

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、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实、准确、完整承担责任。
基金管理人和中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年1月8日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,本基金净值不存在虚假记载、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。
基金过往业绩并不代表未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。
本基金招募说明书、基金合同和基金产品概要,请登录本公司网站。
本基金报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。
\$2基金产品概况

2.1基金产品概况

广发主要消费指数

基金代码:001458

交易方式:开放式

基金合同生效日:2015年8月16日

报告期末基金资产净值:68,525,300.04元

投资目标:本基金主要通过投资于标的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:本基金主要通过投资于标的ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争在扣除基金管理费和托管费后的净值增长率与业绩基准之间的差额在35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

业绩比较基准:广发中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(基金净值)与业绩基准的差额

风险收益特征:本基金为ETF联接基金,风险收益高于货币型基金,风险收益与货币型基金、本基金为指数基金,具有与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:中国银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称:广发主要消费指数A

广发主要消费指数C

下属两级基金的基金代码:001458

002976

报告期末下属两级基金的基金总额:35,270,716.35份

31,254,614.99份

2.2基金基本信息

基金名称:广发中证主要消费ETF

基金代码:159946

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年7月1日

基金报告期:2015年7月1日至2017年6月30日

基金资产净值:48,956,352.08元

43,302,842.78元

基金净值增长率:13880

13855

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.3基金的财务指标

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

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:822,160.15

2.本期利润:2,698,257.17

3.加权平均基金份额本期利润:0.0920

4.期末基金资产净值:48,956,352.08

43,302,842.78元

5.期末基金份额净值:1.3880

1.3855

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.4基金的财务指标

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

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:822,160.15

2.本期利润:2,698,257.17

3.加权平均基金份额本期利润:0.0920

4.期末基金资产净值:48,956,352.08

43,302,842.78元

5.期末基金份额净值:1.3880

1.3855

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.5基金的财务指标

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

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:1,790,369.32

2.本期利润:4,545,170.39

3.加权平均基金份额本期利润:0.0843

4.期末基金资产净值:87,792,367.73

87,792,367.73元

5.期末基金份额净值:1.2651

1.2651

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.6基金的财务指标

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

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:1,790,369.32

2.本期利润:15,437,573.97

3.加权平均基金份额本期利润:0.0927

4.期末基金资产净值:341,355,499.95

341,355,499.95元

5.期末基金份额净值:1.0982

1.0982

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.7基金的财务指标

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

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:-3,851,403.05

2.本期利润:-15,437,573.97

3.加权平均基金份额本期利润:-0.0927

4.期末基金资产净值:341,355,499.95

341,355,499.95元

5.期末基金份额净值:1.0982

1.0982

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.8基金的财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期:2017年1月8日至2017年12月31日

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:-4,998,000.00

2.本期利润:-4,998,000.00

3.加权平均基金份额净值增长率为-0.01%

4.期末基金资产净值:340,709,087.00

340,709,087.00元

5.期末基金份额净值:1.0000

1.0000

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.9基金的财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期:2017年1月8日至2017年12月31日

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:-4,998,000.00

2.本期利润:-4,998,000.00

3.加权平均基金份额净值增长率为-0.01%

4.期末基金资产净值:340,709,087.00

340,709,087.00元

5.期末基金份额净值:1.0000

1.0000

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.10基金的财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期:2017年1月8日至2017年12月31日

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:-4,998,000.00

2.本期利润:-4,998,000.00

3.加权平均基金份额净值增长率为-0.01%

4.期末基金资产净值:340,709,087.00

340,709,087.00元

5.期末基金份额净值:1.0000

1.0000

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.11基金的财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期:2017年1月8日至2017年12月31日

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:-4,998,000.00

2.本期利润:-4,998,000.00

3.加权平均基金份额净值增长率为-0.01%

4.期末基金资产净值:340,709,087.00

340,709,087.00元

5.期末基金份额净值:1.0000

1.0000

注:本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于上述数字。

2.12基金的财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期:2017年1月8日至2017年12月31日

广发主要消费指数C

1.本期已实现收益:-4,998,000.00

2.本期利润:-4,998,000.00

3.加权平均基金份额净值增长率为-0.01%

4.期末基金资产净值:340