

# 广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

## 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 2016 年 8 月 23 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 2016 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	广发沪深 300ETF
基金主代码	510360
交易代码	510360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 20 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,100,381,165.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 9 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合，但因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。
业绩比较基准	本基金的标的指数为沪深 300 指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	洪渊
	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

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	11,334,383.14
本期利润	28,169,638.27
加权平均基金份额本期利润	0.0411
本期基金份额净值增长率	-13.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0440
期末基金资产净值	1,051,975,251.92
期末基金份额净值	0.9560

注：（1）上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	0.45%	0.96%	-0.49%	0.98%	0.94%	-0.02%
过去三个月	-0.68%	1.00%	-1.99%	1.01%	1.31%	-0.01%
过去六个月	-13.55%	1.82%	-15.47%	1.84%	1.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-4.40%	1.74%	-18.84%	2.06%	14.44%	-0.32%

注：业绩比较基准：沪深 300 指数收益率。

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

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 8 月 20 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日期为 2015 年 8 月 20 日，至披露时点本基金成立未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## 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、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 25 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研

究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理九十八只开放式基金---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、广发聚康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，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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

	接基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；数量投资部总经理助理				广发中证 500ETF 以及广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理，2015 年 8 月 20 日起任广发沪深 300ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 18 日起任广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 25 日起任广发中小板 300ETF 及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日起任数量投资部总经理助理。
--	---	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，本基金日均跟踪误差为 0.06%，符合要求。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是成份股调整、申购和赎回因素；作为 ETF 基金，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响相对较小。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为-13.55%，同期业绩比较基准收益率为-15.47%，较好地跟踪了指数。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，全球经济复苏乏力，几大经济体的走势都并不乐观，而国内也处在去产能加速时期，稳增长和经济转型压力依然巨大；股市方面，1月初人民币贬值以及熔断等情况引发了股票市场非理性恐慌行为，1月份整体市场累计跌幅较大，其后市场触底反弹，自2月份以来市场表现为震荡向上的趋势。

展望3季度，国际方面，英国脱欧带来的经济不确定性，将使美联储加息政策更加谨慎；国内方面，当前经济依然在保增长、防风险和促转型之间的艰难平衡，而未来经济呈现为“L”形走势也

得到了市场认可，具体来看供给侧结构性改革是帮助中国走出困局的关键。综合来看，未来市场风险偏好有望延续，整体市场可能继续保持震荡走势，市场存在结构性行情和局部性机会，未来深港通等政策预期也将提振市场信心。

沪深 300 指数目前估值水平较低，是个兼顾风险和收益的良好投资标的，沪深 300 的大盘蓝筹覆盖面相对于与上证 50、上证 180 要大，代表性要好，风险相对于创业板等高估值板块要小，因此对于部分投资者而言，风险相对较小的沪深 300 指数基金是个不错的享受行情反弹的品种。

#### 4.6 管理人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，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 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：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	15,118,520.88	1,173,682.38
结算备付金	30,132,764.44	28,404.22
存出保证金	89,407.24	80,658.97
交易性金融资产	1,007,025,944.65	28,427,401.88
其中：股票投资	1,006,806,481.45	28,424,501.88
基金投资	-	-

