

广发中证全指信息技术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

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国银行股份有限公司托管人中国银行股份有限公司共同承担本报告期内基金财产净值变动情况的保证责任,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者风险自担,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。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指信息技术ETF
场内简称	信息技术
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	466,428,063.09份

1.3 主要财务指标和基金净值表现

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	-2,440,401.92
2.本期利润	-44,320,233.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0327
4.期末基金资产净值	394,299,461.57
5.期末基金份额净值	0.8455

1.4 管理人报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

名称	简称	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
农林牧渔	-	-	-	-
医药生物	-	-	-	-
信息技术	-	-	-	-
金融	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

2.1 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

2.2 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

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	223,754,404.42	56.75
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,315,967.68	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	159,308,223.89	40.30
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	523,212.00	0.13
P	综合	38,916,000.00	9.83
合计	-	396,890,400.99	98.11

3.1 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

3.2 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

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

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国银行股份有限公司托管人中国银行股份有限公司共同承担本报告期内基金财产净值变动情况的保证责任,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者风险自担,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。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指信息技术ETF联接
场内简称	信息技术联接
基金主代码	000042
交易代码	000042
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	326,019,307.28份

1.3 主要财务指标和基金净值表现

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	-4,340,709.86
2.本期利润	-18,344,743.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0322
4.期末基金资产净值	360,200,027.89
5.期末基金份额净值	1.0741

1.4 管理人报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

名称	简称	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
农林牧渔	-	-	-	-
医药生物	-	-	-	-
信息技术	-	-	-	-
金融	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

2.1 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

2.2 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

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	972,439.02	0.27
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	30,800.18	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	696,771.36	0.27
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	2,360.00	0.00
P	综合	1,762.00	0.00
合计	-	1,704,162.04	0.65

3.1 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

3.2 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

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

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国银行股份有限公司托管人中国银行股份有限公司共同承担本报告期内基金财产净值变动情况的保证责任,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者风险自担,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。
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指主要消费ETF
场内简称	主要消费
基金主代码	159946
交易代码	159946
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	19,306,700.69份

1.3 主要财务指标和基金净值表现

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	-4,153,901.27
2.本期利润	-2,069,089.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1082
4.期末基金资产净值	16,101,047.93
5.期末基金份额净值	0.8336

1.4 管理人报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

名称	简称	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
农林牧渔	-	-	-	-
医药生物	-	-	-	-
信息技术	-	-	-	-
金融	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

2.1 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

2.2 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

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	66,274.40	0.43
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	22,409.12	0.14
P	综合	22,186,716.03	138.00
合计	-	66,274.40	0.43

3.1 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。

3.2 基金业绩表现
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、诚信”的经营理念,坚持“价值投资、长期投资”的投资策略,在严格控制风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略进行投资管理,基金运作合规,基金资产净值稳步增长,基金份额持有人利益得到切实保障。