

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

2015 年半年度报告

2015 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：二〇一五年八月二十八日

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 2015 年 8 月 21 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 2015 年 1 月 29 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末投资目标基金明细	37
7.3 期末按行业分类的股票投资组合	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.7 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	45
7.8 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	46
7.9 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	46
7.10 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	46
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.13 投资组合报告附注	46

8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	48
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录	52
11.2 存放地点	52
11.3 查阅方式	52

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发起式联接基金
基金简称	广发信息技术联接
基金主代码	000942
交易代码	000942
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 29 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	163,566,387.10 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金主代码	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
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，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	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。
业绩比较基准	95%×中证全指信息技术指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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，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。

2.2.1 目标基金产品说明

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		王志伟	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	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼
--------	------------	---------------------------------

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	109,993,287.30
本期利润	115,815,613.76
加权平均基金份额本期利润	0.5258
本期加权平均净值利润率	35.76%
本期基金份额净值增长率	56.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	82,386,516.34
期末可供分配基金份额利润	0.5037
期末基金资产净值	256,016,891.73
期末基金份额净值	1.5652
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	56.52%

注：（1）本基金合同 2015 年 1 月 29 日生效，至披露时点未半年。

（2）所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）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。

（4）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	-20.69%	4.06%	-18.02%	3.94%	-2.67%	0.12%
过去三个月	17.75%	3.19%	20.41%	3.14%	-2.66%	0.05%
自基金合同生效起至今	56.52%	2.69%	64.73%	2.69%	-8.21%	0.00%

注：（1）业绩比较基准为：95%×中证全指信息技术指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

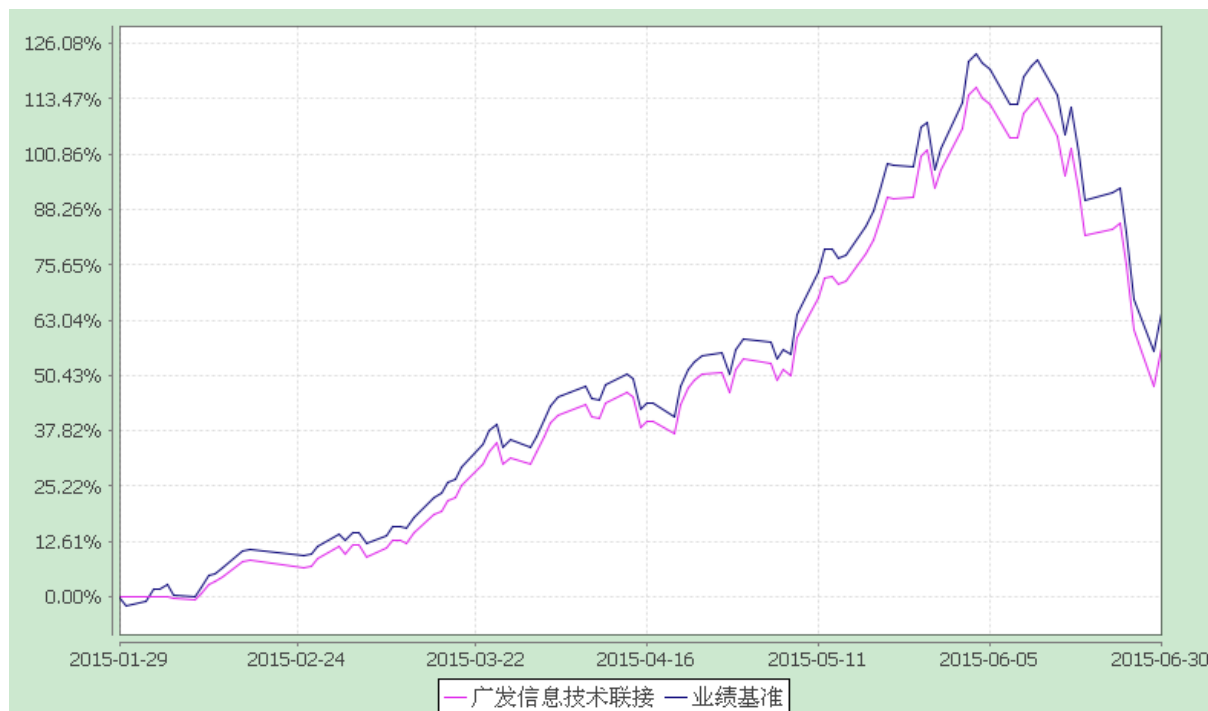
(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发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

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 29 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：(1) 本基金合同生效日期为 2015 年 1 月 29 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 24 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、互联网金融部（下辖杭州理财中心）、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。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。

