

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末投资目标基金明细.....	38
7.3 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
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	48
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
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	50
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	广发沪深 300 联接	
基金主代码	270010	
交易代码	270010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 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	
报告期末基金份额总额	1,315,518,857.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
下属两级基金的交易代码	270010	002987
报告期末下属分级基金的份额总额	728,545,573.47 份	586,973,284.30 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

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%×沪深 300 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。
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	郭明
	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
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55 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55 号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		孙树明	易会满

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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
本期已实现收益	23,716,565.87	19,683,099.47
本期利润	126,637,767.87	106,251,008.06
加权平均基金份额本期利润	0.1686	0.1529
本期加权平均净值利润率	10.76%	9.78%
本期基金份额净值增长率	11.22%	10.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
期末可供分配利润	366,183,067.02	285,185,024.81
期末可供分配基金份额利润	0.5026	0.4859
期末基金资产净值	1,218,622,312.84	978,694,956.52
期末基金份额净值	1.6727	1.6674
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	104.67%	15.63%

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

广发沪深 300ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.17%	0.61%	4.73%	0.64%	0.44%	-0.03%
过去三个月	6.56%	0.57%	5.80%	0.59%	0.76%	-0.02%
过去六个月	11.22%	0.52%	10.26%	0.54%	0.96%	-0.02%
过去一年	18.50%	0.61%	15.49%	0.63%	3.01%	-0.02%
过去三年	71.38%	1.74%	66.00%	1.66%	5.38%	0.08%
自基金合同生效起至今	104.67%	1.54%	93.12%	1.52%	11.55%	0.02%

广发沪深 300ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.13%	0.61%	4.73%	0.64%	0.40%	-0.03%
过去三个月	6.45%	0.57%	5.80%	0.59%	0.65%	-0.02%
过去六个月	10.99%	0.52%	10.26%	0.54%	0.73%	-0.02%
自基金合同生效起至今	15.63%	0.61%	13.64%	0.63%	1.99%	-0.02%

(1) 业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。

(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

广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 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
 (2008 年 12 月 30 日至 2017 年 6 月 30 日)

广发沪深 300ETF 联接 A



广发沪深 300ETF 联接 C



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 26 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百四十四只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发

起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新

机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF)、广发景祥纯债债券型证券投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发量化稳健基金的基金经理；广	2014-04-01	-	13 年	男，中国籍，工学学士，持有中国证券基金从业证书，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，

	<p>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；广发沪深 300ETF 基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；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；数量投资部总经理助理</p>				<p>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, 2016 年 9 月 26 日起任广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理, 2017 年 1 月 25 日起任广发中证环保 ETF 基金的基金经理, 2017 年 4 月 25 日起任广发创业板 ETF 基金的基金经理, 2017 年 5 月 25 日起任广发创业板 ETF 联接基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	--

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未发生过同日反向交易的情况。

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

作为指数基金，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。

本基金是 ETF 联接基金，将主要持有广发沪深 300ETF 及指数成分股，间接复制指数，本质上依

然是被动投资策略，跟踪效果与直接持有成分股效果相同，同时作为联接基金，可参与场内折溢价套利等交易，更有利于广发沪深 300ETF 及其联接基金持有人的利益。

(2) 运作分析

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过 0.35% 的限制。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是成分股调整、申赎因素和停牌股票估值调整因素，目前的规模水平下，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额的净值增长率为 11.22%，C 类份额的净值增长率为 10.99%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%，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

在金融去杠杆、减持新政和加强监管等影响下，上半年市场呈现了明显“一九行情”，白酒、家电和金融等白马股表现最好。

展望下半年，随着 A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，未来 A 股市场或将进一步助推境外机构的价值投资理念。随着经济稳定且逐步好转，未来政策或转向监管和流动性之间的协调平衡，权益类资产的配置机会仍然值得关注。

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，因此对于风险承受力较低的投资者而言，选择沪深 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。

