

广发全球精选股票型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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。本半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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
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	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	36
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	43
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	43
7.11 投资组合报告附注	43
8 基金份额持有人信息	43

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3	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	44
9	开放式基金份额变动	44
10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
10.2	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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	49
11	影响投资者决策的其他重要信息	49
12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发全球精选股票型证券投资基金	
基金简称	广发全球精选股票(QDII)	
基金主代码	270023	
交易代码	270023	-
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 8 月 18 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	1,073,677,907.02 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在全球市场进行积极的资产配置和组合管理,有效分散基金的投资组合风险,实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将通过自上而下的资产配置策略和自下而上的个股精选策略进行基金资产的投资组合构建,注重国际宏观经济环境、政治形势、区域市场和证券市场走势的综合分析,并强调公司品质与成长性的结合,由此确定基金资产在国家与地区间的区域配置以及在股票、债券和现金等各类资产类别上的投资比例,并通过自下而上的个股精选,挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	60%×MSCI 全球指数(MSCI World Index)+40%×恒生指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

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	北京市西城区复兴门内大街55

	3号4004-56室	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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	—	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	—	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		—	香港中环德辅道中四至四 A 号渣打银行大厦 32 楼
办公地址		—	香港九龙观塘光观塘路三百八十八号渣打中心 15 楼
邮政编码		—	—

2.5 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	41,334,179.71
本期利润	160,180,584.70

加权平均基金份额本期利润	0.2307
本期加权平均净值利润率	14.21%
本期基金份额净值增长率	17.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-5,065,952.18
期末可供分配基金份额利润	-0.0047
期末基金资产净值	1,637,460,953.37
期末基金份额净值	1.525
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	96.15%

注：1、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。

2、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、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。

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
过去一个月	0.09%	0.76%	-0.54%	0.47%	0.63%	0.29%
过去三个月	5.20%	0.67%	2.87%	0.43%	2.33%	0.24%
过去六个月	17.24%	0.65%	9.36%	0.45%	7.88%	0.20%
过去一年	25.82%	0.66%	20.78%	0.51%	5.04%	0.15%
过去三年	35.80%	1.09%	20.02%	0.77%	15.78%	0.32%
自基金合同生效起 至今	96.15%	0.98%	32.26%	0.93%	63.89%	0.05%

注：1、本基金自 2014 年 6 月 10 日起，将基金业绩比较基准由“摩根士丹利综合亚太（除日本）总收益指数”变更为“60%×MSCI 全球指数（MSCI World Index）+40%×恒生指数”。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发全球精选股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010 年 8 月 18 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：本基金自 2014 年 6 月 10 日起，将基金业绩比较基准由“摩根士丹利综合亚太（除日本）总收益指数”变更为“60%×MSCI 全球指数（MSCI World Index）+40%×恒生指数”。

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、保险保障基金委托资产管理投资管理人、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 26 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、渠道管理总部、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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百四十四只开放式基金——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、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资

资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）、广发景祥纯债债券型证券投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、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、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

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		
余昊	本基金的基金经理；广发沪港深股票基金的基金经理；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理	2016-10-27	-	7 年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2010 年 6 月至 2013 年 9 月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和国际业务部任研究员，2013 年 9 月 10 日至 2014 年 3 月 25 日任广发亚太精选股票（QDII）基金的基金经理助理，2014 年 6 月 4 日至 2015 年 4 月 19 日任国际业务部专户投资经理，2015 年 4 月 20 日至 2016 年 6 月 6 日任国际业务部研究员，2016 年 6

					月 7 日起任广发沪港深股票基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起任广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理,2017 年 2 月 28 日起任广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)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、《广发全球精选股票型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。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

2017 年上半年，新兴市场和科技板块继续引领全球权益类资产价格上升，美元指数和美国国债收益率继续走低，全球经济趋势普遍向好。美联储货币政策继续走向收紧的方向，除了连续三个季度加息外，缩表也提上议程，未来多年有望对资产价格造成长期重大影响。但加息初期是对经济向好趋势的确认，缩表在短期内对实际资金的影响并不显著，全球资产价格在加息和缩表的早期和中期仍会维持较好的趋势，特别是各类资产中性性价比更高的资产类别将受到追捧。目前港股为代表的新兴市场正处于这一阶段，发达市场股票估值处于历史高位，而新兴市场股票估值仍处于历史中位，同时这两年新兴市场特别是中国的盈利趋势显著改善。上半年港股的强势，一方面是大陆-香港体系中，资金配置到低估值的港股；另一方面是香港-全球体系中，在流动性大拐点之前，由于港股估值低于发达市场，国际资金流入港股追逐涨幅落后估值便宜的港股。

