

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2016 年年度报告
2016 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：二〇一七年三月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	16
6.1 管理层对财务报表的责任.....	16
6.2 注册会计师的责任.....	16
6.3 审计意见.....	17
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	50

8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 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	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 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	67
8.9 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	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末上市基金前十名持有人	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	70
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	73
§12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 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
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
报告期末基金份额总额	1,646,381,165.00 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		孙树明	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通	中国 上海

	合伙)	
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 8 月 20 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	34,565,009.75	3,817,984.11
本期利润	81,377,268.53	6,487,413.07
加权平均基金份额本期利润	0.0829	0.0618
本期加权平均净值利润率	8.33%	6.11%
本期基金份额净值增长率	-7.57%	10.58%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	36,467,235.42	2,792,213.67
期末可供分配基金份额利润	0.0221	0.1058
期末基金资产净值	1,682,848,400.42	29,173,378.67
期末基金份额净值	1.0221	1.1058
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	2.21%	10.58%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

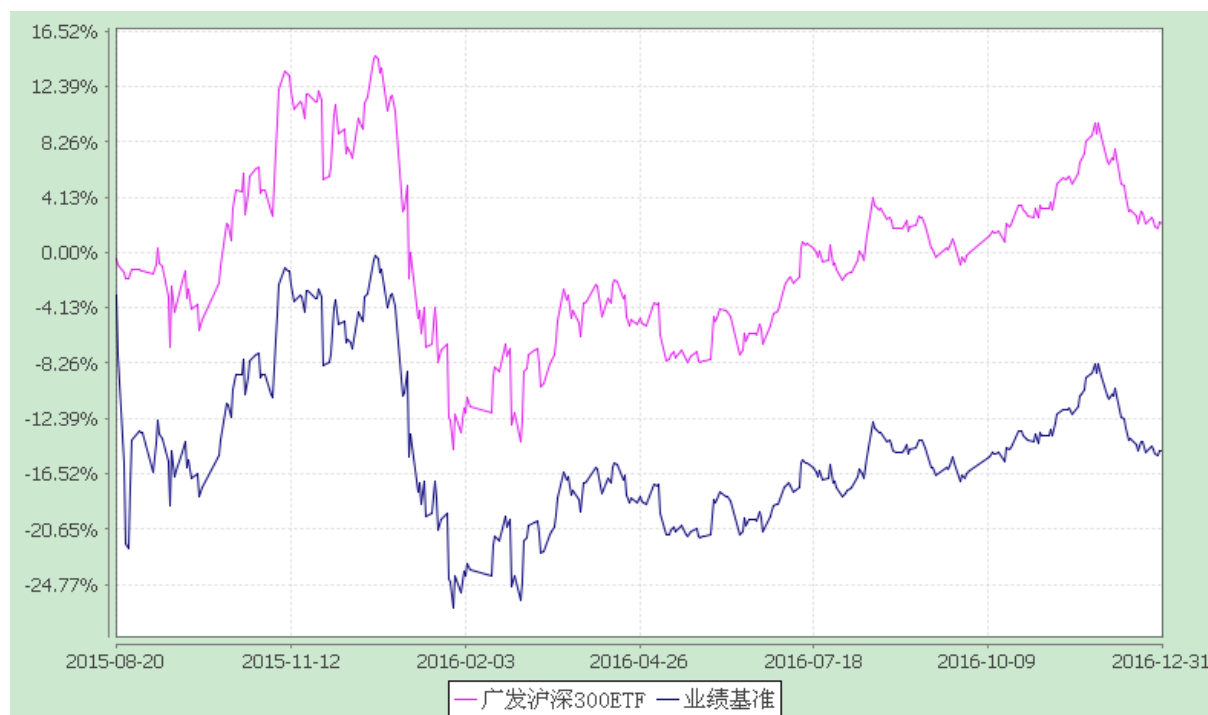
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.18%	0.69%	1.75%	0.71%	0.43%	-0.02%
过去六个月	6.91%	0.73%	4.95%	0.75%	1.96%	-0.02%
过去一年	-7.57%	1.37%	-11.28%	1.40%	3.71%	-0.03%
自基金合同生效起至今	2.21%	1.45%	-14.82%	1.69%	17.03%	-0.24%

注：业绩比较基准：沪深 300 指数收益率。

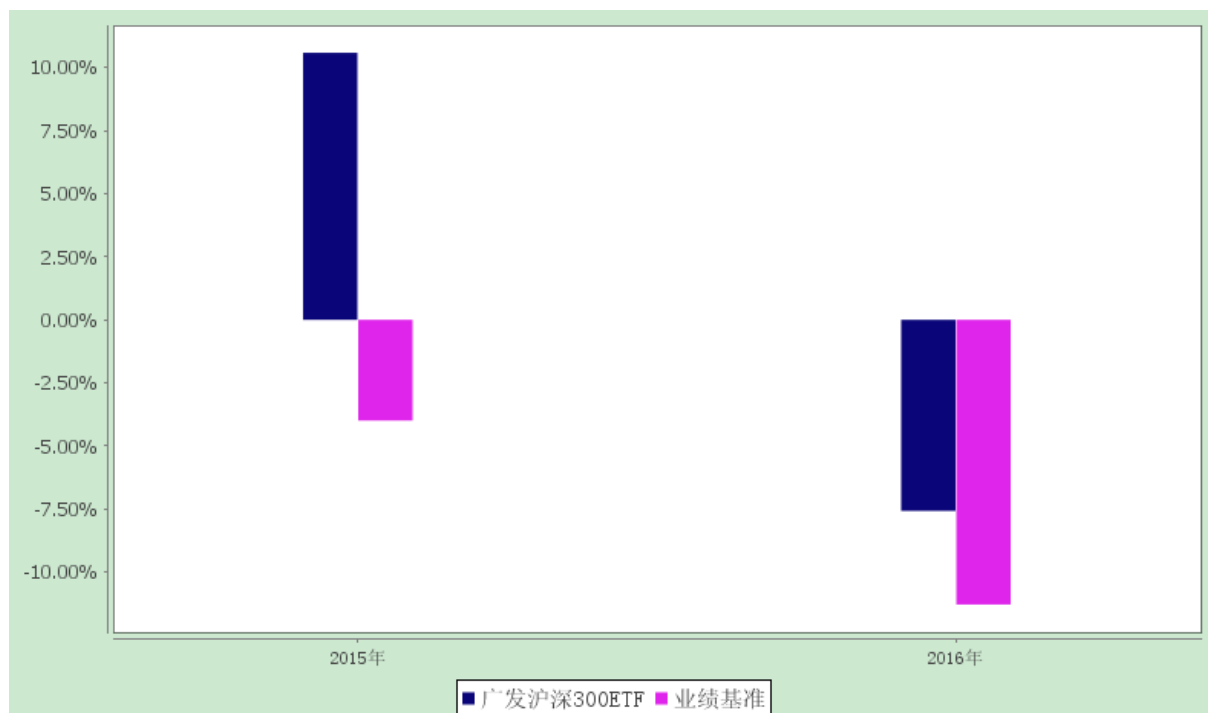
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
 份额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
 (2015 年 8 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年（2015 年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2015 年 8 月 20 日）至报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 25 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管

理有限公司（香港子公司）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理一百二十五只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、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、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式

联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、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、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 3048 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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 及联接(LOF)基金的基金经理；广发中小板 300ETF 及联接基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；广发中证军工 ETF 基金的基金经理；广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理；数量投资部总经理助理	2015-08-20	-	12 年	男，中国籍，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书，2004 年 7 月至 2010 年 11 月在广发基金管理有限公司信息技术部工作，2010 年 11 月至 2014 年 3 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员，2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日任广发沪深 300 指数基金的基金经理，2014 年 4 月 1 日起任广发中证 500ETF 以及广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理，2015 年 8 月 20 日起任广发沪深 300ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 18 日起任广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 25 日起任广发中小板 300ETF 及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日起任数量投资部总经理助理，2016 年 8 月 30 日起任广发中证军工 ETF 基金的基金经理，2016 年 9 月 26 日起任广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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 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 0.06%，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。