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人管理七十五只开放式基金——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、广发中债金融债指数证券投资基金、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和广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为 2262.47 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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中小板 300ETF 及联接基金的基金经理；广发深 100 指数分级基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 及联接基金的基金经理；广发百发 100 指数基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发全指信息技术 ETF 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；	2015-01-29	-	16 年	男，中国籍，经济学硕士，持有基金业执业资格证书，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 日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日起任广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日起任广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日起任广发深证 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 日起任广发百发 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

	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；数量投资部总经理				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。
--	---	--	--	--	--

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发起式联接基金基金合同》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%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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 联接基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证全指信息技术 ETF 及指数成份股等，间接复制指数，同时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，本基金跟踪误差来源主要是建仓、申购、赎回和成份股调整因素。

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 56.52%，同期业绩比较基准收益率为 64.73%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，在经济改革等因素的预期下，市场走出了波澜壮阔的上涨行情，但在 2 季度末，受资金流动性并非很充裕，政府清场外配资，中小股票估值过高，希腊债务问题迟迟没有明朗等因素的影响，市场可谓内忧外患，出现了前所未有的快速深度回调，随着政府强有力的救市措施，市场逐渐企稳。展望下半年，政府会逐步落实经济改革的各项措施，未来经济有望健康持续发展。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、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、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、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。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。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发起式联接基金（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发起式联接基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资 产：		-
银行存款	6.4.7.1	21,012,928.54
结算备付金		18,361,188.28
存出保证金		108,921.82
交易性金融资产	6.4.7.2	256,012,856.21
其中：股票投资		27,934,779.41
基金投资		228,078,076.80
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		16,392,113.63
应收利息	6.4.7.5	6,549.67
应收股利		-
应收申购款		1,823,683.77
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	631,682.65
资产总计		314,349,924.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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		57,587,610.01
应付管理人报酬		15,600.58
应付托管费		3,120.12
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	414,762.19
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	311,939.94
负债合计		58,333,032.84
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	163,566,387.10
未分配利润	6.4.7.1 0	92,450,504.63
所有者权益合计		256,016,891.73
负债和所有者权益总计		314,349,924.57

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5652 元，基金份额总额 163,566,387.10 份。

2、本会计期间为 2015 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

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发起式联接基金

本报告期：2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		117,123,745.89
1. 利息收入		157,360.24
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	157,360.24
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）		110,352,724.77
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	22,389,295.31
基金投资收益	6.4.7.1 3	87,945,664.63
债券投资收益	6.4.7.1 4	-
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 5	-
股利收益	6.4.7.1 6	17,764.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	5,822,326.46
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 8	791,334.42
减：二、费用		1,308,132.13
1. 管理人报酬		143,636.68
2. 托管费		28,727.29
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	968,426.49
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.2 0	167,341.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		115,815,613.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		115,815,613.76

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发起式联接基金

本报告期：2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 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	260,483,590.56	-	260,483,590.56

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	115,815,613.76	115,815,613.76
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)	-96,917,203.46	-23,365,109.13	-120,282,312.59
其中: 1. 基金申购款	547,058,954.91	313,905,944.76	860,964,899.67
2. 基金赎回款	-643,976,158.37	-337,271,053.89	-981,247,212.26
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)	163,566,387.10	92,450,504.63	256,016,891.73

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: 王志伟, 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发起式联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2014]1269号《关于准予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注册的批复》核准,由基金发起人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基金合同》发起,于2015年1月29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2015年1月5日至2015年1月23日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币260,483,590.56元,有效认购户数为3,427户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币43,686.05元,折合基金份额43,686.05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。基金合同于2015年1月29日生效,基金合同生效日的基金份额总额为260,483,590.56份。

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：目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股。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）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：中证全指信息技术指数。

本基金的财务报表于 2015 年 8 月 28 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于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日止的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2015 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具投资（主要为权证投资）等，其中股票投资、债券投资和基金投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券

的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 基金投资

买入基金于交易日按基金的公允价值入账，相关的交易费用直接计入当期损益。

卖出基金于交易日确认基金投资收益，卖出基金按移动加权平均法结转成本。

(4) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。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次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

针对本基金投资的金融资产和金融负债，按照如下原则进行公允价值估值：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 基金投资收益于交易日按卖出或赎回基金的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

(4) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(5) 股票现金股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。基金现金红利于除息日确认为投资收益。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率逐日计提。

3. 本基金收取指数许可使用费，本基金管理人将根据与指数许可方签订的指数许可使用协议，从基金财产中计提指数使用费。

4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

5. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计

提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3. 本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 本基金每一基金份额享有同等分配权；

5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，估值处理标准另有规定的除外。于 2015 年 3 月 17 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