债券投资	219,463.20	2,900.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	413,479.14	-
应收利息	8,282.34	255.96
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,052,788,398.69</b>	<b>29,710,403.41</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	230,520.43
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	425,493.35	13,690.72
应付托管费	85,098.66	2,738.14
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	170,773.24	95,615.92
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	131,781.52	194,459.53
<b>负债合计</b>	<b>813,146.77</b>	<b>537,024.74</b>
<b>所有者权益:</b>	-	-
实收基金	1,100,381,165.00	26,381,165.00
未分配利润	-48,405,913.08	2,792,213.67
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,051,975,251.92</b>	<b>29,173,378.67</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,052,788,398.69</b>	<b>29,710,403.41</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.9560 元，基金份额总额 1,100,381,165.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
<b>一、收入</b>	<b>30,826,959.48</b>	
1.利息收入	108,092.12	
其中：存款利息收入	107,749.97	
债券利息收入	342.15	
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）	13,471,690.28	
其中：股票投资收益	3,810,475.92	
基金投资收益	-	
债券投资收益	18,753.05	
资产支持证券投资收益	-	
贵金属投资收益	-	
衍生工具收益	37,680.00	
股利收益	9,604,781.31	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	16,835,255.13	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	411,921.95	
<b>减：二、费用</b>	<b>2,657,321.21</b>	
1. 管理人报酬	1,564,302.62	
2. 托管费	312,860.50	
3. 销售服务费	-	
4. 交易费用	597,469.57	
5. 利息支出	-	
其中：卖出回购金融资产支出	-	
6. 其他费用	182,688.52	
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>28,169,638.27</b>	
减：所得税费用	-	
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>28,169,638.27</b>	

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	26,381,165.00	2,792,213.67	29,173,378.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,169,638.27	28,169,638.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,074,000,000.00	-79,367,765.02	994,632,234.98
其中：1.基金申购款	1,080,000,000.00	-80,090,930.60	999,909,069.40
2.基金赎回款	-6,000,000.00	723,165.58	-5,276,834.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,100,381,165.00	-48,405,913.08	1,051,975,251.92

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：沪深 300 指数的成份股、备选成份股，非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国

证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。在建仓完成后，本基金股票资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数。

本基金的财务报表于 2016 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

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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.以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2.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、债券免征营业税和增值税。
- 3.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。
- 4.对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，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。
- 5.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。
- 6.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。
- 7.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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

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

### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人母公司的全资子公司

### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
广发证券股份有限公司	79,027,468.21	15.72%

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	3,326.30	3.48%

##### 6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年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	73,598.35	16.50%	32,448.08	19.00%

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。

### 6.4.8.2 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 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	1,564,302.62
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	312,860.50

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 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
	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	10,001,000.00
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	10,001,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.91%

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,081,739,300.00	98.31%	-	-

#### 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

	2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	15,118,520.88	64,767.44

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

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.9 期末（2016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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	7,670.00	99,556.60	99,556.60	-

注：截至本报告期末 2016 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。

##### 6.4.9.2 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	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	----------	--------	--------	----

						价					
000002	万科 A	2015-12-21	重大事项停牌	24.43	2016-07-04	21.99	23,800.00	327,394.85	581,434.00	-	
000415	渤海金控	2016-02-01	重大事项停牌	6.82	2016-08-11	7.50	3,500.00	30,196.41	23,870.00	-	
000629	*ST 钒钛	2016-05-26	重大事项停牌	2.39	-	-	563,100.00	1,758,858.28	1,345,809.00	-	
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	19.22	-	-	138,400.00	2,613,314.84	2,660,048.00	-	
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项停牌	16.72	2016-07-08	17.37	152,900.00	2,690,703.84	2,556,488.00	-	
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项停牌	25.10	2016-07-04	22.59	2,100.00	39,336.25	52,710.00	-	
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.29	-	-	168,100.00	1,442,155.36	1,393,549.00	-	
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项停牌	12.44	-	-	224,400.00	2,885,233.05	2,791,536.00	-	
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	2.76	-	-	495,900.00	1,506,293.14	1,368,684.00	-	
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	4.90	-	-	606,672.00	3,234,313.96	2,972,692.80	-	
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项停牌	14.36	-	-	182,826.00	2,694,301.99	2,625,381.36	-	
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	28,236.00	97,978.92	590,697.12	-	

### 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 2016 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 2016 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考最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 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 987,715,486.49 元，第二层级的余额为 19,182,362.48 元，第三层级的余额为 122,463.88 元

(2015 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 27,034,511.88 元，第二层级的余额为 1,389,990.00 元，第三层级的余额为 2,900.00 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的债券)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