4.4.2 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-7.57%，同期业绩比较基准收益率为-11.28%，较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年初，因汇率波动及熔断的影响，整体股市年初出现了较大幅度下跌，自 2 月起市场则呈现了缓慢向上的震荡态势。下半年，在实体经济的投资意愿和投资出现好转倾向的背景下，整体股市在保险资金及产业资本举牌的刺激下出现了一波上涨行情，其后监管层约束举牌行为，规范和引导股市中长期投资行为，为股市未来的发展做好了铺垫。

展望 2017 年，我们认为整体市场总体上可能好于 2016 年，同时有望延续 2016 年 4 季度表现，整体市场将在混改、PPP 项目加速落地、汇率相对稳定以及人民币贬值后相对有利于出口等方面的影响下，股市存在一定的结构性行情。

沪深 300 的大盘蓝筹覆盖面相对于与上证 50、上证 180 要大，代表性要好，风险相对于创业板等高估值板块要小，因此对于风险承受力较低的投资者而言，选择沪深 300 指数基金是个不错的享受行情反弹的品种。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2016 年 1 月 4 日起至 2016 年 2 月 1 日，本基金连续 21 个工作日出现资产净值低于五千万。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购

赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

德师报(审)字(17)第 P00556 号

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“广发沪深 300ETF”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发沪深 300ETF 的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出

会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，广发沪深 300ETF 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了广发沪深 300ETF 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年年度的经营成果和基金净值变动情况。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
中国 上海
2017 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	21,921,417.36	1,173,682.38
结算备付金		15,559,548.14	28,404.22
存出保证金		241,714.83	80,658.97
交易性金融资产	7.4.7.2	1,643,725,645.25	28,427,401.88
其中：股票投资		1,643,725,645.25	28,424,501.88
基金投资		-	-
债券投资		-	2,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,336,280.87	-
应收利息	7.4.7.5	5,895.03	255.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,684,790,501.48	29,710,403.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		504,806.97	230,520.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		724,756.76	13,690.72
应付托管费		144,951.36	2,738.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	326,782.42	95,615.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	240,803.55	194,459.53
负债合计		1,942,101.06	537,024.74
所有者权益：		-	-

实收基金	7.4.7.9	1,646,381,165.00	26,381,165.00
未分配利润	7.4.7.10	36,467,235.42	2,792,213.67
所有者权益合计		1,682,848,400.42	29,173,378.67
负债和所有者权益总计		1,684,790,501.48	29,710,403.41

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0221 元，基金份额总额 1,646,381,165.00 份。

7.2 利润表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 20 日（基 金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		88,652,111.74	7,334,020.51
1.利息收入		272,641.61	175,261.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	271,644.16	175,261.23
债券利息收入		997.45	0.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,783,342.84	4,348,115.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,262,603.56	4,220,153.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	63,910.61	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	37,680.00	-
股利收益	7.4.7.15	22,419,148.67	127,961.61

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	46,812,258.78	2,669,428.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	783,868.51	141,214.68
减：二、费用		7,274,843.21	846,607.44
1. 管理人报酬		4,794,167.35	198,663.28
2. 托管费		958,833.49	39,732.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,087,217.38	363,375.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	434,624.99	244,835.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,377,268.53	6,487,413.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,377,268.53	6,487,413.07

注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 20 日，上年度可比区间不完整。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,381,165.00	2,792,213.67	29,173,378.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,377,268.53	81,377,268.53

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,620,000,000.00	-47,702,246.78	1,572,297,753.22
其中：1.基金申购款	1,629,000,000.00	-48,493,371.09	1,580,506,628.91
2.基金赎回款	-9,000,000.00	791,124.31	-8,208,875.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,646,381,165.00	36,467,235.42	1,682,848,400.42
项目	上年度可比期间		
	2015 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	308,381,165.00	-	308,381,165.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,487,413.07	6,487,413.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-282,000,000.00	-3,695,199.40	-285,695,199.40
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	11,379.83	3,011,379.83
2.基金赎回款	-285,000,000.00	-3,706,579.23	-288,706,579.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	26,381,165.00	2,792,213.67	29,173,378.67
-----------------	---------------	--------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2015]985 号文核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》（“基金合同”）发起，于 2015 年 8 月 20 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 7 月 10 日至 2015 年 8 月 7 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 308,381,165.00 元，有效认购户数为 2,973 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,796.00 元，折合基金份额 1,796.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：沪深 300 指数的成份股、备选成份股，非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。在建仓完成后，本基金股票资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数。

本基金的财务报表于 2017 年 3 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中

中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。可比期间的会计年度为 2015 年 8 月 20 日(基金合同生效日)起至 2015 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表

内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

4. 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的证监会公告 [2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具

体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购及赎回等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购及赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，

若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

当本基金申购对价中包含可以现金替代时，在本基金补足可以现金替代成分股票(或采取强制退款)之前，该股票估值日与申购日估值的差额确认为公允价值变动收益，并于补入被替代股票的实际买入日或强制退款计算日转出计入其他收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.5%的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.1%的年费率逐日计提。

3. 本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提。

4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

5. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，基金管理人可进行收益分配；

2、在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特

点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

- 3、本基金的收益分配采取现金分红的方式；
- 4、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。
2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	21,921,417.36	1,173,682.38
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	21,921,417.36	1,173,682.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,594,200,157.51	1,643,725,645.25	49,525,487.74
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,594,200,157.51	1,643,725,645.25	49,525,487.74
项目	上年度末			
	2015 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		25,755,072.92	28,424,501.88	2,669,428.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,900.00	2,900.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,900.00	2,900.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		25,757,972.92	28,427,401.88	2,669,428.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	987,600.00	-	-	-
其中：股指期货投资	987,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	987,600.00	-	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其中：股指期货投资	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,603.07	206.52
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	15.40	36.30
应收结算备付金利息	3,276.56	12.70
应收债券利息	-	0.44
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	5,895.03	255.96

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	326,782.42	95,615.92
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	326,782.42	95,615.92

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	35,000.00	106,000.00
应付替代款	92,315.80	9,813.92
可退替代款	4,324.60	6,363.00
应付指数使用费	109,163.15	72,282.61
合计	240,803.55	194,459.53

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	26,381,165.00	26,381,165.00
本期申购	1,629,000,000.00	1,629,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-9,000,000.00	-9,000,000.00
本期末	1,646,381,165.00	1,646,381,165.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,794,190.78	-1,977.11	2,792,213.67
本期利润	34,565,009.75	46,812,258.78	81,377,268.53
本期基金份额交易产生的变动数	125,755,152.96	-173,457,399.74	-47,702,246.78
其中：基金申购款	126,583,207.63	-175,076,578.72	-48,493,371.09
基金赎回款	-828,054.67	1,619,178.98	791,124.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	163,114,353.49	-126,647,118.07	36,467,235.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 20 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	148,670.56	171,864.47
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,248.87	285.38
结算备付金利息收入	121,724.73	3,111.38
其他	-	-
合计	271,644.16	175,261.23

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 20 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,844,001.83	1,079,648.66
股票投资收益——赎回差价收入	-581,398.27	3,140,504.93
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	18,262,603.56	4,220,153.59

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 20 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	207,819,176.63	74,229,623.44
减：卖出股票成本总额	188,975,174.80	73,149,974.78
买卖股票差价收入	18,844,001.83	1,079,648.66

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 20 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	8,208,875.69	288,706,579.23
减：现金支付赎回款总额	2,602,153.69	142,241,946.23
减：赎回股票成本总额	6,188,120.27	143,324,128.07
赎回差价收入	-581,398.27	3,140,504.93

