

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券 投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 2022 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54

8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9 开放式基金份额变动	56
10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	59
11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指可选消费 ETF
场内简称	可选消费 ETF
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 3 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	154,156,094.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-06-25

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	95566
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942

注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-109,031.93
本期利润	-7,722,096.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0681
本期加权平均净值利润率	-3.90%
本期基金份额净值增长率	-5.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	60,357,241.94
期末可供分配基金份额利润	0.3915
期末基金资产净值	293,374,489.46
期末基金份额净值	1.9031
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	90.31%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	13.10%	1.58%	13.20%	1.61%	-0.10%	-0.03%
过去三个月	17.49%	1.83%	17.17%	1.87%	0.32%	-0.04%
过去六个月	-5.33%	1.75%	-5.99%	1.78%	0.66%	-0.03%
过去一年	-6.33%	1.44%	-9.46%	1.47%	3.13%	-0.03%
过去三年	48.80%	1.40%	25.78%	1.42%	23.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	90.31%	1.56%	52.99%	1.60%	37.32%	-0.04%

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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2014 年 6 月 3 日至 2022 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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏浩洋	本基金的基金经理；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	2021-05-20	-	5 年	夏浩洋先生，理学硕士，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指数投资部任量化研究员。

	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；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广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；广发中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理				
--	---	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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% 的交易共有 17 次，其中 14 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，其余 3 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资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跟踪指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。报告期内，中证全指可选消费指数下跌 5.99%。消费市场方面，受疫情反复影响，上半年销售数据整体表现欠佳。本轮疫情波及国内经济发达区域，对消费市场的冲击尤为明显，3、4、5 月份市场销售连续下降。国家统计局数据显示，上半年社会消费品零售总额 210432 亿元，同比下降 0.7%。分季度看，1 季度增长 3.3%，2 季度下降 4.6%。

2022 年上半年，全球经济复苏节奏一波三折。年初，市场普遍看好各主要经济体的需求修复，然而进入 3 月后，东欧地缘冲突造成了大宗商品价格大幅上涨，引发了金融市场剧烈波动，给全球经济带来了不确定性。此外，美联储加息预期以及疫情的反复也在影响着全球经济。2 季度，市场开始交易美国高通胀和经济衰退的预期，美债实际利率高位震荡，但边际影响减弱，预计未来一段时间内全球资本市场流动性或将保持相对宽松状态。

就国内而言，受益于稳增长政策持续发力，1 季度经济明显复苏，关键经济指标稳中向好，然而 4 月以来，疫情扰乱了经济修复的节奏，随着 5、6 月疫情缓解，其对经济的负面影响才逐渐出现缓和迹象，5 月份主要经济指标降幅收窄，6 月份经济企稳回升，2 季度经济实现正增长。

总的来看，在海外需求放缓、国内疫情反复的情况下，上半年 GDP 同比增长 2.5%，全国规模以上工业增加值同比增长 3.4%，服务业增加值同比增长 1.8%，稳经济大盘政策落地显效。

A 股市场方面，上半年整体市场出现了先跌后涨的局面，强势板块主要集中在煤炭、汽车、光伏逆变器、锂电池等行业。主要指数方面，上证指数下跌 6.63%，深证成指下跌 13.20%，沪深 300 指数下跌 9.22%，中证 500 指数下跌 12.30%，创业板指数下跌 15.41%，科创板 50 指数下跌 20.92%。

进入 6 月以来，可选消费类别中的汽车、家电等大宗消费增长对于整体消费市场的带动作用明显。随着部分乘用车购置税减半政策落地以及各地新能源汽车补贴、家电绿色节能补贴、“以旧换新”等一系列促进重点领域消费举措显效，大宗商品消费快速回暖。

当前影响居民消费意愿的主导因素还是在于疫情，若后续疫情得到进一步缓解，加之各地刺激消费政策逐步落地，居民的消费意愿或将得到修复，前期承压的消费板块上市公司业绩或将得到一定程度缓解。

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-5.33%，同期业绩比较基准收益率为-5.99%。

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，若美国经济衰退趋势形成，预计美联储加息空间相对有限，届时美债实际利率或将回落，市场流动性又将回到宽松轨道上来。就国内来看，受疫情反复影响，经济仍在努力修复，加之国内 CPI 数据仍在合理范围内变化，因此国内流动性预计也将保持相对宽松的状态，市场或将是成长风格再次占优。

在上半年国内 GDP 同比增速录得 2.5%的背景下，全年 5.5%的增速目标不变，这就意味着下半年的经济刺激政策还将继续加码。政策的支持给经济复苏注入了强心针，未来上市公司业绩或将受益。

总的来说，我们相对看好下半年中美经济周期错位带来的流动性宽松以及 A 股上市公司业绩修复的投资机会，但仍需重视疫情反复可能对经济基本面以及股市带来的影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,842,220.40	4,611,336.66
结算备付金		100,933.66	144,590.22

存出保证金		8,410.02	2,899.45
交易性金融资产	6.4.7.2	287,493,592.07	221,273,277.25
其中：股票投资		287,475,591.12	221,261,277.25
基金投资		-	-
债券投资		18,000.95	12,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		19,196,049.40	72,014.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	2,794.30
资产总计		313,641,205.55	226,106,912.45
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		15,964,549.81	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		92,454.27	104,747.18
应付托管费		18,490.82	20,949.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.33	407.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	4,191,220.86	523,119.81
负债合计		20,266,716.09	649,223.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	154,156,094.00	112,156,094.00
未分配利润	6.4.7.9	139,218,395.46	113,301,594.66
净资产合计		293,374,489.46	225,457,688.66
负债和净资产总计		313,641,205.55	226,106,912.45