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》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. 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，暂减按 25%计入应纳税所得额。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，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。
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，暂免予缴纳印花税、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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	21,012,928.54
定期存款	-
其他存款	-
合计	21,012,928.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	27,694,876.45	27,934,779.41	239,902.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		222,495,653.30	228,078,076.80	5,582,423.50
其他		-	-	-
合计		250,190,529.75	256,012,856.21	5,822,326.46

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	3,637.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	44.10
应收结算备付金利息	2,868.22
应收债券利息	-
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	6,549.67

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
其他	631,682.65
合计	631,682.65

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	414,762.19
银行间市场应付交易费用	-

合计	414,762.19
----	------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	158,129.62
预提费用	153,810.32
合计	311,939.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	260,483,590.56	260,483,590.56
本期申购	547,058,954.91	547,058,954.91
本期赎回（以“-”号填列）	-643,976,158.37	-643,976,158.37
本期末	163,566,387.10	163,566,387.10

注：（1）本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额的情况，详见于附注 6.4.1“基金基本情况”之说明。

（2）本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	109,993,287.30	5,822,326.46	115,815,613.76
本期基金份额交易产生的变动数	-27,606,770.96	4,241,661.83	-23,365,109.13
其中：基金申购款	130,924,128.90	182,981,815.86	313,905,944.76
基金赎回款	-158,530,899.86	-178,740,154.03	-337,271,053.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,386,516.34	10,063,988.29	92,450,504.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
活期存款利息收入	131,223.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	535.10

结算备付金利息收入	24,957.63
其他	644.50
合计	157,360.24

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 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,423,837.75
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	12,965,457.56
合计	22,389,295.31

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 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
卖出股票成交总额	333,022,822.12
减：卖出股票成本总额	323,598,984.37
买卖股票差价收入	9,423,837.75

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
申购基金份额总额	462,107,200.00
减：现金支付申购款总额	66,676,551.33
减：申购股票成本总额	382,465,191.11
申购差价收入	12,965,457.56

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	615,092,418.12
减：卖出/赎回基金成本总额	527,146,753.49
基金投资收益	87,945,664.63

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,764.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,764.83

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	5,822,326.46
——股票投资	239,902.96
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	5,582,423.50
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	5,822,326.46

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金赎回费收入	691,948.66
手续费返还	-
基金转换费收入	99,385.76
印花税返还	-
替代损益	-
其他	-
合计	791,334.42

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
交易所市场交易费用	968,426.49
银行间市场交易费用	-
合计	968,426.49

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
审计费用		18,095.60
信息披露费		135,714.72
银行汇划费		11,928.65
指数使用费		1,602.70
合计		167,341.67

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关系发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
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	本基金是该基金的联接基金

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	
	2015年1月29日（基金合同生效日）至2015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	84,394,358.59	12.31%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015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	76,839.09	15.25%	0.00	0.00%

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。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 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	180,641.53

注：基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）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 为前一日基金资产净值-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

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 2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）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－前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金合同生效日（2015 年 1 月 29 日）持有的基金份额	10,000,200.02
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	13,231,241.09
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	23,231,441.11
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	14.20%

注：基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015年1月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	21,012,928.54	131,223.01

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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的债券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有 142,548,798.00 份目标 ETF 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份额，占其总份额的比例为 31.48%。

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（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项	21.54	-	-	3,200.00	63,904.00	68,928.00	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	34.88	-	-	3,200.00	110,080.00	111,616.00	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事项	16.42	-	-	8,400.00	138,096.00	137,928.00	-
002214	大立科技	2015-06-15	重大事项	15.44	-	-	600.00	11,951.02	9,264.00	-
002288	超华科技	2015-06-08	重大事项	17.75	2015-08-17	15.98	2,100.00	33,311.12	37,275.00	-
002308	威创股份	2015-06-12	重大事项	31.00	-	-	72.00	1,947.67	2,232.00	-
002528	英飞拓	2015-06-25	重大事项	15.18	2015-07-02	13.66	1,600.00	26,320.00	24,288.00	-
002577	雷柏科技	2015-06-10	重大事项	80.60	-	-	200.00	16,837.36	16,120.00	-
002636	金安国纪	2015-06-29	重大事项	22.10	-	-	3,080.00	75,349.26	68,068.00	-
300007	汉威电子	2015-06-29	重大事项	74.72	2015-08-24	67.25	2,000.00	158,416.00	149,440.00	-
300074	华平股份	2015-06-29	重大事项	15.39	2015-07-14	16.00	4,000.00	70,600.00	61,560.00	-
300155	安居宝	2015-06-15	重大事项	40.14	2015-07-20	32.54	100.00	4,495.98	4,014.00	-
300162	雷曼光电	2015-04-15	重大事项	23.40	2015-07-20	21.06	1,900.00	44,884.68	44,460.00	-
300202	聚光科	2015-0	重大事	41.19	2015-0	33.88	600.00	22,608.00	24,714.00	-

