广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指信息技术ETF
场内简称	信息技术
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年1月8日
报告期末基金份额总额	1,010,828,053.00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法,即按照标的指数的成分股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成分股及备选成分股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数。
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。本基金为指数型基金,主要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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	3,862,033.20
2.本期利润	182,474,361.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.2808
4.期末基金资产净值	1,066,840,854.42
5.期末基金份额净值	1.0554

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。

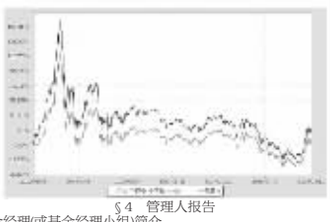
3.2 基金净值表现

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	44.06%	2.10%	44.53%	2.13%	-0.47%	-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

广发中证全指信息技术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1月8日至2019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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
霍华明	本基金的基金经理;广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式联接基金的基金经理;广发中证基建工程指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理	2017-04-20	-	11年	霍华明先生,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证券登记结帐算专员、数量投资部数据分析员、ETF基金助理兼研究员。
陆志明	本基金的基金经理;广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;量化投资部副总经理	2015-01-08	-	20年	陆志明先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员,深圳证券信息有限公司部门总监,广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、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2011年6月3日至2016年7月28日)、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2011年6月9日至2016年7月28日)、广发深证100指数分级证券投资基金基金经理(自2012年5月7日至2016年7月28日)、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金经理(自2014年10月30日至2016年7月28日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自2015年7月23日至2016年7月28日)、广发中证全指能源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2015年8月18日至2018年12月20日)、广发中证全指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经理(自2015年8月18日至2018年12月20日)。

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、《广发中证全指信息技术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

作为ETF基金,本基金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。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。

2019年1季度,受中美贸易问题缓和、政府采取措施排解上市企业质押问题、基建补短板拉动经济增长、政府的降税减费力度加大且速度加快等因素的影响,1季度的市场行情出现了较大的涨幅,上证综指上涨23.93%,深证成指上涨36.84%,创业板指上涨35.43%,中小板指上涨35.66%,而中证全指信息技术指数上涨44.53%。2019年是5G元年,5G商用可以有效带动信息技术产业链快速发展,一是大量网络设备采购,二是手机终端升级换代,三是推动开发出更多应用程序。从间接贡献看,5G与云计算、大数据、人工智能等技术深度融合,将支撑传统产业研发设计、生产制造、管理服务等生产流程的全面深刻变革,为传统产业优化结构、提质增效助一臂之力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为44.06%,同期业绩基准收益率为44.53%。

§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	1,061,703,338.40	99.43
	其中:股票	1,061,703,338.40	99.43
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	5,224,315.34	0.49
7	其他各项资产	875,476.35	0.08
8	合计	1,067,803,130.09	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	597,515,414.68	56.01
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	11,127,526.00	1.04
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	450,629,318.72	42.24
J	金融业	134,343.00	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	1,234,233.00	0.12
S	综合	1,041,026.00	0.10
	合计	1,061,681,861.40	99.52

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	002415	海康威视	1,457,793	51,124,800.51	4.79
2	000725	京东方A	9,348,200	36,457,980.00	3.42
3	300059	东方财富	1,435,823	27,826,249.74	2.61
4	002475	立讯精密	963,113	23,885,202.40	2.24
5	002230	科大讯飞	578,007	20,975,874.03	1.97
6	600570	恒生电子	192,560	16,860,553.60	1.58
7	002008	大族激光	340,130	14,353,486.00	1.35
8	600703	三安光电	959,126	14,070,378.42	1.32
9	600588	用友网络	376,080	12,749,112.00	1.20
10	600271	航天信息	443,614	12,390,139.02	1.16

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根据公开市场信息,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	6,214.64
2	应收证券清算款	867,584.48
3	应收股利	-
4	应收利息	1,677.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	875,476.35

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	470,828,053.00
本报告期基金总申购份额	696,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	156,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,010,828,053.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20190101-20190331		286,290,566.00	316,018,200.00	116,172,600.00	486,136,166.00	48.09%
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

1.中国证监会批准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2.《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3.《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.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
二〇一九年四月二十二日

广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指汽车指数
基金主代码	004854
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月31日
报告期末基金份额总额	40,900,606.88份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,紧密跟踪中证全指汽车指数,力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证全指汽车指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	中证全指汽车指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。
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。 本基金为指数型基金,主要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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	广发中证全指汽车指数A / 广发中证全指汽车指数C
下属分级基金的交易代码	004854 / 004855
报告期末下属分级基金的份额总额	23,393,875.70份 / 17,506,731.18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(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	广发中证全指汽车指数A	广发中证全指汽车指数C
1.本期已实现收益	-646,247.75	-455,966.97
2.本期利润	2,759,704.19	1,995,644.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.1201	0.1175
4.期末基金资产净值	18,778,846.31	14,047,109.60
5.期末基金份额净值	0.8027	0.8024

