广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中小板300ETF
场内简称	中小300
基金主代码	159907
交易代码	159907
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年6月3日
报告期末基金份额总额	161,598,847.00份
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%。 一般情形下，本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑行业属性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中小板300价格指数。
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。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日-2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-3,798,546.74
2.本期利润	-22,861,126.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1403
4.期末基金资产净值	184,383,707.57
5.期末基金份额净值	1.1410

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）本基金已于2011年7月25日进行了份额折算，基金份额折算比例为0.90854670。

（4）本基金本报告期末还原后基金份额净值为1.0367。

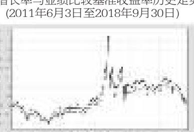
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-11.00%	1.38%	-11.60%	1.40%	0.60%	-0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011年6月3日至2018年9月30日）



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深300ETF联接基金的基金经理；广发中证500ETF基金的基金经理；广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理；广发沪深300ETF基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板300联接基金的基金经理；广发中证环保ETF联接基金的基金经理；广发军工ETF基金的基金经理；广发中证军工ETF联接基金的基金经理；广发中证环保ETF基金的基金经理；广发创业板ETF基金的基金经理；广发创业板ETF联接基金的基金经理；广发量化稳健混合基金的基金经理；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理；广发纳斯达克100指数（QDII）基金的基金经理；广发纳指100ETF基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）基金的基金经理；广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理；广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理；指数投资部总经理助理	2016-01-25	-	14年	刘杰先生，工学学士，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信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日至2016年1月17日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日至2018年4月25日）。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日起任职）、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理（自2014年4月1日起任职）、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2015年8月20日起任职）、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2016年1月18日起任职）、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2016年1月25日起任职）、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2016年1月25日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2016年8月30日起任职）、广发中证军工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2016年9月26日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年1月25日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年4月25日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2017年5月25日起任职）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自2017年8月4日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2018年4月26日起任职）、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）。

注：1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

（1）投资策略

作为ETF基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

（2）运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素；作为ETF基金，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响相对较小。

综合受到中美贸易战、去杠杆以及近期股票质押风险等不利因素的影响，整体市场的表现较欠佳，各大指数近期均已达到或接近近3年的底部区域，市场情绪较差，市场信心不足，同时市场风险也一定程度得到释放，未来机遇与挑战并存。 国际方面，由于原油价格上行、美债收益率上行、美股高波动趋势、中美摩擦等潜在风险点尚未消除，应以谨慎为主；国内方面，随着地方政府参与解决股权质押风险、沪伦通开通在即等积极因素汇聚，未来市场有一定修复市场情绪的可能。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-11.00%，同期业绩基准收益率为-11.60%，较好地跟踪了指数。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	181,771,220.57	98.07
	其中：股票	181,771,220.57	98.07
2	固定收益投资	141,984.00	0.08
	其中：债券	141,984.00	0.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,439,950.04	1.86
7	其他各项资产	2,663.74	0.00
8	合计	185,355,818.35	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,042,804.79	1.11
B	采矿业	815,089.98	0.44
C	制造业	122,207,085.11	66.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	580,905.04	0.32
E	建筑业	4,718,727.04	2.56
F	批发和零售业	7,509,156.12	4.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,715,117.66	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,417,258.60	10.53
J	金融业	7,809,900.93	4.24
K	房地产业	2,782,057.86	1.51
L	租赁和商务服务业	6,532,822.16	3.54
M	科学研究和技术服务业	112,488.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	829,880.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,782,891.48	0.97
R	文化、体育和娱乐业	2,915,493.80	1.58
S	综合	-	-
	合计	181,771,678.57	98.58

5.2.2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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002415	海康威视	253,432	7,283,635.68	3.95
2	002304	洋河股份	42,164	5,396,992.00	2.93
3	002027	分众传媒	438,196	3,729,047.96	2.02
4	002024	苏宁易购	261,596	3,526,314.08	1.91
5	002230	科大讯飞	115,988	3,313,777.16	1.80
6	002142	宁波银行	175,111	3,109,971.36	1.69
7	002594	比亚迪	62,278	3,057,849.80	1.66
8	002008	大族激光	66,378	2,812,435.86	1.53
9	002475	立讯精密	175,714	2,709,509.88	1.47
10	002450	康得新	152,350	2,591,473.50	1.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	141,984.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	141,984.00	0.08

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128035	大族转债	1,360	141,984.00	0.08

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,937.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	726.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,663.74

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128035	大族转债	141,984.00	0.08

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002450	康得新	2,591,473.50	1.41	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	164,598,847.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	161,598,847.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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
广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20180701-20180930	142,733,586.00	6,000,000.00	10,679,300.00	138,054,286.00	85.43%
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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新版；

5.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照；

6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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

