广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:二〇一八年一月二十日

§ 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 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 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	1,196,381,165.00 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 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	131,213,026.11
2.本期利润	97,971,479.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0582
4.期末基金资产净值	1,513,755,980.96
5.期末基金份额净值	1.2653

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	4.69%	0.77%	5.07%	0.80%	-0.38%	-0.03%

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 12 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 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;广发环保指数基金的基金经理;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 联接基金的基金经理;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;指数投资部总经理助理	2015-08-20	-	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)。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 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(LOF)基金的基金经理;广发环保指数基金的基金经理;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 联接基金的基金经理;广发量化稳健混合基金的基金经理;指数投资部总经理助理

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。金融工程与风险管理部风险控制阶段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,本基金日均跟踪误差为 0.04%,符合要求。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要是成分股调整、申购和赎回因素;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。

四季度,整体市场风格延续了全年的市场偏好,即大盘蓝筹表现更好,市场继续延续了"白马"行情,从行业角度看,食品饮料、家电、医药等行业表现较好。

2017 年中国经济出现了企稳回升态势,主要受益于供给侧改革和外需改善。出口方面,在全球经济复苏的带动下,2017 年前 11 个月中国货物贸易总额超过 25 万亿元人民币,比上年同期增长 15.6%,增速创 6 年来新高。在内需方面,消费已经成为中流砥柱,2017 年前 3 季度,社会消费品零售总额同比增长 10.4%,增速与上年同期持平。二级市场大趋势的变化,或许能够从经济结构方面的细微变化找到部分答案,总体上未来也继续看好整体市场的结构性机会。

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 4.69%,同期业绩比较基准收益率为 5.07%。

§ 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	1,492,080,592.14	97.75
	其中:股票	1,492,080,592.14	97.75
2	固定收益投资	978,300.00	0.06
	其中:债券	978,300.00	0.06
	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	33,295,708.55	2.18
7	其他各项资产	69,275.84	0.00
8	合计	1,526,423,876.53	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	3,572,976.30	0.24
B	采矿业	48,513,806.01	3.20
C	制造业	590,352,471.47	39.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,634,099.60	2.62
E	建筑业	57,111,222.33	3.77
F	批发和零售业	29,595,111.14	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	47,647,820.68	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,728,791.73	3.88
J	金融业	500,419,686.46	33.06
K	房地产业	72,306,035.81	4.78
L	租赁和商务服务业	16,590,569.08	1.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,689,132.48	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,254,835.15	0.28
R	文化、体育和娱乐业	12,342,713.90	0.82
S	综合	1,321,320.00	0.09
	合计	1,492,080,592.14	98.57

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	601318	中国平安	1,377,700	96,411,446.00	6.37
2	600519	贵州茅台	58,813	41,021,479.37	2.71
3	600036	招商银行	1,318,066	38,250,275.32	2.53
4	000333	美的集团	571,111	31,656,682.73	2.09
5	601166	兴业银行	1,590,401	27,020,912.99	1.79
6	000651	格力电器	604,900	26,434,130.00	1.75
7	600887	伊利股份	766,700	24,680,073.00	1.63
8	600016	民生银行	2,923,112	24,524,909.68	1.62
9	601328	交通银行	3,489,803	21,671,676.63	1.43
10	000858	五粮液	244,000	19,490,720.00	1.29

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)	978,300.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	978,300.00	0.06

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	128024	宁行转债	9,783	978,300.00	0.06

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)					129,930.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

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符合既定的投资政策和投资目标,主要目的是套期保值。在投资的过程中,本基金力争利用股指期货的杠杆作用和成本优势,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而达到有效跟踪标的指数的目的。

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	60,631.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,643.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,275.84

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	1,733,381,165.00
本报告期基金总申购份额	72,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	609,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,196,381,165.00

§ 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	10,001,000.00
本报告期买入/申购总份额	0.00
本报告期卖出/赎回总份额	10,001,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

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	卖出	2017-12-22	-10,001,000.00	-12,721,290.73	-
合计			-10,001,000.00	-12,721,290.73	

§ 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
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20171001-20171231	1,712,890,417.00	75,580,200.00	607,312,000.00	1,181,158,617.00	98.73%
产品持有风险							

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,由此可能导致的持有风险主要包括: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深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
(二)《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(四)法律意见书