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联接基金的托管过程中，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，广发基金管理有限公司在对广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 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联接基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	122,587,850.95	140,341,909.68
结算备付金		20,865,056.46	36,050,801.82
存出保证金		6,103,105.24	16,707,361.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,068,536,949.84	1,670,353,840.33
其中：股票投资		9,502,140.72	4,029,745.00
基金投资		2,059,034,809.12	1,666,324,095.33
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		2,321,725.82	-
应收利息	6.4.7.5	24,323.62	34,620.43
应收股利		-	-
应收申购款		1,423,027.02	431,265.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,221,862,038.95	1,863,919,798.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,063,547.96
应付赎回款		23,172,039.98	5,409,647.89
应付管理人报酬		49,237.55	82,091.89
应付托管费		9,847.53	16,418.37
应付销售服务费		317,335.53	240,342.37
应付交易费用	6.4.7.7	773,494.53	355,874.69

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	222,814.47	347,799.86
负债合计		24,544,769.59	8,515,723.03
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,315,518,857.77	1,234,208,341.18
未分配利润	6.4.7.1 0	881,798,411.59	621,195,734.54
所有者权益合计		2,197,317,269.36	1,855,404,075.72
负债和所有者权益总计		2,221,862,038.95	1,863,919,798.75

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，广发沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值人民币 1.6727 元，基金份额总额 728,545,573.47 份；广发沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值人民币 1.6674 元，基金份额总额 586,973,284.30 份；总份额总额 1,315,518,857.77 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联接基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		236,402,731.71	-167,182,764.80
1. 利息收入		620,873.51	236,838.47
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	620,873.51	236,595.39
债券利息收入		-	243.08
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）		46,100,682.95	-110,887,579.29
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	1,276,754.66	-110,913,652.32
基金投资收益	6.4.7.1 3	41,963,866.46	33,635.45
债券投资收益	6.4.7.1 4	-	84,145.80
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	2,839,380.00	36,720.00
股利收益	6.4.7.1 6	20,681.83	-128,428.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	189,489,110.59	-56,702,477.99
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	192,064.66	170,454.01
减：二、费用		3,513,955.78	2,444,293.53
1. 管理人报酬		419,224.63	1,152,456.99
2. 托管费		83,844.90	230,491.38
3. 销售服务费		2,149,550.08	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	666,742.89	780,664.40
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	194,593.28	280,680.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		232,888,775.93	-169,627,058.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		232,888,775.93	-169,627,058.33

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联接基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,234,208,341.18	621,195,734.54	1,855,404,075.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	232,888,775.93	232,888,775.93
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）	81,310,516.59	27,713,901.12	109,024,417.71
其中：1. 基金申购款	1,076,678,783.55	592,854,840.03	1,669,533,623.58

2. 基金赎回款	-995,368,266.96	-565,140,938.91	-1,560,509,205.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,315,518,857.77	881,798,411.59	2,197,317,269.36
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	727,677,374.64	468,444,538.96	1,196,121,913.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-169,627,058.33	-169,627,058.33
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）	66,884,425.49	28,257,890.52	95,142,316.01
其中：1. 基金申购款	430,159,830.88	169,144,823.93	599,304,654.81
2. 基金赎回款	-363,275,405.39	-140,886,933.41	-504,162,338.80
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）	794,561,800.13	327,075,371.15	1,121,637,171.28

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联接基金（原名：广发沪深 300 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[2008]1295 号文《关于核准广发沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》批准，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2008 年 12 月 30 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。本基金已向中国证监会备案，并获中国证监会基金部函(2008)545 号《关于广发沪深 300 指数证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为 2008 年 12 月 8 日至 2008 年 12 月 26 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 653,693,988.31 元，有效认购户数为 12,912 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 44,015.09 元，折合基金份额 44,015.09 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。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2008 年 12 月 30 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 653,693,988.31 份。

根据本基金的管理人于 2016 年 1 月 19 日发布的《关于广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，变更本基金的投资范围及相关事项，将本基金变更为广发沪深 300ETF 的联接基金，允许本基金投资股指期货，参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务。相应地对基金合同中有关本基金的名称、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改，广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议经中国证券监督管理委员会于 2016 年 1 月 18 日备案确认，自该日生效。根据《关于广发沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》、《广发沪深 300 指数证券投资基金托管协议》修订为《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合同》、《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》，并已报中国证监会审核。《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合同》和《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》自中国证监会备案确认广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效之日，原《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》、《广发沪深 300 指数证券投资基金托管协议》同日失效。