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.9031 元，基金份额总额 154,156,094.00 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,026,093.45	9,284,307.86
1.利息收入		25,110.40	135,192.53
其中：存款利息收入	6.4.7.10	8,247.69	6,884.65
债券利息收入		-	31.78
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		16,862.71	128,276.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		592,059.23	35,981,416.25
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,789,452.57	34,050,261.20
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,810.80	5,347.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,364,701.00	1,925,807.99
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-7,613,064.17	-26,939,822.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-30,198.91	107,521.45
减：二、营业总支出		696,002.65	1,160,115.55
1. 管理人报酬		490,412.22	700,911.79
2. 托管费		98,082.48	140,182.33
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		61.12	462.08
8. 其他费用	6.4.7.21	107,446.83	318,559.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,722,096.10	8,124,192.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,722,096.10	8,124,192.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,722,096.10	8,124,192.31

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	112,156,094.00	113,301,594.66	225,457,688.66
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	112,156,094.00	113,301,594.66	225,457,688.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	42,000,000.00	25,916,800.80	67,916,800.80
（一）、综合收益总额	-	-7,722,096.10	-7,722,096.10
（二）、本期基金	42,000,000.00	33,638,896.90	75,638,896.90

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	58,000,000.00	47,874,372.60	105,874,372.60
2. 基金赎回款	-16,000,000.00	-14,235,475.70	-30,235,475.70
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	154,156,094.00	139,218,395.46	293,374,489.46
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	194,156,094.00	192,894,380.55	387,050,474.55
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	194,156,094.00	192,894,380.55	387,050,474.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-68,000,000.00	-62,742,579.83	-130,742,579.83
（一）、综合收益总额	-	8,124,192.31	8,124,192.31
（二）、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）	-68,000,000.00	-70,866,772.14	-138,866,772.14
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	4,177,715.32	8,177,715.32
2.基金赎回款	-72,000,000.00	-75,044,487.46	-147,044,487.46
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产	126,156,094.00	130,151,800.72	256,307,894.72

产（基金净值）			
---------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]1265 号《关于核准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2014 年 6 月 3 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 5 月 5 日至 2014 年 5 月 23 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 838,156,094.00 元，有效认购户数为 7,064 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 40,743.00 元，折合基金份额 40,743.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2022 年 8 月 25 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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务

状况以及 2022 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利

息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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并确认产生的资产和负债；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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 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）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(8) 黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(9) 黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在

相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,611,336.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 429.11 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,611,765.77 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 144,590.22 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 42.17 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 144,632.39 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,899.45 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1.30 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,900.75 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,794.30 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 429.11 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 42.17 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1.30 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.24 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 2,321.48 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,321.48 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,321.48 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 221,273,277.25 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.24 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 221,273,277.49 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

境内证券(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。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税

[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	6,842,220.40
等于：本金	6,841,671.15
加：应计利息	549.25
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	6,842,220.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		263,668,049.48	-	287,475,591.12	23,807,541.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所 市场	18,000.00	0.95	18,000.95	-
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	18,000.00	0.95	18,000.95	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	263,686,049.48	0.95	287,493,592.07	23,807,541.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 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	-
应付交易费用	64,289.70
其中：交易所市场	64,289.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	110,367.52
应付替代款	3,994,441.09
可退替代款	7,703.10
应付指数使用费	14,419.45
合计	4,191,220.86

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	112,156,094.00	112,156,094.00
本期申购	58,000,000.00	58,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-16,000,000.00
本期末	154,156,094.00	154,156,094.00

6.4.7.9 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	44,256,814.68	69,044,779.98	113,301,594.66
本期利润	-109,031.93	-7,613,064.17	-7,722,096.10
本期基金份额交易产生的变动数	16,209,459.19	17,429,437.71	33,638,896.90
其中：基金申购款	22,426,179.67	25,448,192.93	47,874,372.60
基金赎回款	-6,216,720.48	-8,018,755.22	-14,235,475.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,357,241.94	78,861,153.52	139,218,395.46

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,502.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	61.99
结算备付金利息收入	683.60
其他	-
合计	8,247.69

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,879,559.46
股票投资收益——赎回差价收入	1,090,106.89
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,789,452.57

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	36,713,363.20

减：卖出股票成本总额	39,477,929.11
减：交易费用	114,993.55
买卖股票差价收入	-2,879,559.46

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	30,235,475.70
减：现金支付赎回款总额	14,298,618.70
减：赎回股票成本总额	14,846,750.11
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,090,106.89

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	31.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,778.90
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	16,810.80

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	109,714.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	92,900.00
减：应计利息总额	32.28
减：交易费用	3.79
买卖债券差价收入	16,778.90

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,364,701.00
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	2,364,701.00

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-7,613,064.17
——股票投资	-7,613,064.17
——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	-7,613,064.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-30,198.91

合计	-30,198.91
----	------------

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	16,860.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,595.66
指数使用费	29,424.78
其他	58.87
合计	107,446.83

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	38,280.00	0.04%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	80,900.00	38.78%	66,700.00	26.56%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	490,412.22	700,911.79
其中：支付销售机构的客户维护费	947.98	4,208.49

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	98,082.48	140,182.33

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
广发中证全指可 选消费交易型开 放式指数证券投 资基金发起式联 接基金	146,006,157.00	94.71%	104,000,757.00	92.73%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	6,842,220.40	7,502.10	4,845,901.41	5,939.19

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

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	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
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6 个月	新股 流通 受限	56.88	56.42	84.00	4,777.92	4,739.28	20220616 除 权除 息,派 息比

										例 0.2000 (含税)
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
111005	富春 转债	2022-0 6-24	1 个月 内(含)	新债 流通 受限	100.00	100.01	180.00	18,000 .00	18,000 .95	-