上半年本基金维持了高仓位，在国家区域方面，维持了香港和美国的配置；在行业方面，主要关注科技、非银金融、工业和医药。

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 17.24%，同期业绩比较基准收益率为 9.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为港股下半年有望延续 AH 估值体系融合和新兴市场追落后的过程，个股的选股机会有望强于指数机会。上半年，港股在各类基本面或者资金面的压力测试中表现超预期的良好，比如三月的经济预期边际转差，中东和朝鲜危机，美股科技股短期大幅下挫等，在 AH 溢价仍在同时企业盈利持续改善等因素不变的情况下，管理人认为港股下半年仍充满机会。管理人将根据市场预期的发

展灵活调整策略，重点发掘盈利复苏超预期的公司，坚持从下往上精选个股。

4.6 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及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。

4.7 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，2017 年 6 月 29 日广发全球精选股票型证券投资基金每 10 份基金份额分配人民币 1.870 元，美元现汇基金份额的每份额分配金额为人民币份额的每份额分配数额按照权益登记日前一工作日美元估值汇率折算后的美元金额，计算结果以美元为单位，符合基金合同规定。

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全球精选股票型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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发全球精选股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发全球精选股票型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。

5.3 托管人对本半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全球精选股票型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发全球精选股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	279,146,388.01	81,673,109.94
结算备付金		21,117,506.87	52,339,473.11
存出保证金		-	1,525,267.82
交易性金融资产	6.4.7.2	1,447,509,735.49	855,520,462.81
其中：股票投资		1,447,509,735.49	855,520,462.81
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,376,743.63	-
应收利息	6.4.7.5	53,414.47	4,912.12
应收股利		4,780,052.84	119,459.80
应收申购款		5,345,513.85	1,091,163.47
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,780,329,355.16	992,273,849.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,489,953.63	120.76
应付赎回款		4,918,988.19	16,127,717.07
应付管理人报酬		1,960,513.50	1,673,858.79
应付托管费		381,210.96	325,472.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	756,280.89	650,914.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		132,067,653.59	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	293,801.03	499,869.43
负债合计		142,868,401.79	19,277,952.74
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,073,677,907.02	666,969,532.01
未分配利润	6.4.7.1 0	563,783,046.35	306,026,364.32
所有者权益合计		1,637,460,953.37	972,995,896.33
负债和所有者权益总计		1,780,329,355.16	992,273,849.07

注:报告截止日 2017 年 06 月 30 日,基金份额净值人民币 1.525 元,基金份额总额 1,073,677,907.02 份。

6.2 利润表

会计主体: 广发全球精选股票型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		174,707,109.18	-29,790,671.34
1. 利息收入		202,076.10	772,337.38
其中: 存款利息收入	6.4.7.1 1	202,076.10	772,337.38

债券利息收入		-	-
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）		57,526,449.69	-44,487,330.61
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	51,721,297.83	-55,038,125.98
基金投资收益	6.4.7.1 3	-	2,280,189.02
债券投资收益	6.4.7.1 4	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-2,243,905.43	3,542,413.58
股利收益	6.4.7.1 6	8,049,057.29	4,728,192.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	118,846,404.99	11,585,077.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,178,963.11	1,471,645.74
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	311,141.51	867,598.70
减：二、费用		14,526,524.48	11,403,637.23
1. 管理人报酬		10,026,755.47	6,633,283.91
2. 托管费		1,949,646.88	1,289,805.21
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	2,371,049.41	3,279,901.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.2 0	179,072.72	200,646.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		160,180,584.70	-41,194,308.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		160,180,584.70	-41,194,308.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	666,969,532.01	306,026,364.32	972,995,896.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	160,180,584.70	160,180,584.70
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）	406,708,375.01	290,794,976.29	697,503,351.30
其中：1. 基金申购款	612,594,508.23	423,007,394.77	1,035,601,903.00
2. 基金赎回款	-205,886,133.22	-132,212,418.48	-338,098,551.70
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）	-	-193,218,878.96	-193,218,878.96
五、期末所有者权益（基金净值）	1,073,677,907.02	563,783,046.35	1,637,460,953.37
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	767,381,125.37	404,363,753.37	1,171,744,878.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-41,194,308.57	-41,194,308.57
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）	-86,254,010.41	-43,306,075.75	-129,560,086.16
其中：1. 基金申购款	401,250,621.40	170,864,389.11	572,115,010.51
2. 基金赎回款	-487,504,631.81	-214,170,464.86	-701,675,096.67
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）	-	-12,946,648.16	-12,946,648.16
五、期末所有者权益（基金净值）	681,127,114.96	306,916,720.89	988,043,835.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发全球精选股票型证券投资基金(原名为广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金，以下简