3	技	4-20	项		8-12						
300212	易华录	2015-06-30	重大事项	64.12	2015-07-13	54.00	2,800.00	177,320.00	179,536.00	-	
300269	联建光电	2015-06-30	重大事项	28.81	-	-	4,200.00	128,562.00	121,002.00	-	
300373	扬杰科技	2015-06-09	重大事项	82.50	2015-07-14	74.25	300.00	26,193.07	24,750.00	-	
300377	赢时胜	2015-05-20	重大事项	145.51	2015-07-15	168.99	400.00	62,272.00	58,204.00	-	
300383	光环新网	2015-06-17	重大事项	97.06	-	-	450.00	43,509.39	43,677.00	-	
300392	腾信股份	2015-06-30	重大事项	133.74	2015-07-14	147.11	200.00	37,080.00	26,748.00	-	
600074	中达股份	2015-06-26	重大事项	20.92	-	-	6,600.00	144,980.00	138,072.00	-	
600410	华胜天成	2015-05-28	重大事项	47.84	2015-07-22	43.06	800.00	36,369.50	38,272.00	-	
600602	仪电电子	2015-04-14	重大事项	10.28	2015-08-07	11.31	8,400.00	86,352.00	86,352.00	-	
600654	飞乐股份	2015-06-29	重大事项	30.91	-	-	8,000.00	269,664.00	247,280.00	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 2015 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、

监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金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。

本基金本报告期末未持有债券投资，因此与债券相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会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，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

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 2015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	21,012,928.54	-	-	-	21,012,928.54
结算备付金	18,361,188.28	-	-	-	18,361,188.28

					8
存出保证金	108,921.82	-	-	-	108,921.82
交易性金融资产	0.00	-	-	256,012,856.21	256,012,856.21
应收证券清算款	-	-	-	16,392,113.63	16,392,113.63
应收利息	-	-	-	6,549.67	6,549.67
应收申购款	0.00	-	-	1,823,683.77	1,823,683.77
其他资产	-	-	-	631,682.65	631,682.65
资产总计	39,483,038.64	-	-	274,866,885.93	314,349,924.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	57,587,610.01	57,587,610.01
应付管理人报酬	-	-	-	15,600.58	15,600.58
应付托管费	-	-	-	3,120.12	3,120.12
应付交易费用	-	-	-	414,762.19	414,762.19
其他负债	-	-	-	311,939.94	311,939.94
负债总计	-	-	-	58,333,032.84	58,333,032.84
利率敏感度缺口	39,483,038.64	-	-	216,533,853.09	256,016,891.73

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。

6.4.13.4.2 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	
	2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	27,934,779.41	10.91
交易性金融资产—基金投资	228,078,076.80	89.09
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	256,012,856.21	100.00

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 2015年6月30日
	业绩比较基准上升 5%	1,374,733.60
	业绩比较基准下降 5%	-1,374,733.60

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 6.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2015 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 254,289,056.21 元，属于第二层级的余额为 1,723,800.00 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。如附注 6.4.5.2 所述，本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(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	27,934,779.41	8.89
	其中：股票	27,934,779.41	8.89
2	基金投资	228,078,076.80	72.56
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	39,374,116.82	12.53
8	其他各项资产	18,962,951.54	6.03
9	合计	314,349,924.57	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
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	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	228,078,076.80	89.09

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

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	14,803,443.40	5.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	31,600.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,873,186.01	5.03
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	226,550.00	0.09
	合计	27,934,779.41	10.91

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300059	东方财富	14,000	883,260.00	0.35
2	600570	恒生电子	6,000	672,300.00	0.26