注：截至本报告期末 2022 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权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00270 3	浙江世 宝	2022-06 -29	重大事 项停牌	15.56	2022-0 7-06	14.00	18,000.00	144,649.03	280,080.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	18,000.95	12,000.00
未评级	-	-
合计	18,000.95	12,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券

外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,842,220.40	-	-	-	6,842,220.40
结算备付金	100,933.66	-	-	-	100,933.66
存出保证金	8,410.02	-	-	-	8,410.02
交易性金融资产	18,000.95	-	-	287,475,591.12	287,493,592.07
应收清算款	-	-	-	19,196,049.40	19,196,049.40

资产总计	6,969,565.03	-	-	306,671,640.52	313,641,205.55
负债					
应付清算款	-	-	-	15,964,549.81	15,964,549.81
应付管理人报酬	-	-	-	92,454.27	92,454.27
应付托管费	-	-	-	18,490.82	18,490.82
应交税费	-	-	-	0.33	0.33
其他负债	-	-	-	4,191,220.86	4,191,220.86
负债总计	-	-	-	20,266,716.09	20,266,716.09
利率敏感度缺口	6,969,565.03	-	-	286,404,924.43	293,374,489.46
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,611,336.66	-	-	-	4,611,336.66
结算备付金	144,590.22	-	-	-	144,590.22
存出保证金	2,899.45	-	-	-	2,899.45
交易性金融资产	12,000.00	-	-	221,261,277.25	221,273,277.25
应收证券清算款	-	-	-	72,014.57	72,014.57
应收利息	-	-	-	2,794.30	2,794.30
资产总计	4,770,826.33	-	-	221,336,086.12	226,106,912.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	104,747.18	104,747.18
应付托管费	-	-	-	20,949.40	20,949.40
应付交易费用	-	-	-	86,216.52	86,216.52
应交税费	-	-	-	407.40	407.40
其他负债	-	-	-	436,903.29	436,903.29
负债总计	-	-	-	649,223.79	649,223.79
利率敏感度缺口	4,770,826.33	-	-	220,686,862.33	225,457,688.66

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	287,475,591.12	97.99	221,261,277.25	98.14
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	18,000.95	0.01	12,000.00	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	287,493,592.07	98.00	221,273,277.25	98.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	上升 5%	14,694,056.77	11,027,762.32
	下降 5%	-14,694,056.77	-11,027,762.32

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	287,190,771.84
第二层次	298,080.95
第三层次	4,739.28
合计	287,493,592.07

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	287,475,591.12	91.66
	其中：普通股	286,091,641.12	91.22
	存托凭证	1,383,950.00	0.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,000.95	0.01
	其中：债券	18,000.95	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,943,154.06	2.21
8	其他各项资产	19,204,459.42	6.12
9	合计	313,641,205.55	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	232,933,678.07	79.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,230,748.61	6.90

G	交通运输、仓储和邮政业	283,634.50	0.10
H	住宿和餐饮业	4,796,994.10	1.64
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,914.00	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	21,955,915.37	7.48
M	科学研究和技术服务业	223,620.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,690,526.96	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,237,681.56	0.76
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,846,877.95	0.97
S	综合	-	-
	合计	287,475,591.12	97.99

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	78,721	26,252,666.29	8.95
2	000333	美的集团	426,208	25,738,701.12	8.77
3	601888	中国中免	84,850	19,764,110.50	6.74
4	000651	格力电器	412,703	13,916,345.16	4.74
5	600690	海尔智家	329,846	9,057,571.16	3.09
6	000625	长安汽车	432,337	7,488,076.84	2.55
7	600104	上汽集团	407,034	7,249,275.54	2.47
8	600660	福耀玻璃	139,340	5,825,805.40	1.99
9	002050	三花智控	156,500	4,300,620.00	1.47
10	601633	长城汽车	107,191	3,970,354.64	1.35
11	601127	赛力斯	47,200	3,827,448.00	1.30
12	002920	德赛西威	24,100	3,566,800.00	1.22

13	600741	华域汽车	137,129	3,153,967.00	1.08
14	601238	广汽集团	192,221	2,929,448.04	1.00
15	601689	拓普集团	38,338	2,623,469.34	0.89
16	603816	顾家家居	44,322	2,509,954.86	0.86
17	600754	锦江酒店	39,703	2,497,318.70	0.85
18	603486	科沃斯	20,180	2,459,740.20	0.84
19	601058	赛轮轮胎	213,305	2,403,947.35	0.82
20	603833	欧派家居	15,847	2,387,825.96	0.81
21	601799	星宇股份	12,600	2,154,600.00	0.73
22	300144	宋城演艺	136,577	2,096,456.95	0.71
23	600733	北汽蓝谷	224,100	2,077,407.00	0.71
24	605117	德业股份	6,338	1,773,942.82	0.60
25	002472	双环传动	54,154	1,724,263.36	0.59
26	688169	石头科技	2,724	1,679,890.80	0.57
27	600177	雅戈尔	241,951	1,604,135.13	0.55
28	600859	王府井	59,312	1,540,925.76	0.53
29	002572	索菲亚	55,386	1,523,115.00	0.52
30	002508	老板电器	41,075	1,479,932.25	0.50
31	603596	伯特利	17,600	1,411,168.00	0.48
32	300432	富临精工	63,230	1,391,060.00	0.47
33	689009	九号公司	31,100	1,383,950.00	0.47
34	601966	玲珑轮胎	51,718	1,312,085.66	0.45
35	600699	均胜电子	83,440	1,310,842.40	0.45
36	600655	豫园股份	135,500	1,279,120.00	0.44
37	000887	中鼎股份	68,800	1,254,912.00	0.43
38	600258	首旅酒店	49,768	1,234,246.40	0.42
39	601717	郑煤机	80,500	1,160,005.00	0.40
40	688696	极米科技	3,400	1,046,758.00	0.36
41	603195	公牛集团	6,800	1,039,788.00	0.35
42	601258	庞大集团	712,600	990,514.00	0.34
43	002607	中公教育	161,064	932,560.56	0.32
44	600839	四川长虹	322,034	927,457.92	0.32
45	600827	百联股份	69,800	922,058.00	0.31
46	600297	广汇汽车	353,201	921,854.61	0.31
47	002851	麦格米特	34,900	916,474.00	0.31
48	002127	南极电商	170,900	912,606.00	0.31
49	002091	江苏国泰	83,300	895,475.00	0.31
50	603129	春风动力	7,800	887,016.00	0.30
51	601777	力帆科技	156,700	869,685.00	0.30
52	603008	喜临门	23,596	865,973.20	0.30
53	600060	海信视像	68,279	853,487.50	0.29
54	000581	威孚高科	43,788	842,919.00	0.29
55	000982	中银绒业	371,600	828,668.00	0.28
56	002032	苏泊尔	14,100	794,394.00	0.27