称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2010]644 号《关于同意广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金募集的批复》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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2010 年 8 月 18 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,境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。本基金已向中国证监会备案,并于 2010 年 8 月 18 日获得确认。

本基金募集期为 2010 年 7 月 19 日至 2010 年 8 月 16 日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集为人民币 540,598,089.38 元,有效认购户数为 6,610 户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 23,922.99 元,折合基金份额 23,922.99 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有限公司验资。基金合同于 2010 年 8 月 18 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 540,598,089.38 份。

根据本基金的管理人于 2014 年 6 月 10 日发布的《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》,变更本基金的投资范围及相关事项,本基金的投资范围将由修改前主要投资亚太地区(除日本)变更为投资于全球主要证券市场。基于上述投资范围的变更并根据法律法规的更新情况,相应地对《基金合同》中有关本基金的名称、基金的投资目标、投资理念、投资策略和业绩比较基准及其他部分条款,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改,广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议经中国证券监督管理委员会于 2014 年 6 月 9 日备案确认,自该日生效。根据《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金变更投资范围等事项的议案》及《〈广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同〉修改说明》的规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,基金管理人已将《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》、《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金托管协议》修订为《广发全球精选股票型证券投资基金基金合同》、《广发全球精选股票型证券投资基金托管协议》,并据此更新了《广发全球精选股票型证券投资基金招募说明书》,上述文件已经报中国证监会审核。修订后的文件将自中国证监会备案确认本次持有人大会决议生效之日起生效,原《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》、《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金托管协议》失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》

和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等；现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。本基金的基金资产将投资于全球主要证券市场，其中投资于与中国证监会签订了双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%。如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，本基金投资的主要证券市场将相应调整。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准采用：60%×MSCI 全球指数（MSCI World Index）+40%×恒生指数。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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

[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关境内外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. 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	279,146,388.01
定期存款	—
其他存款	—
合计	279,146,388.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,300,340,136.54	1,447,509,735.49	147,169,598.95
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		1,300,340,136.54	1,447,509,735.49	147,169,598.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	49,092.20
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	4,322.27
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	53,414.47

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	756,280.89
银行间市场应付交易费用	—
合计	756,280.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	15,280.73
预提费用	278,520.30
合计	293,801.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	666,969,532.01	666,969,532.01
本期申购	612,594,508.23	612,594,508.23
本期赎回（以“-”号填列）	-205,886,133.22	-205,886,133.22
本期末	1,073,677,907.02	1,073,677,907.02

注：申购含转换转入、红利再投资份(金)额，赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 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	79,484,645.66	226,541,718.66	306,026,364.32
本期利润	41,334,179.71	118,846,404.99	160,180,584.70
本期基金份额交易产生的变动数	67,334,101.41	223,460,874.88	290,794,976.29
其中：基金申购款	94,066,027.47	328,941,367.30	423,007,394.77
基金赎回款	-26,731,926.06	-105,480,492.42	-132,212,418.48
本期已分配利润	-193,218,878.96	-	-193,218,878.96
本期末	-5,065,952.18	568,848,998.53	563,783,046.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	189,380.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,628.51
其他	2,067.08
合计	202,076.10

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	303,213,811.66
减：卖出股票成本总额	251,492,513.83
买卖股票差价收入	51,721,297.83

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出权证成交总额	44,705.13
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	44,705.13

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	-2,288,610.56

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,049,057.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,049,057.29

