	京山轻机	1,600	10,384.00	0.05
467	000632	三木集团	1,600	10,352.00	0.05
468	002471	中超控股	4,400	10,340.00	0.05
469	603960	克来机电	320	10,310.40	0.05
470	002480	新筑股份	2,600	10,296.00	0.05
471	002141	贤丰控股	2,800	10,276.00	0.05
472	000837	秦川机床	2,400	10,272.00	0.05
472	002297	博云新材	1,600	10,272.00	0.05
473	300393	中来股份	707	10,244.43	0.05
474	000812	陕西金叶	3,100	10,230.00	0.05
474	603333	尚纬股份	1,000	10,230.00	0.05
475	002374	丽鹏股份	3,500	10,185.00	0.05
476	600501	航天晨光	1,300	10,153.00	0.05
477	600650	锦江投资	1,000	10,150.00	0.05
478	002793	东音股份	750	10,125.00	0.05
479	300048	合康新能	4,200	10,122.00	0.05
480	600279	重庆港九	2,200	10,120.00	0.05
481	000711	京蓝科技	1,860	10,118.40	0.05
482	002879	长缆科技	620	10,056.40	0.05
483	002178	延华智能	2,400	10,056.00	0.05
483	603698	航天工程	800	10,056.00	0.05
484	002533	金杯电工	2,000	10,040.00	0.05
485	002452	长高集团	2,100	10,038.00	0.05
486	300471	厚普股份	1,100	10,010.00	0.05
487	600012	皖通高速	1,700	9,996.00	0.05
488	601218	吉鑫科技	3,500	9,940.00	0.05
489	600619	海立股份	1,200	9,900.00	0.05
490	300340	科恒股份	780	9,890.40	0.05
491	300424	航新科技	616	9,862.16	0.05
492	002514	宝馨科技	1,700	9,860.00	0.05
493	603959	百利科技	976	9,857.60	0.05
494	300018	中元股份	1,900	9,842.00	0.05
495	002270	华明装备	2,000	9,840.00	0.05
496	002158	汉钟精机	1,100	9,812.00	0.05
497	002781	奇信股份	600	9,756.00	0.05
498	601226	华电重工	2,300	9,752.00	0.05

499	002775	文科园林	1,664	9,734.40	0.05
500	002300	太阳电缆	1,460	9,723.60	0.05
501	000905	厦门港务	1,300	9,711.00	0.05
502	300569	天能重工	650	9,698.00	0.05
503	000856	冀东装备	900	9,693.00	0.05
504	002140	东华科技	1,380	9,687.60	0.05
505	000557	西部创业	2,800	9,660.00	0.05
506	300140	中环装备	900	9,648.00	0.05
507	002196	方正电机	1,800	9,612.00	0.05
508	300472	新元科技	700	9,562.00	0.05
509	000404	长虹华意	2,400	9,480.00	0.05
510	300262	巴安水务	1,950	9,457.50	0.05
511	000151	中成股份	900	9,450.00	0.05
512	000530	大冷股份	2,400	9,432.00	0.05
513	002689	远大智能	2,600	9,412.00	0.05
514	603283	赛腾股份	300	9,375.00	0.05
515	601177	杭齿前进	1,000	9,370.00	0.05
516	000551	创元科技	1,400	9,352.00	0.05
517	603618	杭电股份	1,700	9,350.00	0.05
518	603728	鸣志电器	840	9,307.20	0.05
519	300008	天海防务	3,200	9,248.00	0.05
520	603318	派思股份	800	9,224.00	0.04
521	300171	东富龙	1,300	9,217.00	0.04
522	300414	中光防雷	750	9,097.50	0.04
523	600113	浙江东日	1,260	9,034.20	0.04
524	600313	农发种业	3,200	9,024.00	0.04
525	603466	风语筑	600	8,892.00	0.04
526	000628	高新发展	900	8,883.00	0.04
527	603100	川仪股份	1,000	8,880.00	0.04
528	600830	香溢融通	1,600	8,816.00	0.04
529	600268	国电南自	1,700	8,738.00	0.04
530	002546	新联电子	2,100	8,715.00	0.04
531	600939	重庆建工	1,800	8,658.00	0.04
532	603030	全筑股份	1,500	8,655.00	0.04
533	600579	克劳斯	1,300	8,645.00	0.04
534	603871	嘉友国际	280	8,590.40	0.04
535	001872	招商港口	500	8,580.00	0.04
535	603105	芯能科技	1,200	8,580.00	0.04
536	300097	智云股份	900	8,559.00	0.04
537	000833	粤桂股份	1,700	8,551.00	0.04
538	002534	杭锅股份	1,100	8,492.00	0.04
539	601865	福莱特	700	8,491.00	0.04
540	300425	中建环能	1,936	8,479.68	0.04
541	002350	北京科锐	1,510	8,456.00	0.04