57	002126	银轮股份	68,806	787,828.70	0.27
58	002429	兆驰股份	196,802	755,719.68	0.26
59	002832	比音勒芬	29,815	751,338.00	0.26
60	000829	天音控股	62,400	743,184.00	0.25
61	002906	华阳集团	16,400	743,084.00	0.25
62	600398	海澜之家	154,604	734,369.00	0.25
63	603179	新泉股份	25,216	731,264.00	0.25
64	300888	稳健医疗	10,900	724,850.00	0.25
65	002085	万丰奥威	133,456	716,658.72	0.24
66	601718	际华集团	229,000	709,900.00	0.24
67	002984	森麒麟	22,700	706,197.00	0.24
68	002280	联络互动	189,700	705,684.00	0.24
69	603489	八方股份	3,600	700,164.00	0.24
70	600916	中国黄金	58,700	686,790.00	0.23
71	000559	万向钱潮	115,069	683,509.86	0.23
72	002048	宁波华翔	42,645	683,172.90	0.23
73	600138	中青旅	50,573	651,885.97	0.22
74	002705	新宝股份	28,900	635,511.00	0.22
75	603197	保隆科技	12,780	628,648.20	0.21
76	603306	华懋科技	18,500	627,150.00	0.21
77	603348	文灿股份	11,700	627,120.00	0.21
78	000034	神州数码	40,100	610,322.00	0.21
79	000572	海马汽车	100,100	609,609.00	0.21
80	002416	爱施德	65,106	605,485.80	0.21
81	002239	奥特佳	197,299	601,761.95	0.21
82	002867	周大生	38,175	592,857.75	0.20
83	300979	华利集团	8,100	591,948.00	0.20
84	000016	深康佳 A	97,612	590,552.60	0.20
85	002537	海联金汇	71,320	583,397.60	0.20
86	600158	中体产业	68,800	566,224.00	0.19
87	000921	海信家电	39,256	556,650.08	0.19
88	002612	朗姿股份	19,502	551,516.56	0.19
89	300217	东方电热	88,084	539,074.08	0.18
90	300428	立中集团	16,000	528,800.00	0.18
91	002101	广东鸿图	23,011	524,650.80	0.18
92	603529	爱玛科技	9,820	514,371.60	0.18
93	002003	伟星股份	54,094	513,893.00	0.18
94	603398	沐邦高科	17,700	497,016.00	0.17
95	002242	九阳股份	26,959	494,967.24	0.17
96	600933	爱柯迪	30,100	493,038.00	0.17
97	002434	万里扬	57,288	489,812.40	0.17
98	603305	旭升股份	16,200	489,564.00	0.17
99	002293	罗莱生活	36,700	483,339.00	0.16
100	002283	天润工业	69,104	471,980.32	0.16

101	300755	华致酒行	10,660	467,441.00	0.16
102	002488	金固股份	69,451	467,405.23	0.16
103	600609	金杯汽车	68,375	460,163.75	0.16
104	300005	探路者	53,700	453,228.00	0.15
105	600612	老凤祥	10,816	451,892.48	0.15
106	002540	亚太科技	66,300	445,536.00	0.15
107	000501	武商集团	40,020	444,222.00	0.15
108	000901	航天科技	48,405	440,001.45	0.15
109	603801	志邦家居	16,264	438,802.72	0.15
110	600742	一汽富维	47,207	438,080.96	0.15
111	300681	英搏尔	7,540	435,585.80	0.15
112	002190	成飞集成	15,600	424,320.00	0.14
113	603997	继峰股份	38,900	423,232.00	0.14
114	002563	森马服饰	70,400	416,768.00	0.14
115	000913	钱江摩托	23,600	414,416.00	0.14
116	002707	众信旅游	55,242	411,552.90	0.14
117	603766	隆鑫通用	89,258	411,479.38	0.14
118	600523	贵航股份	17,465	410,427.50	0.14
119	002277	友阿股份	84,812	393,527.68	0.13
120	300894	火星人	10,440	390,351.60	0.13
121	002154	报喜鸟	89,345	385,970.40	0.13
122	603035	常熟汽饰	23,100	381,612.00	0.13
123	600335	国机汽车	38,070	381,080.70	0.13
124	600729	重庆百货	17,426	375,878.82	0.13
125	002681	奋达科技	95,300	375,482.00	0.13
126	601010	文峰股份	128,300	374,636.00	0.13
127	002454	松芝股份	28,263	370,245.30	0.13
128	600653	申华控股	135,317	359,943.22	0.12
129	603665	康隆达	7,000	359,380.00	0.12
130	002697	红旗连锁	70,900	358,045.00	0.12
131	002284	亚太股份	38,535	354,136.65	0.12
132	600480	凌云股份	39,712	353,039.68	0.12
133	000589	贵州轮胎	80,200	352,880.00	0.12
134	002355	兴民智通	37,313	351,861.59	0.12
135	002489	浙江永强	94,952	345,625.28	0.12
136	002035	华帝股份	59,180	344,427.60	0.12
137	600628	新世界	45,000	343,800.00	0.12
138	000030	富奥股份	61,439	336,685.72	0.11
139	002510	天汽模	82,308	334,993.56	0.11
140	002614	奥佳华	38,488	333,306.08	0.11
141	603868	飞科电器	4,400	333,300.00	0.11
142	002677	浙江美大	22,500	330,075.00	0.11
143	300745	欣锐科技	6,600	329,208.00	0.11
144	600336	澳柯玛	48,300	328,440.00	0.11