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 20 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交 总额	339,808.50	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成本总额	274,900.00	-

减：应收利息总额	997.89	-
买卖债券差价收入	63,910.61	-

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
股指期货投资收益	37,680.00	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	22,419,148.67	127,961.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	22,419,148.67	127,961.61

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
1.交易性金融资产	46,856,058.78	2,669,428.96
——股票投资	46,856,058.78	2,669,428.96
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2.衍生工具	-43,800.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货投资收益	-43,800.00	-
3.其他	-	-
合计	46,812,258.78	2,669,428.96

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
手续费返还	-	-
基金转换费收入	-	-
印花税返还	-	-
替代损益	705,868.51	87,538.13
其他	78,000.00	53,676.55
合计	783,868.51	141,214.68

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
交易所市场交易费用	1,087,140.86	363,375.92
银行间市场交易费用	-	-
期货交易费用	76.52	-
合计	1,087,217.38	363,375.92

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
审计费用	40,000.00	32,000.00
信息披露费	15,000.00	90,000.00
银行汇划费	1,236.00	153.00
上市费	60,000.00	50,000.00
指数使用费	318,388.99	72,282.61
其他	-	400.00
合计	434,624.99	244,835.61

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
广发期货有限公司	与基金管理人受同一控制
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：本基金本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	242,616,941.64	26.98%	110,018,807.62	37.49%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	3,326.30	0.98%	-	-

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

广发证券股份有限公司	225,950.02	28.26%	152,351.67	46.62%
关联方名称	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日）至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	102,460.81	38.92%	1,957.86	2.05%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,794,167.35	198,663.28
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	958,833.49	39,732.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
基金合同生效日（2015 年 8 月 20 日）持有的基金份额	-	10,001,000.00
报告期初持有的基金份额	10,001,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.61%	37.91%
---------------------	-------	--------

注：基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,630,294,585.00	99.02%	-	-

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	21,921,417.36	148,670.56	1,173,682.38	171,864.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股流通受限	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	15.28	15.28	681.00	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-

603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股流通受限	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	23.16	23.16	3,491.00	80,851.56	80,851.56	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项停牌	6.25	2017-01-26	6.29	1,105,665.00	7,107,858.46	6,910,406.25	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大事项停牌	6.93	2017-01-03	7.00	440,500.00	3,020,835.08	3,052,665.00	-
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项停牌	6.97	2017-01-20	6.27	498,550.00	3,528,360.76	3,474,893.50	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.27	-	-	168,100.00	1,442,155.36	1,390,187.00	-
300104	乐视网	2016-12-07	重大事项停牌	35.80	2017-01-16	36.88	155,300.00	7,153,043.20	5,559,740.00	-
600406	国电南瑞	2016-12-28	重大事项停牌	16.63	-	-	266,273.00	3,842,147.70	4,428,119.99	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.60	-	-	252,300.00	4,494,252.16	3,683,580.00	-
600649	城投控股	2016-12-06	重大事项停牌	20.34	-	-	247,326.00	3,928,861.99	5,030,610.84	-

600654	中安消	2016-12-14	重大事项停牌	17.43	-	-	122,700.00	2,341,268.00	2,138,661.00	-
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项停牌	10.79	-	-	217,055.00	2,296,501.14	2,342,023.45	-
601727	上海电气	2016-08-31	重大事项停牌	8.42	-	-	375,883.00	3,273,556.49	3,164,934.86	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念, 在董事会下设立合规及风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息, 或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降, 将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险, 本基金主要投资于信用等级较高的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。

但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	2,900.00
未评级	-	-
合计	-	2,900.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债和央行票据。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

7.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影

响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大的风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,921,417.36	-	-	-	21,921,417.36
结算备付金	15,559,548.14	-	-	-	15,559,548.14
存出保证金	241,714.83	-	-	-	241,714.83
交易性金融资产	-	-	-	1,643,725,645.25	1,643,725,645.25
应收证券清算款	-	-	-	3,336,280.87	3,336,280.87
应收利息	-	-	-	5,895.03	5,895.03
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,722,680.33	-	-	1,647,067,821.15	1,684,790,501.48
负债					
应付证券清算款	-	-	-	504,806.97	504,806.97
应付管理人报酬	-	-	-	724,756.76	724,756.76
应付托管费	-	-	-	144,951.36	144,951.36
应付交易费用	-	-	-	326,782.42	326,782.42
其他负债	-	-	-	240,803.55	240,803.55
负债总计	-	-	-	1,942,101.06	1,942,101.06
利率敏感度缺口	37,722,680.33	-	-	1,645,125,720.09	1,682,848,400.42

					42
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,173,682.38	-	-	-	1,173,682.38
结算备付金	28,404.22	-	-	-	28,404.22
存出保证金	80,658.97	-	-	-	80,658.97
交易性金融资产	2,900.00	-	-	28,424,501.88	28,427,401.88
应收利息	-	-	-	255.96	255.96
资产总计	1,285,645.57	-	-	28,424,757.84	29,710,403.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	230,520.43	230,520.43
应付管理人报酬	-	-	-	13,690.72	13,690.72
应付托管费	-	-	-	2,738.14	2,738.14
应付交易费用	-	-	-	95,615.92	95,615.92
其他负债	-	-	-	194,459.53	194,459.53
负债总计	-	-	-	537,024.74	537,024.74
利率敏感度缺口	1,285,645.57	-	-	27,887,733.10	29,173,378.67

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资，上年度末持有的债券占基金资产净值较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误

差、beta 值、风险价值模型(VAR)等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,643,725,645.25	97.68	28,424,501.88	97.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,900.00	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,643,725,645.25	97.68	28,427,401.88	97.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	82,649,502.30	1,439,701.02
	业绩比较基准下降 5%	-82,649,502.30	-1,439,701.02

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,602,060,138.85 元，属于第二层级的余额为 41,175,821.89 元，属于第三层级的余额为 489,684.51 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票（2015 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为 27,034,511.88 元，第二层级的余额为 1,389,990.00 元，第三层级的余额为 2,900.00 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的债券）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,643,725,645.25	97.56
	其中：股票	1,643,725,645.25	97.56
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	37,480,965.50	2.22
7	其他各项资产	3,583,890.73	0.21
8	合计	1,684,790,501.48	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,614,500.16	0.27
B	采矿业	55,059,638.43	3.27
C	制造业	533,768,491.96	31.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,326,546.06	2.69
E	建筑业	76,565,481.51	4.55
F	批发和零售业	35,969,916.96	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	48,271,324.17	2.87
H	住宿和餐饮业	765,960.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,574,573.23	6.33
J	金融业	593,855,601.31	35.29
K	房地产业	76,300,920.23	4.53
L	租赁和商务服务业	18,395,774.40	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,007,852.48	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,116,920.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	22,618,391.80	1.34

