广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发安富回报混合	
基金主代码	002107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月29日	
报告期末基金份额总额	266,281,307.09份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过对不同资产类别的优化配置,充分挖掘市场潜在的投资机会,力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上,判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势,分析不同政策对各类资产的市场影响,评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值,根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置,确定合适的资产配置比例,并适时进行调整。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率。	
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发安富回报混合A	广发安富回报混合C
下属分级基金的交易代码	002107	002108
报告期末下属分级基金的份额总额	265,797,373.43份	483,933.66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(2017年1月1日-2017年3月31日)	
	广发安富回报混合A	广发安富回报混合C
1.本期已实现收益	6,231,021.76	12,011.29
2.本期利润	8,577,392.99	16,391.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0323	0.0318
4.期末基金资产净值	242,738,226.57	441,795.61
5.期末基金份额净值	0.913	0.913

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.广发安富回报混合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	3.63%	0.52%	1.09%	0.17%	2.54%	0.35%

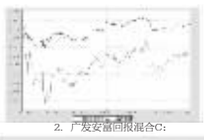
2.广发安富回报混合C:

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	3.63%	0.51%	1.09%	0.17%	2.54%	0.34%

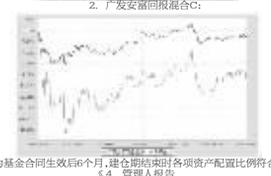
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金
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
(2015年12月29日至2017年3月31日)

1. 广发安富回报混合A:



2. 广发安富回报混合C:



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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		
张军	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理;广发集鑫债券基金的基金经理;广发鑫裕混合基金的基金经理;广发集裕债券基金的基金经理;广发集丰债券基金的基金经理;广发集安债券基金的基金经理;广发集颐债券基金的基金经理;固定收益投资总监,固定收益部总经理	2015-12-29	-	16年	女,中国籍,金融学硕士、MBA,持有中国证券投资基金业从业证书,2001年6月至2012年2月曾在中国银河证券研究中心、中国人保资产管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司从事固定收益类投研工作,2012年2月起任广发基金管理有限公司固定收益部总经理,2012年12月14日起任广发纯债债券基金的基金经理,2013年7月12日起任广发聚鑫债券基金的基金经理,2015年11月23日至2016年12月7日任广发聚盛混合基金的基金经理,2015年12月25日起任广发集鑫债券基金的基金经理,2015年12月29日任广发安富回报混合基金的基金经理,2015年12月30日至2017年2月5日任广发安宏回报混合基金的基金经理,2016年3月1日起任广发鑫裕混合基金的基金经理,2016年5月11日起任广发集裕债券基金的基金经理,2016年5月30日起任广发基金管理有限公司固定收益投资总监,2016年11月1日起任广发集丰债券基金的基金经理,2017年1月20日起任广发集安债券和广发集颐债券基金的基金经理。

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、《广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金合同》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。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。监察稽核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,本基金合规稳健运作,投资组合在投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济企稳,政策转向结构性调整,货币政策稳中趋紧。部分品种估值合理,本基金坚持重点行业和品种持仓,适当增加周期股配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

广发安富A类本报告期净值增长率为3.63%,广发安富C类本报告期净值增长率为3.63%,同期业绩比较基准收益率为1.09%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内国际形势错综复杂,宏观经济转向调结构,货币政策不会明显放松。权益市场估值合理,但是市场难以走出趋势性行情。本基金坚持价值投资理念,适当持有估值合理的成长股。

§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	172,295,047.11	63.24
	其中:股票	172,295,047.11	63.24
2	固定收益投资	79,991,004.40	29.36
	其中:债券	79,991,004.40	29.36
	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	14,994,142.49	5.50
	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	4,185,806.08	1.54
7	其他各项资产	972,863.00	0.36
8	合计	272,438,923.08	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

序号	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	24,476,631.13	10.07
C	制造业	80,534,073.63	33.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,167,905.97	0.48
E	建筑业	212,432.50	0.09
F	批发和零售业	12,926,325.60	5.32
G	交通运输、仓储和邮政业	56,981.19	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,722,505.45	14.28
J	金融业	4,811,932.20	1.98
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	16,930.16	0.01
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	13,369,329.28	5.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	172,295,047.11	70.85