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	118,846,404.99
——股票投资	118,846,404.99
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——股指期货	-
4. 其他	-
合计	118,846,404.99

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	310,939.82
基金转换费收入	201.69
合计	311,141.51

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,371,049.41
银行间市场交易费用	-

合计	2,371,049.41
----	--------------

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	352.42
开户费	200.00
合计	179,072.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
渣打银行（香港）有限公司	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	831,724,083.65	81.91%	-	-

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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
广发证券股份有有限 公司	831,724.05	67.95%	756,280.89	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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
广发证券股份有有限 公司	-	-	2,102,528.80	72.59%

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。

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双方约定的佣金率计算。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,026,755.47	6,633,283.91
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,087,634.90	661,648.56

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.8%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	1,949,646.88	1,289,805.21

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

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

本基金托管费包含境外托管人托管费。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2017年1月1日至2017年6月30 日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
期初持有的基金份额	50,737,694.21	50,737,694.21
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	50,737,694.21	50,737,694.21
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.73%	7.45%

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渣打银行(香港)有限公司	11,659,715.90	16,685.63	57,549,290.61	14,118.75
中国工商银行股份有限公司	267,486,672.11	172,694.88	259,059,909.98	729,702.93

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和境外资产托管人渣打银行(香港)有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	场内 除息 日	场外 除息 日	每 10 份基 金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资 形式 发放总 额	利润分 配 合计	备注
1	2017-06-30	-	2017-06-29	1.870	132,079,829.92	61,139,049.04	193,218,878.96	-

合	-	-			132,079,829	61,139,	193,218	
计			-	1.870	.92	049.04	,878.96	-

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
940 HK	CHINA ANIMAL HEALTH CARE LTD	2015-03-30	重大事项	0.00	-	-	573,000.00	2,132,091.76	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此与债券相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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重大风险，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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	279,146,388.01	-	-	-	279,146,388.01
结算备付金	-	-	-	21,117,506.87	21,117,506.87
交易性金融资产	-	-	-	1,447,509,735.49	1,447,509,735.49
应收股利	-	-	-	4,780,052.84	4,780,052.84
应收利息	-	-	-	53,414.47	53,414.47
应收申购款	1,000,683.69	-	-	4,344,830.16	5,345,513.85
应收证券清算款	-	-	-	22,376,743.63	22,376,743.63

资产总计	280,147,071.70	-	-	1,500,182,283.46	1,780,329,355.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,918,988.19	4,918,988.19
应付管理人报酬	-	-	-	1,960,513.50	1,960,513.50
应付托管费	-	-	-	381,210.96	381,210.96
应付交易费用	-	-	-	756,280.89	756,280.89
应付证券清算款	-	-	-	2,489,953.63	2,489,953.63
应付利润	-	-	-	132,067,653.59	132,067,653.59
其他负债	-	-	-	293,801.03	293,801.03
负债总计	-	-	-	142,868,401.79	142,868,401.79
利率敏感度缺口	280,147,071.70	-	-	1,357,313,881.67	1,637,460,953.37
上年度末 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	81,673,109.94	-	-	-	81,673,109.94
结算备付金	10,347,208.20	-	-	41,992,264.91	52,339,473.11
交易性金融资产	-	-	-	855,520,462.81	855,520,462.81
应收股利	-	-	-	119,459.80	119,459.80
应收利息	-	-	-	4,912.12	4,912.12
应收申购款	141,317.55	-	-	949,845.92	1,091,163.47
存出保证金	1,525,267.82	-	-	-	1,525,267.82
资产总计	93,686,903.51	-	-	898,586,945.56	992,273,849.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,127,717.07	16,127,717.07
应付管理人报酬	-	-	-	1,673,858.79	1,673,858.79
应付托管费	-	-	-	325,472.55	325,472.55
应付证券清算款	-	-	-	120.76	120.76
应付交易费用	-	-	-	650,914.14	650,914.14
其他负债	-	-	-	499,869.43	499,869.43

负债总计	-	-	-	19,277,952.74	19,277,952.74
利率敏感度缺口	93,686,903.51	-	-	879,308,992.82	972,995,896.33

