广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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:二〇一六年七月二十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	广发可选消费联接
基金主代码	001133
交易代码	001133
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月15日
报告期末基金份额总额	544,896,558.47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%×中证全指可选消费指数收益率+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	中国银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
基金份额上市的证券交易所	深交所
上市日期	2014年6月25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	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份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份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指可选消费指数。
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。

§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（2016年4月1日-2016年6月30日）
1.本期已实现收益	-191,401.29
2.本期利润	-4,023,513.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0073
4.期末基金资产净值	420,630,099.94
5.期末基金份额净值	0.7719

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。

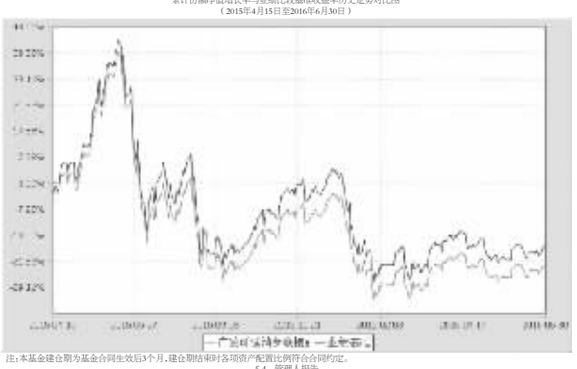
3.2 基金净值表现

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	-0.94%	1.37%	-1.66%	1.40%	0.72%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年4月15日至2016年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300联接基金的基金经理;广发沪深300指数分级基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理;广发中证全指信息技术ETF基金经理;广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理;广发中证全指原材料ETF基金的基金经理;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理;广发能源联接基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;广发原材料联接基金的基金经理;广发主要消费联接基金的基金经理;数量投资部副总经理	2015-04-15	-	17年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金从业证书。1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年8月9日至2016年5月29日任广发基金管理有限公司数量投资部总经理,2011年6月3日起任广发中小板300ETF基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300ETF联接基金的基金经理,2012年5月31日起任广发沪深300指数分级基金的基金经理,2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理,2015年4月13日起任广发中证全指能源ETF基金的基金经理,2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理,2015年6月25日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理,2015年7月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年8月31日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年9月25日起任广发中证全指能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理,2015年7月1日起任广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理,2015年7月9日起任广发能源联接基金的基金经理,2015年7月23日起任广发原材料联接基金的基金经理,2015年8月18日起任广发主要消费联接基金的基金经理,2016年5月30日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理。

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、《广发中证全指可选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。

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联接基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,主要持有广发中证全指可选消费ETF及指数成份股等,间接复制指数,同时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,本基金跟踪误差来源主要是建仓、申购、赎回和成份股调整因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为-0.94%,同期业绩比较基准收益率为-1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度市场维持震荡格局,并随着美国脱欧、外汇贬值等风险的进一步释放,以及企业盈利增速符合预期,市场出现了震荡上行的走势。中国经济"L"走势成为共识,经济转型正有序进行,预计新兴产业的企业未来盈利也会逐步企稳。随着国内房地产的调控与人民币升值的影响,投资与出口在我国经济增长的作用逐步减弱。经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动,这是大势所趋。而随着居民收入的提高,改善型消费品的需求旺盛,可选消费品增速明显高于必需消费品。结合政府的宏观政策,可以预见,未来可选消费的发展速度应该高于全市场的发展速度。

§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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,963,340.39	0.70
	其中:股票	2,963,340.39	0.70
2	基金投资	395,243,487.05	93.05
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,490,751.98	5.77
8	其他各项资产	2,068,837.69	0.49
9	合计	424,766,417.11	100.00

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	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	395,243,487.05	93.96

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	1,677.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,201,022.86	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,460.00	0.00
F	批发和零售业	183,038.65	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,786.00	0.00
H	住宿和餐饮业	15,379.88	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,286,384.52	0.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,614.00	0.00
L	租赁和商务服务业	104,956.81	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,688.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,890.18	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	127,442.39	0.03
S	综合	-	-
	合计	2,963,340.39	0.70

5.3.2 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。

5.4 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	600637	东方明珠	51,081	1,239,735.87	0.29
2	000651	格力电器	18,200	401,674.00	0.10
3	002712	思美传媒	900	34,218.00	0.01
4	002283	天润曲轴	1,502	25,759.30	0.01
5	600877	中国嘉陵	2,900	21,402.00	0.01
6	000839	中信国安	900	19,179.00	0.00
7	002594	比亚迪	300	18,303.00	0.00
8	000333	美的集团	750	17,790.00	0.00
9	600104	上汽集团	799	16,211.71	0.00
10	601599	鹿港科技	1,404	15,921.36	0.00

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 报告期末股指期货持仓的风险管理情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.3 报告期末股指期货投资情况和期货投资策略的说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11 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 报告期内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	12,716.96
2	应收证券清算款	2,000,619.28
3	应收股利	-
4	应收利息	4,418.56
5	应收申购款	51,082.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,068,837.69

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末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	000651	格力电器	401,674.00	0.10	重大事项停牌
2	002712	思美传媒	34,218.00	0.01	重大事项停牌
3	002283	天润曲轴	25,759.30	0.01	重大事项停牌
4	600877	中国嘉陵	21,402.00	0.01	重大事项停牌
5	601599	鹿港科技	15,921.36	0.00	重大事项停牌

