

广发标普全球农业指数证券投资基金

2018 年半年度报告摘要

2018 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：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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 2018 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发全球农业指数（QDII）
基金主代码	270027
交易代码	270027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 28 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	33,776,699.69 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%，年跟踪误差不超过 5%，实现对标普全球农业指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。 本基金将不低于 85% 的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	郭明
	联系电话	020-83936666	(010) 66105798
	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) 66105799

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	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
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

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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,875,444.02
本期利润	-3,430,747.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0904
本期基金份额净值增长率	-5.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1901
期末基金资产净值	40,196,703.42
期末基金份额净值	1.190

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	1.88%	0.55%	2.13%	0.48%	-0.25%	0.07%
过去三个月	3.21%	0.65%	3.11%	0.65%	0.10%	0.00%
过去六个月	-5.25%	0.76%	-5.39%	0.75%	0.14%	0.01%
过去一年	0.85%	0.62%	1.69%	0.62%	-0.84%	0.00%
过去三年	10.08%	0.79%	9.10%	0.81%	0.98%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	19.00%	0.87%	25.23%	0.90%	-6.23%	-0.03%

注：业绩比较基准：人民币计价的标普全球农业指数收益率。

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

广发标普全球农业指数证券投资基金
 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
 (2011年6月28日至2018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
 第5页共37页

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。公司拥有公募基金管理、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（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 30 个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、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），参股了证通股份有限公司。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 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		
刘杰	本基金的基金经理； 广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理； 广发中证 500ETF 基金的基金经理； 广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理； 广	2018-08-06	-	14 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深

	<p>发沪深 300ETF 基 金的基金 经理；广 发养老指 数基金的 基金经理； 广发中小 板 300ETF 基 金的基金 经理；广 发中小板 300 联接 基金的基 金经理； 广发中证 环保 ETF 联接 基金的基 金经理； 广发军工 ETF 基金 的基金经 理；广发 中证军工 ETF 联接 基金的基 金经理； 广发中证 环保 ETF 基金 的基金经 理；广发 创业板 ETF 基金 的基金经 理；广发 创业板 ETF 联接 基金的基 金经理； 广发量化 稳健混合 基金的基</p>				<p>300 指数 证券投资 基金基金 基金经理（自 2014 年 4 月 1 日 至 2016 年 1 月 17 日） 、广发中 证环保产 业指数型 发起式证 券投资基 金基金经 理（自 2016 年 1 月 25 日 至 2018 年 4 月 25 日） 。现任广 发基金管 理有限公司 指数投 资部总 经理助 理、广 发中证 500 交 易型开 放式指 数证 券投 资基 金基 金经 理（自 2014 年 4 月 1 日 起任 职）、 广 发中 证 500 交 易型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金 (LOF)基 金经 理（自</p>
--	--	--	--	--	--

	<p>金经理； 广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理； 广发港股通恒生综合中型股指指数基金的基金经理； 广发美国房地产指数（QDII）基金的基金经理； 广发纳斯达克 100 指数（QDII）基金的基金经理； 广发纳指 100ETF 基金的基金经理； 广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理； 广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理； 指数投资部总经理助理</p>				<p>2014 年 4 月 1 日起任职）、 广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 8 月 20 日起任职）、 广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 18 日起任职）、 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、</p>
--	---	--	--	--	--

					<p>广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 30 日起任职）、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基金经理（自 2016 年 9 月 26 日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 25 日起任职）、广发创业板交易型开放式指</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 25 日起任职）、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基金经理（自 2017 年 5 月 25 日起任职）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 8 月 4 日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2018 年 4 月 26 日起任职）、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理（自</p>
--	--	--	--	--	--

					2018 年 8 月 6 日 起任职)、 广发纳斯 达克 100 交易 型开放式 指数证券 投资基金 基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日 起任职)、 广发标普 全球农业 指数证券 投资基金 基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日 起任职)、 广发道琼 斯美国石 油开发与 生产指数 证券投资 基金 (QDII- LOF) 基 金经理 (自 2018 年 8 月 6 日 起任职)、 广发港股 通恒生综 合中型股 指数证券 投资基金 (LOF)基 金经理(自 2018 年 8 月 6 日
--	--	--	--	--	---

					起任职)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)。
李耀柱	本基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)	2016-08-23	-	8年	李耀柱先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基

	<p>基金的基金经理； 广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理； 广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理； 广发沪港深新起点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； 广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理； 广发海外多元配置（QDII）基金的基金经理； 广发科技动力股票基金的基金经理； 国际业务部总经理助理</p>				<p>金经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日）。现任广发基金管理有限公司国际业务部总经理助理、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 17 日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日起任职）、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理</p>
--	--	--	--	--	---