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，2016 年 1 月 18 日前本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、到期日在一年以内的政府债券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具；2016 年 1 月 18 日起，本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，为

更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及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的相关规定）。本基金的业绩比较基准采用： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。

本基金自 2016 年 7 月 6 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	122,587,850.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	122,587,850.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,275,462.40	9,502,140.72	226,678.32

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	1,789,721,757.61	2,059,034,809.12	269,313,051.51
其他	-	-	-
合计	1,798,997,220.01	2,068,536,949.84	269,539,729.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	27,355,500.00	-	-	-
其中：股指期货投资	27,355,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	27,355,500.00	-	-	-

期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
		(单位：手)		
IF1707	IF1707	25	27,355,500.00	511,440.00
总额合计	-	-	27,355,500.00	511,440.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	511,440.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	20,007.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	145.17
应收结算备付金利息	4,170.97
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	24,323.62

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	773,494.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	773,494.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	34,375.37
预提费用	188,439.10
合计	222,814.47

6.4.7.9 实收基金

广发沪深 300ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	767,516,821.88	767,516,821.88
本期申购	272,996,589.68	272,996,589.68
本期赎回（以“-”号填列）	-311,967,838.09	-311,967,838.09

本期末	728,545,573.47	728,545,573.47
-----	----------------	----------------

广发沪深 300ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	466,691,519.30	466,691,519.30
本期申购	803,682,193.87	803,682,193.87
本期赎回（以“-”号填列）	-683,400,428.87	-683,400,428.87
本期末	586,973,284.30	586,973,284.30

注：申购含转换转入、红利再投资份(金)额，赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

广发沪深 300ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	361,307,053.47	25,467,916.53	386,774,970.00
本期利润	23,716,565.87	102,921,202.00	126,637,767.87
本期基金份额交易产生的变动数	-18,840,552.32	-4,495,446.18	-23,335,998.50
其中：基金申购款	131,809,107.49	23,152,290.90	154,961,398.39
基金赎回款	-150,649,659.81	-27,647,737.08	-178,297,396.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	366,183,067.02	123,893,672.35	490,076,739.37

广发沪深 300ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	213,439,098.86	20,981,665.68	234,420,764.54
本期利润	19,683,099.47	86,567,908.59	106,251,008.06
本期基金份额交易产生的变动数	52,062,826.48	-1,012,926.86	51,049,899.62
其中：基金申购款	369,429,288.66	68,464,152.98	437,893,441.64
基金赎回款	-317,366,462.18	-69,477,079.84	-386,843,542.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	285,185,024.81	106,536,647.41	391,721,672.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	501,703.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,529.33
结算备付金利息收入	116,640.38
其他	-
合计	620,873.51

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,092,791.06
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	183,963.60
合计	1,276,754.66

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	137,404,391.64
减：卖出股票成本总额	136,311,600.58
买卖股票差价收入	1,092,791.06

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	426,312,600.00
减：现金支付申购款总额	141,184,970.35
减：申购股票成本总额	284,943,666.05
申购差价收入	183,963.60

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	539,465,991.80
减：卖出/赎回基金成本总额	497,502,125.34
基金投资收益	41,963,866.46

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	2,839,380.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,681.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,681.83

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	186,253,310.59
——股票投资	-322,373.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	186,575,683.82
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	3,235,800.00
——权证投资	-
——股指期货投资	3,235,800.00
4. 其他	-
合计	189,489,110.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	97,758.13
手续费返还	-
基金转换费收入	94,306.53
印花税返还	-
其他	-
合计	192,064.66

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	635,692.20
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	31,050.69
合计	666,742.89

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	6,154.18
合计	194,593.28

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
广发期货有限公司	基金管理人母公司的全资子公司
广发沪深 300 交易型指数证券投资基金	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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比 例	成交金额	占当期股票成交总额的比 例
广发证券股份有限公司	-	-	239,845,971.10	57.39%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比 例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比 例
广发证券股份有限公司	223,368.66	57.85%	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	419,224.63	1,152,456.99
其中：支付销售机构的客户维护费	709,317.64	580,635.17

