

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券 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 信息披露方式	6
2.5 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	14
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	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	19
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	47
7.7 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	47
7.8 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	47
7.9 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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
8 基金份额持有人信息	49

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	49
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	50
9	开放式基金份额变动	50
10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	51
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	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	52
11	影响投资者决策的其他重要信息	52
12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	53

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指信息技术 ETF
场内简称	信息技术
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 8 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	330,828,053.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 2 月 5 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法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95566
传真		020-89899158	(010) 66594942

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1 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1 号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	田国立

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	-20,884,912.36
本期利润	-422,842.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0012
本期加权平均净值利润率	-0.11%
本期基金份额净值增长率	-0.60%
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	-32,239,991.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0975
期末基金资产净值	358,073,112.43
期末基金份额净值	1.0824
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	8.24%

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
过去一个月	5.60%	1.08%	5.39%	1.10%	0.21%	-0.02%
过去三个月	-1.58%	1.04%	-2.57%	1.06%	0.99%	-0.02%
过去六个月	-0.60%	1.00%	-2.98%	1.02%	2.38%	-0.02%
过去一年	-10.20%	1.04%	-13.84%	1.06%	3.64%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.24%	2.41%	26.28%	2.46%	-18.04%	-0.05%

注：业绩比较基准为：中证全指信息技术指数收益率。

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

广发中证全指信息技术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历史走势对比图
 (2015年1月8日至2017年6月30日)



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		
霍华明	本基金的基金经理；广发信息技术联接基金的基金经	2017-04-20	-	9 年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，自 2008 年 7 月加入广发基金管理有限公司，2008 年 7 月至 2012 年 6

	理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理				月在注册登记部工作，2012 年 7 月至 2017 年 4 月在数量投资部先后任数据分析员、ETF 基金助理与量化研究员，2017 年 4 月 20 日起任广发中证全指医药卫生 ETF 及联接基金、广发中证全指信息技术 ETF 及联接基金的基金经理。
陆志明	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发信息技术联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源 ETF 基金的基金经理；广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理；广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理；广发金融地产联接基金的基金经理；广发能源联接基金的基金经理；广发原材料联接基金的基金经理；广发主要消费联	2015-01-08	-	18 年	男，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，1999 年 5 月至 2001 年 5 月在大鹏证券有限公司任研究员，2001 年 5 月至 2010 年 8 月在深圳证券信息有限公司任部门总监，2010 年 8 月 9 日至 2016 年 5 月 29 日任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 27 日任广发中小板 300ETF 基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 27 日任广发中小板 300ETF 联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 27 日任广发深证 100 指数分级基金的基金经理，2014 年 6 月 3 日起任广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理，2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 27 日任广发百发 100 指数基金的基金经理，2014 年 12 月 1 日起任广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 8 日起任广发中证全指信息技术 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 29 日起任广发中证全指信息技术 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 3 月 23 日起任广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理，2015 年 4 月 15 日起任广发可选消费联接基金的基金经理，2015 年 5 月 6 日起任广发医药卫生联接基金的基金经理，2015 年 6 月 25 日起任广发中证全指能源 ETF 和广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理，2015 年 7 月 1 日起任广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理，2015 年 7 月 9 日起任广发能源联接和广发金融地产联接基

	接基金的基金经理；广发全指工业 ETF 联接基金的基金经理；广发中证全指工业 ETF 基金的基金经理；数量投资部副总经理				金的基金经理, 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 27 日任广发医疗指数分级基金的基金经理, 2015 年 8 月 18 日起任广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理, 2016 年 5 月 30 日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理, 2017 年 6 月 13 日起任广发中证全指工业 ETF 和广发全指工业 ETF 联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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、《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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，本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素，作为 ETF 基金，由于本基金规模较小，申购赎回对本基金的跟踪效果有较大影响。

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-0.60%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年，市场的结构严重分化，代表大盘的沪深 300 指数创新高，而代表小盘的中证 1000 指数表现偏弱。根据统计局公告的数据，二季度 GDP 增速为 6.9%，经济内生增长较强，宏观经济端的超预期表现使得近期周期行业股票表现强势。另外，6 月工业增加值同比增速 7.6%；6 月单月固定资产投资增速同比回升至 8.8%，其中制造业投资同比从上月的 5.9% 上升到 6 月的 6.6%，基建从上月的 13.1% 大幅上升到 6 月的 17.3%；社会消费品零售总额 6 月同比上升 11%。众多经济数据预示着未来经济逐步走入正轨。互联网是全球未来的发展方向，背后体现了信息技术的潜在产业机会，尤其对软件企业来说，未来充满了机遇和发展，信息技术将会更深一步地推动全球一体化，未来继续看好信息技术板块的业绩表现。

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“基金的收益与分配”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。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的

规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

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	4,112,787.70	6,729,337.93
结算备付金		14,010.97	10,303.11
存出保证金		24,177.36	7,591.68
交易性金融资产	6.4.7.2	354,455,073.42	411,026,140.90
其中：股票投资		354,395,778.41	411,026,140.90
基金投资		-	-
债券投资		59,295.01	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	771.97	1,169.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		358,606,821.42	417,774,542.71
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2017 年 6 月 30 日	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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		145,658.93	180,722.48
应付托管费		29,131.80	36,144.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	133,804.60	74,990.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	225,113.66	631,579.98
负债合计		533,708.99	923,437.86
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	330,828,053.00	382,828,053.00
未分配利润	6.4.7.1 0	27,245,059.43	34,023,051.85
所有者权益合计		358,073,112.43	416,851,104.85
负债和所有者权益总计		358,606,821.42	417,774,542.71