S	综合	10,513,752.55	0.62
	合计	1,643,725,645.25	97.68

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,981,300	70,197,459.00	4.17
2	601166	兴业银行	2,438,400	39,355,776.00	2.34
3	600016	民生银行	4,325,300	39,273,724.00	2.33
4	600036	招商银行	1,885,300	33,181,280.00	1.97
5	600519	贵州茅台	93,513	31,247,368.95	1.86
6	601328	交通银行	5,021,500	28,974,055.00	1.72
7	600000	浦发银行	1,583,030	25,660,916.30	1.52
8	601668	中国建筑	2,730,331	24,190,732.66	1.44
9	600837	海通证券	1,487,000	23,420,250.00	1.39
10	600030	中信证券	1,445,100	23,208,306.00	1.38
11	601169	北京银行	2,226,140	21,727,126.40	1.29
12	601288	农业银行	6,989,696	21,668,057.60	1.29
13	000651	格力电器	879,900	21,663,138.00	1.29
14	000333	美的集团	767,611	21,623,601.87	1.28
15	600887	伊利股份	1,084,500	19,087,200.00	1.13
16	601398	工商银行	4,078,200	17,984,862.00	1.07
17	000002	万科A	811,800	16,682,490.00	0.99
18	601766	中国中车	1,675,313	16,367,808.01	0.97
19	601601	中国太保	576,056	15,997,075.12	0.95
20	600900	长江电力	1,208,160	15,295,305.60	0.91
21	600104	上汽集团	603,235	14,145,860.75	0.84
22	601211	国泰君安	730,900	13,587,431.00	0.81
23	000001	平安银行	1,485,580	13,518,778.00	0.80
24	601988	中国银行	3,855,022	13,261,275.68	0.79
25	000725	京东方A	4,350,600	12,442,716.00	0.74
26	601989	中国重工	1,679,113	11,904,911.17	0.71
27	000858	五粮液	344,200	11,868,016.00	0.71
28	600276	恒瑞医药	258,660	11,769,030.00	0.70
29	600048	保利地产	1,261,657	11,518,928.41	0.68
30	601818	光大银行	2,910,567	11,380,316.97	0.68

31	601390	中国中铁	1,279,481	11,336,201.66	0.67
32	600050	中国联通	1,550,134	11,331,479.54	0.67
33	601688	华泰证券	598,772	10,694,067.92	0.64
34	600015	华夏银行	976,001	10,589,610.85	0.63
35	600028	中国石化	1,923,057	10,403,738.37	0.62
36	600518	康美药业	546,200	9,749,670.00	0.58
37	601186	中国铁建	790,195	9,450,732.20	0.56
38	000776	广发证券	543,500	9,163,410.00	0.54
39	002450	康得新	453,445	8,665,333.95	0.51
40	600958	东方证券	544,590	8,457,482.70	0.50
41	002415	海康威视	333,800	7,947,778.00	0.47
42	002024	苏宁云商	683,200	7,822,640.00	0.46
43	002304	洋河股份	110,130	7,775,178.00	0.46
44	601006	大秦铁路	1,086,220	7,690,437.60	0.46
45	600999	招商证券	452,909	7,396,003.97	0.44
46	601628	中国人寿	306,549	7,384,765.41	0.44
47	601009	南京银行	662,533	7,181,857.72	0.43
48	001979	招商蛇口	433,802	7,110,014.78	0.42
49	601857	中国石油	890,488	7,079,379.60	0.42
50	002736	国信证券	449,519	6,990,020.45	0.42
51	601939	建设银行	1,276,066	6,941,799.04	0.41
52	000166	申万宏源	1,105,665	6,910,406.25	0.41
53	000063	中兴通讯	433,089	6,907,769.55	0.41
54	600795	国电电力	2,152,676	6,823,982.92	0.41
55	601336	新华保险	153,196	6,706,920.88	0.40
56	300059	东方财富	389,260	6,590,171.80	0.39
57	601377	兴业证券	860,663	6,584,071.95	0.39
58	601899	紫金矿业	1,935,550	6,464,737.00	0.38
59	601099	太平洋	1,249,830	6,436,624.50	0.38
60	600585	海螺水泥	366,833	6,221,487.68	0.37
61	000783	长江证券	608,000	6,219,840.00	0.37
62	601985	中国核电	854,700	6,034,182.00	0.36
63	002142	宁波银行	358,700	5,968,768.00	0.35
64	601088	中国神华	363,343	5,878,889.74	0.35
65	300070	碧水源	325,049	5,694,858.48	0.34
66	000625	长安汽车	374,000	5,587,560.00	0.33
67	300104	乐视网	155,300	5,559,740.00	0.33
68	600019	宝钢股份	875,472	5,559,247.20	0.33
69	600637	东方明珠	236,095	5,501,013.50	0.33
70	600690	青岛海尔	555,200	5,485,376.00	0.33
71	601669	中国电建	754,385	5,476,835.10	0.33
72	601901	方正证券	717,756	5,454,945.60	0.32
73	000503	海虹控股	128,000	5,382,400.00	0.32
74	002673	西部证券	258,000	5,358,660.00	0.32

75	600383	金地集团	413,100	5,353,776.00	0.32
76	601788	光大证券	327,528	5,237,172.72	0.31
77	000423	东阿阿胶	97,120	5,231,854.40	0.31
78	002594	比亚迪	103,300	5,131,944.00	0.30
79	600089	特变电工	561,833	5,129,535.29	0.30
80	000768	中航飞机	240,346	5,109,755.96	0.30
81	601555	东吴证券	384,588	5,103,482.76	0.30
82	600649	城投控股	247,326	5,030,610.84	0.30
83	600705	中航资本	819,056	5,012,622.72	0.30
84	600703	三安光电	373,240	4,997,683.60	0.30
85	600547	山东黄金	136,400	4,979,964.00	0.30
86	600010	包钢股份	1,784,772	4,979,513.88	0.30
87	002202	金风科技	284,200	4,862,662.00	0.29
88	600111	北方稀土	395,399	4,851,545.73	0.29
89	000538	云南白药	63,600	4,843,140.00	0.29
90	600535	天士力	116,641	4,839,435.09	0.29
91	601600	中国铝业	1,146,495	4,838,208.90	0.29
92	600109	国金证券	370,479	4,827,341.37	0.29
93	600660	福耀玻璃	257,767	4,802,199.21	0.29
94	600066	宇通客车	245,096	4,801,430.64	0.29
95	300017	网宿科技	88,998	4,771,182.78	0.28
96	002739	万达院线	87,804	4,747,562.28	0.28
97	600886	国投电力	706,952	4,715,369.84	0.28
98	002456	欧菲光	136,400	4,675,792.00	0.28
99	600068	葛洲坝	502,497	4,617,947.43	0.27
100	600009	上海机场	173,808	4,609,388.16	0.27
101	000839	中信国安	497,550	4,567,509.00	0.27
102	600804	鹏博士	207,762	4,556,220.66	0.27
103	600029	南方航空	642,533	4,510,581.66	0.27
104	600893	中航动力	137,642	4,506,399.08	0.27
105	600100	同方股份	324,866	4,499,394.10	0.27
106	300072	三聚环保	97,070	4,493,370.30	0.27
107	002230	科大讯飞	165,783	4,491,061.47	0.27
108	002241	歌尔股份	167,000	4,428,840.00	0.26
109	600406	国电南瑞	266,273	4,428,119.99	0.26
110	000338	潍柴动力	441,700	4,399,332.00	0.26
111	600196	复星医药	189,044	4,374,478.16	0.26
112	600570	恒生电子	92,190	4,345,836.60	0.26
113	000728	国元证券	218,200	4,342,180.00	0.26
114	300024	机器人	201,560	4,309,352.80	0.26
115	600309	万华化学	199,602	4,297,431.06	0.26
116	600415	小商品城	495,984	4,290,261.60	0.25
117	600031	三一重工	696,299	4,247,423.90	0.25
118	601800	中国交建	276,611	4,201,721.09	0.25