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日

等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	83,844.90	230,491.38

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C	合计
广发基金管理有限公司	-	2,118,632.02	2,118,632.02
广发证券股份有限公司	-	4,123.80	4,123.80
合计	-	2,122,755.82	2,122,755.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发沪深300ETF联接A	广发沪深300ETF联接C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经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划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发沪深 300ETF 联接 A

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。

广发沪深 300ETF 联接 C

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。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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	122,587,850.95	501,703.80	28,145,183.40	194,383.00

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券股份有限公司	600089	特变电工	配股认购	172.00	1,233.24
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-

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 1,798,912,117 份目标 ETF 基金广发沪深 300 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 98.98%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

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
601919	中远海控	2017-05-17	重大事项停牌	5.35	2017-07-26	5.89	1,300.00	6,877.00	6,955.00	-
600654	*ST 中安	2017-06-07	重大事项停牌	13.48	-	-	600.00	9,936.00	8,088.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项停牌	6.21	-	-	3,100.00	19,499.00	19,251.00	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项停牌	7.57	2017-07-03	7.54	3,600.00	26,053.00	27,252.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项停牌	3.60	-	-	7,800.00	26,920.00	28,080.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项停牌	22.29	-	-	1,400.00	28,742.00	31,206.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项停牌	30.82	2017-07-17	27.74	2,100.00	69,135.00	64,722.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项停牌	8.07	-	-	12,600.00	105,930.00	101,682.00	-

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 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易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

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	122,587,850.95	-	-	-	122,587,850.95
结算备付金	20,865,056.46	-	-	-	20,865,056.46
存出保证金	6,103,105.24	-	-	-	6,103,105.24
交易性金融资产	-	-	-	2,068,536,949.84	2,068,536,949.84
应收证券清算款	-	-	-	2,321,725.82	2,321,725.82
应收利息	-	-	-	24,323.62	24,323.62
应收申购款	-	-	-	1,423,027.02	1,423,027.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	149,556,012.65	-	-	2,072,306,026.30	2,221,862,038.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,172,039.98	23,172,039.98
应付管理人报酬	-	-	-	49,237.55	49,237.55
应付托管费	-	-	-	9,847.53	9,847.53
应付交易费用	-	-	-	773,494.53	773,494.53
应付销售服务费	-	-	-	317,335.53	317,335.53
其他负债	-	-	-	222,814.47	222,814.47
负债总计	-	-	-	24,544,769.59	24,544,769.59
利率敏感度缺口	149,556,012.65	-	-	2,047,761,256.71	2,197,317,269.36
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	140,341,909.68	-	-	-	140,341,909.68
结算备付金	36,050,801.82	-	-	-	36,050,801.82

存出保证金	16,707,361.00	-	-	-	16,707,361.00
交易性金融资产	-	-	-	1,670,353,840.33	1,670,353,840.33
应收利息	-	-	-	34,620.43	34,620.43
应收申购款	-	-	-	431,265.49	431,265.49
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	193,100,072.50	-	-	1,670,819,726.25	1,863,919,798.75
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,063,547.96	2,063,547.96
应付赎回款	-	-	-	5,409,647.89	5,409,647.89
应付管理人报酬	-	-	-	82,091.89	82,091.89
应付托管费	-	-	-	16,418.37	16,418.37
应付交易费用	-	-	-	355,874.69	355,874.69
应付销售服务费	-	-	-	240,342.37	240,342.37
其他负债	-	-	-	347,799.86	347,799.86
负债总计	-	-	-	8,515,723.03	8,515,723.03
利率敏感度缺口	193,100,072.50	-	-	1,662,304,003.22	1,855,404,075.72

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,502,140.72	0.43	4,029,745.00	0.22
交易性金融资产—基金投资	2,059,034,809.1 2	93.71	1,666,324,095.3 3	89.81
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,068,536,949.8 4	94.14	1,670,353,840.3 3	90.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2017年6月30日	2016年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	516,914.44	108,072,452.51
	业绩比较基准下降 5%	-516,914.44	-108,072,452.51