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0824 元，基金份额总额 330,828,053.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

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		1,078,557.35	-89,435,488.56
1. 利息收入		27,661.43	21,031.02
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	27,653.55	21,031.02
债券利息收入		7.88	-
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）		-19,370,201.01	-46,014,385.01
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-20,690,283.09	-47,455,169.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	1,320,082.08	1,440,784.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	20,462,070.15	-43,288,876.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-40,973.22	-153,258.43
减：二、费用		1,501,399.56	1,789,112.35
1. 管理人报酬		948,201.15	1,162,038.75
2. 托管费		189,640.31	232,407.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	107,089.98	115,449.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	256,468.12	279,216.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-422,842.21	-91,224,600.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-422,842.21	-91,224,600.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

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）	382,828,053.00	34,023,051.85	416,851,104.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-422,842.21	-422,842.21
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）	-52,000,000.00	-6,355,150.21	-58,355,150.21
其中：1. 基金申购款	54,000,000.00	4,669,796.82	58,669,796.82
2. 基金赎回款	-106,000,000.00	-11,024,947.03	-117,024,947.03
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）	330,828,053.00	27,245,059.43	358,073,112.43
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）	408,828,053.00	180,281,751.30	589,109,804.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-91,224,600.91	-91,224,600.91
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）	-28,000,000.00	-10,817,338.81	-38,817,338.81
其中：1. 基金申购款	140,000,000.00	12,501,875.06	152,501,875.06
2. 基金赎回款	-168,000,000.00	-23,319,213.87	-191,319,213.87
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）	380,828,053.00	78,239,811.58	459,067,864.58

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

广发中证全指信息技术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[2014]1269号《关于核准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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》等有关规定和《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2015年1月8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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2014年12月15日至2014年12月26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354,828,053.00元,有效认购户数为3,988户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币22,681.00元,折合基金份额22,681.00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》、《公开募集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:中证全指信息技术指数的成份股、备选成份股。可少量投资于非成份股(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、权证、股指期货、货币市场工具及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。本基金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95%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准:中证全指信息技术指数收益率。

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(以下简称“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6月30日的财务状况以及2017年上半年度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

本基金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[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，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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	4,112,787.70
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,112,787.70

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	415,222,527.61	354,395,778.41	-60,826,749.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	52,100.00	59,295.01
	银行间市场	-	-
	合计	52,100.00	59,295.01
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	415,274,627.61	354,455,073.42	-60,819,554.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本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	731.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	9.81
应收结算备付金利息	23.20
应收债券利息	7.88
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	771.97

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	133,804.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	133,804.60

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	-
预提费用	198,356.09
应付指数使用费	26,757.57
合计	225,113.66

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	382,828,053.00	382,828,053.00
本期申购	54,000,000.00	54,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-106,000,000.00	-106,000,000.00
本期末	330,828,053.00	330,828,053.00

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	-14,074,182.57	48,097,234.42	34,023,051.85
本期利润	-20,884,912.36	20,462,070.15	-422,842.21
本期基金份额交易产生的变动数	2,719,103.66	-9,074,253.87	-6,355,150.21
其中：基金申购款	-3,089,250.52	7,759,047.34	4,669,796.82

基金赎回款	5,808,354.18	-16,833,301.21	-11,024,947.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,239,991.27	59,485,050.70	27,245,059.43

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	25,913.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	176.42
结算备付金利息收入	1,563.81
其他	-
合计	27,653.55

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-458,574.51
股票投资收益——赎回差价收入	-20,231,708.58
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-20,690,283.09

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	43,252,192.13
减：卖出股票成本总额	43,710,766.64
买卖股票差价收入	-458,574.51

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	117,024,947.03
减：现金支付赎回款总额	2,722,775.03
减：赎回股票成本总额	134,533,880.58
赎回差价收入	-20,231,708.58

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	1,320,082.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,320,082.08

6.4.7.16 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	20,466,910.15
——股票投资	20,459,715.14
——债券投资	7,195.01
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-4,840.00
合计	20,462,070.15

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

6.4.7.17 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	-
手续费返还	-
基金转换费收入	-
印花税返还	-
替代损益	-40,973.22
其他	-
合计	-40,973.22

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购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确认日估值的差额。

6.4.7.18 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	107,089.98
银行间市场交易费用	-
合计	107,089.98

6.4.7.19 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	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	1,220.00
上市费	29,752.78
指数使用费	56,892.03
合计	256,468.12

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。

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
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	本基金的联接基金

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	546,557.51	0.68%	890,421.00	0.99%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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
广发证券股份有限公司	509.02	0.87%	509.02	0.38%
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
广发证券股份有限公司	829.23	1.25%	-	-

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。

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	948,201.15	1,162,038.75
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 5 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	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	189,640.31	232,407.76

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 5 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。

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	208,562,137.00	63.04%	243,381,837.00	63.57%
广发证券股份有限公司	2,209,944.00	0.67%	2,233,845.00	0.58%

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		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
中国银行股份有限公司	4,112,787.70	25,913.32	3,109,562.55	17,287.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股流通受限	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-

00288 2	金龙 羽	2017- 06-15	2017- 07-17	新股 流通 受限	6.20	6.20	2,966 .00	18,38 9.20	18,38 9.20	-
00287 9	长缆 科技	2017- 06-05	2017- 07-07	新股 流通 受限	18.02	18.02	1,313 .00	23,66 0.26	23,66 0.26	-