					经理（自 2016 年 8 月 23 日 起任职）、 广发美国 房地产指 数证券投 资基金基 金基金经 理（自 2016 年 8 月 23 日 起任职）、 广发全球 医疗保健 指数证券 投资基金 基金基金 经理（自 2016 年 8 月 23 日 起任职）、 广发纳斯 达克生物 科技指数 型发起式 证券投资 基金基金 经理（自 2016 年 8 月 23 日 起任职）、 广发沪港 深新起点 股票型证 券投资基 金基金经 理（自 2016 年 11 月 9 日 起任职）、 广发道琼 斯美国石 油开发与 生产指数
--	--	--	--	--	---

					证券投资 基金 （QDII- LOF）基 金经理 （自 2017 年 3 月 10 日 起任职）、 广发港股 通恒生综 合中型股 指数证券 投资基金 (LOF)基金 经理（自 2017 年 9 月 21 日 任职）、 广发海外 多元配置 证券投资 基金 （QDII） 基金经理 （自 2018 年 2 月 8 日 起任职）、 广发科技 动力股票 型证券投资 基金基金 经理 （自 2018 年 5 月 31 日 起任职）。
--	--	--	--	--	--

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 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、《广发标普全球农业指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一月份，市场对经济增长和通胀保持乐观预期，农业指数呈现上涨趋势。

二月份，美国非农数据远超预期，引发通胀上升的预期，市场对美联储加快加息节奏的担忧，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，引发投资者对利率过快上行后对估值压制的担忧。叠加上前期美股涨幅较大，技术面上处于超买状态，盈利盘的获利了结给指数带来大量卖压，指数出现深度回调。

三月份，月初 2 月非农就业数据大幅超预期，显示劳动力市场稳健，指数有所反弹。但随后受美联储加息，以及中美贸易摩擦等负面因素影响，指数出现恐慌性抛售，大幅下跌。

四月份，美国通胀预期在此前价格调整中得到较充分的反映，随着美国经济稳健增长，就业市场超预期维持低就业率，农业指数开启上升通道。

五月份，市场对美国经济预期持续向好，同时美联储加息、欧洲央行货币政策偏鸽派，导致美元快速走强，农业指数继续上涨。

六月份，中美贸易战不确定性增加，边际风险上升，但由于美元仍处于上涨通道，全球资金流向美国趋势未改，受益于此，农业指数保持上涨态势。

报告期内，本基金紧密跟踪标的指数。

4.5.2 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-5.25%，同期业绩比较基准收益率为-5.39%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，中美贸易战不确定性增加，中国也宣布将对原产于美国约 500 亿美元进口商品加征 25% 关税，其中对农产品、汽车、水产品等约 340 亿美元商品加征关税，指数边际风险上升，但由于美元仍处于上涨通道，全球资金流向美国趋势未改，美国经济复苏，企业盈利数据强劲，失业率低，通胀预期持续，农业指数有望得到支撑。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理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。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2018 年 2 月 13 日至 2018 年 6 月 29 日连续 89 个工作日出现了基金资产净值低于五千万的情形。

基金管理人已向中国证监会报告此情形，鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

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标普全球农业指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发标普全球农业指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发标普全球农业指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基

金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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标普全球农业指数证券投资基金 2018 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：广发标普全球农业指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,727,826.31	5,470,785.21
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	37,483,577.67	56,299,100.37
其中：股票投资		37,483,577.67	56,299,100.37
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		2,295,026.03	1,513,717.40
应收利息	6.4.7.5	131.00	694.87
应收股利		58,661.95	145,720.58
应收申购款		53,585.06	233,162.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	512,574.76	993,730.86
资产总计		44,131,382.78	64,656,911.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		3,205,230.65	3,545,963.63
应付赎回款		163,718.91	64,288.00
应付管理人报酬		26,600.27	49,555.96
应付托管费		8,312.58	15,486.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	530,816.95	1,164,335.95
负债合计		3,934,679.36	4,839,629.77
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	33,776,699.69	47,622,759.22
未分配利润	6.4.7.1 0	6,420,003.73	12,194,522.53
所有者权益合计		40,196,703.42	59,817,281.75
负债和所有者权益总计		44,131,382.78	64,656,911.52

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.190 元，基金份额总额 33,776,699.69 份。