5.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	000028	国药一致	169,970	12,795,341.60	5.26
2	300137	先河环保	779,093	12,036,986.85	4.95
3	002450	康得新	622,265	11,897,706.80	4.89
4	300244	迪安诊断	382,264	11,857,829.28	4.88
5	600887	伊利股份	593,045	11,214,480.95	4.61
6	601600	中国铝业	2,293,409	10,664,351.85	4.39
7	600362	江西铜业	613,146	10,576,768.50	4.35
8	002439	启明星辰	484,867	9,610,063.94	3.95
9	600497	驰宏锌锗	1,342,961	9,360,438.17	3.85
10	002268	卫士通	281,777	9,112,668.18	3.75

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	9,967,000.00	4.09
	其中:政策性金融债	9,967,000.00	4.09
4	企业债券	19,260,000.00	7.92
5	企业短期融资券	29,960,000.00	12.32
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	20,814,004.40	8.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,991,004.40	32.89

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	011752016	17德力西SCP001	200,000	19,954,000.00	8.21
2	127400	16广晟01	200,000	19,260,000.00	7.92
3	113008	电气转债	118,000	13,502,740.00	5.55
4	011762014	17西江SCP001	100,000	10,006,000.00	4.11
5	170301	17进出01	100,000	9,957,000.00	4.09

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	235,787.43
2	应收证券清算款	514,034.68
3	应收股利	-
4	应收利息	223,040.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	972,863.00

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	113008	电气转债	13,502,740.00	5.55
2	110031	航信转债	3,105,000.00	1.28
3	110035	白云转债	1,945,339.20	0.80
4	110032	三一转债	819,622.80	0.34

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	广发安富回报混合A	广发安富回报混合C
本报告期期初基金份额总额	265,724,288.16	497,132.04
本报告期基金总申购份额	137,996.30	126,112.76
减:本报告期基金总赎回份额	64,911.03	139,311.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	265,797,373.43	483,933.66

§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	20170101-20170331	265,037,606.17	0.00	0.00	265,037,606.17	99.53%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,在极端市场行情或遇其他流动性缺乏时,基金份额较大比例的集中赎回将使基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,因而对基金的正常运作和基金净值的计算造成影响,从而影响投资者的利益。							

§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安富回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《广发安富回报灵活配置混合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)《广发安富回报灵活配置混合型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。

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
二〇一七年四月二十二日

广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:二〇一七年四月二十二日

§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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300ETF
基金主代码	510360
交易代码	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
报告期末基金份额总额	2,084,381,165.00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策略,即按照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。在一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。
业绩比较基准	本基金的标的指数为沪深300指数。本基金的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。
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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	16,826,261.32
2.本期利润	90,250,860.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0441
4.期末基金资产净值	2,228,922,395.31
5.期末基金份额净值	1.0693

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。

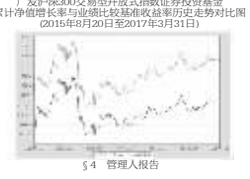
3.2 基金净值表现

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	4.62%	0.50%	4.41%	0.51%	0.21%	-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

广发沪深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
(2015年8月20日至2017年3月31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及联接(LOF)基金的基金经理;广发沪深300ETF基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理;广发养老指数基金的基金经理;广发环保指数基金的基金经理;广发中证军工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;数量投资部总经理助理	2015-08-20	-	13年	男,中国籍,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司信息技术部工作,2010年11月至2014年3月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员,2014年4月1日至2016年1月17日任广发沪深300指数基金的基金经理,2014年4月1日起任广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理,2015年8月20日起任广发沪深300ETF基金的基金经理,2016年1月18日起任广发中小板300ETF及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理,2016年1月28日起任数量投资部总经理助理,2016年8月30日起任广发中证军工ETF基金的基金经理,2016年9月26日起任广发中证军工ETF联接基金的基金经理,2017年1月25日起任广发中证环保ETF基金的基金经理。

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、《广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金合同》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。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。监察稽核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,本基金合规稳健运作,投资组合在投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金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,本基金日均跟踪误差为0.01%,符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