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,068,249,713.84 元，属于第二层级的余额为 287,236.00 元，无属于第三层级的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层级的余额 1,670,353,840.33 元，无属于第二层级的余额，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	9,502,140.72	0.43
	其中：股票	9,502,140.72	0.43
2	基金投资	2,059,034,809.12	92.67
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	143,452,907.41	6.46
8	其他各项资产	9,872,181.70	0.44
9	合计	2,221,862,038.95	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	广发沪深 300 交易型指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	2,059,034,809.12	93.71

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	11,360.00	0.00
B	采矿业	364,132.00	0.02
C	制造业	2,520,462.00	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	348,968.00	0.02
E	建筑业	591,473.00	0.03
F	批发和零售业	215,569.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	361,380.92	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	308,228.00	0.01
J	金融业	4,294,402.80	0.20
K	房地产业	348,631.00	0.02
L	租赁和商务服务业	65,246.00	0.00
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	33,784.00	0.00
S	综合	38,504.00	0.00
	合计	9,502,140.72	0.43

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.4 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	601318	中国平安	14,400	714,384.00	0.03
2	600519	贵州茅台	800	377,480.00	0.02
3	600036	招商银行	14,300	341,913.00	0.02
4	601166	兴业银行	17,300	291,678.00	0.01
5	600016	民生银行	31,200	256,464.00	0.01
6	601328	交通银行	36,400	224,224.00	0.01
7	601668	中国建筑	20,600	199,408.00	0.01
8	600000	浦发银行	15,600	197,340.00	0.01
9	600030	中信证券	10,900	185,518.00	0.01
10	601288	农业银行	50,400	177,408.00	0.01
11	600887	伊利股份	8,000	172,720.00	0.01
12	600837	海通证券	10,800	160,380.00	0.01
13	601398	工商银行	28,400	149,100.00	0.01
14	600104	上汽集团	4,800	149,040.00	0.01
15	601169	北京银行	16,000	146,720.00	0.01
16	601601	中国太保	4,300	145,641.00	0.01
17	600900	长江电力	9,200	141,496.00	0.01
18	601766	中国中车	12,800	129,536.00	0.01
19	600276	恒瑞医药	2,500	126,475.00	0.01
20	601211	国泰君安	6,000	123,060.00	0.01
21	300315	掌趣科技	12,600	102,816.00	0.00
22	601988	中国银行	27,600	102,120.00	0.00
23	002426	胜利精密	12,600	101,682.00	0.00
24	600048	保利地产	9,200	91,724.00	0.00
25	600518	康美药业	4,000	86,960.00	0.00
26	601390	中国中铁	10,000	86,700.00	0.00
27	601818	光大银行	20,800	84,240.00	0.00
28	600028	中国石化	14,000	83,020.00	0.00
29	600015	华夏银行	8,640	79,660.80	0.00
30	601688	华泰证券	4,400	78,760.00	0.00
31	600019	宝钢股份	11,600	77,836.00	0.00
32	601186	中国铁建	6,000	72,180.00	0.00

33	600585	海螺水泥	3,000	68,190.00	0.00
34	601006	大秦铁路	7,928	66,515.92	0.00
35	600703	三安光电	3,300	65,010.00	0.00
36	002049	紫光国芯	2,100	64,722.00	0.00
37	600690	青岛海尔	4,300	64,715.00	0.00
38	601336	新华保险	1,200	61,680.00	0.00
39	600309	万华化学	2,000	57,280.00	0.00
40	600340	华夏幸福	1,700	57,086.00	0.00
41	600958	东方证券	4,000	55,640.00	0.00
42	601901	方正证券	5,600	55,608.00	0.00
43	600999	招商证券	3,200	55,104.00	0.00
44	600660	福耀玻璃	2,100	54,684.00	0.00
45	601939	XD 建设银	8,800	54,120.00	0.00
46	601628	中国人寿	2,000	53,960.00	0.00
47	601009	南京银行	4,800	53,808.00	0.00
48	600089	特变电工	4,772	49,294.76	0.00
49	601857	中国石油	6,400	49,216.00	0.00
50	600009	上海机场	1,300	48,503.00	0.00
51	601669	中国电建	6,000	47,520.00	0.00
52	600741	华域汽车	1,942	47,074.08	0.00
53	601985	中国核电	6,000	46,860.00	0.00
54	601899	紫金矿业	13,600	46,648.00	0.00
55	601607	上海医药	1,600	46,208.00	0.00
56	601377	兴业证券	6,000	44,580.00	0.00
57	600068	葛洲坝	3,800	42,712.00	0.00
58	600031	三一重工	5,200	42,276.00	0.00
59	600029	南方航空	4,800	41,760.00	0.00
60	600886	国投电力	5,200	41,080.00	0.00
61	601600	中国铝业	8,800	39,776.00	0.00
62	600010	包钢股份	18,000	39,420.00	0.00
63	601888	中国国旅	1,300	39,182.00	0.00
64	600606	绿地控股	4,800	37,536.00	0.00
65	600570	恒生电子	800	37,344.00	0.00
66	600196	复星医药	1,200	37,188.00	0.00
67	600406	国电南瑞	2,100	37,065.00	0.00
68	601555	东吴证券	3,300	37,059.00	0.00
69	601933	永辉超市	5,200	36,816.00	0.00
70	600522	中天科技	3,000	36,150.00	0.00
71	601618	中国中冶	7,200	36,072.00	0.00
72	601788	光大证券	2,400	35,832.00	0.00
73	601099	太平洋	8,800	35,376.00	0.00
74	600066	宇通客车	1,600	35,152.00	0.00
75	600637	东方明珠	1,600	34,672.00	0.00
76	600705	中航资本	6,000	33,900.00	0.00