9.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话95105828或020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	广发中小板300联接
基金主代码	270026
交易代码	270026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月9日
报告期末基金份额总额	181,401,138.94份
投资目标	通过将绝大部分基金资产投资于中小板300ETF，紧密跟踪标的指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为中小板300ETF联接基金。中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对中小板300价格指数紧密跟踪的被动式指数基金，本基金主要通过投资于中小板300ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。 当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期标的指数的成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。
业绩比较基准	中小板300价格指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，风险和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，主要投资于标的ETF，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。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159907
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年6月3日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年8月10日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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%。 一般情形下，本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑行业属性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中小板300价格指数。
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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日-2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-3,845,763.68
2.本期利润	-20,671,834.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1131
4.期末基金资产净值	171,939,109.04
5.期末基金份额净值	0.9478

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-10.76%	1.31%	-11.01%	1.33%	0.25%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011年6月9日至2018年9月30日）

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深300ETF联接基金的基金经理；广发中证500ETF基金的基金经理；广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理；广发沪深300ETF基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板300ETF基金的基金经理；广发中证环保ETF联接基金的基金经理；广发军工ETF基金的基金经理；广发中证军工ETF联接基金的基金经理；广发中证环保ETF基金的基金经理；广发创业板ETF基金的基金经理；广发创业板ETF联接基金的基金经理；广发量化稳健混合基金的基金经理；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理；广发纳斯达克100指数（QDII）基金的基金经理；广发纳指100ETF基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）基金的基金经理；广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理；广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理；指数投资部总经理助理	2016-01-25	-	14年	刘杰先生，工学学士，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信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日至2016年1月17日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日至2018年4月25日）。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日起任职）、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理（自2014年4月1日起任职）、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2015年8月20日起任职）、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2016年1月18日起任职）、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2016年1月25日起任职）、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2016年1月25日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2016年8月30日起任职）、广发中证军工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2016年9月26日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年1月25日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年4月25日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2017年5月25日起任职）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自2017年8月4日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2018年4月26日起任职）、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）。

注：1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

（1）投资策略

作为ETF联接基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中小300ETF及指数成份股等，间接复制指数，同时积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

（2）运作分析

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素；目前情况下，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响相对较小。

综合受到中美贸易战、去杠杆以及近期股票质押风险等不利因素的影响，整体市场的表现较欠佳，各大指数近期均已达到或接近近3年的底部区域，市场情绪较差，市场信心不足，同时市场风险也一定程度得到释放，未来机遇与挑战并存。 国际方面，由于原油价格上行、美债收益率上行、美股高波动趋势、中美摩擦等潜在风险点尚未消除，应以谨慎为主；国内方面，随着地方政府参与解决股权质押风险、沪伦通开通在即等积极因素汇聚，未来市场有一定修复市场情绪的可能。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-10.76%，同期业绩基准收益率为-11.01%，较好地跟踪了指数。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,567,572.73	2.64
	其中：股票	4,567,572.73	2.64
2	基金投资	157,519,940.33	91.11
3	固定收益投资	4,071.60	0.00
	其中：债券	4,071.60	0.00
	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	10,512,568.10	6.08
8	其他各项资产	291,129.70	0.17
9	合计	172,895,282.46	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	157,519,940.33	91.61

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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	53,448.00	0.03
B	采矿业	20,229.00	0.01
C	制造业	2,936,680.18	1.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,179.00	0.01
E	建筑业	125,901.00	0.07
F	批发和零售业	203,338.64	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	50,627.80	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	529,357.80	0.31
J	金融业	229,458.00	0.13
K	房地产业	65,588.00	0.04
L	租赁和商务服务业	212,956.60	0.12
M	科学研究和技术服务业	2,616.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	23,055.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,000.80	0.03
R	文化、体育和娱乐业	50,136.91	0.03
S	综合	-	-
	合计	4,567,572.73	2.66

5.3.2 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。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002415	海康威视	7,200	206,928.00	0.12
2	002304	洋河股份	1,100	140,800.00	0.08
3	002027	分众传媒	15,860	134,968.60	0.08
4	002024	苏宁易购	7,200	97,056.00	0.06
5	002230	科大讯飞	3,300	94,281.00	0.05
6	002142	宁波银行	5,100	90,576.00	0.05
7	002594	比亚迪	1,800	88,380.00	0.05
8	002008	大族激光	1,800	76,266.00	0.04
9	002475	立讯精密	4,790	73,861.80	0.04
10	002466	天齐锂业	1,500	57,045.00	0.03

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	4,071.60	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,071.60	0.00

5.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128035	大族转债	39	4,071.60	0.00

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2报告期本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,069.55
2	应收证券清算款	82,891.74
3	应收股利	-
4	应收利息	2,495.16
5	应收申购款	182,097.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,575.60
9	合计	291,129.70

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128035	大族转债	4,071.60	0.00

5.12.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	182,227,851.17
本报告期基金总申购份额	34,426,744.39
减：本报告期基金总赎回份额	35,253,456.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	181,401,138.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	37,160,163.51
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	37,160,163.51
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	20.49

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180710，20180712-20180722，20180731-20180930	37,160,163.51	-	-	37,160,163.51	20.49%
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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2.《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合同》；

