

# 广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：二〇一六年十月二十四日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,145,381,165.00 份
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。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	16,218,784.53
2.本期利润	47,684,645.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0426
4.期末基金资产净值	1,145,776,702.34
5.期末基金份额净值	1.0003

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.63%	0.77%	3.15%	0.80%	1.48%	-0.03%

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

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 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 9 月 30 日)



注: 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 基金经理(或基金经理小组)简介

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

	金经 理； 广发 环 保 指 数 基 金 的 基 金 经 理； 广发 中 证 军 工 E T F 基 金 的 基 金 经 理； 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 公平交易专项说明

##### 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%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 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 0.09%，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 4.63%，同期业绩比较基准收益率为 3.15%，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

3 季度整体市场依然处在震荡趋势之中，上证综指依然无法有效突破和站稳 3100 点；展望 4 季度，整体市场将可能继续保持这种震荡行情，同时受政策和事件影响，市场依然存在结构性行情和局部性机会，例如 4 季度美联储的加息预期负面影响，又如调结构过程中的 PPP 相关投资机会，其对环保、养老等公共服务的刺激作用，以及对整体市场的短期提振影响，未来深港通等既定政策预期的落实也将提振市场信心。

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。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,108,146,883.99	96.52
	其中：股票	1,108,146,883.99	96.52
2	固定收益投资	232,927.20	0.02
	其中：债券	232,927.20	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	39,551,554.21	3.45
7	其他各项资产	146,769.79	0.01
8	合计	1,148,078,135.19	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	889,401.40	0.08
B	采矿业	38,309,666.10	3.34
C	制造业	360,453,211.81	31.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,755,866.16	3.82
E	建筑业	38,752,822.43	3.38
F	批发和零售业	23,697,930.26	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	33,225,607.52	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,404,421.97	5.80
J	金融业	403,066,982.83	35.18
K	房地产业	51,077,064.48	4.46
L	租赁和商务服务业	13,034,077.04	1.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,790,307.99	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,741,008.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	19,384,062.13	1.69
S	综合	5,564,453.87	0.49

合计	1,108,146,883.99	96.72
----	------------------	-------

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,385,700	47,335,512.00	4.13
2	600016	民生银行	3,024,000	28,002,240.00	2.44
3	601166	兴业银行	1,700,700	27,160,179.00	2.37
4	600036	招商银行	1,319,200	23,745,600.00	2.07
5	601328	交通银行	3,498,800	19,348,364.00	1.69
6	600519	贵州茅台	64,768	19,295,034.88	1.68
7	600000	浦发银行	1,105,730	18,233,487.70	1.59
8	600837	海通证券	1,053,500	16,761,185.00	1.46
9	600030	中信证券	1,024,500	16,514,940.00	1.44
10	601288	农业银行	4,888,996	15,302,557.48	1.34

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	232,927.20	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	232,927.20	0.02

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120001	16 以岭 EB	1,980	232,927.20	0.02

#### 5.6 报告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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 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。

#### 5.10 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	73,211.50
2	应收证券清算款	65,799.16
3	应收股利	-
4	应收利息	7,759.13
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,769.79

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,100,381,165.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,145,381,165.00

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,000.00
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.87

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

(一) 中国证监会批准广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二) 《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

### 8.2 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

### 8.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司  
二〇一六年十月二十四日