注：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债券和权证。

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
00280 6	华锋股份	2017-0 6-19	重大事项停牌	25.71	-	-	3,600.00	82,318.00	92,556.00	-
30046 2	华铭智能	2017-0 4-21	重大事项停牌	36.83	-	-	7,300.00	258,126.01	268,859.00	-
30051 8	盛讯达	2016-1 2-13	重大事项停牌	113.30	2017-0 7-10	101.97	3,000.00	378,085.20	339,900.00	-
60035 3	旭光股份	2017-0 6-09	重大事项停牌	7.56	-	-	52,700.00	492,087.58	398,412.00	-
00207 6	雪莱特	2017-0 3-20	重大事项停牌	7.07	-	-	58,200.00	407,834.08	411,474.00	-
30044 0	运达科技	2017-0 2-20	重大事项停牌	13.12	-	-	35,800.00	593,938.19	469,696.00	-
00276 6	索菱股份	2017-0 5-15	重大事项停牌	33.18	2017-0 8-15	16.75	15,800.00	575,594.12	524,244.00	-
30020 9	天泽信息	2017-0 2-10	重大事项停牌	27.72	-	-	19,001.00	503,418.51	526,707.72	-
30034 0	科恒股份	2017-0 6-05	重大事项停牌	40.11	-	-	13,300.00	787,992.86	533,463.00	-
00233 1	皖通科技	2017-0 5-02	重大事项停牌	14.16	-	-	45,200.00	877,550.88	640,032.00	-
60060 2	云赛智联	2017-0 6-22	重大事项停牌	7.51	2017-0 7-04	7.80	91,800.00	888,289.72	689,418.00	-
60046 0	士兰微	2017-0 5-12	重大事项停牌	6.07	2017-0 8-15	6.68	119,800.00	879,682.79	727,186.00	-
30007 5	数字政通	2017-0 6-29	重大事项停牌	20.94	2017-0 7-17	18.86	35,200.00	1,195,430.33	737,088.00	-
30008 5	银之杰	2017-0 6-30	重大事项停牌	18.50	2017-0 7-07	18.88	40,670.00	1,499,854.72	752,395.00	-
60028	亿阳信	2017-0	重大事	10.94	2017-0	12.03	72,000.00	1,189,114.4	787,680.00	-

9	通	5-10	项停牌		8-18				2		
600764	中电广通	2017-06-29	重大事项停牌	33.25	2017-07-07	33.98	24,400.00	645,237.15	811,300.00	-	
300364	中文在线	2017-02-13	重大事项停牌	37.28	-	-	23,501.00	1,108,963.66	876,117.28	-	
002464	金利科技	2017-01-23	重大事项停牌	43.13	2017-07-26	38.82	21,940.00	914,566.79	946,272.20	-	
002638	勤上股份	2017-04-26	重大事项停牌	8.14	-	-	116,370.00	989,839.01	947,251.80	-	
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项停牌	25.06	2017-07-07	22.54	38,100.00	1,179,426.40	954,786.00	-	
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大事项停牌	11.46	2017-08-09	6.25	91,620.00	932,714.90	1,049,965.20	-	
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项停牌	25.63	2017-07-06	23.07	43,400.00	931,191.30	1,112,342.00	-	
300271	华宇软件	2017-06-22	重大事项停牌	16.59	2017-07-04	16.80	76,722.00	1,515,547.42	1,272,817.98	-	
000034	神州数码	2017-03-21	重大事项停牌	24.45	2017-07-18	22.01	53,800.00	1,340,039.13	1,315,410.00	-	
300367	东方网力	2016-12-15	重大事项停牌	20.00	2017-07-03	18.01	67,125.00	1,638,234.36	1,342,500.00	-	
300088	长信科技	2016-09-12	重大事项停牌	15.75	2017-08-09	14.50	97,500.00	1,357,360.05	1,535,625.00	-	
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.27	-	-	193,320.00	2,805,095.95	1,598,756.40	-	
600654	*ST 中安	2017-06-07	重大事项停牌	13.48	-	-	120,213.00	2,959,068.49	1,620,471.24	-	
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项停牌	30.82	2017-07-17	27.74	56,300.00	2,229,117.03	1,735,166.00	-	
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项停牌	17.40	-	-	117,980.00	2,375,811.89	2,052,852.00	-	
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项停牌	24.93	-	-	117,500.00	5,065,774.10	2,929,275.00	-	
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项停牌	14.12	-	-	287,000.00	4,864,566.92	4,052,440.00	-	
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	30.68	-	-	187,760.00	8,034,289.89	5,760,476.80	-	

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体系的理念，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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	59,295.01	-
未评级	-	-
合计	59,295.01	-

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。

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	4,112,787.70	-	-	-	4,112,787.70
结算备付金	14,010.97	-	-	-	14,010.97
存出保证金	24,177.36	-	-	-	24,177.36
交易性金融资产	59,295.01	-	-	354,395,778.41	354,455,073.42
应收利息	-	-	-	771.97	771.97
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,210,271.04	-	-	354,396,550.38	358,606,821.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	145,658.93	145,658.93
应付托管费	-	-	-	29,131.80	29,131.80
应付交易费用	-	-	-	133,804.60	133,804.60
其他负债	-	-	-	225,113.66	225,113.66
负债总计	-	-	-	533,708.99	533,708.99
利率敏感度缺口	4,210,271.04	-	-	353,862,841.39	358,073,112.43