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	3,964,374.47	11,455,935.49	4.21	15,420,314.17
结算备付金	1,660.74	21,115,846.13	-	21,117,506.87
交易性金融资产	138,473,891.32	1,309,035,844.17	-	1,447,509,735.49
应收股利	36,581.76	1,094,881.08	-	1,131,462.84
应收利息	39.70	-	-	39.70
应收申购款	286,535.78	-	-	286,535.78
资产合计	142,763,083.77	1,342,702,506.87	4.21	1,485,465,594.85
以外币计价的负债				

应付赎回款	55,109.20	-	-	55,109.20
应付证券清算款	-	2,489,953.63	-	2,489,953.63
应付利润	4,208,536.86	-	-	4,208,536.86
其他负债	183.79	-	-	183.79
负债合计	4,263,829.85	2,489,953.63	-	6,753,783.48
资产负债表 外汇风险敞 口净额	138,499,253.92	1,340,212,553.24	4.21	1,478,711,811.37
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	40,732,359.92	26,387,715.07	4.10	67,120,079.09
交易性金融资产	124,047,281.39	731,473,181.42	-	855,520,462.81
应收股利	37,459.80	-	-	37,459.80
应收利息	325.14	-	-	325.14
应收申购款	73,835.28	-	-	73,835.28
结算备付金	1,700.61	41,990,564.30	-	41,992,264.91
资产合计	164,892,962.14	799,851,460.79	4.10	964,744,427.03
以外币计价的负债				
应付赎回款	66,134.24	-	-	66,134.24
其他负债	249.25	-	-	249.25
负债合计	66,383.49	-	-	66,383.49
资产负债表 外汇风险敞 口净额	164,826,578.65	799,851,460.79	4.10	964,678,043.54

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

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
		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	53,327,402.25	48,233,902.18
	所有外币相对人民币贬值 5%	-53,327,402.25	-48,233,902.18

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	1,447,509,735.49	88.40	855,520,462.81	87.93
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,447,509,735.49	88.40	855,520,462.81	87.93

6.4.13.4.3.2 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
		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	74,742,442.22	45,101,377.12
	业绩比较基准下降 5%	-74,742,442.22	-45,101,377.12

6.4.14 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 6.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 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 1,447,509,735.49 元，第三层级的余额为 0.00 元，无属于第二层级的余额，其中列入属于第三层级余额为 0.00 元的金融工具为因重大事项停牌的股票（2016 年 12 月 31 日：第一层级 854,987,406.41 元，第三层级 533,056.40，无属于第二层级的余额）。

(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。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层级的余额为 0.00 元（2016 年 12 月 31 日：533,056.40 元）。该项归属于第三层级的金融工具为中国动物保健品有限公司于香港联交所上市的股票，管理人自 2016 年 1 月 14 日起对其运用可比公司法进行估值。估值调整导致 2016 年度第三层级新增转入金额 2,519,102.82 元及新增计入损益的损失金额 1,986,046.42 元。其中，对公司的盈利预期及可比公司的市盈率是估值模型重要的不可观测输入值，与公允价值正相关。

此后，管理人根据公司最新公告情况，预期该项投资的可回收金额为 0.00 元，并于 2017 年 6 月 21 日起调整了该股票的估值。估值调整导致本报告期第三层级新增转入金额 0.00 元及新增计入损益的损失金额 533,056.40 元。其中，预期可回收金额为重要的不可观测输入值，与公允价值正相关。

除上述事项外，本报告期内及上年度可比期间内，本基金的金融工具中属于第三层级的余额无变动。

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。

7 投资组合报告

7.1 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	1,447,509,735.49	81.31
	其中：普通股	1,379,391,375.37	77.48
	存托凭证	68,118,360.12	3.83
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
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	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	300,263,894.88	16.87
8	其他各项资产	32,555,724.79	1.83
9	合计	1,780,329,355.16	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	1,309,035,844.17	79.94
美国	138,473,891.32	8.46
合计	1,447,509,735.49	88.40

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括注册地为开曼群岛上市的 ADR。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	54,340,471.20	3.32
材料	33,987,747.20	2.08
工业	193,077,569.99	11.79
非必须消费品	88,148,927.26	5.38
必须消费品	18,395,564.40	1.12
保健	52,121,286.55	3.18
金融	436,752,792.98	26.67
信息技术	459,773,879.11	28.08
电信服务	50,339,360.00	3.07
公共事业	50,981,620.80	3.11
房地产	9,590,516.00	0.59
合计	1,447,509,735.49	88.40