3	002415	海康威视	14,000	627,200.00	0.24
4	000725	京东方 A	119,000	617,610.00	0.24
5	300104	乐视网	11,000	569,360.00	0.22
6	600703	三安光电	17,000	532,100.00	0.21
7	600100	同方股份	21,000	440,790.00	0.17
8	300168	万达信息	8,000	392,960.00	0.15
9	000503	海虹控股	8,000	392,000.00	0.15
10	600271	航天信息	6,000	388,260.00	0.15
11	600588	用友网络	8,000	367,040.00	0.14
12	002230	科大讯飞	10,000	349,400.00	0.14
13	002241	歌尔声学	9,000	323,100.00	0.13
14	002008	大族激光	10,000	287,200.00	0.11
15	300017	网宿科技	6,000	278,520.00	0.11
16	002405	四维图新	6,000	262,800.00	0.10
17	002065	东华软件	9,000	258,750.00	0.10
18	300033	同花顺	3,000	257,970.00	0.10
19	600654	中安消	8,000	247,280.00	0.10
20	600446	金证股份	2,000	246,920.00	0.10
21	600601	方正科技	26,000	236,600.00	0.09
22	002456	欧菲光	7,000	236,180.00	0.09
23	002236	大华股份	7,000	223,440.00	0.09
24	002129	中环股份	11,000	217,690.00	0.09
25	600718	东软集团	10,000	217,300.00	0.08
26	300002	神州泰岳	14,058	214,243.92	0.08
27	000997	新大陆	8,000	212,800.00	0.08
28	600571	信雅达	2,000	211,700.00	0.08
29	300253	卫宁软件	4,000	208,000.00	0.08
30	000977	浪潮信息	7,000	206,850.00	0.08
31	000970	中科三环	10,000	206,100.00	0.08
32	002439	启明星辰	6,000	205,800.00	0.08
33	002475	立讯精密	6,000	202,860.00	0.08
34	000413	东旭光电	20,000	195,600.00	0.08
35	300315	掌趣科技	14,090	190,919.50	0.07
36	002312	三泰控股	5,075	190,109.50	0.07
37	600797	浙大网新	10,000	188,900.00	0.07
38	601012	隆基股份	12,000	188,880.00	0.07
39	002410	广联达	8,000	187,200.00	0.07
40	002657	中科金财	2,020	185,880.40	0.07
41	300212	易华录	2,800	179,536.00	0.07
42	002055	得润电子	3,000	173,640.00	0.07
43	600584	长电科技	9,000	171,990.00	0.07
44	300170	汉得信息	7,050	171,244.50	0.07
45	601519	大智慧	9,000	168,390.00	0.07
46	002104	恒宝股份	7,000	165,830.00	0.06

47	002152	广电运通	5,000	161,700.00	0.06
48	600151	航天机电	10,000	160,300.00	0.06
49	603000	人民网	3,000	156,390.00	0.06
50	300274	阳光电源	5,000	152,850.00	0.06
51	002161	远望谷	7,000	152,320.00	0.06
52	300007	汉威电子	2,000	149,440.00	0.06
53	600171	上海贝岭	6,000	146,700.00	0.06
54	300068	南都电源	7,000	145,950.00	0.06
55	002261	拓维信息	3,000	145,710.00	0.06
56	002049	同方国芯	3,000	144,000.00	0.06
57	300085	银之杰	2,000	143,460.00	0.06
58	300010	立思辰	5,000	142,600.00	0.06
59	300020	银江股份	5,040	138,600.00	0.05
60	600074	保千里	6,600	138,072.00	0.05
61	002106	莱宝高科	8,400	137,928.00	0.05
62	000021	深科技	9,000	137,250.00	0.05
63	600478	科力远	8,000	136,160.00	0.05
64	300359	全通教育	1,080	135,291.60	0.05
65	600728	佳都科技	4,000	134,760.00	0.05
66	002179	中航光电	4,000	132,000.00	0.05
67	300271	华宇软件	3,000	131,430.00	0.05
68	002153	石基信息	1,000	129,990.00	0.05
69	600666	西南药业	3,000	127,650.00	0.05
70	300077	国民技术	3,000	127,620.00	0.05
71	002063	远光软件	4,000	125,080.00	0.05
72	002195	二三四五	3,000	124,680.00	0.05
73	000988	华工科技	7,000	124,670.00	0.05
74	600183	生益科技	12,000	122,280.00	0.05
75	300202	聚龙股份	3,000	121,200.00	0.05
76	300269	联建光电	4,200	121,002.00	0.05
77	300367	东方网力	2,000	115,500.00	0.05
78	002642	荣之联	2,000	114,300.00	0.04
79	300075	数字政通	3,000	113,070.00	0.04
80	000748	长城信息	3,200	111,616.00	0.04
81	300088	长信科技	4,000	110,000.00	0.04
82	300380	安硕信息	1,000	109,050.00	0.04
83	002185	华天科技	6,000	108,120.00	0.04
84	603678	火炬电子	1,000	107,880.00	0.04
85	300333	兆日科技	1,000	107,800.00	0.04
86	300166	东方国信	3,000	107,760.00	0.04
87	002280	联络互动	2,000	106,600.00	0.04
88	600536	中国软件	3,000	106,440.00	0.04
89	002544	杰赛科技	3,000	105,570.00	0.04
90	300182	捷成股份	2,000	103,000.00	0.04