77	601800	中国交建	2,100	33,369.00	0.00
78	600109	国金证券	2,800	32,816.00	0.00
79	600893	航发动力	1,200	32,760.00	0.00
80	600816	安信信托	2,400	32,616.00	0.00
81	600383	金地集团	2,800	32,116.00	0.00
82	600111	北方稀土	2,800	31,724.00	0.00
83	600271	航天信息	1,512	31,207.68	0.00
84	601088	中国神华	1,400	31,206.00	0.00
85	600436	片仔癀	500	30,520.00	0.00
86	600177	雅戈尔	3,000	30,360.00	0.00
87	600804	鹏博士	1,700	30,175.00	0.00
88	600535	天士力	712	29,576.48	0.00
89	601018	宁波港	5,200	29,380.00	0.00
90	601198	东兴证券	1,700	29,308.00	0.00
91	600739	辽宁成大	1,600	28,848.00	0.00
92	601992	金隅股份	4,400	28,468.00	0.00
93	600023	浙能电力	5,200	28,392.00	0.00
94	600221	海航控股	8,800	28,336.00	0.00
95	600795	国电电力	7,800	28,080.00	0.00
96	600085	同仁堂	800	27,968.00	0.00
97	600018	上港集团	4,400	27,896.00	0.00
98	600674	川投能源	2,800	27,496.00	0.00
99	601111	中国国航	2,800	27,300.00	0.00
100	601727	上海电气	3,600	27,252.00	0.00
101	600115	东方航空	4,000	27,200.00	0.00
102	600153	建发股份	2,100	27,153.00	0.00
103	600352	浙江龙盛	2,800	26,684.00	0.00
104	600061	国投安信	1,700	26,435.00	0.00
105	603993	洛阳钼业	5,200	26,312.00	0.00
106	600415	小商品城	3,600	26,064.00	0.00
107	600208	新潮中宝	5,600	25,200.00	0.00
108	601998	中信银行	4,000	25,160.00	0.00
109	600489	中金黄金	2,500	25,075.00	0.00
110	600820	隧道股份	2,400	24,240.00	0.00
111	601155	新城控股	1,300	24,102.00	0.00
112	600332	白云山	800	23,232.00	0.00
113	600547	山东黄金	800	23,144.00	0.00
114	600170	上海建工	6,000	22,920.00	0.00
115	600157	永泰能源	6,400	22,848.00	0.00
116	601633	长城汽车	1,700	22,593.00	0.00
117	600118	中国卫星	800	22,272.00	0.00
118	600895	张江高科	1,300	21,944.00	0.00
119	601216	君正集团	4,400	21,516.00	0.00
120	600297	广汇汽车	2,800	21,084.00	0.00