145	002516	旷达科技	63,600	325,632.00	0.11
146	601163	三角轮胎	27,900	325,314.00	0.11
147	600220	江苏阳光	108,600	323,628.00	0.11
148	300680	隆盛科技	12,480	323,481.60	0.11
149	300911	亿田智能	4,200	322,770.00	0.11
150	300507	苏奥传感	41,133	320,426.07	0.11
151	600694	大商股份	17,664	316,185.60	0.11
152	600400	红豆股份	60,400	315,288.00	0.11
153	002251	步步高	45,140	312,820.20	0.11
154	002059	云南旅游	35,500	308,140.00	0.11
155	600337	美克家居	99,400	304,164.00	0.10
156	002292	奥飞娱乐	64,601	302,978.69	0.10
157	603708	家家悦	21,200	301,888.00	0.10
158	000888	峨眉山 A	32,902	301,711.34	0.10
159	603358	华达科技	15,220	301,356.00	0.10
160	300660	江苏雷利	8,236	299,543.32	0.10
161	002664	长鹰信质	17,372	298,450.96	0.10
162	002448	中原内配	42,250	298,285.00	0.10
163	002561	徐家汇	25,800	298,248.00	0.10
164	002033	丽江股份	27,155	293,274.00	0.10
165	000726	鲁泰 A	40,986	293,049.90	0.10
166	002503	搜于特	216,214	291,888.90	0.10
167	600987	航民股份	54,639	291,225.87	0.10
168	000700	模塑科技	55,704	290,217.84	0.10
169	603818	曲美家居	30,400	288,800.00	0.10
170	002419	天虹股份	40,400	288,052.00	0.10
171	600619	海立股份	42,200	286,116.00	0.10
172	603055	台华新材	22,760	285,865.60	0.10
173	002627	三峡旅游	44,950	283,634.50	0.10
174	603960	克来机电	13,800	283,590.00	0.10
175	002662	京威股份	78,104	283,517.52	0.10
176	002042	华孚时尚	74,313	280,903.14	0.10
177	002703	浙江世宝	18,000	280,080.00	0.10
178	688533	上声电子	3,900	278,616.00	0.09
179	002045	国光电器	32,556	278,353.80	0.09
180	300258	精锻科技	25,100	277,104.00	0.09
181	002328	新朋股份	47,073	276,318.51	0.09
182	600054	黄山旅游	22,500	276,300.00	0.09
183	603809	豪能股份	20,664	271,731.60	0.09
184	002959	小熊电器	4,300	268,019.00	0.09
185	603377	东方时尚	44,208	265,248.00	0.09
186	002512	达华智能	73,601	262,019.56	0.09
187	300160	秀强股份	32,091	260,899.83	0.09
188	601599	浙文影业	70,300	259,407.00	0.09

189	002418	康盛股份	78,600	258,594.00	0.09
190	603877	太平鸟	12,700	257,048.00	0.09
191	603313	梦百合	21,345	256,140.00	0.09
192	603786	科博达	4,100	252,437.00	0.09
193	600261	阳光照明	74,111	249,754.07	0.09
194	603355	莱克电气	9,820	247,758.60	0.08
195	002029	七匹狼	45,800	246,404.00	0.08
196	603558	健盛集团	20,104	245,670.88	0.08
197	300247	融捷健康	69,700	244,647.00	0.08
198	603319	湘油泵	12,872	244,053.12	0.08
199	600738	丽尚国潮	33,400	243,486.00	0.08
200	300304	云意电气	45,630	243,207.90	0.08
201	300616	尚品宅配	8,540	242,963.00	0.08
202	600824	益民集团	63,700	239,512.00	0.08
203	002860	星帅尔	16,020	237,256.20	0.08
204	002083	孚日股份	50,000	236,000.00	0.08
205	301073	君亭酒店	3,400	235,756.00	0.08
206	600327	大东方	46,400	234,320.00	0.08
207	603136	天目湖	8,157	233,779.62	0.08
208	000428	华天酒店	43,500	233,595.00	0.08
209	000996	中国中期	30,169	233,206.37	0.08
210	600730	中国高科	40,500	232,875.00	0.08
211	000753	漳州发展	60,100	231,986.00	0.08
212	600626	申达股份	57,800	231,200.00	0.08
213	603515	欧普照明	13,220	230,689.00	0.08
214	600818	中路股份	12,700	230,505.00	0.08
215	601007	金陵饭店	20,600	230,308.00	0.08
216	002406	远东传动	43,405	226,574.10	0.08
217	605136	丽人丽妆	14,100	223,062.00	0.08
218	300622	博士眼镜	8,900	217,872.00	0.07
219	300547	川环科技	13,400	217,616.00	0.07
220	000417	合肥百货	47,192	216,611.28	0.07
221	000524	岭南控股	17,400	215,760.00	0.07
222	002265	西仪股份	13,900	215,033.00	0.07
223	600698	湖南天雁	43,600	214,512.00	0.07
224	603158	腾龙股份	25,372	214,393.40	0.07
225	603730	岱美股份	16,342	214,243.62	0.07
226	605108	同庆楼	9,000	212,490.00	0.07
227	603982	泉峰汽车	8,700	212,193.00	0.07
228	002345	潮宏基	46,201	212,062.59	0.07
229	603610	麒盛科技	15,490	209,269.90	0.07
230	600661	昂立教育	20,000	207,000.00	0.07
231	002678	珠江钢琴	35,600	206,836.00	0.07
232	000026	飞亚达	19,325	206,584.25	0.07