119	000793	华闻传媒	370,900	4,187,461.00	0.25
120	000069	华侨城 A	600,000	4,170,000.00	0.25
121	601618	中国中冶	891,879	4,156,156.14	0.25
122	002252	上海莱士	179,040	4,134,033.60	0.25
123	000568	泸州老窖	125,100	4,128,300.00	0.25
124	600271	航天信息	203,800	4,065,810.00	0.24
125	000009	中国宝安	390,795	4,048,636.20	0.24
126	600023	浙能电力	745,266	4,046,794.38	0.24
127	600115	东方航空	568,842	4,021,712.94	0.24
128	600739	辽宁成大	221,900	3,985,324.00	0.24
129	601198	东兴证券	198,000	3,971,880.00	0.24
130	000623	吉林敖东	127,600	3,954,324.00	0.23
131	601888	中国国旅	91,062	3,952,090.80	0.23
132	601607	上海医药	201,898	3,949,124.88	0.23
133	600177	雅戈尔	279,175	3,902,866.50	0.23
134	600867	通化东宝	176,944	3,880,381.92	0.23
135	600340	华夏幸福	162,122	3,874,715.80	0.23
136	600352	浙江龙盛	417,934	3,849,172.14	0.23
137	002065	东华软件	164,325	3,828,772.50	0.23
138	600489	中金黄金	316,382	3,825,058.38	0.23
139	600816	安信信托	161,000	3,802,820.00	0.23
140	600221	海南航空	1,164,567	3,796,488.42	0.23
141	000413	东旭光电	335,700	3,779,982.00	0.22
142	000630	铜陵有色	1,222,809	3,766,251.72	0.22
143	000895	双汇发展	178,100	3,727,633.00	0.22
144	600369	西南证券	519,650	3,705,104.50	0.22
145	600485	信威集团	252,300	3,683,580.00	0.22
146	601919	中国远洋	697,400	3,654,376.00	0.22
147	000157	中联重科	804,600	3,652,884.00	0.22
148	600741	华域汽车	228,190	3,639,630.50	0.22
149	002236	大华股份	265,800	3,636,144.00	0.22
150	002465	海格通信	310,600	3,618,490.00	0.22
151	601018	宁波港	712,864	3,607,091.84	0.21
152	600820	隧道股份	325,500	3,583,755.00	0.21
153	601998	中信银行	557,553	3,573,914.73	0.21
154	002008	大族激光	156,800	3,543,680.00	0.21
155	002007	华兰生物	98,800	3,532,100.00	0.21
156	300124	汇川技术	173,492	3,527,092.36	0.21
157	600674	川投能源	403,419	3,509,745.30	0.21
158	600718	东软集团	178,243	3,504,257.38	0.21
159	601933	永辉超市	708,458	3,478,528.78	0.21
160	000750	国海证券	498,550	3,474,893.50	0.21
161	600157	永泰能源	853,600	3,422,936.00	0.20
162	600150	中国船舶	122,992	3,395,809.12	0.20

163	601111	中国国航	469,113	3,377,613.60	0.20
164	600118	中国卫星	108,091	3,376,762.84	0.20
165	002475	立讯精密	159,150	3,302,362.50	0.20
166	300315	掌趣科技	356,600	3,294,984.00	0.20
167	000100	TCL 集团	996,600	3,288,780.00	0.20
168	000963	华东医药	45,500	3,279,185.00	0.19
169	600606	绿地控股	375,300	3,268,863.00	0.19
170	600153	建发股份	301,900	3,230,330.00	0.19
171	000686	东北证券	259,160	3,203,217.60	0.19
172	300027	华谊兄弟	290,399	3,194,389.00	0.19
173	600061	国投安信	204,500	3,192,245.00	0.19
174	002466	天齐锂业	97,740	3,171,663.00	0.19
175	600085	同仁堂	101,054	3,171,074.52	0.19
176	601727	上海电气	375,883	3,164,934.86	0.19
177	601333	广深铁路	622,253	3,154,822.71	0.19
178	000826	启迪桑德	95,300	3,142,994.00	0.19
179	000060	中金岭南	281,582	3,139,639.30	0.19
180	000540	中天城投	440,500	3,052,665.00	0.18
181	000876	新希望	379,000	3,050,950.00	0.18
182	600018	上港集团	593,192	3,037,143.04	0.18
183	600583	海油工程	406,437	2,999,505.06	0.18
184	000917	电广传媒	208,100	2,994,559.00	0.18
185	002085	万丰奥威	149,300	2,950,168.00	0.18
186	600005	武钢股份	861,300	2,937,033.00	0.17
187	600170	上海建工	617,397	2,920,287.81	0.17
188	600959	江苏有线	256,420	2,897,546.00	0.17
189	600839	四川长虹	677,280	2,831,030.40	0.17
190	002081	金螳螂	286,750	2,807,282.50	0.17
191	600588	用友网络	134,708	2,804,620.56	0.17
192	000559	万向钱潮	210,700	2,793,882.00	0.17
193	002183	怡亚通	255,900	2,779,074.00	0.17
194	600208	新湖中宝	666,915	2,774,366.40	0.16
195	600256	广汇能源	575,603	2,688,066.01	0.16
196	002385	大北农	375,600	2,666,760.00	0.16
197	000792	盐湖股份	138,200	2,635,474.00	0.16
198	603993	洛阳钼业	707,441	2,631,680.52	0.16
199	300058	蓝色光标	257,600	2,619,792.00	0.16
200	000709	河钢股份	776,500	2,593,510.00	0.15
201	601718	际华集团	280,300	2,581,563.00	0.15
202	600688	上海石化	397,521	2,560,035.24	0.15
203	600362	江西铜业	152,847	2,557,130.31	0.15
204	600895	张江高科	143,700	2,546,364.00	0.15
205	002500	山西证券	208,800	2,509,776.00	0.15
206	600060	海信电器	145,407	2,489,367.84	0.15

207	600332	白云山	102,186	2,450,420.28	0.15
208	300168	万达信息	120,500	2,436,510.00	0.14
209	300033	同花顺	35,400	2,434,812.00	0.14
210	601633	长城汽车	219,754	2,430,479.24	0.14
211	000402	金融街	234,100	2,411,230.00	0.14
212	000425	徐工机械	705,700	2,385,266.00	0.14
213	601866	中海集运	581,369	2,371,985.52	0.14
214	600737	中粮屯河	188,000	2,342,480.00	0.14
215	600875	东方电气	217,055	2,342,023.45	0.14
216	600446	金证股份	92,900	2,334,577.00	0.14
217	601258	庞大集团	837,718	2,320,478.86	0.14
218	002426	胜利精密	280,400	2,318,908.00	0.14
219	002310	东方园林	163,565	2,314,444.75	0.14
220	600297	广汇汽车	270,100	2,312,056.00	0.14
221	600252	中恒集团	504,368	2,310,005.44	0.14
222	000977	浪潮信息	108,800	2,306,560.00	0.14
223	600074	保千里	172,900	2,289,196.00	0.14
224	600376	首开股份	193,400	2,284,054.00	0.14
225	600663	陆家嘴	102,100	2,259,473.00	0.13
226	002470	金正大	284,300	2,245,970.00	0.13
227	300144	宋城演艺	106,500	2,230,110.00	0.13
228	300002	神州泰岳	241,100	2,227,764.00	0.13
229	002074	国轩高科	71,600	2,218,884.00	0.13
230	600873	梅花生物	338,200	2,205,064.00	0.13
231	002292	奥飞娱乐	97,100	2,204,170.00	0.13
232	000983	西山煤电	258,000	2,182,680.00	0.13
233	600704	物产中大	209,830	2,167,543.90	0.13
234	601216	君正集团	463,946	2,157,348.90	0.13
235	600038	中直股份	44,236	2,141,907.12	0.13
236	600654	中安消	122,700	2,138,661.00	0.13
237	000738	中航动控	86,400	2,137,536.00	0.13
238	300015	爱尔眼科	70,800	2,116,920.00	0.13
239	600827	百联股份	147,167	2,113,318.12	0.13
240	000778	新兴铸管	397,400	2,054,558.00	0.12
241	000039	中集集团	140,400	2,052,648.00	0.12
242	600666	奥瑞德	76,100	2,050,895.00	0.12
243	600373	中文传媒	101,507	2,050,441.40	0.12
244	000712	锦龙股份	84,500	1,980,680.00	0.12
245	002049	紫光国芯	59,531	1,960,951.14	0.12
246	601872	招商轮船	386,200	1,907,828.00	0.11
247	002195	二三四五	168,023	1,902,020.36	0.11
248	600037	歌华有线	123,600	1,893,552.00	0.11
249	002152	广电运通	141,000	1,872,480.00	0.11
250	002146	荣盛发展	235,150	1,845,927.50	0.11