121	600008	首创股份	3,200	21,056.00	0.00
122	601229	上海银行	800	20,432.00	0.00
123	600362	江西铜业	1,200	20,232.00	0.00
124	600369	西南证券	3,600	20,196.00	0.00
125	601333	广深铁路	4,400	19,888.00	0.00
126	600827	百联股份	1,200	19,500.00	0.00
127	601989	中国重工	3,100	19,251.00	0.00
128	600663	陆家嘴	800	18,912.00	0.00
129	600373	中文传媒	800	18,808.00	0.00
130	600718	东软集团	1,200	18,660.00	0.00
131	600688	上海石化	2,800	18,508.00	0.00
132	600038	中直股份	400	18,308.00	0.00
133	600150	中国船舶	800	18,296.00	0.00
134	600060	海信电器	1,200	18,204.00	0.00
135	600649	城投控股	1,700	17,867.00	0.00
136	601225	陕西煤业	2,500	17,675.00	0.00
137	600704	物产中大	2,400	17,496.00	0.00
138	600583	海油工程	2,800	17,472.00	0.00
139	601117	中国化学	2,400	16,776.00	0.00
140	600256	广汇能源	4,000	16,560.00	0.00
141	600909	华安证券	1,600	16,144.00	0.00
142	600074	保千里	1,200	15,372.00	0.00
143	600977	中国电影	800	14,976.00	0.00
144	600919	江苏银行	1,600	14,864.00	0.00
145	600682	南京新百	400	14,760.00	0.00
146	600021	上海电力	1,200	14,508.00	0.00
147	601866	中远海发	4,000	14,400.00	0.00
148	600446	金证股份	800	14,064.00	0.00
149	601718	际华集团	1,600	14,064.00	0.00
150	600372	中航电子	800	13,896.00	0.00
151	600376	首开股份	1,200	13,728.00	0.00
152	600588	用友网络	800	13,696.00	0.00
153	601021	春秋航空	400	13,452.00	0.00
154	601163	三角轮胎	500	13,150.00	0.00
155	601375	中原证券	1,300	13,078.00	0.00
156	601997	贵阳银行	800	12,648.00	0.00
157	600482	中国动力	500	12,645.00	0.00
158	600037	歌华有线	800	11,648.00	0.00
159	601118	海南橡胶	2,000	11,360.00	0.00
160	600737	中粮糖业	1,200	11,328.00	0.00
161	601966	玲珑轮胎	500	11,215.00	0.00
162	600685	中船防务	400	10,952.00	0.00
163	601127	小康股份	500	9,975.00	0.00
164	600233	圆通速递	500	9,795.00	0.00

165	601611	中国核建	800	9,576.00	0.00
166	601881	中国银河	800	9,488.00	0.00
167	601958	金钼股份	1,200	8,604.00	0.00
168	600549	厦门钨业	400	8,596.00	0.00
169	600654	*ST 中安	600	8,088.00	0.00
170	601877	正泰电器	400	8,036.00	0.00
171	600871	石化油服	2,400	8,016.00	0.00
172	601919	中远海控	1,300	6,955.00	0.00
173	600926	杭州银行	400	5,940.00	0.00
174	600188	兖州煤业	400	4,896.00	0.00
175	600648	外高桥	200	3,704.00	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	601318	中国平安	19,426,535.90	1.05
2	600519	贵州茅台	10,518,132.22	0.57
3	601166	兴业银行	10,515,338.11	0.57
4	600016	民生银行	10,376,085.32	0.56
5	600036	招商银行	9,442,543.36	0.51
6	601328	交通银行	7,845,969.18	0.42
7	600000	浦发银行	7,053,959.90	0.38
8	601668	中国建筑	6,565,299.00	0.35
9	600030	中信证券	6,310,437.36	0.34
10	600837	海通证券	6,244,988.49	0.34
11	601169	北京银行	5,893,750.84	0.32
12	600887	伊利股份	5,337,409.00	0.29
13	601288	农业银行	4,845,367.00	0.26
14	601766	中国中车	4,766,384.00	0.26
15	600104	上汽集团	4,291,406.94	0.23
16	600900	长江电力	4,237,354.29	0.23
17	601211	国泰君安	4,206,441.00	0.23
18	601601	中国太保	4,080,303.14	0.22
19	601398	工商银行	3,917,540.00	0.21
20	600276	恒瑞医药	3,561,489.60	0.19