(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	1,006,806,481.45	95.63
	其中：股票	1,006,806,481.45	95.63
2	固定收益投资	219,463.20	0.02
	其中：债券	219,463.20	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	45,251,285.32	4.30
7	其他各项资产	511,168.72	0.05
8	合计	1,052,788,398.69	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	809,130.14	0.08
B	采矿业	37,701,606.38	3.58
C	制造业	322,347,794.20	30.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,201,672.68	3.92
E	建筑业	34,671,890.85	3.30
F	批发和零售业	20,450,850.98	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	31,784,292.54	3.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,150,667.21	5.81
J	金融业	376,325,316.77	35.77
K	房地产业	35,552,675.83	3.38
L	租赁和商务服务业	11,029,378.88	1.05
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,336,804.12	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,764,399.00	0.17

R	文化、体育和娱乐业	19,489,203.50	1.85
S	综合	5,170,672.27	0.49
	合计	1,006,806,481.45	95.71

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,330,200	42,619,608.00	4.05
2	600016	民生银行	2,903,100	25,924,683.00	2.46
3	601166	兴业银行	1,637,300	24,952,452.00	2.37
4	600036	招商银行	1,266,700	22,167,250.00	2.11
5	601328	交通银行	3,357,900	18,904,977.00	1.80
6	600519	贵州茅台	61,768	18,031,314.56	1.71
7	600000	浦发银行	1,061,830	16,532,693.10	1.57
8	600030	中信证券	966,500	15,686,295.00	1.49
9	600837	海通证券	993,500	15,319,770.00	1.46
10	601288	农业银行	4,693,696	15,019,827.20	1.43

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 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	000333	美的集团	8,731,036.70	29.93
2	000725	京东方 A	8,384,329.00	28.74
3	000001	平安银行	8,269,804.56	28.35
4	300059	东方财富	7,164,100.00	24.56
5	002024	苏宁云商	7,135,814.98	24.46
6	601398	工商银行	7,043,481.51	24.14
7	000858	五粮液	7,019,069.81	24.06
8	000776	广发证券	6,675,951.03	22.88
9	600000	浦发银行	6,588,945.45	22.59

10	002304	洋河股份	5,724,159.27	19.62
11	000166	申万宏源	5,337,446.00	18.30
12	001979	招商蛇口	5,209,306.00	17.86
13	002594	比亚迪	5,020,718.95	17.21
14	002736	国信证券	5,008,967.29	17.17
15	002415	海康威视	4,982,919.99	17.08
16	002450	康得新	4,957,814.00	16.99
17	000100	TCL 集团	4,647,900.00	15.93
18	002673	西部证券	4,507,067.14	15.45
19	000783	长江证券	4,410,602.03	15.12
20	002739	万达院线	4,350,290.62	14.91
21	000538	云南白药	4,185,370.60	14.35
22	300104	乐视网	4,094,126.84	14.03
23	000625	长安汽车	4,023,260.82	13.79
24	000063	中兴通讯	3,975,433.82	13.63
25	300017	网宿科技	3,899,144.17	13.37
26	002142	宁波银行	3,873,635.65	13.28
27	600271	航天信息	3,714,240.00	12.73
28	300027	华谊兄弟	3,708,610.26	12.71
29	300024	机器人	3,657,716.07	12.54
30	002202	金风科技	3,550,220.54	12.17
31	300070	碧水源	3,464,698.80	11.88
32	002252	上海莱士	3,408,314.57	11.68
33	002465	海格通信	3,328,249.00	11.41
34	002241	歌尔股份	3,325,067.00	11.40
35	000423	东阿阿胶	3,307,934.66	11.34
36	000069	华侨城 A	3,273,533.00	11.22
37	000768	中航飞机	3,268,098.00	11.20
38	002236	大华股份	3,186,589.72	10.92
39	000728	国元证券	3,079,174.07	10.55
40	002230	科大讯飞	3,078,060.80	10.55
41	600958	东方证券	3,011,497.00	10.32
42	300315	掌趣科技	2,990,326.70	10.25
43	002385	大北农	2,942,687.26	10.09
44	000157	中联重科	2,920,831.00	10.01
45	002008	大族激光	2,802,477.72	9.61
46	000559	万向钱潮	2,797,810.00	9.59
47	000009	中国宝安	2,761,414.93	9.47
48	000876	新希望	2,705,988.00	9.28
49	000895	双汇发展	2,702,316.47	9.26
50	000338	潍柴动力	2,676,219.56	9.17
51	002292	奥飞娱乐	2,643,699.84	9.06
52	000793	华闻传媒	2,615,041.00	8.96
53	002475	立讯精密	2,613,736.24	8.96