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

广发中证全指汽车指数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	18.03%	1.56%	17.14%	1.58%	0.89%	-0.03%

广发中证全指汽车指数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	18.05%	1.56%	17.14%	1.58%	0.91%	-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

广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金
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
(2017年7月31日至2019年3月31日)

广发中证全指汽车指数A

§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
罗国庆	本基金的基金经理;广发深证100指数分级证券投资基金的基金经理;广发中证医疗指数分级证券投资基金的基金经理;广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证1000指数型发起式证券投资基金的基金经理;指数投资部副总经理	2017-07-31	-	10年	罗国庆先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员,华富基金管理有限公司产品设计研究员,广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员。

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、《广发中证全指汽车指数型发起式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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的是中证全指汽车指数,该指数选取中证全指样本股中的汽车行业股票组成,以反映该行业股票的整体表现。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资,指数样本采用完全复制方法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

经历了2018年A股市场单边下跌,2019年一季度A股市场呈现普涨行情。截止一季度末,沪深300指数上涨28.62%,中证500指数上涨33.10%,创业板指数上涨35.43%。偏小市值的中证500指数和创业板指数涨幅大于大市值的沪深300指数。一季度市场风格偏向小市值股票,尤其是在2.3月份小市值的股票表现更为突出,而1月份则是大市值股票表现更好。回顾整个一季度,市值轮动规律是大市值股票率先启动,小市值股票后来居上。小市值风格说明在国家政策影响下,投资者的经济预期得到改善,风险偏好随之提升。如果今年经济稳中向好的趋势不变,投资者对基本面及中美贸易摩擦的担忧将大幅消退,市场估值水平有望继续提升。

基金投资运作方面,报告期内,本基金严格遵守合同要求,认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作,运作过程中未发生任何风险事件。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的A类份额净值增长率为18.03%,C类份额净值增长率为18.05%,同期业绩比较基准收益率为17.14%。

§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	30,292,214.45	90.52
	其中:股票	30,292,214.45	90.52
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	2,345,736.75	7.01
7	其他资产	825,814.82	2.47
8	合计	33,463,766.02	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

5.2.1.1积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
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	811,440.00	2.47
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	811,440.00	2.47

5.2.1.2指数投资按行业分类的股票投资组合

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

5.3.1期末指数投资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	600104	上汽集团	160,500	4,184,235.00	12.75
2	002594	比亚迪	70,844	3,789,445.56	11.54
3	600066	宇通客车	169,000	2,269,670.00	6.91
4	000625	长安汽车	246,500	2,041,020.00	6.22
5	600297	广汇汽车	315,400	1,671,620.00	5.09
6	600166	福田汽车	596,700	1,396,278.00	4.25
7	601238	广汽集团	118,000	1,378,240.00	4.20
8	601633	长城汽车	153,100	1,198,773.00	3.65
9	601258	庞大集团	597,700	1,016,090.00	3.10
10	000800	一汽轿车	101,300	854,972.00	2.60

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002607	中公教育	63,000	811,440.00	2.47

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庞大集团(代码:601258)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年7月5日,中国证券监督管理委员会针对庞大集团如下事由罚款共计人民币60万元:(一)庞庆华、庞大集团未如实披露权益变动情况;(二)庞大集团未按规定披露关联交易;(三)庞庆华、庞大集团未披露自身涉嫌犯罪被司法机关调查。

本基金为指数型基金,上述股票系标的指数成份股,投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期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	3,383.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	661.64
5	应收申购款	821,769.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	825,814.82

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

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000800	一汽轿车	854,972.00	2.60	重大事项停牌

5.11.5.2期末非指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	23,345,679.93	17,253,605.60
报告期基金总申购份额	9,241,479.70	20,065,679.29
减:报告期基金总赎回份额	9,193,283.93	19,812,553.71
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	23,393,875.70	17,506,731.18

§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	10,001,200.02	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	24.45	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

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	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,200.02	24.45%	10,001,200.02	24.45%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,200.02	24.45%	10,001,200.02	24.45%	三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20190101-20190331		10,001,200.02	0.00	0.00	10,001,200.02	24.45%
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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会注册广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金募集的文件

2.《广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、营业执照

7.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号保利国际广场南塔31-33楼

10.3 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,