6.2 利润表

会计主体：广发标普全球农业指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-2,957,110.66	1,763,828.00
1.利息收入		14,161.90	6,592.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,161.90	6,592.47
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）		2,101,401.72	3,925,291.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,702,737.54	3,144,628.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	398,664.18	780,662.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,306,191.18	-2,060,265.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		224,573.33	-117,725.70
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,943.57	9,936.19
减：二、费用		473,636.50	640,635.91
1. 管理人报酬		180,174.47	305,291.56
2. 托管费		56,304.42	95,403.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	25,127.36	23,572.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	212,030.25	216,368.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,430,747.16	1,123,192.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,430,747.16	1,123,192.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发标普全球农业指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	47,622,759.22	12,194,522.53	59,817,281.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,430,747.16	-3,430,747.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-13,846,059.53	-2,343,771.64	-16,189,831.17

值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	9,194,872.52	1,939,526.94	11,134,399.46
2. 基金赎回款	-23,040,932.05	-4,283,298.58	-27,324,230.63
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）	33,776,699.69	6,420,003.73	40,196,703.42
项目	上年度可比期间 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）	70,796,695.98	11,584,401.79	82,381,097.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,123,192.09	1,123,192.09
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）	-10,057,523.23	-1,774,970.36	-11,832,493.59
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-10,057,523.23	-1,774,970.36	-11,832,493.59
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）	60,739,172.75	10,932,623.52	71,671,796.27

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

广发标普全球农业指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)证监许可[2011]667号《关于核准广发标普全球农业指数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《广发标普全球农

业指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2011 年 6 月 28 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,境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

本基金募集期为 2011 年 5 月 25 日至 2011 年 6 月 24 日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币 446,564,827.62 元,有效认购户数为 6,945 户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币 43,516.63 元,折合基金份额 43,516.63 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。

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:全球证券市场中的标普全球农业指数成份股、备选成份股、以标普全球农业指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)、新股(一级市场初次发行或增发)等,其中,标普全球农业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:人民币计价的标普全球农业指数收益率。

本基金的财务报表于 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外资产托管人

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	180,174.47	305,291.56
其中：支付销售机构的客户维护费	50,280.28	60,876.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	56,304.42	95,403.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

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

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
报告期初持有的基金份额	-	15,000,347.24
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	15,000,347.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	24.70%

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国工商银行股份有限公司	1,888,209.01	3,007.97	2,048,256.09	3,023.39
布朗兄弟哈里曼银行	1,839,617.30	11,153.04	1,545,788.03	3,569.08

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布朗兄弟哈里曼银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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 2018 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.10 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 2018 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 37,483,577.67 元，无属于第二层级和第三层级的金额（2017 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 56,299,100.37 元，无属于第二层级和第三层级的金额）。

(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。

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	37,483,577.67	84.94
	其中：普通股	36,352,062.98	82.37
	存托凭证	1,131,514.69	2.56
	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	3,727,826.31	8.45
8	其他各项资产	2,919,978.80	6.62
9	合计	44,131,382.78	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（%）
美国	22,185,876.31	55.19
加拿大	3,707,600.63	9.22
挪威	2,489,297.18	6.19
日本	2,428,313.16	6.04
英国	2,384,458.93	5.93
新加坡	1,512,228.98	3.76
中国香港	1,071,862.73	2.67
瑞士	747,328.93	1.86
德国	614,303.74	1.53
以色列	342,307.08	0.85
合计	37,483,577.67	93.25

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、上述美国比重包括巴西、智利在美国上市的 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（%）
非日常生活消费品	-	-
电信业务	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
信息技术	-	-
医疗保健	-	-

公用事业	-	-
金融	-	-
日常消费品	20,043,835.48	49.86
原材料	10,428,566.16	25.94
工业	7,011,176.03	17.44
合计	37,483,577.67	93.25

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前十名权益投资明细

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	NUTRIE N LTD	-	NTR CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	10,304.00	3,707,600.63	9.22
2	ARCHER - DANIEL S- MIDLAN D CO	Archer- Daniels- Midland 公 司	ADM US	纽约证 券交易 所	美国	11,431.00	3,466,322.47	8.62
3	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品 公司	TSN US	纽约证 券交易 所	美国	7,426.00	3,382,935.91	8.42
4	DEERE & CO	迪尔	DE US	纽约证 券交易 所	美国	3,441.00	3,182,927.34	7.92
5	KUBOTA CORP	久保田	6326 JP	东京证 券交易 所	日本	23,253.00	2,428,313.16	6.04
6	ASSOCI ATED BRITISH FOODS PLC	英国联合 食品集团	ABF LN	伦敦证 券交易 所	英国	10,062.00	2,384,458.93	5.93
7	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食 品有限公 司	HRL US	纽约证 券交易 所	美国	7,628.00	1,878,041.72	4.67
8	BUNGE LTD	Bunge 有 限公司	BG US	纽约证 券交易 所	美国	3,971.00	1,831,596.69	4.56
9	FMC	FMC 公司	FMC US	纽约证	美国	2,664.00	1,572,470.98	3.91