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	6,729,337.93	-	-	-	6,729,337.93
结算备付金	10,303.11	-	-	-	10,303.11
存出保证金	7,591.68	-	-	-	7,591.68
交易性金融资产	-	-	-	411,026,140.90	411,026,140.90
应收利息	-	-	-	1,169.09	1,169.09
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,747,232.72	-	-	411,027,309.99	417,774,542.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	180,722.48	180,722.48
应付托管费	-	-	-	36,144.48	36,144.48
应付交易费用	-	-	-	74,990.92	74,990.92
其他负债	-	-	-	631,579.98	631,579.98
负债总计	-	-	-	923,437.86	923,437.86
利率敏感度缺口	6,747,232.72	-	-	410,103,872.13	416,851,104.85

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

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
	市场利率上升 25 个基点	15,564.94	-
	市场利率下降 25 个基点	-15,564.94	-

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

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	354,395,778.41	98.97	411,026,140.90	98.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	59,295.01	0.02	-	-
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	354,455,073.42	98.99	411,026,140.90	98.60

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%	17,412,138.55	20,517,736.67
	业绩比较基准下降 5%	-17,412,138.55	-20,517,736.67

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本基金最近一期年报。

(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 314,459,159.69 元，属于第二层级的余额为 39,812,935.62 元，属于第三层级的余额为 123,683.10 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（2016 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 372,549,641.37 元，第二层级余额为 38,024,342.10 元，第三层级余额为 452,157.43 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）。

(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

无。

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	354,395,778.41	98.83
	其中：股票	354,395,778.41	98.83
2	固定收益投资	59,295.01	0.02
	其中：债券	59,295.01	0.02
	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	4,126,798.67	1.15
7	其他各项资产	24,949.33	0.01
8	合计	358,606,821.42	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	201,688,684.45	56.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,799.50	0.01
F	批发和零售业	2,628,017.68	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	1,083,376.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	147,449,839.01	41.18
J	金融业	187,943.49	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	876,117.28	0.24
S	综合	443,001.00	0.12
	合计	354,395,778.41	98.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 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	002415	海康威视	546,593	17,654,953.90	4.93
2	000725	京东方 A	3,519,600	14,641,536.00	4.09
3	600703	三安光电	351,300	6,920,610.00	1.93
4	300104	乐视网	187,760	5,760,476.80	1.61
5	002230	科大讯飞	144,000	5,745,600.00	1.60
6	002241	歌尔股份	271,752	5,239,378.56	1.46
7	002456	欧菲光	281,650	5,117,580.50	1.43
8	002236	大华股份	214,797	4,899,519.57	1.37
9	300059	东方财富	381,186	4,581,855.72	1.28
10	002008	大族激光	126,389	4,378,114.96	1.22
11	600100	同方股份	287,000	4,052,440.00	1.13
12	000413	东旭光电	343,115	3,849,750.30	1.08
13	002475	立讯精密	125,568	3,671,608.32	1.03
14	600570	恒生电子	73,360	3,424,444.80	0.96
15	600271	航天信息	165,614	3,418,272.96	0.95
16	300408	三环集团	153,700	3,226,163.00	0.90
17	002065	东华软件	139,500	3,039,705.00	0.85
18	600804	鹏博士	167,660	2,975,965.00	0.83
19	000503	海虹控股	117,500	2,929,275.00	0.82
20	002405	四维图新	133,015	2,628,376.40	0.73
21	300017	网宿科技	213,903	2,581,809.21	0.72
22	000050	深天马 A	124,400	2,558,908.00	0.71
23	300315	掌趣科技	307,340	2,507,894.40	0.70
24	600584	长电科技	153,500	2,463,675.00	0.69
25	000066	中国长城	261,647	2,357,439.47	0.66
26	300115	长盈精密	80,241	2,341,432.38	0.65
27	300296	利亚德	120,708	2,269,310.40	0.63
28	000997	新大陆	97,312	2,208,009.28	0.62
29	600666	奥瑞德	117,980	2,052,852.00	0.57
30	002195	二三四五	281,264	2,011,037.60	0.56
31	600718	东软集团	128,900	2,004,395.00	0.56
32	002624	完美世界	58,300	1,999,690.00	0.56
33	300033	同花顺	31,890	1,983,876.90	0.55
34	002410	广联达	99,500	1,870,600.00	0.52
35	000970	中科三环	126,200	1,865,236.00	0.52
36	600588	用友网络	108,400	1,855,808.00	0.52
37	600074	保千里	144,400	1,849,764.00	0.52