542	300443	金雷股份	600	8,394.00	0.04
543	601038	一拖股份	1,200	8,328.00	0.04
544	300350	华鹏飞	1,600	8,320.00	0.04
545	601068	中铝国际	1,500	8,310.00	0.04
546	603859	能科股份	300	8,280.00	0.04
547	300011	鼎汉技术	1,400	8,274.00	0.04
548	600207	安彩高科	1,766	8,247.22	0.04
549	300732	设研院	480	8,227.20	0.04
550	600822	上海物贸	800	8,176.00	0.04
551	300280	紫天科技	500	8,145.00	0.04
552	002457	青龙管业	1,000	8,110.00	0.04
553	002046	轴研科技	1,200	8,100.00	0.04
554	002606	大连电瓷	1,400	8,064.00	0.04
555	600853	龙建股份	2,520	8,013.60	0.04
556	603713	密尔克卫	200	8,010.00	0.04
557	600475	华光股份	800	7,992.00	0.04
558	603648	畅联股份	800	7,968.00	0.04
559	300545	联得装备	300	7,935.00	0.04
560	000509	华塑控股	3,300	7,920.00	0.04
561	603117	万林物流	2,080	7,904.00	0.04
562	002346	柘中股份	700	7,868.00	0.04
563	300307	慈星股份	1,800	7,848.00	0.04
564	600287	江苏舜天	1,300	7,839.00	0.04
565	300281	金明精机	1,300	7,826.00	0.04
565	300344	太空智造	1,300	7,826.00	0.04
566	002116	中国海诚	1,000	7,810.00	0.04
567	002743	富煌钢构	1,200	7,800.00	0.04
567	002933	新兴装备	200	7,800.00	0.04
568	002535	林州重机	2,800	7,756.00	0.04
569	300278	华昌达	1,800	7,722.00	0.04
570	600192	长城电工	1,500	7,710.00	0.04
571	603897	长城科技	400	7,700.00	0.04
572	002162	悦心健康	2,100	7,686.00	0.04
573	600290	ST 华仪	2,700	7,668.00	0.04
574	300466	赛摩电气	1,300	7,618.00	0.04
575	002487	大金重工	1,400	7,616.00	0.04
576	002337	赛象科技	2,100	7,602.00	0.04
577	300690	双一科技	300	7,581.00	0.04
578	002769	普路通	900	7,569.00	0.04
579	300335	迪森股份	1,300	7,553.00	0.04
580	002282	博深股份	900	7,542.00	0.04
581	000626	远大控股	1,000	7,520.00	0.04
582	603045	福达合金	500	7,500.00	0.04
583	002560	通达股份	1,300	7,488.00	0.04