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
二〇一八年一月二十日

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:二〇一八年一月二十日

§ 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 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 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	270010
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	877,895,083.57 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	270010 / 002987
报告期末下属两级基金的份额总额	674,839,687.79 份 / 203,055,395.78 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,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。
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(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 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	110,839,830.54	40,385,945.87
2.本期利润	56,289,500.30	39,314,580.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0818	0.0711
4.期末基金资产净值	1,243,175,244.80	372,097,031.87
5.期末基金份额净值	1.8422	1.8325

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	4.63%	0.74%	4.82%	0.76%	-0.19%	-0.02%

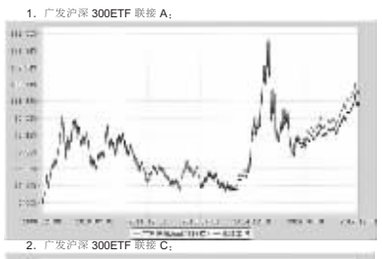
2.广发沪深 300ETF 联接 C:

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	4.52%	0.74%	4.82%	0.76%	-0.30%	-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 2017 年 12 月 31 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;广发环保指数基金的基金经理;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 联接基金的基金经理;广发量化稳健混合基金的基金经理;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)。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)基金的基金经理;广发环保指数基金的基金经理;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 联接基金的基金经理;广发量化稳健混合基金的基金经理;指数投资部总经理助理

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。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阶段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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未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

2017 年四季度,全球权益类市场维持了较好的趋势,但新兴市场和科技板块的波动性有所提高。在发达市场中,美国经济维持了稳健的复苏,欧洲 PMI 等软数据的复苏持续超预期,日本央行也打消了换届带来的货币政策不确定性。在经济复苏的同时,通胀数据维持在较低水平,给全球各家央行的货币政策收紧流程留下了充足的空间。新兴市场方面,随着全球经济复苏和美元弱势的延续,新兴市场经济也较为景气。经济持续复苏和通胀维持低位的组合,为全球权益类资产的持续增值奠定了较好的收益基础。中国的供给侧改革初见成效,企业盈利的改善趋势延续,港股较低的估值引发内地和国际资金继续流入香港市场。

本季度港股整体的盈利预期继续上调,恒生指数的盈利增长预期已经从年初的低双位数上调至目前的 20%左右,不断上调的业绩增速预期是本季度乃至全年港股表现优秀的核心原因。

四季度本基金维持了高仓位,并继续将持股集中于港股,配置部分 A 股。广发沪港深新机遇 2017 年四季度在市场方面,维持了对香港和 A 股的配置;在行业方面,主要关注金融、科技、工业和医药。

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 5.12%,同期业绩比较基准收益率为 6.07%。

§ 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	1,481,317,004.42	90.09
	其中:股票	1,481,317,004.42	90.09
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	160,947,087.47	9.79
7	其他各项资产	2,010,516.77	0.12
8	合计	1,644,274,608.66	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 1,354,928,052.89 元,占基金资产净值比例 83.82%。

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	-	-
C	制造业	126,388,951.53	7.82
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	-	-
J	金融业	-	-
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	126,388,951.53	7.82

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	1,494,519,998.09	92.52

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	19,425.00	0.00
B	采矿业	793,351.05	0.05
C	制造业	6,512,536.72	0.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	691,285.35	0.04
E	建筑业	882,952.54	0.05
F	批发和零售业	579,244.56	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	802,184.84	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	420,827.82	0.03
J	金融业	7,984,223.70	0.49
K	房地产业	678,628.29	0.04
L	租赁和商务服务业	127,533.00	0.01
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	45,262.00	0.00
S	综合	30,030.00	0.00
	合计	19,567,484.87	1.21

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	601318	中国平安	24,432	1,709,751.36	0.11
2	600309	万华化学	25,200	956,088.00	0.06
3	600519	贵州茅台	1,353	943,703.97	0.06
4	601600	中国铝业	127,500	850,425.00	0.05
5	600036	招商银行	23,070	669,491.40	0.04
6	601166	兴业银行	28,000	475,720.00	0.03
7	600887	伊利股份	13,915	447,923.85	0.03
8	600016	民生银行	53,200	446,348.00	0.03
9	601328	交通银行	62,210	386,324.10	0.02
10	600000	浦发银行	26,529	334,000.11	0.02

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