38	002217	合力泰	185,400	1,831,752.00	0.51
39	002185	华天科技	252,480	1,827,955.20	0.51
40	002179	中航光电	58,504	1,824,739.76	0.51
41	600260	凯乐科技	69,200	1,753,528.00	0.49
42	002049	紫光国芯	56,300	1,735,166.00	0.48
43	300002	神州泰岳	203,486	1,697,073.24	0.47
44	300383	光环新网	123,888	1,679,921.28	0.47
45	002558	巨人网络	35,960	1,662,071.20	0.46
46	300113	顺网科技	61,620	1,657,578.00	0.46
47	300168	万达信息	113,540	1,652,007.00	0.46
48	002174	游族网络	51,100	1,622,936.00	0.45
49	002273	水晶光电	78,600	1,621,518.00	0.45
50	600654	*ST 中安	120,213	1,620,471.24	0.45
51	002129	中环股份	193,320	1,598,756.40	0.45
52	002555	三七互娱	61,800	1,580,226.00	0.44
53	300418	昆仑万维	68,800	1,573,456.00	0.44
54	300324	旋极信息	85,184	1,553,756.16	0.43
55	603019	中科曙光	55,000	1,547,700.00	0.43
56	000977	浪潮信息	88,900	1,539,748.00	0.43
57	300088	长信科技	97,500	1,535,625.00	0.43
58	601231	环旭电子	96,660	1,518,528.60	0.42
59	002280	联络互动	138,400	1,505,792.00	0.42
60	002152	广电运通	180,036	1,496,099.16	0.42
61	002439	启明星辰	79,700	1,482,420.00	0.41
62	600797	浙大网新	119,400	1,479,366.00	0.41
63	002138	顺络电子	78,288	1,454,591.04	0.41
64	300182	捷成股份	151,818	1,451,380.08	0.41
65	002354	天神娱乐	66,700	1,434,050.00	0.40
66	000988	华工科技	92,384	1,347,882.56	0.38
67	300367	东方网力	67,125	1,342,500.00	0.37
68	000938	紫光股份	21,700	1,326,304.00	0.37
69	600183	生益科技	107,400	1,325,316.00	0.37
70	000034	神州数码	53,800	1,315,410.00	0.37
71	600446	金证股份	74,200	1,304,436.00	0.36
72	002373	千方科技	94,600	1,290,344.00	0.36
73	300271	华宇软件	76,722	1,272,817.98	0.36
74	002635	安洁科技	34,750	1,258,645.00	0.35
75	300137	先河环保	51,100	1,216,180.00	0.34
76	600601	方正科技	325,100	1,209,372.00	0.34
77	300166	东方国信	89,749	1,205,329.07	0.34
78	600410	华胜天成	130,874	1,159,543.64	0.32
79	002261	拓维信息	98,800	1,156,948.00	0.32
80	300077	国民技术	83,542	1,143,689.98	0.32
81	000727	华东科技	402,500	1,139,075.00	0.32

82	002544	杰赛科技	49,695	1,133,046.00	0.32
83	300433	蓝思科技	38,860	1,130,437.40	0.32
84	300287	飞利信	122,676	1,126,165.68	0.31
85	002517	恺英网络	31,900	1,122,561.00	0.31
86	002308	威创股份	85,372	1,114,104.60	0.31
87	300065	海兰信	43,400	1,112,342.00	0.31
88	002389	南洋科技	52,600	1,107,756.00	0.31
89	002036	联创电子	66,100	1,090,650.00	0.30
90	600751	天海投资	190,400	1,083,376.00	0.30
91	603000	人民网	81,900	1,078,623.00	0.30
92	002153	石基信息	47,400	1,077,402.00	0.30
93	300020	银江股份	76,040	1,052,393.60	0.29
94	002600	江粉磁材	91,620	1,049,965.20	0.29
95	002421	达实智能	171,160	1,047,499.20	0.29
96	002268	卫士通	62,086	1,044,286.52	0.29
97	300496	中科创达	35,771	1,012,319.30	0.28
98	600563	法拉电子	20,086	992,449.26	0.28
99	002368	太极股份	35,514	983,382.66	0.27
100	002657	中科金财	33,897	982,674.03	0.27
101	600562	国睿科技	35,505	977,807.70	0.27
102	002402	和而泰	97,110	957,504.60	0.27
103	002642	荣之联	38,100	954,786.00	0.27
104	600756	浪潮软件	47,900	947,941.00	0.26
105	002638	勤上股份	116,370	947,251.80	0.26
106	002436	兴森科技	150,342	947,154.60	0.26
107	002464	金利科技	21,940	946,272.20	0.26
108	000021	深科技	108,900	934,362.00	0.26
109	300170	汉得信息	89,050	918,105.50	0.26
110	600728	佳都科技	118,541	917,507.34	0.26
111	300431	暴风集团	38,481	917,002.23	0.26
112	002055	得润电子	40,200	913,746.00	0.26
113	603444	吉比特	3,200	906,656.00	0.25
114	300310	宜通世纪	68,158	901,048.76	0.25
115	002376	新北洋	65,500	898,660.00	0.25
116	000636	风华高科	103,900	884,189.00	0.25
117	300364	中文在线	23,501	876,117.28	0.24
118	600651	飞乐音响	102,900	871,563.00	0.24
119	300053	欧比特	64,650	869,542.50	0.24
120	600667	太极实业	124,700	869,159.00	0.24
121	300352	北信源	150,367	867,617.59	0.24
122	600330	天通股份	98,400	863,952.00	0.24
123	002106	莱宝高科	83,734	848,225.42	0.24
124	600536	中国软件	43,900	841,124.00	0.23
125	300010	立思辰	64,621	836,841.95	0.23