91	300032	金龙机电	3,000	102,960.00	0.04
92	300111	向日葵	13,000	102,960.00	0.04
93	600330	天通股份	6,000	102,060.00	0.04
94	002177	御银股份	7,000	100,940.00	0.04
95	300115	长盈精密	3,000	99,930.00	0.04
96	600288	大恒科技	4,000	99,760.00	0.04
97	600289	亿阳信通	5,000	99,650.00	0.04
98	002474	榕基软件	5,000	97,150.00	0.04
99	300207	欣旺达	4,000	96,880.00	0.04
100	300339	润和软件	2,000	96,180.00	0.04
101	002315	焦点科技	1,000	96,000.00	0.04
102	000050	深天马A	4,000	93,880.00	0.04
103	002273	水晶光电	3,000	93,750.00	0.04
104	300053	欧比特	2,000	93,200.00	0.04
105	002174	游族网络	1,000	92,760.00	0.04
106	300205	天喻信息	3,000	90,450.00	0.04
107	000670	盈方微	6,000	88,800.00	0.03
108	002449	国星光电	4,000	88,000.00	0.03
109	000636	风华高科	7,000	87,360.00	0.03
110	002402	和而泰	3,000	87,300.00	0.03
111	300352	北信源	2,000	86,800.00	0.03
112	603019	中科曙光	1,000	86,590.00	0.03
113	002373	千方科技	2,000	86,580.00	0.03
114	600602	仪电电子	8,400	86,352.00	0.03
115	600884	杉杉股份	3,000	85,800.00	0.03
116	002197	证通电子	3,080	85,685.60	0.03
117	300183	东软载波	3,000	85,500.00	0.03
118	300131	英唐智控	3,000	85,380.00	0.03
119	600149	廊坊发展	4,000	84,920.00	0.03
120	002463	沪电股份	10,000	83,500.00	0.03
121	600460	士兰微	9,000	83,070.00	0.03
122	600237	铜峰电子	7,000	82,460.00	0.03
123	600260	凯乐科技	5,000	82,250.00	0.03
124	300378	鼎捷软件	1,000	81,140.00	0.03
125	300226	上海钢联	1,000	81,000.00	0.03
126	000733	振华科技	3,000	80,970.00	0.03
127	002421	达实智能	4,040	80,921.20	0.03
128	300248	新开普	2,000	80,320.00	0.03
129	002093	国脉科技	5,000	80,000.00	0.03
130	002025	航天电器	3,020	79,124.00	0.03
131	600800	天津磁卡	6,000	78,000.00	0.03
132	002658	雪迪龙	3,000	77,700.00	0.03
133	002389	南洋科技	4,000	77,600.00	0.03
134	300036	超图软件	2,089	76,624.52	0.03

135	002138	顺络电子	5,000	76,250.00	0.03
136	002371	七星电子	2,000	76,000.00	0.03
137	002638	勤上光电	4,000	75,440.00	0.03
138	000555	神州信息	1,000	74,800.00	0.03
139	002156	通富微电	4,000	74,640.00	0.03
140	000948	南天信息	2,000	74,400.00	0.03
141	300296	利亚德	4,000	74,400.00	0.03
142	002338	奥普光电	1,000	73,000.00	0.03
143	002376	新北洋	4,000	71,600.00	0.03
144	600845	宝信软件	1,000	71,210.00	0.03
145	300231	银信科技	3,000	70,770.00	0.03
146	000536	华映科技	4,000	70,000.00	0.03
147	002095	生意宝	1,080	69,001.20	0.03
148	000066	长城电脑	3,200	68,928.00	0.03
149	300137	先河环保	3,000	68,640.00	0.03
150	002636	金安国纪	3,080	68,068.00	0.03
151	600360	华微电子	7,000	67,620.00	0.03
152	300065	海兰信	2,000	63,860.00	0.02
153	300052	中青宝	2,000	63,800.00	0.02
154	002056	横店东磁	2,000	62,560.00	0.02
155	600563	法拉电子	2,000	61,900.00	0.02
156	300074	华平股份	4,000	61,560.00	0.02
157	300139	福星晓程	3,000	60,900.00	0.02
158	300118	东方日升	5,000	60,150.00	0.02
159	002609	捷顺科技	3,000	60,000.00	0.02
160	300044	赛为智能	2,000	59,580.00	0.02
161	000532	力合股份	2,000	59,380.00	0.02
162	002331	皖通科技	2,000	58,760.00	0.02
163	300288	朗玛信息	1,000	58,530.00	0.02
164	300377	赢时胜	400	58,204.00	0.02
165	300324	旋极信息	2,000	56,780.00	0.02
166	002610	爱康科技	4,000	55,600.00	0.02
167	600850	华东电脑	1,000	55,390.00	0.02
168	002079	苏州固锝	5,000	54,450.00	0.02
169	300220	金运激光	1,000	54,400.00	0.02
170	002436	兴森科技	3,000	54,300.00	0.02
171	000823	超声电子	4,000	53,840.00	0.02
172	600537	亿晶光电	3,000	53,700.00	0.02
173	300369	绿盟科技	1,050	53,550.00	0.02
174	002279	久其软件	1,000	53,500.00	0.02
175	300150	世纪瑞尔	4,000	53,280.00	0.02
176	300014	亿纬锂能	2,000	53,000.00	0.02
177	300229	拓尔思	2,000	51,800.00	0.02
178	601231	环旭电子	3,000	51,030.00	0.02

