

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

2019 年半年度报告

2019 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

送出日期：二〇一九年八月二十八日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 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遵规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 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..... | 15 |
| 5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| 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 报告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..... | 42 |
| 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.13 投资组合报告附注..... | 45 |

| | |
|--|----|
| 8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 47 |
| 9 开放式基金份额变动 | 47 |
| 10 重大事件揭示 | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 其他重大事件..... | 54 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| 12 备查文件目录 | 55 |
| 12.1 备查文件目录..... | 55 |
| 12.2 存放地点..... | 55 |
| 12.3 查阅方式..... | 55 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------------|------------------|
| 基金名称 | 广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 | |
| 基金简称 | 广发创业板 ETF 联接 | |
| 基金主代码 | 003765 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 5 月 25 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 | 1,150,529,571.75 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发创业板 ETF 联接 A | 广发创业板 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003765 | 003766 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 317,569,952.08 份 | 832,959,619.67 份 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|---------------------|
| 基金名称 | 广发创业板交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159952 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 4 月 25 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2017 年 5 月 19 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%×创业板指数收益率+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 90%且不低于非现金基金资产的 80%。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的标的指数为创业板指数。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 | 邱春杨 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-83936666 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | qcy@gffunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105828 | 95588 |
| 传真 | | 020-89899158 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区） | 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 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|-----------------|
| | 广发创业板 ETF 联接 A | 广发创业板 ETF 联接 C |
| 本期已实现收益 | 12,019,643.54 | 31,739,196.38 |
| 本期利润 | 42,178,775.25 | 43,265,063.35 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1365 | 0.0637 |
| 本期加权平均净值利润率 | 15.94% | 7.30% |
| 本期基金份额净值增长率 | 18.31% | 18.34% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) | |
| | 广发创业板 ETF 联接 A | 广发创业板 ETF 联接 C |
| 期末可供分配利润 | -44,273,243.66 | -114,898,123.02 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1394 | -0.1379 |
| 期末基金资产净值 | 273,296,708.42 | 718,061,496.65 |
| 期末基金份额净值 | 0.8606 | 0.8621 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) | |
| | 广发创业板 ETF 联接 A | 广发创业板 ETF 联接 C |
| 基金份额累计净值增长率 | -13.94% | -13.79% |

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

广发创业板 ETF 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 | 2.00% | 1.38% | 1.78% | 1.40% | 0.22% | -0.02% |
| 过去三个月 | -9.32% | 1.79% | -10.21% | 1.85% | 0.89% | -0.06% |
| 过去六个月 | 18.31% | 1.79% | 19.84% | 1.89% | -1.53% | -0.10% |
| 过去一年 | -5.33% | 1.70% | -5.61% | 1.78% | 0.28% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.94% | 1.49% | -14.12% | 1.56% | 0.18% | -0.07% |

广发创业板 ETF 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 | 1.99% | 1.38% | 1.78% | 1.40% | 0.21% | -0.02% |
| 过去三个月 | -9.35% | 1.79% | -10.21% | 1.85% | 0.86% | -0.06% |
| 过去六个月 | 18.34% | 1.79% | 19.84% | 1.89% | -1.50% | -0.10% |
| 过去一年 | -5.28% | 1.70% | -5.61% | 1.78% | 0.33% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.79% | 1.49% | -14.12% | 1.56% | 0.33% | -0.07% |

注：（1）业绩比较基准： $95\% \times \text{创业板指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

（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。

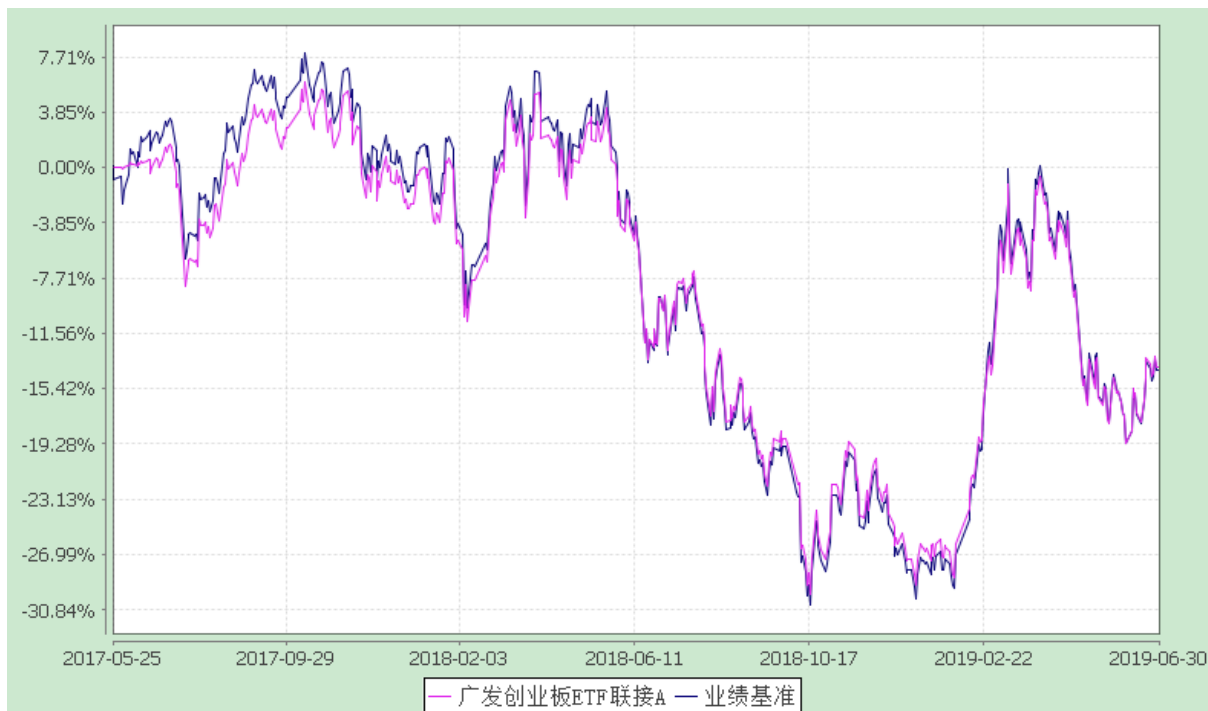
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