233	003032	传智教育	14,200	203,770.00	0.07
234	002420	毅昌科技	27,900	203,670.00	0.07
235	300342	天银机电	22,107	203,384.40	0.07
236	002965	祥鑫科技	6,700	202,943.00	0.07
237	000521	长虹美菱	53,601	202,611.78	0.07
238	601116	三江购物	19,400	202,342.00	0.07
239	603587	地素时尚	12,760	202,246.00	0.07
240	301177	迪阿股份	2,700	200,340.00	0.07
241	601339	百隆东方	39,200	199,136.00	0.07
242	603303	得邦照明	12,640	194,782.40	0.07
243	002721	金一文化	50,054	194,710.06	0.07
244	002590	万安科技	21,001	194,049.24	0.07
245	002087	新野纺织	57,691	191,534.12	0.07
246	600960	渤海汽车	49,600	190,464.00	0.06
247	603013	亚普股份	13,500	188,595.00	0.06
248	688667	菱电电控	1,300	187,759.00	0.06
249	000850	华茂股份	49,500	186,120.00	0.06
250	300860	锋尚文化	3,900	184,197.00	0.06
251	300375	鹏翎股份	40,600	181,076.00	0.06
252	600854	春兰股份	31,700	181,007.00	0.06
253	600838	上海九百	24,500	180,565.00	0.06
254	300643	万通智控	12,200	180,194.00	0.06
255	600865	百大集团	16,245	179,669.70	0.06
256	605555	德昌股份	7,000	178,290.00	0.06
257	300272	开能健康	30,015	177,088.50	0.06
258	600857	宁波中百	15,700	176,311.00	0.06
259	300994	久祺股份	5,300	173,893.00	0.06
260	002758	浙农股份	13,200	173,844.00	0.06
261	002536	飞龙股份	26,121	172,921.02	0.06
262	002953	日丰股份	10,146	172,887.84	0.06
263	002397	梦洁股份	39,500	172,615.00	0.06
264	002404	嘉欣丝绸	30,000	172,500.00	0.06
265	300484	蓝海华腾	12,800	170,752.00	0.06
266	603889	新澳股份	27,000	170,640.00	0.06
267	603180	金牌厨柜	5,504	170,403.84	0.06
268	300969	恒帅股份	2,000	169,320.00	0.06
269	600814	杭州解百	25,300	168,498.00	0.06
270	300403	汉宇集团	25,724	168,492.20	0.06
271	002553	南方精工	18,000	168,480.00	0.06
272	601500	通用股份	37,300	167,477.00	0.06
273	000955	欣龙控股	37,400	167,178.00	0.06
274	603166	福达股份	22,500	166,725.00	0.06
275	603085	天成自控	19,700	166,268.00	0.06
276	002708	光洋股份	25,625	166,050.00	0.06

277	300577	开润股份	10,200	165,750.00	0.06
278	002863	今飞凯达	30,300	164,226.00	0.06
279	300100	双林股份	17,300	163,312.00	0.06
280	605333	沪光股份	7,000	161,700.00	0.06
281	002084	海鸥住工	40,585	159,904.90	0.05
282	605080	浙江自然	2,500	159,725.00	0.05
283	002676	顺威股份	37,700	158,717.00	0.05
284	002674	兴业科技	12,900	157,896.00	0.05
285	600081	东风科技	12,600	156,240.00	0.05
286	603001	奥康国际	20,900	155,287.00	0.05
287	603808	歌力思	15,895	153,863.60	0.05
288	603949	雪龙集团	5,600	153,552.00	0.05
289	002186	全聚德	16,000	153,280.00	0.05
290	002105	信隆健康	19,500	152,295.00	0.05
291	688386	泛亚微透	2,800	152,012.00	0.05
292	605336	帅丰电器	5,100	150,705.00	0.05
293	603579	荣泰健康	6,100	150,365.00	0.05
294	300464	星徽股份	21,500	149,210.00	0.05
295	301221	光庭信息	2,300	149,109.00	0.05
296	002571	德力股份	20,500	149,035.00	0.05
297	600178	东安动力	20,800	148,304.00	0.05
298	300928	华安鑫创	2,600	146,458.00	0.05
299	002631	德尔未来	22,700	146,415.00	0.05
300	300176	派生科技	27,094	146,036.66	0.05
301	300580	贝斯特	7,000	145,740.00	0.05
302	300651	金陵体育	5,690	145,095.00	0.05
303	600386	北巴传媒	35,200	144,672.00	0.05
304	603518	锦泓集团	18,000	144,360.00	0.05
305	603199	九华旅游	5,000	143,650.00	0.05
306	000419	通程控股	26,200	142,790.00	0.05
307	603239	浙江仙通	9,200	141,864.00	0.05
308	605128	上海沿浦	3,700	137,899.00	0.05
309	605068	明新旭腾	5,900	137,765.00	0.05
310	300824	北鼎股份	11,550	136,983.00	0.05
311	600693	东百集团	31,000	135,780.00	0.05
312	603519	立霸股份	11,800	135,346.00	0.05
313	300729	乐歌股份	7,700	135,135.00	0.05
314	300733	西菱动力	6,100	135,054.00	0.05
315	300816	艾可蓝	4,400	133,672.00	0.05
316	300863	卡倍亿	1,800	133,236.00	0.05
317	603366	日出东方	28,900	133,229.00	0.05
318	300473	德尔股份	7,100	131,563.00	0.04
319	002723	小崧股份	10,840	128,345.60	0.04
320	002780	三夫户外	9,500	128,250.00	0.04