	CORP			券交易所				
10	MARINE HARVEST	Marine Harvest 股份有限公司	MHG NO	奥斯陆证券交易所	挪威	11,630.00	1,531,223.44	3.81

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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	NUTRIEN LTD	NTR CN	5,799,877.87	9.70
2	NUTRIEN LTD	NTR US	3,463,298.36	5.79
3	HORMEL FOODS CORP	HRL US	1,863,405.00	3.12
4	DEERE & CO	DE US	880,041.28	1.47
5	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM US	865,757.21	1.45
6	TYSON FOODS INC-CLASS A	TSN US	803,205.34	1.34
7	KUBOTA CORP	6326 JP	637,200.04	1.07
8	K+S AG-REG	SDF GR	617,519.05	1.03
9	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	SQM US	586,743.08	0.98
10	MONSANTO CO	MON US	577,465.07	0.97
11	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	ABF LN	559,117.31	0.93
12	CNH INDUSTRIAL NV	CNHI US	531,025.13	0.89
13	BUNGE LTD	BG US	452,579.02	0.76
14	INGREDION INC	INGR US	394,618.05	0.66
15	WILMAR INTERNATIONAL LTD	WIL SP	372,741.90	0.62
16	MARINE HARVEST	MHG NO	358,941.92	0.60
17	FMC CORP	FMC US	353,515.09	0.59
18	WH GROUP LTD	288 HK	312,727.97	0.52
19	MOSAIC CO/THE	MOS US	289,731.71	0.48
20	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF US	272,761.46	0.46

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	MONSANTO CO	MON US	5,136,732.32	8.59
2	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	POT US	3,217,456.95	5.38
3	NUTRIEN LTD	NTR US	3,089,179.34	5.16
4	AGRIUM INC	AGU CN	2,992,922.60	5.00
5	DEERE & CO	DE US	2,407,651.70	4.03
6	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM US	2,301,414.39	3.85
7	NUTRIEN LTD	NTR CN	1,723,318.90	2.88
8	KUBOTA CORP	6326 JP	1,606,494.74	2.69
9	TYSON FOODS INC-CL A	TSN US	1,600,257.55	2.68
10	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	ABF LN	1,294,925.84	2.16
11	NH FOODS LTD	2282 JP	1,133,993.21	1.90
12	BUNGE LTD	BG US	1,116,969.95	1.87
13	INGREDION INC	INGR US	906,149.36	1.51
14	CNH INDUSTRIAL NV	CNHI US	878,616.17	1.47
15	FMC CORP	FMC US	867,842.70	1.45
16	WILMAR INTERNATIONAL LTD	WIL SP	830,588.23	1.39
17	WH GROUP LTD	288 HK	792,699.35	1.33
18	MARINE HARVEST	MHG NO	780,305.23	1.30
19	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF US	712,662.68	1.19
20	MOSAIC CO/THE	MOS US	685,846.07	1.15

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	20,900,100.62
卖出收入（成交）总额	36,112,169.68

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 本报告期本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	2,295,026.03
3	应收股利	58,661.95
4	应收利息	131.00
5	应收申购款	53,585.06
6	其他应收款	330,803.61
7	待摊费用	181,771.15
8	其他	-
9	合计	2,919,978.80

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股票中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	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	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
2,769	12,198.16	791,304.08	2.34%	32,985,395.61	97.66%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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（2011年6月28日）基金份额总额	446,564,827.62
本报告期期初基金份额总额	47,622,759.22
本报告期基金总申购份额	9,194,872.52
减：本报告期基金总赎回份额	23,040,932.05
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	33,776,699.69

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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	
Citigroup	-	30,228,306.22	73.61%	12,668.97	62.54%	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	10,838,557.91	26.39%	7,586.93	37.46%	-
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-
Knight Capital Group	-	-	-	-	-	-
Bank of Montreal	-	-	-	-	-	-
Barclays Bank PLC	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
Tanrich	-	-	-	-	-	-
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	-	-	-	-	-	-

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。

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
机构	1	20180101-20180213	11,999,833.33	0.00	11,999,833.33	0.00	0.00%
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。							

广发基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日