3.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新版；

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照；

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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

9.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话95105828或020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中债7-10年国开债指数	
基金主代码	003376	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月26日	
报告期末基金份额总额	519,182,094.27份	
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	1.本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 2.本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以降低债券仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。	
业绩比较基准	标的指数"中债-7-10年期国开行债券指数"收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发中债7-10年国开债指数A	广发中债7-10年国开债指数C
下属分级基金的交易代码	003376	003377
报告期末下属分级基金的份额总额	246,366,944.20份	272,815,150.07份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日-2018年9月30日）	
	广发中债7-10年国开债指数A	广发中债7-10年国开债指数C
1.本期已实现收益	5,102,262.72	3,253,181.04
2.本期利润	3,395,193.91	3,018,526.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115	0.0132
4.期末基金资产净值	246,150,751.81	269,576,849.62
5.期末基金份额净值	0.9991	0.9881

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

1、广发中债7-10年国开债指数A：

阶段	净值增长率①	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	1.03%	0.14%	1.11%	0.15%	-0.08%	-0.01%

2、广发中债7-10年国开债指数C：

阶段	净值增长率①	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	0.97%	0.14%	1.11%	0.15%	-0.14%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金

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

(2016年9月26日至2018年9月30日)

1. 广发中债7-10年国开债指数A：

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王予柯	本基金的基金经理；广发聚盛混合基金的基金经理；广发安宏回报混合基金的基金经理；广发稳裕保本基金的基金经理；广发景盛纯债基金的基金经理；广发鑫隆混合基金的基金经理；广发景丰纯债基金的基金经理；广发集富纯债基金的基金经理；广发中证10年期国开债指数基金的基金经理；广发价值回报基金的基金经理；广发汇佳定期开放债券发起式基金的基金经理；广发汇康定开发起债基金的基金经理；广发中债1-3年农发债指数基金的基金经理；广发集泰债券基金的基金经理	2016-09-26	-	11年	王予柯先生，经济学硕士，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固定收益部债券交易员兼研究员、投资经理、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理（自2015年5月27日至2016年6月24日）、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月22日至2018年1月6日）。现任广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年12月25日起任职）、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年1月8日起任职）、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理（自2016年6月27日起任职）、广发景盛纯债债券型证券投资基金基金经理（自2016年8月30日起任职）、广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金经理（自2016年9月26日起任职）、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年11月7日起任职）、广发景丰纯债债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月23日起任职）、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理（自2017年1月13日起任职）、广发中证10年期国开债指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2017年11月15日起任职）、广发价值回报混合型证券投资基金基金经理（自2017年11月29日起任职）、广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自2018年3月12日起任职）、广发中债1-3年农发行债券指数证券投资基金基金经理（自2018年4月24日起任职）、广发集泰债券型证券投资基金基金经理（自2018年7月26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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》及其配套法规、《广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，利率债收益率先下后上，整体维持震荡：其中7月债市收益率整体区间震荡，8月中旬在经历过前期极度宽松的资金利率后，央行开始暂停公开市场操作叠加地方债的巨量供给挤出，引发资金利率和长端利率的连续调整，9月下旬地方债供给放缓、美联储加息国内未跟随带来市场情绪好转，收益率小幅下行。信用债方面，中低评级信用利差和等级利差继续小幅走阔。作为被动管理的指数基金，本基金继续针对目标指数进行优化抽样复制，力争控制跟踪误差，适度增强收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发中债7-10年国开债指数A类净值增长率为1.03%，广发中债7-10年国开债指数C类净值增长率为0.97%，同期业绩比较基准收益率为1.11%

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	497,723,179.40	96.19
	其中：债券	497,723,179.40	96.19
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	12,028,138.04	2.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	596,615.55	0.12
7	其他各项资产	7,107,899.88	1.37
8	合计	517,455,832.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	497,723,179.40	96.51
	其中：政策性金融债	497,723,179.40	96.51
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	497,723,179.40	96.51

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	180210	18国开10	1,700,000	167,841,000.00	32.54
2	170210	17国开10	900,000	87,966,000.00	17.06
3	160213	16国开13	900,000	82,251,000.00	15.95
4	160210	16国开10	700,000	64,799,000.00	12.56
5	018005	国开1701	244,340	24,534,179.40	4.76

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,901.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,683,369.93
5	应收申购款	419,628.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,107,899.88

5.11.4报告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。

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中债7-10年国开债指数A	广发中债7-10年国开债指数C
本报告期期初基金份额总额	357,158,795.12	255,890,765.87
本报告期基金总申购份额	56,938,887.26	371,298,457.89
减：本报告期基金总赎回份额	167,730,738.18	354,374,073.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	246,366,944.20	272,815,150.07

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180907-20180930	-	152,361,604.88	0.00	152,361,604.88	29.35%
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。							

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

（一）中国证监会批准广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金募集的文件

（二）《广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2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

9.3查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日