321	002762	金发拉比	15,300	128,214.00	0.04
322	000757	浩物股份	29,077	127,938.80	0.04
323	601566	九牧王	14,894	126,003.24	0.04
324	003016	欣贺股份	15,000	126,000.00	0.04
325	301061	匠心家居	3,700	125,430.00	0.04
326	600280	中央商场	49,700	123,256.00	0.04
327	300707	威唐工业	7,200	121,752.00	0.04
328	002813	路畅科技	4,400	120,208.00	0.04
329	300893	松原股份	5,950	120,190.00	0.04
330	603788	宁波高发	9,640	120,114.40	0.04
331	002687	乔治白	26,860	120,064.20	0.04
332	300694	蠡湖股份	10,900	118,483.00	0.04
333	603311	金海高科	9,000	118,440.00	0.04
334	002870	香山股份	3,800	116,584.00	0.04
335	002634	棒杰股份	24,003	115,214.40	0.04
336	002790	瑞尔特	14,700	115,101.00	0.04
337	605299	舒华体育	10,500	114,660.00	0.04
338	301088	戎美股份	6,122	114,236.52	0.04
339	300945	曼卡龙	7,100	114,168.00	0.04
340	603023	威帝股份	24,400	113,704.00	0.04
341	002621	美吉姆	28,920	113,655.60	0.04
342	002825	纳尔股份	10,200	113,118.00	0.04
343	603214	爱婴室	6,200	111,910.00	0.04
344	002574	明牌珠宝	22,900	111,523.00	0.04
345	603040	新坐标	5,914	110,887.50	0.04
346	002763	汇洁股份	14,500	108,895.00	0.04
347	300918	南山智尚	12,700	108,585.00	0.04
348	603121	华培动力	15,119	107,344.90	0.04
349	605133	嵘泰股份	4,600	105,248.00	0.04
350	603266	天龙股份	7,000	104,790.00	0.04
351	603701	德宏股份	12,040	104,146.00	0.04
352	002187	广百股份	12,400	104,036.00	0.04
353	603608	天创时尚	22,140	102,508.20	0.03
354	603390	通达电气	12,500	101,875.00	0.03
355	603926	铁流股份	9,800	100,646.00	0.03
356	000526	学大教育	6,200	99,448.00	0.03
357	601279	英利汽车	14,400	98,352.00	0.03
358	301078	孩子王	6,705	98,295.30	0.03
359	002853	皮阿诺	8,100	96,795.00	0.03
360	300952	恒辉安防	5,400	93,960.00	0.03
361	605098	行动教育	3,365	93,412.40	0.03
362	301193	家联科技	3,400	92,310.00	0.03
362	300840	酷特智能	10,200	92,310.00	0.03
363	301020	密封科技	4,100	92,250.00	0.03

364	300926	博俊科技	3,900	91,065.00	0.03
365	300192	科德教育	14,400	89,712.00	0.03
366	300877	金春股份	5,400	89,424.00	0.03
367	001216	华瓷股份	6,700	86,095.00	0.03
368	605228	神通科技	10,800	83,484.00	0.03
369	301072	中捷精工	2,600	83,278.00	0.03
370	603922	金鸿顺	3,600	80,820.00	0.03
371	605599	菜百股份	7,400	80,512.00	0.03
372	603787	新日股份	5,400	80,136.00	0.03
373	603219	富佳股份	4,000	79,680.00	0.03
374	603048	浙江黎明	4,000	79,520.00	0.03
375	603726	朗迪集团	6,600	79,200.00	0.03
376	300998	宁波方正	2,601	78,680.25	0.03
377	605055	迎丰股份	11,700	78,273.00	0.03
378	605005	合兴股份	4,500	78,030.00	0.03
379	603178	圣龙股份	6,200	77,996.00	0.03
380	300901	中胤时尚	8,200	77,162.00	0.03
381	605319	无锡振华	5,300	77,062.00	0.03
382	603657	春光科技	5,160	76,884.00	0.03
383	301188	力诺特玻	4,300	76,540.00	0.03
384	301055	张小泉	4,300	76,454.00	0.03
385	605365	立达信	4,600	76,222.00	0.03
386	603038	华立股份	8,900	75,383.00	0.03
387	688288	鸿泉物联	3,300	74,877.00	0.03
388	603655	朗博科技	3,900	74,451.00	0.03
389	301066	万事利	5,180	73,866.80	0.03
390	003010	若羽臣	4,500	73,125.00	0.02
391	301000	肇民科技	2,380	73,018.40	0.02
392	605189	富春染织	3,600	72,288.00	0.02
393	301133	金钟股份	2,600	72,202.00	0.02
394	603511	爱慕股份	4,100	71,627.00	0.02
395	300658	延江股份	7,800	71,448.00	0.02
396	603839	安正时尚	10,160	71,221.60	0.02
397	001234	泰慕士	2,600	70,408.00	0.02
398	301011	华立科技	2,100	69,069.00	0.02
399	301113	雅艺科技	1,700	68,850.00	0.02
400	605138	盛泰集团	5,400	67,392.00	0.02
401	605151	西上海	3,700	65,712.00	0.02
402	603900	莱绅通灵	8,700	63,423.00	0.02
403	301007	德迈仕	4,203	63,339.21	0.02
404	300819	聚杰微纤	4,200	63,168.00	0.02
405	605180	华生科技	3,600	62,604.00	0.02
406	603150	万朗磁塑	2,100	62,517.00	0.02
407	605018	长华股份	3,900	61,932.00	0.02