126	002123	梦网荣信	73,800	819,918.00	0.23
127	002449	国星光电	49,418	817,867.90	0.23
128	600171	上海贝岭	79,900	812,583.00	0.23
129	600764	中电广通	24,400	811,300.00	0.23
130	600652	游久游戏	73,900	806,988.00	0.23
131	000823	超声电子	55,800	804,636.00	0.22
132	002104	恒宝股份	84,600	794,394.00	0.22
133	002463	沪电股份	173,499	789,420.45	0.22
134	600289	亿阳信通	72,000	787,680.00	0.22
135	002095	生意宝	22,611	781,436.16	0.22
136	000733	振华科技	48,655	773,614.50	0.22
137	300078	思创医惠	71,880	771,272.40	0.22
138	600986	科达股份	56,478	765,841.68	0.21
139	300297	蓝盾股份	69,698	763,193.10	0.21
140	300036	超图软件	46,662	762,923.70	0.21
141	300188	美亚柏科	44,084	762,212.36	0.21
142	300043	星辉娱乐	92,000	755,320.00	0.21
143	300085	银之杰	40,670	752,395.00	0.21
144	603888	新华网	23,050	746,589.50	0.21
145	002636	金安国纪	43,072	743,853.44	0.21
146	002063	远光软件	71,366	743,633.72	0.21
147	603678	火炬电子	26,700	743,061.00	0.21
148	300317	珈伟股份	50,661	739,650.60	0.21
149	002139	拓邦股份	68,650	739,360.50	0.21
150	300075	数字政通	35,200	737,088.00	0.21
151	600363	联创光电	52,600	736,926.00	0.21
152	002156	通富微电	72,129	734,273.22	0.21
153	300128	锦富技术	87,406	734,210.40	0.21
154	600460	士兰微	119,800	727,186.00	0.20
155	002222	福晶科技	50,700	723,489.00	0.20
156	000555	神州信息	42,760	714,092.00	0.20
157	300102	乾照光电	83,410	712,321.40	0.20
158	603160	汇顶科技	7,100	712,130.00	0.20
159	002474	榕基软件	64,500	699,825.00	0.20
160	300044	赛为智能	35,488	699,113.60	0.20
161	300096	易联众	51,000	697,680.00	0.19
162	300212	易华录	27,607	696,524.61	0.19
163	300183	东软载波	33,670	689,561.60	0.19
164	600602	云赛智联	91,800	689,418.00	0.19
165	002649	博彦科技	62,489	689,253.67	0.19
166	300323	华灿光电	49,500	687,060.00	0.19
167	002618	丹邦科技	57,000	682,290.00	0.19
168	300032	金龙机电	48,546	677,216.70	0.19
169	300202	聚龙股份	40,778	673,652.56	0.19

170	300131	英唐智控	79,204	666,897.68	0.19
171	300288	朗玛信息	23,700	660,045.00	0.18
172	300219	鸿利智汇	49,700	659,022.00	0.18
173	300476	胜宏科技	27,750	655,732.50	0.18
174	002371	北方华创	27,142	649,236.64	0.18
175	300031	宝通科技	35,300	649,167.00	0.18
176	300458	全志科技	24,549	646,620.66	0.18
177	002253	川大智胜	26,706	640,944.00	0.18
178	000676	智度股份	42,800	640,716.00	0.18
179	002331	皖通科技	45,200	640,032.00	0.18
180	300339	润和软件	50,600	637,560.00	0.18
181	002658	雪迪龙	35,910	637,402.50	0.18
182	600360	华微电子	87,550	635,613.00	0.18
183	600571	信雅达	45,600	633,840.00	0.18
184	603118	共进股份	46,420	632,704.60	0.18
185	300303	聚飞光电	145,332	629,287.56	0.18
186	300327	中颖电子	19,800	627,660.00	0.18
187	300377	赢时胜	55,060	627,133.40	0.18
188	002161	远望谷	76,700	621,270.00	0.17
189	300300	汉鼎宇佑	34,100	618,574.00	0.17
190	300226	上海钢联	16,624	618,412.80	0.17
191	300359	全通教育	47,000	614,290.00	0.17
192	300348	长亮科技	28,800	610,560.00	0.17
193	300232	洲明科技	37,400	598,400.00	0.17
194	002609	捷顺科技	39,600	592,812.00	0.17
195	300007	汉威电子	30,446	586,389.96	0.16
196	002288	超华科技	82,800	577,116.00	0.16
197	002484	江海股份	57,768	573,058.56	0.16
198	300256	星星科技	55,000	572,000.00	0.16
199	300302	同有科技	31,200	561,912.00	0.16
200	300379	东方通	28,600	560,560.00	0.16
201	600800	天津磁卡	72,600	559,746.00	0.16
202	600288	大恒科技	51,840	549,504.00	0.15
203	300340	科恒股份	13,300	533,463.00	0.15
204	300299	富春股份	28,000	533,400.00	0.15
205	300467	迅游科技	12,800	529,024.00	0.15
206	300231	银信科技	40,040	528,528.00	0.15
207	300209	天泽信息	19,001	526,707.72	0.15
208	002093	国脉科技	59,700	525,360.00	0.15
209	002766	索菱股份	15,800	524,244.00	0.15
210	002279	久其软件	41,677	523,046.35	0.15
211	300369	绿盟科技	47,233	522,396.98	0.15
212	603989	艾华集团	13,300	521,892.00	0.15
213	300366	创意信息	31,100	521,236.00	0.15

