广发沪港深新机遇股票型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	广发沪港深股票
基金主代码	001764
交易代码	001764
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月27日
报告期末基金份额总额	1,496,548,412.56份
投资目标	本基金在深入研究的基础上,精选质地优良的境内市场股票以及香港市场股票进行投资,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为一只股票型基金,其股票投资比例占基金资产的比例不低于80%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内,本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析,合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	45%×沪深300指数收益率+45%×恒生指数收益率+10%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资于港股通标的股票,需承担汇率风险及境外市场风险。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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	-80,968,792.68
2.本期利润	-121,850,121.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0773
4.期末基金资产净值	1,488,147,140.08
5.期末基金份额净值	0.994

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。

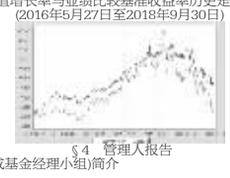
3.2 基金净值表现

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	-7.28%	1.41%	-2.60%	0.98%	-4.68%	0.43%

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

广发沪港深新机遇股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年5月27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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
余昊	本基金的基金经理;广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理;广发沪港深先锋混合基金的基金经理;广发中小盘精选混合基金的基金经理	2016-06-07	-	8年	余昊先生,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研究发展部研究员、国际业务部研究员、基金经理助理、投资经理。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2017年2月28日至2018年4月18日)。现任广发沪港深新机遇股票型证券投资基金基金经理(自2016年6月7日起任职)、广发全球精选股票型证券投资基金基金经理(自2016年10月27日起任职)、广发沪港深行业龙头混合型证券投资基金基金经理(自2018年3月21日起任职)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自2018年5月4日起任职)。
吴健飞	本基金的基金经理;广发国际资产管理有限公司权益投资总监	2018-04-10	2018-09-18	13年	吴健飞先生,文学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任彭博资讯高级数据分析师、贝莱德资产管理公司数据分析经理、华夏基金管理有限公司行业研究员,华夏基金(香港)有限公司基金经理,慧业源资本顾问(香港)有限公司基金经理、广发基金管理有限公司国际业务部研究员、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金基金经理(自2018年4月10日至2018年9月18日)。现任广发国际资产管理有限公司权益投资总监。

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、《广发沪港深新机遇股票型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,本基金没有发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

2018年三季度,全球市场继续大幅分化,港股和A股市场继续走弱,美国市场表现强劲甚至获得历史新高。核心原因是在美国经济增速强劲,美联储退出宽松的货币政策中,新兴市场普遍承压。同时,中国经济增速下滑,也对港股和A股造成了负面的影响。三季度开始,市场对中国企业盈利增速预期出现下调,8月中报期前后下滑预期得到加强。这是16年企业盈利增速预期开始上调后,首次的掉头向下。虽然中报业绩的整体表现尚可,特别是周期性品种业绩弹性十足,但是由于地产销售减速、去杠杆、环保、贸易战等因素,市场对未来的盈利较为悲观。同时,在9月和十一假期,从宏观数据到微观行业经营趋势,都显示出疲态,也验证了市场的悲观预期。管理人认为,盈利增速的下调尚在进行当中,外资对港股的观点也在不断修正,从不理解内地投资者的悲观态度,到逐步接受盈利增速下调的情况。这个因素也是这几个月港股大幅下跌的主要原因之一。另一方面,贸易战的进展越发僵局,对市场情绪和明年经济预期也造成负面影响。

由于本基金是股票型基金,故一直保持了八成以上的合规仓位。广发沪港深新机遇2018年三季度在行业方面,主要关注公用事业、油气和金融。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为-7.28%,同期业绩比较基准收益率为-2.60%。

§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	1,434,415,272.86	94.74
	其中:股票	1,434,415,272.86	94.74
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	78,314,182.18	5.17
7	其他各项资产	1,366,686.64	0.09
8	合计	1,514,096,141.68	100.00

注:权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为940,419,944.90元,占基金资产净值比例63.19%。

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	-	-
B	采矿业	28,332,170.00	1.90
C	制造业	353,992,068.62	23.79
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,163,283.38	1.76
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	85,507,805.96	5.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	493,995,327.96	33.20

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
金融	182,544,817.94	12.27
公用事业	177,272,615.12	11.91
工业	136,897,408.19	9.20
非日常生活消费品	105,334,916.32	7.08
信息技术	103,945,044.10	6.98
原材料	88,395,619.24	5.94
医疗保健	71,458,618.82	4.80
能源	43,243,453.24	2.91
日常消费品	31,327,451.93	2.11
合计	940,419,944.90	63.19

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
(2)由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	600585	海螺水泥	3,186,340	117,225,448.60	7.88
2	00002	中电控股	1,139,000	91,857,408.53	6.17
3	601888	中国国旅	1,257,098	85,507,805.96	5.75
4	03808	中国重汽	4,353,000	65,270,396.25	4.39
5	01299	友邦保险	1,010,800	62,172,796.25	4.18
6	00006	电能实业	1,222,500	58,627,768.69	3.94
7	00700	腾讯控股	203,400	57,846,927.46	3.89
8	03323	中国建材	9,172,000	56,092,764.73	3.77
9	600309	万华化学	1,270,100	53,941,147.00	3.62
10	01169	海尔电器	2,681,000	50,131,851.44	3.37