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股 有限公司	700 HK	香港交 易所	中国香港	690,000.00	167,203,052.16	10.21
2	PING AN INSURANC E GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港交 易所	中国香港	2,500,000.00	111,636,210.00	6.82
3	BYD ELECTRON IC INTL CO LTD	比亚迪电 子	285 HK	香港交 易所	中国香港	8,000,000.00	107,483,212.80	6.56
4	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港交 易所	中国香港	1,800,000.00	89,126,704.80	5.44
5	CHINA CONSTRUC TION BANK-H	建设银行	939 HK	香港交 易所	中国香港	16,000,000.00	84,014,656.00	5.13

6	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国太保	2601 HK	香港交易所	中国香港	3,000,000.00	83,059,944.00	5.07
7	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	762 HK	香港交易所	中国香港	5,000,000.00	50,339,360.00	3.07
8	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	ASM 太平洋	522 HK	香港交易所	中国香港	450,000.00	41,204,502.00	2.52
9	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	中车时代电气	3898 HK	香港交易所	中国香港	1,217,000.00	40,454,705.91	2.47
10	STARBUCK S CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	101,000.00	39,896,541.66	2.44
11	ALIBABA GROUP HOLDING- SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	40,000.00	38,180,518.40	2.33
12	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港交易所	中国香港	10,000,000.00	35,931,888.00	2.19
13	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING	理文造纸	2314 HK	香港交易所	中国香港	5,000,000.00	31,462,100.00	1.92
14	NETEASE INC-ADR	网易公司	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	14,700.00	29,937,841.72	1.83
15	DFZQ-H	东方证券股份有限公司	958 HK	香港交易所	中国香港	4,500,000.00	29,136,074.40	1.78
16	AIR CHINA LTD-H	中国国航	753 HK	香港交易所	中国香港	4,000,000.00	27,947,024.00	1.71
17	STANDARD CHARTERED PLC	渣打集团	2888 HK	香港交易所	中国香港	398,000.00	27,150,967.78	1.66
18	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港交易所	中国香港	3,000,000.00	22,262,148.00	1.36
19	DATANG	大唐发电	991 HK	香港交易所	中国香港	10,000,000.00	21,611,208.00	1.32

	INTL POWER GEN CO-H			易所		0.00		
20	CHINA PETROLEU M & CHEMICAL -H	中国石化	386 HK	香港交 易所	中国香港	4,000,000 .00	21,142,531.20	1.29
21	SINOTRAN S LIMITED- H	中国外运	598 HK	香港交 易所	中国香港	6,000,000 .00	20,830,080.00	1.27
22	HAITIAN INTERNAT IONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	香港交 易所	中国香港	1,000,000 .00	19,007,448.00	1.16
23	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC- H	金风科技	2208 HK	香港交 易所	中国香港	1,900,000 .00	18,799,147.20	1.15
24	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,000.00	18,468,301.54	1.13
25	ZHOU HEI YA INTERNAT IONAL HO	周黑鸭国 际	1458 HK	香港交 易所	中国香港	2,700,000 .00	18,395,564.40	1.12
26	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港交 易所	中国香港	700,000.0 0	18,165,565.60	1.11
27	CHINA DONGXIAN G GROUP CO	中国动向	818 HK	香港交 易所	中国香港	15,000,00 0.00	18,096,132.00	1.11
28	GUANGSHE N RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	525 HK	香港交 易所	中国香港	5,000,000 .00	16,794,252.00	1.03
29	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	香港交 易所	中国香港	3,500,000 .00	15,492,372.00	0.95
30	CHINA RESOURCE S GAS GROUP LT	华润燃气	1193 HK	香港交 易所	中国香港	600,000.0 0	13,878,040.80	0.85