179	300300	汉鼎股份	2,000	50,700.00	0.02
180	300356	光一科技	1,000	50,600.00	0.02
181	300245	天玑科技	2,050	49,630.50	0.02
182	300025	华星创业	2,000	49,580.00	0.02
183	300303	聚飞光电	4,000	49,160.00	0.02
184	603005	晶方科技	1,000	48,910.00	0.02
185	002635	安洁科技	2,000	48,700.00	0.02
186	002401	中海科技	2,000	48,300.00	0.02
187	000049	德赛电池	1,000	47,700.00	0.02
188	002484	江海股份	2,000	47,400.00	0.02
189	002139	拓邦股份	2,000	46,660.00	0.02
190	600764	中电广通	2,000	46,200.00	0.02
191	000727	华东科技	3,000	45,600.00	0.02
192	300128	锦富新材	2,000	45,200.00	0.02
193	300370	安控科技	2,000	44,760.00	0.02
194	002253	川大智胜	1,000	44,550.00	0.02
195	300162	雷曼光电	1,900	44,460.00	0.02
196	002017	东信和平	2,020	43,914.80	0.02
197	300383	光环新网	450	43,677.00	0.02
198	300051	三五互联	2,000	43,180.00	0.02
199	000032	深桑达A	2,000	41,480.00	0.02
200	300290	荣科科技	1,000	39,980.00	0.02
201	300102	乾照光电	4,000	39,920.00	0.02
202	300311	任子行	1,000	39,400.00	0.02
203	002222	福晶科技	2,000	38,980.00	0.02
204	300130	新国都	1,000	38,510.00	0.02
205	300351	永贵电器	1,000	38,350.00	0.01
206	002218	拓日新能	3,000	38,340.00	0.01
207	600410	华胜天成	800	38,272.00	0.01
208	300219	鸿利光电	1,000	37,980.00	0.01
209	002600	江粉磁材	4,000	37,960.00	0.01
210	600476	湘邮科技	1,000	37,810.00	0.01
211	002232	启明信息	2,000	37,800.00	0.01
212	002288	超华科技	2,100	37,275.00	0.01
213	300223	北京君正	1,000	35,600.00	0.01
214	300408	三环集团	1,000	34,860.00	0.01
215	300165	天瑞仪器	1,000	34,770.00	0.01
216	300241	瑞丰光电	2,000	33,460.00	0.01
217	300227	光韵达	1,026	32,780.70	0.01
218	300235	方直科技	1,001	31,701.67	0.01
219	600203	福日电子	2,000	31,600.00	0.01
220	002579	中京电子	2,000	31,600.00	0.01
221	603328	依顿电子	1,000	30,660.00	0.01
222	002189	利达光电	1,000	30,040.00	0.01

223	300275	梅安森	1,000	29,580.00	0.01
224	300076	GQY 视讯	1,000	29,560.00	0.01
225	300050	世纪鼎利	1,000	28,520.00	0.01
226	300392	腾信股份	200	26,748.00	0.01
227	300373	扬杰科技	300	24,750.00	0.01
228	300203	聚光科技	600	24,714.00	0.01
229	002528	英飞拓	1,600	24,288.00	0.01
230	300301	长方照明	2,000	19,840.00	0.01
231	002577	雷柏科技	200	16,120.00	0.01
232	002214	大立科技	600	9,264.00	0.00
233	300155	安居宝	100	4,014.00	0.00
234	002555	顺荣三七	70	3,136.00	0.00
235	002308	威创股份	72	2,232.00	0.00
236	300114	中航电测	20	879.80	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	7,490,197.38	2.93
2	300104	乐视网	7,352,037.96	2.87
3	600570	恒生电子	7,093,798.00	2.77
4	000725	京东方 A	7,051,174.00	2.75
5	600100	同方股份	6,046,268.22	2.36
6	600804	鹏博士	6,001,413.00	2.34
7	600588	用友网络	5,584,927.20	2.18
8	000503	海虹控股	5,377,728.66	2.10
9	002230	科大讯飞	5,192,769.84	2.03
10	600271	航天信息	4,794,250.40	1.87
11	300059	东方财富	4,727,758.00	1.85
12	002241	歌尔声学	4,711,219.51	1.84
13	002065	东华软件	4,664,997.33	1.82
14	600718	东软集团	4,027,078.00	1.57
15	300168	万达信息	3,934,766.58	1.54
16	300253	卫宁软件	3,626,807.85	1.42
17	002236	大华股份	3,617,480.63	1.41
18	600703	三安光电	3,413,642.80	1.33
19	600446	金证股份	3,407,687.42	1.33
20	603000	人民网	3,404,788.92	1.33