251	600372	中航电子	97,751	1,814,258.56	0.11
252	600008	首创股份	438,578	1,802,555.58	0.11
253	603000	人民网	101,760	1,797,081.60	0.11
254	601225	陕西煤业	366,041	1,775,298.85	0.11
255	601155	新城控股	147,900	1,737,825.00	0.10
256	600482	中国动力	56,900	1,737,726.00	0.10
257	000156	华数传媒	96,900	1,735,479.00	0.10
258	300182	捷成股份	167,859	1,730,626.29	0.10
259	000718	苏宁环球	198,900	1,716,507.00	0.10
260	002131	利欧股份	105,400	1,681,130.00	0.10
261	600685	中船防务	56,600	1,681,020.00	0.10
262	000061	农产品	133,600	1,652,632.00	0.10
263	000800	一汽轿车	150,300	1,633,761.00	0.10
264	000627	天茂集团	209,274	1,600,946.10	0.10
265	002027	分众传媒	110,700	1,579,689.00	0.09
266	002714	牧原股份	67,600	1,573,728.00	0.09
267	300251	光线传媒	161,000	1,571,360.00	0.09
268	600021	上海电力	128,977	1,565,780.78	0.09
269	601021	春秋航空	42,400	1,557,776.00	0.09
270	300146	汤臣倍健	129,400	1,545,036.00	0.09
271	002299	圣农发展	72,600	1,540,572.00	0.09
272	000415	渤海金控	212,900	1,522,235.00	0.09
273	600582	天地科技	303,500	1,508,395.00	0.09
274	601118	海南橡胶	215,546	1,500,200.16	0.09
275	000027	深圳能源	217,600	1,494,912.00	0.09
276	002174	游族网络	56,400	1,491,780.00	0.09
277	601928	凤凰传媒	141,996	1,486,698.12	0.09
278	601611	中国核建	86,000	1,478,340.00	0.09
279	000671	阳光城	265,100	1,476,607.00	0.09
280	300133	华策影视	124,660	1,414,891.00	0.08
281	002424	贵州百灵	74,300	1,407,242.00	0.08
282	002153	石基信息	57,700	1,406,149.00	0.08
283	002129	中环股份	168,100	1,390,187.00	0.08
284	002797	第一创业	39,500	1,374,600.00	0.08
285	000938	紫光股份	23,600	1,354,404.00	0.08
286	600871	石化油服	327,500	1,342,750.00	0.08
287	601958	金钼股份	174,349	1,333,769.85	0.08
288	600648	外高桥	66,433	1,311,387.42	0.08
289	601608	中信重工	233,600	1,310,496.00	0.08
290	601877	正泰电器	64,600	1,292,000.00	0.08
291	000008	神州高铁	135,600	1,263,792.00	0.08
292	600783	鲁信创投	54,407	1,230,686.34	0.07
293	300085	银之杰	50,300	1,051,270.00	0.06
294	603885	吉祥航空	41,400	964,620.00	0.06

295	000555	神州信息	45,100	957,473.00	0.06
296	600754	锦江股份	26,000	765,960.00	0.05
297	600188	兖州煤业	68,071	739,251.06	0.04
298	002568	百润股份	34,900	706,376.00	0.04
299	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
300	601127	小康股份	7,700	205,898.00	0.01
301	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
302	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
303	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
304	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
305	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
306	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
307	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
308	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
309	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
310	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
311	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
312	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
313	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
314	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
315	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
316	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
317	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
318	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
319	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
320	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
321	603098	森特股份	642	15,452.94	0.00
322	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
323	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
324	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
325	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
326	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
327	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
328	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)

1	000651	格力电器	20,094,085.00	68.88
2	000333	美的集团	19,644,210.33	67.34
3	000002	万 科 A	17,466,567.00	59.87
4	000001	平安银行	14,358,484.56	49.22
5	000725	京东方 A	12,386,496.00	42.46
6	000858	五 粮 液	10,965,203.53	37.59
7	000776	广发证券	10,180,667.03	34.90
8	002024	苏宁云商	9,856,952.01	33.79
9	300059	东方财富	9,790,221.00	33.56
10	601211	国泰君安	8,766,132.00	30.05
11	002304	洋河股份	8,284,029.49	28.40
12	000166	申万宏源	7,985,035.00	27.37
13	001979	招商蛇口	7,825,988.31	26.83
14	002736	国信证券	7,734,511.02	26.51
15	002415	海康威视	7,728,489.16	26.49
16	002450	康得新	7,667,451.47	26.28
17	002594	比亚迪	7,071,229.07	24.24
18	601398	工商银行	7,043,481.51	24.14
19	300104	乐视网	7,034,553.84	24.11
20	002673	西部证券	6,881,502.14	23.59
21	000783	长江证券	6,810,083.03	23.34
22	002739	万达院线	6,805,328.51	23.33
23	600000	浦发银行	6,588,945.45	22.59
24	000625	长安汽车	6,367,766.82	21.83
25	000063	中兴通讯	6,354,420.24	21.78
26	300017	网宿科技	6,154,914.91	21.10
27	002142	宁波银行	6,069,702.70	20.81
28	300070	碧水源	5,888,337.19	20.18
29	000768	中航飞机	5,565,895.58	19.08
30	000423	东阿阿胶	5,459,926.36	18.72
31	300024	机器人	5,414,494.87	18.56
32	002202	金风科技	5,156,792.10	17.68
33	000100	TCL 集团	4,975,261.00	17.05
34	002241	歌尔股份	4,942,235.99	16.94
35	000069	华侨城 A	4,737,519.00	16.24
36	002230	科大讯飞	4,733,236.80	16.22
37	000728	国元证券	4,730,235.07	16.21
38	002252	上海莱士	4,642,128.77	15.91
39	300072	三聚环保	4,572,192.51	15.67
40	002236	大华股份	4,510,979.72	15.46
41	000503	海虹控股	4,426,439.73	15.17
42	002465	海格通信	4,390,500.00	15.05
43	300027	华谊兄弟	4,328,915.26	14.84
44	300315	掌趣科技	4,296,333.70	14.73

45	000983	西山煤电	4,295,277.00	14.72
46	000839	中信国安	4,244,402.00	14.55
47	000157	中联重科	4,194,916.00	14.38
48	000538	云南白药	4,185,370.60	14.35
49	002456	欧菲光	4,154,191.21	14.24
50	000338	潍柴动力	4,139,261.56	14.19
51	000009	中国宝安	4,109,442.93	14.09
52	002008	大族激光	4,077,318.72	13.98
53	000793	华闻传媒	4,056,881.00	13.91
54	600958	东方证券	4,046,680.00	13.87
55	000895	双汇发展	4,005,914.47	13.73
56	000750	国海证券	3,980,036.68	13.64
57	002385	大北农	3,899,622.26	13.37
58	000559	万向钱潮	3,870,025.00	13.27
59	000963	华东医药	3,778,422.06	12.95
60	002475	立讯精密	3,771,773.24	12.93
61	300124	汇川技术	3,746,000.60	12.84
62	000876	新 希 望	3,740,177.94	12.82
63	002466	天齐锂业	3,716,850.20	12.74
64	000686	东北证券	3,714,611.37	12.73
65	600271	航天信息	3,714,240.00	12.73
66	000623	吉林敖东	3,656,352.70	12.53
67	000917	电广传媒	3,649,736.50	12.51
68	002292	奥飞娱乐	3,646,991.84	12.50
69	000630	铜陵有色	3,613,712.59	12.39
70	000060	中金岭南	3,599,250.58	12.34
71	000413	东旭光电	3,589,167.00	12.30
72	002065	东华软件	3,574,165.34	12.25
73	002007	华兰生物	3,445,454.33	11.81
74	000568	泸州老窖	3,438,641.23	11.79
75	600606	绿地控股	3,377,660.00	11.58
76	000792	盐湖股份	3,364,001.76	11.53
77	000826	启迪桑德	3,358,455.51	11.51
78	002183	怡 亚 通	3,354,399.49	11.50
79	300058	蓝色光标	3,237,696.62	11.10
80	002081	金 螳 螂	3,166,573.00	10.85
81	000540	中天城投	3,155,270.00	10.82
82	000738	中航动控	3,145,651.37	10.78
83	000402	金 融 街	3,120,491.00	10.70
84	002500	山西证券	3,070,062.00	10.52
85	300144	宋城演艺	3,056,609.23	10.48
86	002085	万丰奥威	3,031,572.68	10.39
87	300003	乐普医疗	2,922,411.68	10.02
88	300168	万达信息	2,888,213.18	9.90