5.4 报告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。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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	138,276.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,185,792.51
4	应收利息	14,134.05
5	应收申购款	28,484.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,366,686.64

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

本报告期期初基金份额总额	1,672,572,470.27
本报告期基金总申购份额	117,890,172.65
减:本报告期基金总赎回份额	293,914,230.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,496,548,412.56

§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	43,781,961.47
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	10,945,490.40
报告期期末管理人持有的本基金份额	32,836,471.07
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.19

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2018-07-16	-912,124.20	-961,109.83	-
2	赎回	2018-07-20	-912,124.20	-955,664.45	-
3	赎回	2018-07-24	-912,124.20	-960,202.26	-
4	赎回	2018-07-31	-912,124.20	-962,017.39	-
5	赎回	2018-08-08	-912,124.20	-921,177.03	-
6	赎回	2018-08-15	-912,124.20	-913,916.52	-
7	赎回	2018-08-22	-912,124.20	-895,765.26	-
8	赎回	2018-08-29	-912,124.20	-909,378.71	-
9	赎回	2018-09-05	-912,124.20	-891,227.43	-
10	赎回	2018-09-12	-912,124.20	-832,238.80	-
11	赎回	2018-09-19	-912,124.20	-856,740.01	-
12	赎回	2018-09-27	-912,124.20	-899,395.50	-
合计			-10,945,490.40	-10,958,830.19	

注:赎回费55069.51元。

§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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180927-20180930	299,671,763.92	-	-	299,671,763.92	20.02%

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沪港深新机遇股票型证券投资基金募集的文件
(二)《广发沪港深新机遇股票型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)《广发沪港深新机遇股票型证券投资基金托管协议》
(五)《广发沪港深新机遇股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版
(六)法律意见书
(七)基金管理人业务资格批件、营业执照
(八)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

广发沪深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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	广发沪深300联接
基金主代码	ZF0010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月30日
报告期末基金份额总额	1,299,127,942.91份
投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF,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	本基金为ETF联接基金,主要通过投资于目标ETF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的绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,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,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	中国工商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	广发沪深300ETF联接A / 广发沪深300ETF联接C
下属两级基金的交易代码	ZF0010 / 002987
报告期末下属两级基金的份额总额	815,713,881.19份 / 483,414,061.72份

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年8月20日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年9月9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	中国工商银行股份有限公司

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	主要采取完全复制策略,围绕标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	标的指数为沪深300指数。业绩比较基准为标的指数收益率。
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) 广发沪深300ETF联接A	广发沪深300ETF联接C
1.本期已实现收益	6,095,906.76	3,094,441.38
2.本期利润	6,142,705.00	6,745,220.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0085	0.0140
4.期末基金资产净值	1,317,791,434.69	775,570,365.39
5.期末基金份额净值	1.6155	1.6044

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.广发沪深300ETF联接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	-0.90%	1.25%	-1.95%	1.29%	1.05%	-0.04%

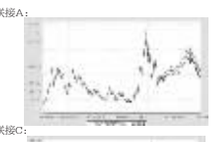
2.广发沪深300ETF联接C:

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	-1.02%	1.24%	-1.95%	1.29%	0.93%	-0.05%

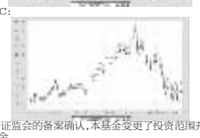
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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
(2008年12月30日至2018年9月30日)

1. 广发沪深300ETF联接A:



2. 广发沪深300ETF联接C:



注:经2016年1月25日中国证监会的备案确认,本基金变更了投资范围并更名为"广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金"。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘杰	本基金的基金经理;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;广发量化稳健混合基金的基金经理;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	2014-04-01	-	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人力资源部人员、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)、广发沪深300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)、广发沪深300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2016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)、广发中证环保ETF基金的基金经理;广发创业板ETF基金的基金经理(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)、广发量化稳健混合基金的基金经理(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26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)、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(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、《广发沪深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。

本报告期内,本基金没有发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

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、《广发沪深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。

本报告期内,本基金没有发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

作为指数基金,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。

本基金是ETF联接基金,将主要持有广发沪深300ETF及指数成分股,间接复制指数,本质上依然是被动投资策略,跟踪效果与直接持有成分股效果相同,同时作为联接基金,可参与场内折溢价套利等交易,更有利于广发沪深300ETF及其联接基金持有人的利益。

(2)运作分析

报告期内,本基金跟踪误差来源主要是成分股调整、申赎因素和停牌股票估值调整因素,目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

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、美俄收益率上行、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A类份额净值增长率为-0.90%,C类份额净值增长率为-1.02%,同期业绩基准收益率为-1.95%,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	1,055,098.43	0.05
	其中:股票	1,055,098.43	0.05
2	基金投资	1,962,891,920.82	93.47
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	117,004,324.25	5.57
8	其他各项资产	19,168,245.20	0.91
9	合计	2,100,119,588.70	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	广发沪深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	1,962,891,920.82	93.77

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	34,424.00	0.00
B	采矿业	198,061.95	0.01
C	制造业	324,086.20	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	197,449.86	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,699.60	0.00
J	金融业	279,376.82	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管