54	300124	汇川技术	2,581,238.53	8.85
55	000060	中金岭南	2,510,097.58	8.60
56	000540	中天城投	2,481,277.00	8.51
57	000917	电广传媒	2,481,225.50	8.51
58	000963	华东医药	2,441,335.00	8.37
59	000686	东北证券	2,430,961.37	8.33
60	000839	中信国安	2,424,474.00	8.31
61	000623	吉林敖东	2,413,436.70	8.27
62	000651	格力电器	2,402,080.00	8.23
63	002456	欧菲光	2,359,908.28	8.09
64	000630	铜陵有色	2,359,138.59	8.09
65	601328	交通银行	2,320,126.00	7.95
66	000503	海虹控股	2,291,381.97	7.85
67	600061	国投安信	2,287,990.00	7.84
68	000792	盐湖股份	2,277,850.76	7.81
69	300058	蓝色光标	2,262,595.97	7.76
70	000750	国海证券	2,236,389.15	7.67
71	300144	宋城演艺	2,193,173.23	7.52
72	600900	长江电力	2,187,797.00	7.50
73	000738	中航动控	2,168,847.00	7.43
74	000826	启迪桑德	2,127,411.51	7.29
75	000568	泸州老窖	2,108,189.00	7.23
76	002081	金螳螂	2,107,528.00	7.22
77	000425	徐工机械	2,078,511.00	7.12
78	002183	怡亚通	2,073,979.49	7.11
79	000402	金融街	2,058,374.00	7.06
80	600446	金证股份	2,038,020.00	6.99
81	000629	*ST 钒钛	2,030,429.69	6.96
82	000413	东旭光电	2,014,681.00	6.91
83	002500	山西证券	1,997,565.00	6.85
84	002007	华兰生物	1,935,650.21	6.63
85	300003	乐普医疗	1,922,627.96	6.59
86	000046	泛海控股	1,907,902.10	6.54
87	000709	河钢股份	1,828,807.00	6.27
88	002422	科伦药业	1,811,176.93	6.21
89	600518	康美药业	1,799,817.60	6.17
90	000983	西山煤电	1,767,759.00	6.06
91	000061	农产品	1,767,167.00	6.06
92	600816	安信信托	1,743,898.11	5.98
93	600074	保千里	1,690,574.88	5.79
94	000778	新兴铸管	1,652,216.00	5.66
95	000977	浪潮信息	1,649,917.00	5.66
96	000800	一汽轿车	1,630,009.98	5.59
97	002470	金正大	1,621,288.10	5.56