89	000046	泛海控股	2,835,556.10	9.72
90	600153	建发股份	2,739,651.00	9.39
91	002422	科伦药业	2,729,953.17	9.36
92	000425	徐工机械	2,696,253.00	9.24
93	002426	胜利精密	2,690,793.00	9.22
94	000709	河钢股份	2,668,771.00	9.15
95	300033	同花顺	2,598,204.00	8.91
96	300002	神州泰岳	2,563,647.82	8.79
97	000977	浪潮信息	2,520,686.00	8.64
98	000061	农产品	2,467,693.00	8.46
99	000039	中集集团	2,389,873.36	8.19
100	600061	国投安信	2,362,150.00	8.10
101	002470	金正大	2,347,992.10	8.05
102	002310	东方园林	2,347,718.59	8.05
103	600654	中安消	2,336,039.00	8.01
104	600297	广汇汽车	2,321,582.00	7.96
105	601328	交通银行	2,320,126.00	7.95
106	000778	新兴铸管	2,316,328.41	7.94
107	002074	国轩高科	2,306,971.53	7.91
108	300015	爱尔眼科	2,278,838.62	7.81
109	000800	一汽轿车	2,266,754.88	7.77
110	002195	二三四五	2,243,205.60	7.69
111	000729	燕京啤酒	2,243,042.49	7.69
112	601390	中国中铁	2,221,375.00	7.61
113	002152	广电运通	2,187,992.12	7.50
114	600900	长江电力	2,187,797.00	7.50
115	000712	锦龙股份	2,118,585.06	7.26
116	300251	光线传媒	2,053,576.03	7.04
117	600446	金证股份	2,038,020.00	6.99
118	000629	*ST 钒钛	2,030,429.69	6.96
119	300146	汤臣倍健	2,018,361.00	6.92
120	000883	湖北能源	2,009,247.00	6.89
121	002049	紫光国芯	2,000,401.19	6.86
122	002146	荣盛发展	1,998,596.46	6.85
123	000718	苏宁环球	1,960,818.00	6.72
124	300182	捷成股份	1,912,499.68	6.56
125	000156	华数传媒	1,903,626.32	6.53
126	600482	中国动力	1,891,038.00	6.48
127	002153	石基信息	1,846,417.00	6.33
128	601788	光大证券	1,834,301.00	6.29
129	601186	中国铁建	1,823,949.00	6.25
130	600666	奥瑞德	1,813,636.69	6.22
131	600074	保千里	1,803,856.16	6.18
132	300133	华策影视	1,800,099.58	6.17

133	600518	康美药业	1,799,817.60	6.17
134	002131	利欧股份	1,784,400.00	6.12
135	002294	信立泰	1,778,682.00	6.10
136	601155	新城控股	1,771,710.50	6.07
137	000027	深圳能源	1,771,671.62	6.07
138	600816	安信信托	1,753,928.11	6.01
139	002027	分众传媒	1,753,068.68	6.01
140	000825	太钢不锈	1,751,946.00	6.01
141	000627	天茂集团	1,713,064.66	5.87
142	002714	牧原股份	1,691,609.57	5.80
143	002299	圣农发展	1,644,442.32	5.64
144	000898	鞍钢股份	1,623,190.86	5.56
145	000671	阳光城	1,621,263.00	5.56
146	000999	华润三九	1,609,301.58	5.52
147	002129	中环股份	1,598,882.00	5.48
148	601611	中国核建	1,577,512.92	5.41
149	000415	渤海金控	1,577,089.00	5.41
150	002174	游族网络	1,545,226.00	5.30
151	000831	*ST 五稀	1,520,823.17	5.21
152	000581	威孚高科	1,520,207.29	5.21
153	600873	梅花生物	1,478,608.00	5.07
154	002797	第一创业	1,476,320.00	5.06
155	000598	兴蓉环境	1,469,411.00	5.04
156	300085	银之杰	1,449,562.40	4.97
157	601877	正泰电器	1,446,793.00	4.96
158	600376	首开股份	1,446,419.00	4.96
159	000938	紫光股份	1,438,961.00	4.93
160	002424	贵州百灵	1,360,182.00	4.66
161	600737	中粮屯河	1,345,040.00	4.61
162	000008	神州高铁	1,344,087.00	4.61
163	002399	海普瑞	1,343,249.36	4.60
164	600037	歌华有线	1,328,154.96	4.55
165	601198	东兴证券	1,323,471.50	4.54
166	600704	物产中大	1,304,022.00	4.47
167	000400	许继电气	1,242,716.25	4.26
168	002410	广联达	1,221,642.74	4.19
169	002038	双鹭药业	1,185,780.00	4.06
170	600959	江苏有线	1,161,741.20	3.98
171	002375	亚厦股份	1,145,835.00	3.93
172	601336	新华保险	1,114,922.95	3.82
173	000555	神州信息	1,108,724.00	3.80
174	601018	宁波港	1,107,502.15	3.80
175	601229	上海银行	1,102,699.58	3.78
176	600739	辽宁成大	1,033,061.00	3.54

177	002353	杰瑞股份	1,021,667.00	3.50
178	601888	中国国旅	1,014,892.00	3.48
179	600685	中船防务	999,768.63	3.43
180	600485	信威集团	971,745.00	3.33
181	600582	天地科技	920,475.00	3.16
182	600663	陆家嘴	910,348.00	3.12
183	600157	永泰能源	901,439.00	3.09
184	600023	浙能电力	890,447.00	3.05
185	002568	百润股份	886,986.64	3.04
186	600208	新湖中宝	877,641.70	3.01
187	600871	石化油服	858,875.00	2.94
188	600754	锦江股份	791,706.00	2.71
189	600098	广州发展	790,986.00	2.71
190	000539	粤电力 A	763,380.00	2.62
191	600089	特变电工	754,715.00	2.59
192	600170	上海建工	733,394.20	2.51
193	000937	冀中能源	729,900.00	2.50
194	601901	方正证券	710,981.00	2.44
195	600795	国电电力	679,215.00	2.33
196	601899	紫金矿业	675,147.00	2.31
197	603993	洛阳钼业	654,920.00	2.24
198	600005	武钢股份	620,134.00	2.13
199	601600	中国铝业	613,434.00	2.10
200	600048	保利地产	612,505.00	2.10
201	603885	吉祥航空	599,503.00	2.05

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	7,357,594.00	25.22
2	600011	华能国际	5,526,290.58	18.94
3	600519	贵州茅台	4,249,296.20	14.57
4	300003	乐普医疗	3,088,674.20	10.59