408	301186	超达装备	1,800	61,794.00	0.02
409	603006	联明股份	6,600	60,126.00	0.02
410	301119	正强股份	1,900	59,432.00	0.02
411	301005	超捷股份	2,540	58,978.80	0.02
412	001209	洪兴股份	3,720	56,618.40	0.02
413	301022	海泰科	1,600	55,200.00	0.02
414	003041	真爱美家	3,520	54,876.80	0.02
415	300978	东箭科技	4,200	54,810.00	0.02
416	301001	凯淳股份	2,000	53,680.00	0.02
417	301008	宏昌科技	1,860	50,275.80	0.02
418	605188	国光连锁	5,900	42,716.00	0.01
419	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
420	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
421	301207	华兰疫苗	84	4,739.28	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	689009	九号公司	6,010,574.92	2.67
2	601888	中国中免	4,907,524.00	2.18
3	600690	海尔智家	2,395,964.00	1.06
4	600104	上汽集团	2,017,733.00	0.89
5	600660	福耀玻璃	1,973,524.00	0.88
6	601127	赛力斯	1,470,147.00	0.65
7	601633	长城汽车	1,109,870.00	0.49
8	688696	极米科技	1,034,780.23	0.46
9	600741	华域汽车	892,587.00	0.40
10	603816	顾家家居	884,147.90	0.39
11	601058	赛轮轮胎	860,993.00	0.38
12	601238	广汽集团	819,113.00	0.36
13	688169	石头科技	731,168.70	0.32
14	600733	北汽蓝谷	727,855.00	0.32
15	002091	江苏国泰	720,820.00	0.32
16	603486	科沃斯	718,978.00	0.32
17	601689	拓普集团	677,843.00	0.30
18	601799	星宇股份	649,085.00	0.29
19	600754	锦江酒店	618,076.00	0.27
20	603833	欧派家居	579,553.00	0.26

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	689009	九号公司	4,057,406.55	1.80
2	601888	中国中免	2,605,214.00	1.16
3	600690	海尔智家	1,322,809.00	0.59
4	600104	上汽集团	1,129,123.00	0.50
5	002594	比亚迪	958,448.00	0.43
6	000333	美的集团	806,678.00	0.36
7	600660	福耀玻璃	707,003.00	0.31
8	688208	道通科技	667,672.77	0.30
9	601633	长城汽车	611,283.00	0.27
10	002024	ST 易购	585,618.47	0.26
11	000651	格力电器	529,984.00	0.24
12	600741	华域汽车	501,666.00	0.22
13	601238	广汽集团	423,919.00	0.19
14	603486	科沃斯	406,755.00	0.18
15	601127	赛力斯	398,453.00	0.18
16	002759	天际股份	398,385.54	0.18
17	601799	星宇股份	393,614.00	0.17
18	300825	阿尔特	375,207.50	0.17
19	601689	拓普集团	345,397.00	0.15
20	600754	锦江酒店	330,239.00	0.15

7.4.3 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	58,977,799.26
卖出股票收入（成交）总额	36,713,363.20

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	18,000.95	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,000.95	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111005	富春转债	180	18,000.95	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	8,410.02
2	应收清算款	19,196,049.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,204,459.42

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	户均持有	持有人结构
-------	------	-------

(户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		广发中证全指可选消费交 易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金	
		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
1,695	90,947.55	146,472 ,788.00	95.02%	7,683,3 06.00	4.98%	146,006,15 7.00	94.71%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海惠澄资产管理有限公司-惠澄白泽一号私募证券投资基金	306,903.00	0.20%
2	涂慧芬	187,200.00	0.12%
3	苑桂花	100,006.00	0.06%
4	石崇清	100,000.00	0.06%
5	陈金华	87,011.00	0.06%
6	方福生	83,700.00	0.05%
7	王卫东	81,504.00	0.05%
8	郁佩颖	78,200.00	0.05%
9	孙治平	71,500.00	0.05%
10	魏波	69,000.00	0.04%
11	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	146,006,157.00	94.71%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 6 月 3 日）基金份额总额	838,156,094.00
本报告期期初基金份额总额	112,156,094.00
本报告期基金总申购份额	58,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	154,156,094.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	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	48,682,003.32	51.13%	35,611.72	51.01%	-
长江证券	2	27,630,476.01	29.02%	20,397.98	29.22%	-
粤开证券	3	18,866,454.49	19.81%	13,797.36	19.76%	-
广发证券	3	38,280.00	0.04%	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
招商证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国联证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (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、交易单元选择流程：

(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		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	-	-	-	-	-	-
长江证券	33,889.70	16.25%	-	-	-	-
粤开证券	93,825.27	44.98%	-	-	-	-
广发证券	80,900.00	38.78%	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-21
2	关于增加开源证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-02-28
3	关于增加华安证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-28
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-30
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-21

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20220101-20220630	104,000,757.00	57,032,900.00	15,027,500.00	146,006,157.00	94.71%
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： ① 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；							

- ② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- ③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- ④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，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；
- ⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。
- 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日