98	002129	中环股份	1,598,882.00	5.48
99	000039	中集集团	1,577,317.36	5.41
100	300002	神州泰岳	1,567,197.00	5.37
101	000729	燕京啤酒	1,561,571.22	5.35
102	300015	爱尔眼科	1,525,917.26	5.23
103	000831	*ST 五稀	1,520,823.17	5.21
104	000581	威孚高科	1,520,207.29	5.21
105	300146	汤臣倍健	1,487,755.00	5.10
106	000598	兴蓉环境	1,469,411.00	5.04
107	600873	梅花生物	1,465,674.00	5.02
108	600153	建发股份	1,453,400.00	4.98
109	600376	首开股份	1,446,419.00	4.96
110	300251	光线传媒	1,441,558.03	4.94
111	000883	湖北能源	1,403,719.00	4.81
112	002153	石基信息	1,377,210.00	4.72
113	002146	荣盛发展	1,364,880.50	4.68
114	600737	中粮屯河	1,345,040.00	4.61
115	002195	二三四五	1,341,371.00	4.60
116	600704	物产中大	1,304,022.00	4.47
117	000712	锦龙股份	1,282,715.92	4.40
118	300133	华策影视	1,270,670.58	4.36
119	600037	歌华有线	1,266,941.96	4.34
120	000027	深圳能源	1,258,273.62	4.31
121	002294	信立泰	1,245,883.00	4.27
122	000400	许继电气	1,242,716.25	4.26
123	002410	广联达	1,221,642.74	4.19
124	002038	双鹭药业	1,185,780.00	4.06
125	601198	东兴证券	1,176,892.50	4.03
126	000825	太钢不锈	1,166,910.00	4.00
127	002375	亚厦股份	1,145,835.00	3.93
128	000999	华润三九	1,135,396.58	3.89
129	002027	分众传媒	1,131,891.68	3.88
130	601336	新华保险	1,114,922.95	3.82
131	000898	鞍钢股份	1,096,785.86	3.76
132	601018	宁波港	1,069,642.15	3.67
133	000156	华数传媒	1,032,786.32	3.54
134	002353	杰瑞股份	1,021,667.00	3.50
135	601888	中国国旅	1,014,892.00	3.48
136	002399	海普瑞	1,014,801.78	3.48
137	600739	辽宁成大	1,013,866.00	3.48
138	300085	银之杰	981,588.00	3.36
139	600582	天地科技	920,475.00	3.16
140	600666	奥瑞德	902,192.81	3.09
141	600023	浙能电力	890,447.00	3.05

142	600208	新湖中宝	877,641.70	3.01
143	002424	贵州百灵	852,523.00	2.92
144	600871	石化油服	851,563.00	2.92
145	600098	广州发展	790,986.00	2.71
146	000539	粤电力 A	763,380.00	2.62
147	300168	万达信息	757,269.18	2.60
148	600685	中船防务	737,276.63	2.53
149	000937	冀中能源	729,900.00	2.50
150	600663	陆家嘴	722,147.00	2.48
151	600795	国电电力	679,215.00	2.33
152	603993	洛阳钼业	648,017.00	2.22

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	600016	民生银行	7,026,240.00	24.08
2	600519	贵州茅台	2,880,861.72	9.87
3	002024	苏宁云商	2,134,200.00	7.32
4	600315	上海家化	1,980,956.07	6.79
5	000983	西山煤电	1,665,319.00	5.71
6	601238	广汽集团	1,653,508.00	5.67
7	600000	浦发银行	1,633,156.51	5.60
8	000581	威孚高科	1,619,345.87	5.55
9	600637	东方明珠	1,521,099.14	5.21
10	002038	双鹭药业	1,453,564.01	4.98
11	300059	东方财富	1,408,456.00	4.83
12	000598	兴蓉环境	1,393,926.17	4.78
13	000831	*ST 五稀	1,373,104.00	4.71
14	600549	厦门钨业	1,367,516.60	4.69
15	000333	美的集团	1,358,663.90	4.66
16	000400	许继电气	1,341,334.67	4.60
17	000776	广发证券	1,299,128.94	4.45
18	002353	杰瑞股份	1,291,578.83	4.43
19	000858	五粮液	1,264,088.00	4.33
20	002385	大北农	1,222,129.00	4.19