5	002422	科伦药业	2,953,338.96	10.12
6	600398	海澜之家	2,916,056.23	10.00
7	601106	中国一重	2,770,664.20	9.50
8	000046	泛海控股	2,717,989.63	9.32
9	600642	申能股份	2,574,919.70	8.83
10	601117	中国化学	2,374,997.60	8.14
11	000729	燕京啤酒	2,273,990.48	7.79
12	002024	苏宁云商	2,271,415.00	7.79
13	600027	华电国际	2,228,406.85	7.64
14	601179	中国西电	2,140,460.75	7.34
15	601098	中南传媒	2,136,038.72	7.32
16	601991	大唐发电	2,084,938.79	7.15
17	000883	湖北能源	2,074,673.00	7.11
18	000898	鞍钢股份	2,065,944.00	7.08
19	601992	金隅股份	1,999,203.00	6.85
20	600315	上海家化	1,980,956.07	6.79
21	000825	太钢不锈	1,967,553.17	6.74
22	601898	中煤能源	1,909,482.11	6.55
23	600000	浦发银行	1,884,345.51	6.46
24	002294	信立泰	1,846,757.40	6.33
25	000999	华润三九	1,790,943.88	6.14
26	000629	*ST 钒钛	1,754,943.00	6.02
27	600863	内蒙华电	1,715,554.84	5.88
28	600999	招商证券	1,709,831.00	5.86
29	000983	西山煤电	1,665,319.00	5.71
30	601398	工商银行	1,661,423.00	5.69
31	601238	广汽集团	1,653,508.00	5.67
32	600600	青岛啤酒	1,624,782.82	5.57
33	000581	威孚高科	1,619,345.87	5.55
34	600098	广州发展	1,614,485.00	5.53
35	601229	上海银行	1,581,399.46	5.42
36	601318	中国平安	1,569,508.00	5.38
37	600637	东方明珠	1,521,099.14	5.21
38	000776	广发证券	1,471,108.77	5.04
39	002038	双鹭药业	1,453,564.01	4.98
40	300059	东方财富	1,431,884.00	4.91
41	002594	比亚迪	1,412,066.68	4.84
42	601808	中海油服	1,410,570.33	4.84
43	000598	兴蓉环境	1,393,926.17	4.78
44	000333	美的集团	1,385,173.90	4.75
45	000831	*ST 五稀	1,373,104.00	4.71
46	600549	厦门钨业	1,367,516.60	4.69
47	000725	京东方 A	1,357,135.00	4.65
48	002399	海普瑞	1,353,327.60	4.64

49	000400	许继电气	1,341,334.67	4.60
50	600317	营口港	1,318,040.00	4.52
51	002353	杰瑞股份	1,291,578.83	4.43
52	000858	五 粮 液	1,283,960.00	4.40
53	002385	大北农	1,254,755.00	4.30
54	002304	洋河股份	1,223,245.15	4.19
55	002410	广联达	1,217,773.20	4.17
56	300017	网宿科技	1,208,201.22	4.14
57	600166	福田汽车	1,189,491.08	4.08
58	000100	TCL 集团	1,180,911.00	4.05
59	000001	平安银行	1,179,481.36	4.04
60	600578	京能电力	1,148,771.40	3.94
61	600998	九州通	1,107,457.90	3.80
62	600633	浙报传媒	1,100,835.52	3.77
63	603288	海天味业	1,076,966.67	3.69
64	002375	亚厦股份	1,075,034.77	3.68
65	000166	申万宏源	1,032,978.00	3.54
66	600570	恒生电子	1,026,894.00	3.52
67	002142	宁波银行	993,387.25	3.41
68	600717	天津港	960,045.00	3.29
69	001979	招商蛇口	938,112.24	3.22
70	601699	潞安环能	907,723.00	3.11
71	002236	大华股份	901,447.06	3.09
72	600036	招商银行	886,641.00	3.04
73	002252	上海莱士	884,019.00	3.03
74	600030	中信证券	880,274.00	3.02
75	000402	金 融 街	862,534.00	2.96
76	000768	中航飞机	860,088.00	2.95
77	000792	盐湖股份	808,377.00	2.77
78	600022	山东钢铁	800,595.00	2.74
79	601377	兴业证券	774,860.00	2.66
80	000625	长安汽车	773,842.00	2.65
81	002673	西部证券	748,027.00	2.56
82	601939	建设银行	743,423.00	2.55
83	300024	机器人	739,163.00	2.53
84	000937	冀中能源	737,381.00	2.53
85	000061	农 产 品	719,387.00	2.47
86	000539	粤电力 A	719,009.00	2.46
87	000783	长江证券	708,246.31	2.43
88	002008	大族激光	700,023.00	2.40
89	000876	新 希 望	686,439.00	2.35
90	000559	万向钱潮	675,459.99	2.32
91	601601	中国太保	671,873.00	2.30
92	600837	海通证券	671,784.00	2.30

93	000728	国元证券	671,576.00	2.30
94	002415	海康威视	666,207.82	2.28
95	002475	立讯精密	661,360.00	2.27
96	600115	东方航空	658,112.00	2.26
97	300058	蓝色光标	637,106.36	2.18
98	002500	山西证券	621,084.00	2.13
99	000069	华侨城 A	618,734.00	2.12
100	601611	中国核建	616,722.80	2.11
101	000423	东阿阿胶	611,965.00	2.10
102	000963	华东医药	605,373.00	2.08
103	000157	中联重科	600,706.00	2.06
104	603858	步长制药	587,763.77	2.01
105	300027	华谊兄弟	586,549.00	2.01
106	600153	建发股份	585,500.00	2.01
107	600909	华安证券	583,474.40	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	699,069,690.78
卖出股票的收入（成交）总额	207,819,176.63

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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	公允价值变动	风险说明
IF1701	IF1701	1.00	987,600.00	-43,800.00	-
公允价值变动总额合计					-43,800.00
股指期货投资本期收益					37,680.00
股指期货投资本期公允价值变动					-43,800.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	241,714.83
2	应收证券清算款	3,336,280.87
3	应收股利	-
4	应收利息	5,895.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	3,583,890.73

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
334	4,929,284.93	1,641,492,917.00	99.70%	4,888,248.00	0.30%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,630,294,585.00	99.02%
2	广发基金管理有限公司	10,001,000.00	0.61%
3	邱志婧	300,000.00	0.02%
4	朱泽刚	252,600.00	0.02%
5	方正证券股份有限公司	251,332.00	0.02%
6	胡恒	229,000.00	0.01%
7	陶洁	213,300.00	0.01%
8	杨胜斌	182,500.00	0.01%
9	张林	153,500.00	0.01%
10	李建龙	150,000.00	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 8 月 20 日)基金份额总额	308,381,165.00
本报告期期初基金份额总额	26,381,165.00
本报告期基金总申购份额	1,629,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,646,381,165.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。自 2016 年 10 月 13 日起，本基金管理人聘任张敬晗为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民

法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
国泰君安	4	8,745,962.91	0.97%	8,145.29	1.02%	-
国金证券	1	4,802,327.67	0.53%	4,472.42	0.56%	-
广发证券	7	242,616,941.64	26.98%	225,950.02	28.26%	-
方正证券	6	190,024,814.03	21.13%	138,965.29	17.38%	-
国信证券	4	152,556,787.38	16.96%	142,077.42	17.77%	-
新时代证券	1	15,112,184.32	1.68%	14,073.87	1.76%	-
中信建投	4	148,376,749.28	16.50%	138,183.46	17.28%	-
光大证券	3	136,973,133.15	15.23%	127,563.51	15.95%	-
申银万国	3	106,136.00	0.01%	98.84	0.01%	-
天风证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
中金公司	4	-	-	-	-	新增 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
平安证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

中信证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
华安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	新增 1 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
英大证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-

华宝证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
广发证券	3,326.30	0.98%	-	-	-	-
方正证券	244,134.00	71.84%	-	-	-	-
新时代证券	92,348.20	27.18%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司旗下基金（除 QDII 基金）资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-30
2	广发基金管理有限公司关于增加东兴证券为	《中国证券报》、《证券	2016-03-04

旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	时报》、《上海证券报》	
-------------------	-------------	--

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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
二〇一七年三月二十八日