§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	555,779,970.29
本报告期基金总申购份额	30,418,392.19
减:本报告期基金总赎回份额	41,301,804.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	544,896,558.47

§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	10,000,200.02
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,200.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.84

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	65,821,345.49	12.08%	10,000,200.02	1.84%	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	65,821,345.49	12.08%	10,000,200.02	1.84%	三年

§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中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集的文件

(二)《广发中证全指可选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)《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

(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
二〇一六年七月二十日

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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:二〇一六年七月二十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	广发信息技术联接
基金主代码	000942
交易代码	000942
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月29日
报告期末基金份额总额	248,619,681.74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%×中证全指信息技术指数收益率+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	中国银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	深圳交易所
上市日期	2015年2月5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	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份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份股及备选成份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。

§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（2016年4月1日-2016年6月30日）
1.本期已实现收益	-10,346,466.99
2.本期利润	10,242,588.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0372
4.期末基金资产净值	282,382,991.88
5.期末基金份额净值	1.1358

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。

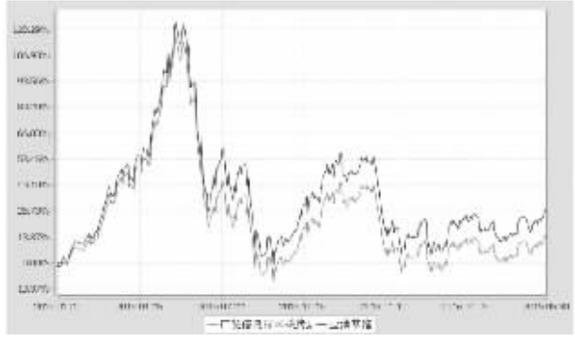
3.2 基金净值表现

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	3.33%	1.82%	4.15%	1.85%	-0.82%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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发起式联接基金
累计份额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29日至2016年6月30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		
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理;广发沪深300指数分级基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF联接基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理;广发全指信息技术ETF基金的基金经理;广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理;广发中证全指原材料ETF基金的基金经理;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理;广发能源联接基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;广发原材料联接基金的基金经理;广发主要消费联接基金的基金经理;数量投资部副总经理	2015-01-29	-	17年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金从业证书。1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年8月9日至2016年5月29日任广发基金管理有限公司数量投资部总经理,2011年6月3日起任广发中小板300ETF基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300ETF联接基金的基金经理,2012年5月31日起任广发沪深300指数分级基金的基金经理,2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理,2015年1月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年3月23日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年4月15日起任广发可选消费联接基金的基金经理,2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理,2015年6月25日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理,2015年7月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年8月31日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年9月25日起任广发中证全指能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理,2015年7月1日起任广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理,2015年7月9日起任广发能源联接基金的基金经理,2015年7月23日起任广发原材料联接基金的基金经理,2015年8月18日起任广发主要消费联接基金的基金经理,2016年5月30日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理。

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。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联接基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,主要持有广发中证全指信息技术ETF及指数成份股等,间接复制指数,同时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,本基金跟踪误差来源主要是建仓、申购、赎回和成份股调整因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为4.48%,同期业绩比较基准收益率为4.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度市场维持震荡格局,并随着美国脱欧、外汇贬值等风险的进一步释放,以及企业盈利增速符合预期,市场出现了震荡上行的走势。中国经济"L"走势成为共识,经济转型正有序进行,预计新兴产业的企业未来盈利也会逐步企稳。互联网+是全球未来的发展方向,背后体现了信息技术的潜在产业机会,尤其对软件企业来说,未来充满了机遇和发展,信息技术将会更深一步地推动全球一体化,未来继续看好信息技术板块的业绩表现。

§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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	457,224,525.75	99.28
	其中:股票	457,224,525.75	99.28
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	3,314,634.69	0.72
7	其他各项资产	13,791.78	0.00
8	合计	460,552,952.22	100.00

注:上表中的股票投资项合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	244,098,979.56	53.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	50,731.00	0.01
F	批发和零售业	2,217,751.04	0.48
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	206,321,386.05	44.94
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	20,126.10	0.00
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	1,389,200.00	0.30
S	综合	3,121,056.00	0.68
	合计	457,219,229.75	99.60

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	000725	京东方A	4,354,900	10,059,819.00	2.19
2	300104	乐视网	171,860	9,093,112.60	1.98
3	300059	东方财富	395,188	8,773,173.60	1.91
4	002415	海康威视	338,929	7,273,416.34	1.58
5	600570	恒生电子	91,360	6,100,107.20	1.33
6	300017	网宿科技	87,427	5,875,094.40	1.28
7	002230	科大讯飞	167,300	5,495,805.00	1.20
8	000503	海虹控股	133,100	5,351,951.00	1.17
9	600100	同方股份	329,400	4,927,824.00	1.07
10	600271	航天信息	205,014	4,879,333.20	1.06

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 报告期内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	13,162.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	629.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,791.78

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	440,828,053.00
本报告期基金总申购份额	58,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	118,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	380,828,053.00

§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