584	002006	精功科技	1,600	7,456.00	0.04
585	600152	维科技术	1,100	7,436.00	0.04
586	000701	厦门信达	1,400	7,434.00	0.04
586	002184	海得控制	700	7,434.00	0.04
587	002801	微光股份	200	7,432.00	0.04
588	603915	国茂股份	500	7,390.00	0.04
589	603017	中衡设计	700	7,364.00	0.04
590	603126	中材节能	1,500	7,350.00	0.04
591	002026	山东威达	1,400	7,308.00	0.04
592	002651	利君股份	1,500	7,275.00	0.04
593	002532	新界泵业	1,200	7,236.00	0.04
594	002483	润邦股份	1,700	7,208.00	0.04
595	603776	永安行	420	7,182.00	0.03
596	603789	星光农机	500	7,160.00	0.03
597	002884	凌霄泵业	472	7,127.20	0.03
598	000548	湖南投资	1,700	7,123.00	0.03
599	603032	德新交运	320	7,104.00	0.03
600	300772	运达股份	400	7,088.00	0.03
601	603666	亿嘉和	100	7,080.00	0.03
602	300503	昊志机电	600	7,062.00	0.03
603	603185	上机数控	280	7,056.00	0.03
604	002892	科力尔	240	7,039.20	0.03
605	300719	安达维尔	600	7,032.00	0.03
606	002941	新疆交建	400	7,020.00	0.03
607	300444	双杰电气	1,401	6,990.99	0.03
608	002860	星帅尔	300	6,939.00	0.03
609	002837	英维克	400	6,864.00	0.03
610	300447	全信股份	700	6,832.00	0.03
611	002040	南京港	970	6,799.70	0.03
612	002789	建艺集团	410	6,785.50	0.03
613	603339	四方科技	500	6,780.00	0.03
614	603507	振江股份	300	6,744.00	0.03
615	300117	嘉寓股份	1,800	6,732.00	0.03
615	300696	爱乐达	300	6,732.00	0.03
616	300775	三角防务	200	6,674.00	0.03
617	002786	银宝山新	800	6,664.00	0.03
618	603607	京华激光	300	6,603.00	0.03
619	002599	盛通股份	1,400	6,594.00	0.03
620	002957	科瑞技术	200	6,554.00	0.03
621	300391	康跃科技	900	6,543.00	0.03
622	603011	合锻智能	1,300	6,539.00	0.03
623	300095	华伍股份	1,100	6,534.00	0.03
624	603187	海容冷链	200	6,528.00	0.03
625	002829	星网宇达	300	6,525.00	0.03

626	002949	华阳国际	300	6,510.00	0.03
627	603843	正平股份	1,380	6,458.40	0.03
628	300435	中泰股份	600	6,456.00	0.03
629	603131	上海沪工	460	6,426.20	0.03
630	002927	泰永长征	320	6,419.20	0.03
631	603967	中创物流	400	6,400.00	0.03
632	002882	金龙羽	600	6,396.00	0.03
633	300688	创业黑马	280	6,395.20	0.03
634	603903	中持股份	460	6,384.80	0.03
635	300500	启迪设计	420	6,329.40	0.03
636	000533	顺钠股份	2,300	6,325.00	0.03
637	300407	凯发电气	800	6,288.00	0.03
638	600753	东方银星	400	6,224.00	0.03
639	300718	长盛轴承	300	6,219.00	0.03
640	300382	斯莱克	1,100	6,193.00	0.03
641	300600	瑞特股份	612	6,113.88	0.03
642	300187	永清环保	1,300	6,110.00	0.03
643	603929	亚翔集成	400	6,096.00	0.03
644	300334	津膜科技	900	6,075.00	0.03
645	000595	宝塔实业	1,900	6,061.00	0.03
646	300103	达刚控股	650	6,058.00	0.03
647	300385	雪浪环境	500	6,055.00	0.03
648	300767	震安科技	100	6,051.00	0.03
649	603396	金辰股份	280	6,000.40	0.03
650	002645	华宏科技	700	5,936.00	0.03
651	002931	锋龙股份	200	5,920.00	0.03
652	002757	南兴股份	350	5,883.50	0.03
653	300581	晨曦航空	380	5,855.80	0.03
654	002694	顾地科技	1,800	5,850.00	0.03
655	002903	宇环数控	400	5,848.00	0.03
656	300240	飞力达	900	5,841.00	0.03
657	603616	韩建河山	700	5,768.00	0.03
658	603098	森特股份	520	5,761.60	0.03
659	300512	中亚股份	500	5,740.00	0.03
660	603828	柯利达	1,100	5,698.00	0.03
661	603066	音飞储存	734	5,637.12	0.03
662	603797	联泰环保	500	5,625.00	0.03
663	002795	永和智控	400	5,572.00	0.03
664	300430	诚益通	700	5,551.00	0.03
665	603085	天成自控	680	5,548.80	0.03
666	300490	华自科技	500	5,540.00	0.03
667	603603	博天环境	600	5,508.00	0.03
668	300746	汉嘉设计	400	5,468.00	0.03
669	603535	嘉诚国际	300	5,436.00	0.03