21	000725	京东方 A	1,219,320.00	4.18
22	002410	广联达	1,217,773.20	4.17
23	600166	福田汽车	1,189,491.08	4.08
24	002304	洋河股份	1,187,194.15	4.07
25	000100	TCL 集团	1,172,536.00	4.02
26	000001	平安银行	1,159,218.36	3.97
27	600633	浙报传媒	1,100,835.52	3.77
28	603288	海天味业	1,076,966.67	3.69
29	002375	亚厦股份	1,075,034.77	3.68
30	601318	中国平安	1,039,100.00	3.56
31	600717	天津港	960,045.00	3.29
32	601699	潞安环能	907,723.00	3.11
33	002594	比亚迪	890,444.68	3.05
34	300017	网宿科技	880,310.22	3.02
35	002252	上海莱士	876,437.00	3.00
36	001979	招商蛇口	872,965.24	2.99
37	000166	申万宏源	853,374.00	2.93
38	000768	中航飞机	850,116.00	2.91
39	002236	大华股份	848,413.06	2.91
40	002142	宁波银行	839,997.45	2.88
41	600570	恒生电子	788,803.00	2.70
42	000937	冀中能源	737,381.00	2.53
43	000539	粤电力 A	719,009.00	2.46
44	000876	新 希 望	680,552.00	2.33
45	600036	招商银行	679,161.00	2.33
46	601377	兴业证券	666,785.00	2.29
47	000792	盐湖股份	661,442.00	2.27
48	002415	海康威视	644,847.82	2.21
49	002008	大族激光	634,401.00	2.17
50	000559	万向钱潮	627,494.99	2.15
51	000783	长江证券	617,421.31	2.12
52	300024	机器人	604,088.00	2.07
53	000069	华侨城 A	587,645.00	2.01
54	600153	建发股份	585,500.00	2.01

#### 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	397,462,786.07
卖出股票的收入（成交）总额	106,647,187.38

#### 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）	219,463.20	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	219,463.20	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	120001	16 以岭 EB	1,980	219,463.20	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。

**7.8 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**

**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计					-

股指期货投资本期收益	37,680.00
股指期货投资本期公允价值变动	-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 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 2015 年 9 月 10 日，海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书（处罚字【2015】73 号），海通证券股份有限公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案。

本基金公司投资该公司的原因：首先，公司作为国内证券行业龙头之一，在券商创新业务蓬勃发展的时期，有着较强的业绩增长预期和较大发展空间，具备投资价值；其次，本次核查和处罚并不影响公司两融业务的发展，在公司对相关问题做出整改后，将对经营层面不造成重大负面影响。综合来看，公司仍然具备投资价值。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

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	89,407.24
2	应收证券清算款	413,479.14
3	应收股利	-
4	应收利息	8,282.34
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	511,168.72

#### 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

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 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
388	2,836,033.9 3	1,093,259,273. 00	99.35%	7,121,892.00	0.65%

#### 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	广发沪深 300 交易型开 放式指数证券投资基金 联接基金	1,081,739,300.00	98.31%
2	广发基金管理有限公司	10,001,000.00	0.91%
3	方正证券股份有限公司	1,331,546.00	0.12%
4	庄维河	1,000,000.00	0.09%
5	张林	611,300.00	0.06%
6	邱志婧	300,000.00	0.03%
7	杜晓伟	187,000.00	0.02%
8	中信证券股份有限公司	173,000.00	0.02%

9	李建龙	150,000.00	0.01%
10	李忠	130,000.00	0.01%

### 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 8 月 20 日）基金份额总额	308,381,165.00
本报告期期初基金份额总额	26,381,165.00
本报告期基金总申购份额	1,080,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,100,381,165.00

## 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

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。

相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

### 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，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

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

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。

#### 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

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

#### 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	
国泰君安	4	8,745,962.91	1.74%	8,145.29	1.83%	-
广发证券	7	79,027,468.21	15.72%	73,598.35	16.50%	-
国金证券	1	4,802,327.67	0.96%	4,472.42	1.00%	-
新时代证券	1	15,112,184.32	3.01%	14,073.87	3.15%	-
中信建投	4	148,376,749.28	29.52%	138,183.46	30.97%	-
光大证券	3	136,973,133.15	27.25%	127,563.51	28.59%	-
方正证券	6	109,461,839.36	21.78%	80,049.61	17.94%	-
申银万国	3	106,136.00	0.02%	98.84	0.02%	-
天风证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
中信证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-

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

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

注：1 交易席位选择标准：

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

2 交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
广发证券	3,326.30	3.48%	-	-	-	-
新时代证券	92,348.20	96.52%	-	-	-	-

广发基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十六日