31	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT -H	中国信达 资产管理 股份有限 公司	1359 HK	香港交 易所	中国香港	5,000,000 .00	12,628,236.00	0.77
32	SHANGHAI PHARMACE UTICALS- H	上海医药	2607 HK	香港交 易所	中国香港	600,000.0 0	12,107,484.00	0.74
33	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽约证 券交易 所	美国	30,000.00	11,990,688.00	0.73
34	QINHUANG DAO PORT CO LTD-H	秦港股份	3369 HK	香港交 易所	中国香港	5,000,000 .00	11,977,296.00	0.73
35	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都 机场	694 HK	香港交 易所	中国香港	1,200,000 .00	11,456,544.00	0.70
36	GREENTOW N SERVICE GROUP CO L	绿城服务 集团有限 公司	2869 HK	香港交 易所	中国香港	3,000,000 .00	11,144,092.80	0.68
37	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港交 易所	中国香港	1,800,000 .00	10,935,792.00	0.67
38	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL- H	山东威高	1066 HK	香港交 易所	中国香港	2,000,000 .00	10,640,699.20	0.65
39	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港交 易所	中国香港	500,000.0 0	9,590,516.00	0.59
40	SSY GROUP LTD	石四药集 团	2005 HK	香港交 易所	中国香港	3,290,000 .00	9,108,907.19	0.56
41	SINO BIOPHARM ACEUTICA L	中国生物 制药	1177 HK	香港交 易所	中国香港	1,500,000 .00	8,982,972.00	0.55
42	TECHNOVA TOR INTERNAT IONAL LT	同方泰德	1206 HK	香港交 易所	中国香港	4,000,000 .00	8,922,217.60	0.54
43	XINYI	信义光能	968 HK	香港交	中国香港	3,300,000	6,387,023.28	0.39

	SOLAR HOLDINGS LTD			易所		.00		
44	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际	152 HK	香港交易所	中国香港	500,000.00	6,214,307.20	0.38
45	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	上海复旦	1385 HK	香港交易所	中国香港	1,334,000.00	6,055,321.61	0.37
46	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	同仁堂科技	1666 HK	香港交易所	中国香港	500,000.00	5,233,557.60	0.32
47	SINOTRANS SHIPPING LTD	中外运航运	368 HK	香港交易所	中国香港	2,500,000.00	4,274,506.00	0.26
48	LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP-H	丽珠集团	1513 HK	香港交易所	中国香港	80,000.00	3,818,848.00	0.23
49	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方	581 HK	香港交易所	中国香港	1,000,000.00	2,525,647.20	0.15
50	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深高速	548 HK	香港交易所	中国香港	400,000.00	2,468,364.48	0.15
51	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港交易所	中国香港	600,000.00	2,228,818.56	0.14
52	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	哈尔滨电气	1133 HK	香港交易所	中国香港	500,000.00	1,709,802.40	0.10
53	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	中国动物保健品	940 HK	香港交易所	中国香港	573,000.00	0.00	0.00

注：1、此处所用证券代码的类别是当地市场代码

2、其中 50 万股的 152 HK、800 万股 285 HK、400 万股 386 HK、500 万股 525 HK、40 万股 548 HK、300 万股 753 HK、300 万股 883 HK、330 万股 968 HK、200 万股 1066 HK、350 万股 1083 HK、180 万股 1171 HK、150 万股 1177 HK、180 万股 1299 HK、500 万股 1359 HK、170 万股 1458 HK、100 万股 1882 HK、500 万股 2314 HK、250 万股 2318 HK、300 万股 2601 HK、60 万股 2607 HK、39.8 万股 2888 HK、70 万股 3606 HK、121.7 万股 3898 HK、45 万股 522 HK、51 万股 700 HK、500 万股 762 HK、

1600 万股 939 HK 通过沪港通持有；60 万股 1193 HK、300 万股 2869 HK、100 万股 1458 HK、240 万 991 HK、60 万股 2186 HK、100 万股 368 HK 通过深港通持有。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	163,987,523.11	16.85
2	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	115,702,848.23	11.89
3	AIA GROUP LTD	1299 HK	91,165,909.40	9.37
4	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	86,400,515.89	8.88
5	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2601 HK	80,905,621.59	8.32
6	AIR CHINA LTD-H	753 HK	22,508,816.69	2.31
7	DATANG INTL POWER GEN CO-H	991 HK	21,836,927.31	2.24
8	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	1458 HK	19,869,979.43	2.04
9	JILIN JIUTAI RURAL COMMERC-H	6122 HK	16,302,000.00	1.68
10	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	12,378,500.02	1.27
11	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	694 HK	11,613,339.19	1.19
12	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	11,278,344.26	1.16
13	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2607 HK	11,027,274.21	1.13
14	QINHUANGDAO PORT CO LTD-H	3369 HK	10,831,079.30	1.11
15	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	9,455,174.29	0.97
16	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	2869 HK	9,166,125.04	0.94
17	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	8,852,236.67	0.91
18	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	6,020,193.08	0.62
19	SINOTRANS SHIPPING LTD	368 HK	3,995,314.78	0.41
20	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	1513 HK	3,684,540.52	0.38