670	603909	合诚股份	400	5,416.00	0.03
671	300265	通光线缆	700	5,390.00	0.03
672	300786	国林科技	100	5,335.00	0.03
673	002164	宁波东力	1,400	5,306.00	0.03
674	300153	科泰电源	800	5,288.00	0.03
675	603970	中农立华	408	5,259.12	0.03
676	002889	东方嘉盛	200	5,208.00	0.03
677	300411	金盾股份	700	5,173.00	0.03
678	603966	法兰泰克	500	5,160.00	0.03
679	300711	广哈通信	360	5,148.00	0.03
680	300589	江龙船艇	400	5,136.00	0.02
681	300154	瑞凌股份	900	5,094.00	0.02
682	002652	扬子新材	1,300	5,083.00	0.02
683	603016	新宏泰	300	5,070.00	0.02
684	300492	山鼎设计	100	5,063.00	0.02
685	300461	田中精机	260	5,062.20	0.02
686	002823	凯中精密	541	5,042.12	0.02
687	300692	中环环保	400	5,040.00	0.02
688	300670	大烨智能	600	5,028.00	0.02
689	603321	梅轮电梯	600	4,944.00	0.02
690	603717	天域生态	560	4,911.20	0.02
691	300488	恒锋工具	300	4,839.00	0.02
692	300056	三维丝	726	4,827.90	0.02
693	300293	蓝英装备	600	4,806.00	0.02
694	300374	恒通科技	510	4,783.80	0.02
695	300635	中达安	300	4,782.00	0.02
696	002811	亚泰国际	300	4,779.00	0.02
697	300260	新莱应材	400	4,708.00	0.02
698	300780	德恩精工	200	4,646.00	0.02
699	002877	智能自控	540	4,627.80	0.02
700	603289	泰瑞机器	500	4,625.00	0.02
701	300484	蓝海华腾	500	4,575.00	0.02
702	300712	永福股份	390	4,527.90	0.02
703	603757	大元泵业	292	4,523.08	0.02
704	002922	伊戈尔	300	4,500.00	0.02
705	603937	丽岛新材	400	4,496.00	0.02
706	603637	镇海股份	290	4,483.40	0.02
707	300536	农尚环境	600	4,464.00	0.02
708	002887	绿茵生态	290	4,457.30	0.02
709	603058	永吉股份	600	4,452.00	0.02
710	002227	奥特迅	400	4,432.00	0.02
711	300475	聚隆科技	400	4,416.00	0.02
712	002896	中大力德	200	4,396.00	0.02
713	600463	空港股份	600	4,374.00	0.02

714	603680	今创集团	420	4,372.20	0.02
715	300697	电工合金	290	4,364.50	0.02
716	300675	建科院	300	4,344.00	0.02
717	603988	中电电机	448	4,327.68	0.02
718	300778	新城市	100	4,311.00	0.02
719	603279	景津环保	200	4,272.00	0.02
720	300757	罗博特科	130	4,232.80	0.02
721	603895	天永智能	180	4,161.60	0.02
722	300763	锦浪科技	100	4,153.00	0.02
723	603329	上海雅仕	300	4,137.00	0.02
724	603912	佳力图	300	4,125.00	0.02
725	603177	德创环保	400	4,056.00	0.02
726	300649	杭州园林	200	4,002.00	0.02
727	300491	通合科技	300	3,903.00	0.02
728	002871	伟隆股份	200	3,836.00	0.02
729	002774	快意电梯	500	3,825.00	0.02
730	300722	新余国科	180	3,778.20	0.02
731	002856	美芝股份	200	3,742.00	0.02
732	300594	朗进科技	100	3,567.00	0.02
733	002691	冀凯股份	590	3,540.00	0.02
734	300538	同益股份	200	3,536.00	0.02
735	002951	金时科技	200	3,460.00	0.02
736	603956	威派格	200	3,318.00	0.02
737	300779	惠城环保	100	3,146.00	0.02
738	603500	祥和实业	220	2,736.80	0.01
739	002943	宇晶股份	100	2,428.00	0.01
740	002836	新宏泽	200	2,418.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	454,171.00	2.27
2	601668	中国建筑	371,586.00	1.86
3	601766	中国中车	97,526.00	0.49
4	600739	辽宁成大	88,689.00	0.44
5	600150	中国船舶	74,970.00	0.37
6	600031	三一重工	74,182.00	0.37
7	002120	韵达股份	69,876.00	0.35

