

## 2017年第四季度报告

单位:份			
项目	广发中证全指建筑材料指数 基金 A	广发中证全指建筑材料指数 基金 C	
报告期期初基金份额总额	12,422,584.36	750,787.44	
报告期基金总申购份额	2,335,124.77	15,853,967.67	
减:报告期基金总赎回份额	2,661,956.92	10,092,061.75	
报告期期末基金份额总额	12,096,139.91	6,512,693.36	

**§ 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			
项目	广发中证全指建筑材料指数 基金 A	广发中证全指建筑材料指数 基金 C	
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,800.08	-	
报告期期间买入/申购总份额	-	-	
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,800.08	-	
报告期期末管理人持有的本基金份额占本基金总份额比例	53.75%	-	

**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,基金管理人存在运用固有资金(A)申购、赎回或买卖本基金的情况。

**§ 8 报告期末本基金基金总资产持有资产情况**

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例	发起份额 总数	发起份额 占基金总 比例	发起份额 是否持有 限制
基金管理人固有资金	10,001,800.08	53.75%	10,001,800.08	53.75%	-
基金管理人高级管理人员/基金经理等个人	-	-	-	-	-
其他关联方	-	-	-	-	-

[illegible]

§ 10 非公开发行目录

10.1 非公开发行目录

(一) 中国证监会注册广东中正国信建筑材料指数型发起式证券投资基金募集的文件

(二) 广东中正国信建筑材料指数型发起式证券投资基金合同

(三) 广发基金管理有限公司开放式基金业务规则

(四) 广东中正国信建筑材料指数型发起式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

10.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南座 31-33 楼

10.3 查阅方式

1. 非营业时间: 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, 也可按本费工本费购买复印件。

2. 网站浏览: 基金管理人网址: <http://www.gfund.com.cn>。

广发基金管理有限公司  
二〇一八年一月二十日

## 2017年第四季度报告

序号	名称	金额(元)
1	应收保证金	5,791,142
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	254,211
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,045,353

5.11.4 报告期末持有的处于质押、冻结等受限状态的资产说明  
 本基金本报告期末未持有处于质押、冻结等受限状态的资产。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在受限情况说明

序号	股票代码	股票名称	期末持仓股数(股)	占基金资产净值比例(%)	受限情况说明
1	600157	永泰能源	4,534,756.80	3.76	重大资产重组停牌

**§ 6 开放式基金资产变动**

	单位：元
本报告期期初基金资产净值	145,072,327.00
本报告期基金申购净收入	47,500,000.00
减：本报告期基金赎回净支付	36,000,000.00
本报告期基金公允价值变动	-
本报告期末基金资产净值	156,572,327.00

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

7 基金管理人运用固有资金投资本基金说明							
<p>报告期内，基金管理人不存在运用固有资金买入(申购)、赎回或卖出本基金的情况。</p>							
8.1 报告期内前十大投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况							
投资者名称		报告期初持有基金份额及变化情况			报告期末持有基金份额		
序号		持有基金份额达到或超过 20% 的比例区间	期初时	非份额	期间净增	持有份额	份额占比
1	中广核金融资产交易平台开放式理财产品投资基金	2017 年 301,711,712	84,360,786.00	47,000,000.00	30,269,070.00	101,099,710.00	64.57%
产品存在风险							
<p>报告期内，上述基金存在单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情况，由此可能导致该等持有人主要影响、支配或者变相支配基金的投资运作。当该投资者的大额赎回可能会对基金资产净值及基金的投资运作产生较大影响，根据前述《基金管理人关于及时识别和处置基金产品应对投资者的赎回申请，首个投资者赎回金额不得超过前一个工作日基金资产净值的 5000 万元》基金合同规定，基金管理人将采取以下措施予以其他基金在公开交易之基金之间等：基金管理人将对大宗赎回进行审慎评估并提前沟通，完善流动性风险管理控制，切实保护持有人利益。</p>							
9 9 重要文件目录							
<p>(一)中国证监会核准发行证券批准通知书和基金募集说明书及基金募集的附件</p> <p>(二)广发中证全指能源行业指数证券投资基金基金合同</p> <p>(三)广发中证全指能源行业开放式证券投资基金证券投资基金管理协议</p> <p>(四)法律意见书</p> <p>(五)基金管理人业务资格批文、营业执照</p> <p>(六)基金托管人业务资格批文、营业执照</p>							
9.2 存放地点							
广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南座 31-33 楼							
9.3 查阅方式							
1、自然人需：查询时间为每周工作日 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、机构投资者，基金管理人：每日工作小时，通过 <a href="http://www.gfund.com">www.gfund.com</a> 查阅。							
广东基金管理有限公司						二〇一八年一月二十	

## 2017年第四学期招生

单位: 份

项目	广发中证全指汽车指数 A	广发中证全指汽车指数 C	
报告期期初基金份额总额	15,517,699.27	9,763,707.54	
报告期基金总申购份额	20,504,952.22	42,399,613.52	
减: 报告期基金总赎回份额	17,141,206.07	40,781,562.52	
报告期基金净申购/赎回份额	-	-	
报告期期末基金份额总额	17,881,445.42	11,341,758.99	

## § 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

项目	广发中证全指汽车指数 A	广发中证全指汽车指数 C	
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,200.02	-	
报告期管理人买入/卖出基金份额	-	-	
报告期期末管理人持有/卖出基金份额	-	-	
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,200.02	-	
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	34.22	-	

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末, 本基金资产不存在运用固有资金(§ 3.4)申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 报告期各期末本基金投资资产配置情况

项目	持有份额总额	持有份额占基金总份额比例	发起份额总额	发起份额占基金总份额比例	发起份额占总持有份额
基金管理人固有资金	10,001,200.02	34.22%	10,001,200.02	34.22%	三折
基金管理人	-	-	-	-	-

[illegible]

10. 备查文件目录

(一)中国证监会核准《广发中证国寿养老指数型发起式证券投资基金募集的文件》

(二)《广发中证国寿养老指数型发起式证券投资基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发中证国寿养老指数型发起式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

12. 存放地点

广州市珠江新城华夏大道1号保利国际广场南塔31-33楼

13. 查阅方式

1. 免费查阅, 查阅时间为每日工作 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. 网站查询, 基金管理人网站: <http://www.gffunds.com.cn>.

广发基金管理有限公司  
二〇一八年一月二十日