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	96,689,649.47	9.94
2	CITIC TELECOM INTERNATIONAL	1833 HK	29,733,202.81	3.06
3	CITIC SEC-H	6030 HK	25,214,036.56	2.59
4	HUATAI SECURIT-H	6886 HK	19,410,697.24	1.99
5	JILIN JIUTAI RURAL COMMERC-H	6122 HK	17,055,167.11	1.75
6	FOSUN INTERNATIONAL LTD	656 HK	15,599,177.42	1.60
7	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	13,856,187.51	1.42
8	DFZQ-H	3958 HK	13,299,492.02	1.37
9	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	1829 HK	13,288,450.64	1.37
10	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1359 HK	12,633,838.22	1.30
11	SHANDONG LUOXIN PHARMACEUT-H	8058 HK	11,828,183.98	1.22
12	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	11,112,741.34	1.14
13	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	548 HK	9,927,769.83	1.02
14	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1186 HK	9,656,254.63	0.99
15	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	2,769,706.26	0.28
16	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LT	1206 HK	1,139,256.62	0.12
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	724,635,381.52
卖出收入（成交）总额	303,213,811.66

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.11.3 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	—
2	应收证券清算款	22,376,743.63
3	应收股利	4,780,052.84
4	应收利息	53,414.47
5	应收申购款	5,345,513.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	32,555,724.79

7.11.4 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。

7.11.5 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不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
36,557	29,369.97	728,288,098.60	67.83%	345,389,808.42	32.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,056,757.96	0.0984%

8.3 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年8月18日）基金份额总额	540,598,089.38
本报告期期初基金份额总额	666,969,532.01
本报告期基金总申购份额	612,594,508.23
减：本报告期基金总赎回份额	205,886,133.22
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,073,677,907.02

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
BOCOM International	-	-	-	-	-	-

l Securities Limited						
CCB International Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities HK LTD	-	-	-	-	-	-
China Galaxy International Securities	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Limited	-	13,856,187.51	1.36%	4,099.86	0.33%	-
China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	136,446,094.41	13.44%	204,669.16	16.72%	-
Daewoo Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
Daishin Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities	-	16,972,249.24	1.67%	20,366.69	1.66%	-

Group Inc						
DBS Vickers Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-
Essence International Financial Holdings Limited	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan International Holdings Limited	-	16,384,917.87	1.61%	163,127.79	13.33%	-
Haitong International Securities Company Ltd.	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Hyundai Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
KGI Asia	-	-	-	-	-	-

Limited						
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Oriental Patron Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Ping an of China Securities (Hong Kong)	-	-	-	-	-	-
Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Samsung Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities (H. K.) Limited	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Woori Investment and Securities	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	831,724,083.65	81.91%	831,724.05	67.95%	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i. 财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- ii. 研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；
- iii. 交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；
- iv. 清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；
- v. 能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；
- vi. 经营行为规范，有健全的内部控制制度；
- vii. 具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

- i. 本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。
- ii. 本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。
- iii. 本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分，可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 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 QDII 基金资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-07-03
2	广发基金管理有限公司关于广发全球精选股票型证券投资基金收益分配公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-06-28
3	广发基金管理有限公司关于增加郑州银行为广发全球精选股票型证券投资基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-01-11

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20170626-20170630	0.00	344,233,505.45	0.00	344,233,505.45	32.06%
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。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发全球精选股票型证券投资基金募集的文件
2. 《广发全球精选股票型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. 《广发全球精选股票型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 《关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金份额持有人大会决议生效公告》
7. 中国证监会批准广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金募集的文件；
8. 《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金基金合同》；
9. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
10. 《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金托管协议》；
11. 《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版；
12. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
13. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

二〇一七年八月二十五日