8	601658	邮储银行	66,000.00	0.33
9	002352	顺丰控股	59,306.00	0.30
10	601598	中国外运	50,376.00	0.25
11	600406	国电南瑞	44,646.00	0.22
12	601669	中国电建	44,370.00	0.22
13	600018	上港集团	34,574.00	0.17
14	600317	营口港	31,136.00	0.16
15	601916	浙商银行	29,640.00	0.15
16	601975	招商南油	28,600.00	0.14
17	300207	欣旺达	23,820.00	0.12
18	300724	捷佳伟创	23,812.00	0.12
19	600981	汇鸿集团	23,400.00	0.12
20	601298	青岛港	21,980.00	0.11

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	460,050.00	2.30
2	600009	上海机场	79,486.00	0.40
3	601658	邮储银行	67,440.00	0.34
4	600270	外运发展	50,376.00	0.25
5	600482	中国动力	45,674.00	0.23
6	000338	潍柴动力	44,465.00	0.22
7	600031	三一重工	38,671.00	0.19
8	603093	南华期货	34,272.00	0.17
9	002621	美吉姆	32,802.00	0.16
10	601766	中国中车	32,387.00	0.16
11	601916	浙商银行	30,928.00	0.15
12	600326	西藏天路	29,971.00	0.15
13	601989	中国重工	28,092.00	0.14
14	601006	大秦铁路	28,011.00	0.14
15	600033	福建高速	26,896.00	0.13

16	601186	中国铁建	26,667.00	0.13
17	601012	隆基股份	25,756.00	0.13
18	003816	中国广核	24,350.00	0.12
19	600416	湘电股份	24,080.00	0.12
20	603338	浙江鼎力	22,306.00	0.11

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,352,398.54
卖出股票收入（成交）总额	3,788,789.39

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	324.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	376.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

89 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	广发中证全指工业交 易型开放式指数证券

						投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
575	47,245.95	12,603,985.00	46.40%	14,562,436.00	53.60%	12,587,457.00	46.33%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	赵翔	2,999,174.00	11.04%
2	钱中明	1,253,417.00	4.61%
3	欧阳珮	409,400.00	1.51%
4	何朗	352,152.00	1.30%
5	张小宁	200,046.00	0.74%
6	方心愉	200,015.00	0.74%
7	邓燕姝	200,015.00	0.74%
8	兰旭东	200,015.00	0.74%
9	苏健	200,011.00	0.74%
10	曹美郴	160,010.00	0.59%
11	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	12,587,457.00	46.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017 年 6 月 13 日)基金份额总额	291,166,421.00
本报告期期初基金份额总额	31,166,421.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	27,166,421.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。2019 年 6 月，刘连舸先生任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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
海通证券	2	1,415,798.56	20.14%	1,035.40	18.00%	-
中信证券	3	1,625,603.60	23.13%	1,188.83	20.66%	-
广发证券	3	3,986,933.77	56.73%	3,529.59	61.34%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下被动型指数基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-12-11
2	关于增加平安证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-11-04
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-23
4	关于增加广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-10-21
5	关于广发中证全指工业交易型开放式指数证	中国证监会指定报刊及	2019-10-16

	券投资基金开通场内申购赎回业务并修改基金合同的公告	网站	
6	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
7	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20190101-20191231	13,276,457.00	59,100.00	748,100.00	12,587,457.00	46.33%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者需求，根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的业务方案，本公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，决定于 2019 年 10 月 21 日起对本基金新增场内申购赎回业务，保留原有场外实物申赎模式，并对本基金的基金合同作相应修改。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金开通场内申购赎回业务并修改基金合同的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书

13.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

13.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二〇年三月二十七日