214	300066	三川智慧	92,400	511,896.00	0.14
215	002177	御银股份	90,100	511,768.00	0.14
216	000971	高升控股	30,300	508,737.00	0.14
217	002414	高德红外	27,720	507,276.00	0.14
218	300333	兆日科技	39,903	500,383.62	0.14
219	002841	视源股份	6,600	489,852.00	0.14
220	002197	证通电子	38,640	485,318.40	0.14
221	300184	力源信息	39,000	485,160.00	0.14
222	002079	苏州固锴	64,700	476,839.00	0.13
223	000536	华映科技	81,913	475,914.53	0.13
224	603005	晶方科技	16,862	471,967.38	0.13
225	300440	运达科技	35,800	469,696.00	0.13
226	300047	天源迪科	37,201	469,104.61	0.13
227	300368	汇金股份	32,300	464,474.00	0.13
228	300319	麦捷科技	52,301	456,587.73	0.13
229	002655	共达电声	53,300	453,050.00	0.13
230	300050	世纪鼎利	44,300	446,101.00	0.12
231	000532	华金资本	30,700	443,001.00	0.12
232	300386	飞天诚信	24,740	440,124.60	0.12
233	002425	凯撒文化	48,100	439,634.00	0.12
234	300264	佳创视讯	48,900	432,276.00	0.12
235	603258	电魂网络	10,500	430,920.00	0.12
236	300446	乐凯新材	12,600	429,282.00	0.12
237	603918	金桥信息	15,800	426,442.00	0.12
238	300373	扬杰科技	21,112	425,406.80	0.12
239	603328	依顿电子	29,576	418,500.40	0.12
240	300331	苏大维格	19,300	417,845.00	0.12
241	300351	永贵电器	22,900	417,467.00	0.12
242	300502	新易盛	17,200	412,456.00	0.12
243	002076	雪莱特	58,200	411,474.00	0.11
244	002587	奥拓电子	54,450	410,553.00	0.11
245	300456	耐威科技	10,950	408,216.00	0.11
246	300311	任子行	26,561	407,711.35	0.11
247	000045	深纺织A	33,900	406,800.00	0.11
248	300419	浩丰科技	31,200	406,536.00	0.11
249	300025	华星创业	50,800	399,796.00	0.11
250	600353	旭光股份	52,700	398,412.00	0.11
251	002782	可立克	19,000	398,050.00	0.11
252	300205	天喻信息	38,325	397,813.50	0.11
253	300245	天玑科技	28,400	396,180.00	0.11
254	603528	多伦科技	27,500	395,175.00	0.11
255	300248	新开普	24,100	389,697.00	0.11
256	300533	冰川网络	4,400	387,420.00	0.11
257	002577	雷柏科技	16,800	385,896.00	0.11

258	300074	华平股份	56,500	385,895.00	0.11
259	300051	三五互联	32,887	383,791.29	0.11
260	300076	GQY 视讯	43,894	378,366.28	0.11
261	300052	中青宝	23,351	377,352.16	0.11
262	300099	精准信息	39,300	376,887.00	0.11
263	300295	三六五网	20,000	374,200.00	0.10
264	603508	思维列控	7,000	370,160.00	0.10
265	002232	启明信息	30,278	368,180.48	0.10
266	300223	北京君正	14,743	358,992.05	0.10
267	300465	高伟达	33,520	357,658.40	0.10
268	300394	天孚通信	13,800	353,142.00	0.10
269	603636	南威软件	28,800	349,632.00	0.10
270	300516	久之洋	5,473	347,480.77	0.10
271	002315	焦点科技	13,904	346,765.76	0.10
272	300229	拓尔思	27,900	345,123.00	0.10
273	002017	东信和平	30,840	343,249.20	0.10
274	603228	景旺电子	7,100	342,575.00	0.10
275	300518	盛讯达	3,000	339,900.00	0.09
276	300165	天瑞仪器	41,298	338,643.60	0.09
277	300130	新国都	17,826	336,733.14	0.09
278	002777	久远银海	4,700	327,120.00	0.09
279	300494	盛天网络	14,100	326,979.00	0.09
280	002771	真视通	11,600	319,580.00	0.09
281	002388	新亚制程	29,500	316,830.00	0.09
282	600876	洛阳玻璃	16,400	312,256.00	0.09
283	300410	正业科技	8,600	310,460.00	0.09
284	000948	南天信息	25,500	310,080.00	0.09
285	002137	麦达数字	34,100	309,287.00	0.09
286	300378	鼎捷软件	19,543	308,974.83	0.09
287	002845	同兴达	4,300	308,740.00	0.09
288	002579	中京电子	28,000	307,160.00	0.09
289	300449	汉邦高科	12,200	299,632.00	0.08
290	603660	苏州科达	7,300	298,935.00	0.08
291	002189	利达光电	17,800	297,260.00	0.08
292	002401	中远海科	22,600	297,190.00	0.08
293	300349	金卡智能	10,400	290,368.00	0.08
294	300448	浩云科技	11,957	287,446.28	0.08
295	300028	金亚科技	35,720	287,188.80	0.08
296	300493	润欣科技	22,200	286,602.00	0.08
297	300468	四方精创	6,400	285,376.00	0.08
298	300567	精测电子	3,500	279,755.00	0.08
299	300469	信息发展	5,000	272,050.00	0.08
300	300346	南大光电	11,900	270,963.00	0.08
301	300462	华铭智能	7,300	268,859.00	0.08