报告期内,本基金跟踪效果来源主要是成分股调整、申购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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类份额的净值增长率为4.38%,C类份额的净值增长率为4.26%,同期业绩比较基准收益率为4.20%,较好地跟踪了指数。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受益于全球经济总体向好的趋势,1季度A股市场延续了去年下半年震荡向上的趋势行情。国际方面,全球经济政策不确定性指数明显回落,尤其美国经济持续稳步扩张,就业形势继续改善,通胀动力市场偏紧,而特朗普上台后一直在酝酿财政刺激政策,未来美国的进一步复苏也会给全球制造业带来一定的提振;国内方面,中国经济景气程度显著回升,1季度房地产投资、基建、制造业投资等内需延续复苏,同时总体经济政策依然是保持稳中求进,供给侧改革的推进也在逐步优化经济结构和改善行业格局。

展望2季度,中美贸易朝着积极的方向发展,近期"习特会"的共识使得中美之间全面贸易战的可能性大大降低,未来中国的进出口有望延续回升,同时在更稳定更健康的监管政策引导下,在房地产调控、混改、雄安新区、粤港澳大湾区等等手段或概念推进下,未来市场有望保持稳中求进的态势,未来股市整体上有望延续震荡向上的趋势。

沪深300的大盘蓝筹覆盖面相对于与上证50、上证180要大,代表性更好,风险相对于创业板等高估值板块更小,因此对于风险承受力较低的投资者而言,选择沪深300指数基金是个不错的享受行情反弹的品种。

§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	2,169,282,395.64	97.24
	其中:股票	2,169,282,395.64	97.24
2	固定收益投资	2,853,000.00	0.13
	其中:债券	2,853,000.00	0.13
	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	58,321,667.33	2.61
7	其他各项资产	375,323.26	0.02
8	合计	2,230,832,386.23	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的合计项本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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,724,807.40	0.26
B	采矿业	73,460,688.79	3.30
C	制造业	746,417,523.18	33.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,083,941.73	2.70
E	建筑业	104,208,143.77	4.68
F	批发和零售业	48,303,350.82	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	66,059,344.85	2.96
H	住宿和餐饮业	750,880.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,000,770.60	5.61
J	金融业	754,971,726.08	33.87
K	房地产业	98,424,426.79	4.42
L	租赁和商务服务业	23,854,764.54	1.07
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	16,515,896.78	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,581,007.17	0.12
R	文化、体育和娱乐业	28,635,009.97	1.28
S	综合	12,698,552.61	0.57
	合计	2,167,707,765.24	97.25

5.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	601318	中国平安	2,506,900	92,780,369.00	4.16
2	601166	兴业银行	3,080,701	49,938,163.21	2.24
3	600519	贵州茅台	122,513	47,334,122.68	2.12
4	600016	民生银行	5,478,612	46,458,629.76	2.08
5	600036	招商银行	2,381,666	45,656,537.22	2.05
6	601328	交通银行	6,358,429	39,613,012.67	1.78
7	000651	格力电器	1,113,500	35,297,950.00	1.58
8	000333	美的集团	986,611	32,854,146.30	1.47
9	600000	浦发银行	2,006,378	32,122,111.78	1.44
10	601668	中国建筑	3,460,331	31,835,045.20	1.43

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)	2,853,000.00	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,853,000.00	0.13

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	113011	光大转债	28,530	2,853,000.00	0.13

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-31,020.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					43,800.00

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值主要目的。在构建股票投资组合的同时,通过卖出股指期货对冲市场下行风险,降低系统风险损失,提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

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	92,990.00
2	应收证券清算款	269,871.16
3	应收股利	-
4	应收利息	12,462.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	375,323.26

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	广发沪深300ETF联接A	广发沪深300ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	767,516,821.88	466,691,519.30
本报告期基金总申购份额	145,362,736.70	689,620,713.48
减:本报告期基金总赎回份额	162,469,415.16	404,071,161.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	750,410,143.42	752,241,070.85

§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	20170101-20170331	263,252,116.63	586,106,898.93	193,000,000.00	656,359,015.56	43.68%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,在极端市场行情或遇