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	601318	中国平安	7,217,784.03	0.39
2	600519	贵州茅台	4,149,878.00	0.22
3	601166	兴业银行	3,609,857.00	0.19
4	600036	招商银行	3,537,468.14	0.19
5	600016	民生银行	3,526,596.00	0.19
6	000002	万科 A	2,999,339.11	0.16
7	601328	交通银行	2,760,312.00	0.15
8	600000	浦发银行	2,517,439.52	0.14
9	601668	中国建筑	2,320,887.00	0.13
10	600030	中信证券	2,271,470.00	0.12
11	600837	海通证券	2,204,349.60	0.12
12	601288	农业银行	2,047,482.00	0.11
13	601169	北京银行	1,994,618.80	0.11
14	600887	伊利股份	1,988,314.00	0.11
15	601766	中国中车	1,748,311.00	0.09
16	000415	渤海金控	1,718,354.00	0.09
17	601398	工商银行	1,676,710.00	0.09
18	600104	上汽集团	1,664,622.69	0.09
19	600900	长江电力	1,562,099.03	0.08
20	601211	国泰君安	1,508,594.00	0.08

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	328,984,905.58
卖出股票的收入（成交）总额	137,404,391.64

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**7.11.1 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
IF1707	IF1707	25.00	27,355,500.00	511,440.00	-
公允价值变动总额合计					511,440.00
股指期货投资本期收益					2,839,380.00
股指期货投资本期公允价值变动					3,235,800.00

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标，主要目的是套期保值。在投资的过程中，本基金力争利用股指期货的杠杆作用和成本优势，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到有效跟踪标的指数的目的。

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 2017 年 5 月 25 日，中信证券（600030）因在融资融券业务开展过程中，违反了《证券公

司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”的规定，被中国证监会予以行政处罚。本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.13.2 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	6,103,105.24
2	应收证券清算款	2,321,725.82
3	应收股利	-
4	应收利息	24,323.62
5	应收申购款	1,423,027.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,872,181.70

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

份额级别	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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
广发沪深 300ETF 联接 A	62,557	11,646.11	60,819,011.79	8.35%	667,726,561.68	91.65%
广发沪深 300ETF 联接 C	2,669	219,922.55	567,820,898.38	96.74%	19,152,385.92	3.26%
合计	65,226	20,168.63	628,639,910.17	47.79%	686,878,947.60	52.21%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发沪深 300ETF 联接 A	47,607.44	0.0065%
	广发沪深 300ETF 联接 C	31,206.31	0.0053%
	合计	78,813.75	0.0060%

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	份额级别	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	广发沪深 300ETF 联接 A	0~10
	广发沪深 300ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发沪深 300ETF 联接 A	0
	广发沪深 300ETF 联接 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发沪深 300ETF 联接 A	广发沪深 300ETF 联接 C
基金合同生效日（2008 年 12 月 30 日）基金份额总额	653,693,988.31	-
本报告期期初基金份额总额	767,516,821.88	466,691,519.30
本报告期基金总申购份额	272,996,589.68	803,682,193.87
减：本报告期基金总赎回份额	311,967,838.09	683,400,428.87

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	728,545,573.47	586,973,284.30

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	3	83,298,871.43	17.86%	60,916.16	14.59%	-
招商证券	4	383,015,439.13	82.14%	356,703.68	85.41%	新增 1 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	8	-	-	-	-	新增 2 个
国元证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
方正证券	7	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	减少 1 个
信达证券	3	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中银国际	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对

交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于通过上海浦东发展银行开展基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-06-30
2	广发基金管理有限公司关于旗下完全被动型指数基金认购关联方承销证券的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-06-01
3	广发基金管理有限公司关于增加华宝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》	2017-05-24
-	公告事项	法定披露方式	-

§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	20170101-20170630	263,252,116.63	586,106,898.93	319,711,000.00	529,648,015.56	40.26%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 关于广发沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告

2. 《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。
3. 《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合同》
4. 中国证监会批准广发沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
5. 《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
6. 《广发沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
7. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
8. 《广发沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》及其更新版；
9. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
10. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；
2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇一七年八月二十五日