302	300356	光一科技	30,750	267,832.50	0.07
303	300523	辰安科技	6,520	260,800.00	0.07
304	300531	优博讯	12,300	260,268.00	0.07
305	603936	博敏电子	9,800	258,230.00	0.07
306	002815	崇达技术	7,700	254,408.00	0.07
307	300479	神思电子	11,700	250,029.00	0.07
308	300380	安硕信息	10,090	249,828.40	0.07
309	603186	华正新材	5,800	248,066.00	0.07
310	300571	平治信息	1,700	235,722.00	0.07
311	300127	银河磁体	14,400	235,152.00	0.07
312	300162	雷曼股份	22,040	232,081.20	0.06
313	300520	科大国创	4,400	230,956.00	0.06
314	300399	京天利	8,970	228,107.10	0.06
315	300570	太辰光	10,260	225,207.00	0.06
316	300390	天华超净	24,200	221,914.00	0.06
317	603189	网达软件	9,700	208,356.00	0.06
318	300602	飞荣达	4,400	208,076.00	0.06
319	300290	荣科科技	19,100	202,078.00	0.06
320	300590	移为通信	6,900	193,683.00	0.05
321	603421	鼎信通讯	6,900	193,131.00	0.05
322	300546	雄帝科技	6,000	188,400.00	0.05
323	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.05
324	603025	大豪科技	7,100	187,440.00	0.05
325	603039	泛微网络	2,900	184,295.00	0.05
326	300561	汇金科技	3,700	181,226.00	0.05
327	300508	维宏股份	2,600	180,440.00	0.05
328	300480	光力科技	10,948	180,313.56	0.05
329	300597	吉大通信	10,500	180,180.00	0.05
330	300566	激智科技	5,550	177,100.50	0.05
331	603322	超讯通信	3,600	173,520.00	0.05
332	002813	路畅科技	5,300	165,148.00	0.05
333	002819	东方中科	5,000	160,550.00	0.04
334	300556	丝路视觉	4,900	160,083.00	0.04
335	300532	今天国际	6,700	158,254.00	0.04
336	300515	三德科技	8,800	156,024.00	0.04
337	300541	先进数通	5,300	154,495.00	0.04
338	300552	万集科技	4,700	154,160.00	0.04
339	603738	泰晶科技	5,000	153,800.00	0.04
340	002808	苏州恒久	8,400	153,720.00	0.04
341	300525	博思软件	3,100	145,700.00	0.04
342	300559	佳发安泰	3,200	127,840.00	0.04
343	300542	新晨科技	4,000	123,880.00	0.03
344	300551	古鳌科技	3,200	119,424.00	0.03
345	300579	数字认证	2,100	101,220.00	0.03

346	002806	华锋股份	3,600	92,556.00	0.03
347	603801	N 志邦	1,406	47,522.80	0.01
348	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
349	603316	诚邦股份	1,825	38,799.50	0.01
350	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
351	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
352	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
353	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
354	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
355	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
356	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
357	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
358	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
359	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
360	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
361	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
362	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
363	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
364	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002415	海康威视	3,305,256.00	0.79
2	000066	中国长城	2,656,384.50	0.64
3	002624	完美世界	2,135,096.00	0.51
4	300104	乐视网	1,834,049.11	0.44
5	002558	巨人网络	1,285,087.00	0.31
6	600751	天海投资	1,106,613.70	0.27
7	000050	深天马 A	950,681.00	0.23
8	603444	吉比特	888,421.00	0.21
9	603888	新华网	792,021.00	0.19
10	300043	星辉娱乐	774,934.00	0.19
11	603678	火炬电子	704,275.00	0.17
12	603160	汇顶科技	674,031.00	0.16
13	300323	华灿光电	657,838.00	0.16
14	000676	智度股份	656,626.00	0.16
15	300299	富春股份	642,112.00	0.15

16	002635	安洁科技	616,628.00	0.15
17	002354	天神娱乐	607,043.00	0.15
18	300496	中科创达	584,900.00	0.14
19	300366	创意信息	496,244.00	0.12
20	002841	视源股份	495,129.00	0.12

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 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。

7.4.2 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	000748	长城信息	2,097,007.50	0.50
2	000725	京东方 A	1,481,332.00	0.36
3	600151	航天机电	1,093,670.00	0.26
4	600850	华东电脑	727,928.86	0.17
5	601519	*ST 智慧	566,087.00	0.14
6	600149	*ST 坊展	558,527.00	0.13
7	601881	中国银河	546,897.89	0.13
8	002241	歌尔股份	525,962.00	0.13
9	600718	东软集团	492,155.17	0.12
10	002456	欧菲光	484,502.00	0.12
11	000066	中国长城	480,240.00	0.12
12	300059	东方财富	466,151.00	0.11
13	300150	世纪瑞尔	454,058.00	0.11
14	002230	科大讯飞	448,267.00	0.11
15	002635	安洁科技	439,453.00	0.11
16	300282	汇冠股份	435,068.00	0.10
17	601212	白银有色	420,332.78	0.10
18	002214	大立科技	406,136.00	0.10
19	002236	大华股份	398,758.00	0.10
20	300017	网宿科技	383,385.00	0.09

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	45,086,713.86
卖出股票的收入（成交）总额	43,252,192.13

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	59,295.01	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,295.01	0.02

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128015	久其转债	521	59,295.01	0.02

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	24,177.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	771.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,949.33

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	300104	乐视网	5,760,476.80	1.61	重大事项停 牌

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
8,162	40,532.72	215,458,284.00	65.13%	115,369,769.00	34.87%

8.2 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	208,562,137.00	63.04%
2	何凤珍	3,329,000.00	1.01%
3	长江证券—建行—长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划	2,300,000.00	0.70%
4	广发证券股份有限公司	2,209,944.00	0.67%
5	常州对外贸易有限公司	2,000,000.00	0.60%
6	罗建明	1,865,000.00	0.56%
7	胡余炳	1,700,000.00	0.51%
8	周军	1,002,600.00	0.30%
9	李尚宾	758,800.00	0.23%

10	刘玉彬	740,100.00	0.22%
----	-----	------------	-------

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	0
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（2015年1月8日）基金份额总额	354,828,053.00
本报告期期初基金份额总额	382,828,053.00
本报告期基金总申购份额	54,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	106,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	330,828,053.00

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	
银河证券	2	79,727,063.06	99.32%	58,304.66	99.13%	-
广发证券	3	546,557.51	0.68%	509.02	0.87%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	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。

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广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-04-20

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20170101-20170630	243,381,837.00	63,403,200.00	98,222,900.00	208,562,137.00	63.04%

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

- (一) 中国证监会批准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 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>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日