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600570	恒生电子	7,458,286.12	2.91
2	300104	乐视网	7,122,665.70	2.78
3	000725	京东方 A	7,077,979.19	2.76
4	002415	海康威视	6,371,991.80	2.49
5	300168	万达信息	6,171,323.09	2.41
6	600100	同方股份	5,327,302.84	2.08
7	600271	航天信息	4,757,049.89	1.86
8	600588	用友网络	4,594,128.67	1.79
9	600703	三安光电	4,193,962.85	1.64
10	000503	海虹控股	3,990,789.68	1.56
11	300002	神州泰岳	3,749,381.03	1.46
12	300017	网宿科技	3,639,144.98	1.42
13	002241	歌尔声学	3,613,582.54	1.41
14	600718	东软集团	3,584,970.83	1.40
15	002236	大华股份	3,439,835.67	1.34
16	002065	东华软件	3,431,208.86	1.34
17	002008	大族激光	3,351,648.16	1.31
18	002230	科大讯飞	3,342,322.88	1.31
19	300253	卫宁软件	3,248,283.02	1.27
20	603000	人民网	3,179,046.51	1.24

7.5.3 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	352,437,567.93
卖出股票的收入（成交）总额	333,022,822.12

7.6 期末按债券品种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序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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 根据公开市场信息，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，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 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。

7.13.3 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	108,921.82
2	应收证券清算款	16,392,113.63
3	应收股利	-
4	应收利息	6,549.67

5	应收申购款	1,823,683.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	631,682.65
9	合计	18,962,951.54

7.13.4 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。

7.13.5 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的情况。

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
7,933	20,618.48	23,747,017.64	14.52%	139,819,369.46	85.48%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	1,788.02	0.0011%
------------------	----------	---------

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份 额比例	发起份 额总 数	发起份 额占 基金总份 额比例	发起份 额承 诺持有 期限
基金管理人固有资金	23,231,441 .11	14.20%	10,000,200 .02	6.11%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	23,231,441 .11	14.20%	10,000,200 .02	6.11%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年1月29日）基金份额总额	260,483,590.56
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	547,058,954.91
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	643,976,158.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	163,566,387.10

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为2015年1月29日。

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

2015 年 4 月 30 日，包林生不再担任本基金管理人的副总经理。2015 年 5 月 23 日，肖雯不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

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

本报告期内本基金的基金管理人、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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	91,708,293.53	13.38%	65,151.50	12.93%	-
广发证券	3	84,394,358.59	12.31%	76,839.09	15.25%	增加 1 个
海通证券	1	490,358,316.16	71.54%	348,351.25	69.14%	-
招商证券	1	18,942,771.77	2.76%	13,456.86	2.67%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	增加 2 个
安信证券	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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-	434,185,794.04	91.12%
招商证券	-	-	-	-	-	-	42,334,181.43	8.88%

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关于增加广发银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-05-29

2	广发基金管理有限公司关于增加诺亚正行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-05-26
3	广发基金管理有限公司关于增加广东顺德农商行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-05-26
4	广发基金管理有限公司关于增加东亚银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-05-06
5	广发基金管理有限公司关于增加华兴银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-21
6	广发基金管理有限公司关于增加民族证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-20
7	广发基金管理有限公司关于增加兴业证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-20
8	广发基金管理有限公司关于增加上海农商银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-13
9	广发基金管理有限公司关于增加利得基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-07
10	广发基金管理有限公司关于增加展恒基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-07
11	广发基金管理有限公司关于增加苏州银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-03-27
12	广发基金管理有限公司关于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开放日常申购、	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-02-16
13	广发基金管理有限公司关于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合同生效公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-30
14	广发基金管理有限公司关于增加中信建投期货为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-29
15	广发基金管理有限公司关于增加海银基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-29
16	广发基金管理有限公司关于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增加代销机构的	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-20
17	广发基金管理有限公司关于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增加代销机构的	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-14
18	广发基金管理有限公司关于增加北京农商行为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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-05

注：无

11 备查文件目录

11.1 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发起式联接基金募集的文件

(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发起式联接基金基金合同》

(三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四) 《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托管协议》

(五) 法律意见书

(六) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

11.2 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

11.3 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

二〇一五年八月二十八日