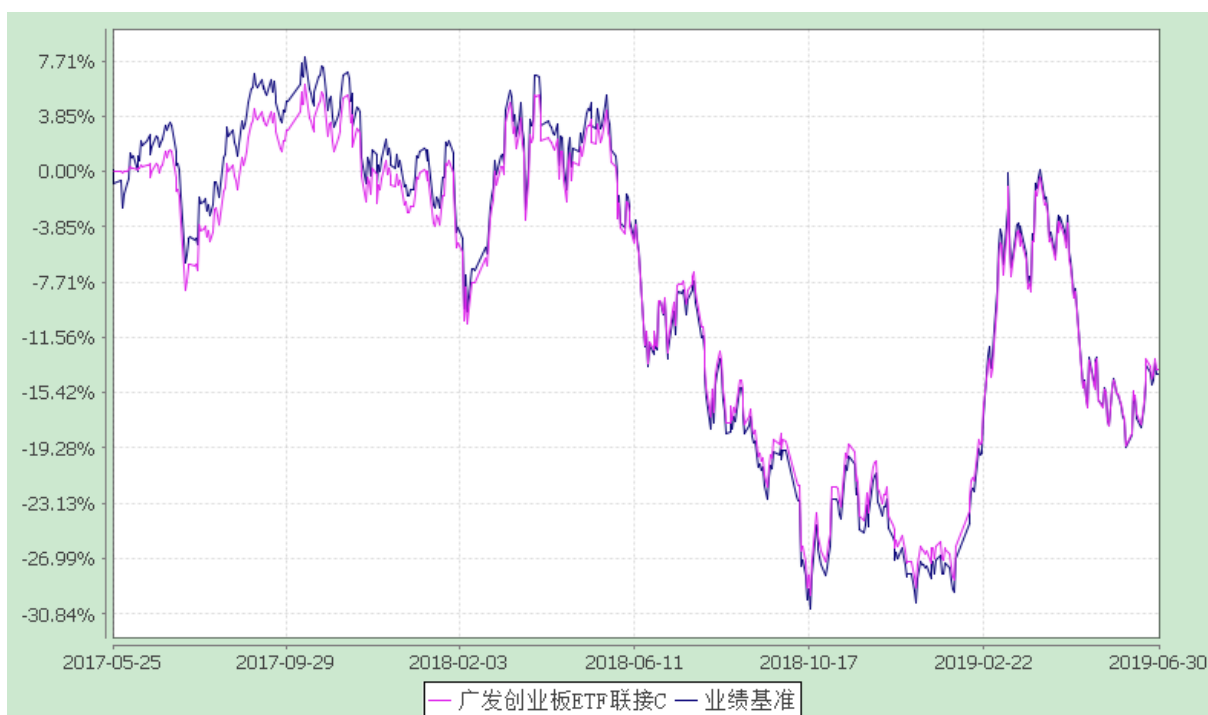
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017年5月25日至2019年6月30日）

广发创业板 ETF 联接 A



广发创业板 ETF 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。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（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 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 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）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘杰 | 本基金的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证 500 交易型 | 2017-05-25 | - | 15 年 | 刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | <p>开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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；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；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指</p> | | | | <p>金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金</p> | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|------------------------------------|--|--|--|--|
| | (QDII)的基金 经理；指数投 资部总经理助 理 | | | | |
|--|------------------------------------|--|--|--|--|

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

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（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共4次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金业绩基准是创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%，主要采用完全复制法来跟踪业绩基准。

（1）投资策略

作为 ETF 联接基金，本基金秉承指数化被动投资策略，主要持有广发创业板 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，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基金成份股调整、申购和赎回因素。

受益于一季度中美贸易问题的短期反转以及 1 月份社融超预期表现，2019 年上半年 A 股市场先扬后抑且整体大幅上涨，其中沪深 300 上涨 27.07%，中证 500 上涨 18.77%，创业板指上涨 20.87%，上证综指上涨 19.45%。

总体上，上半年 A 股市场存在多空信号交错，例如 1 至 5 月固定资产投资累计增速 5.6%，前值 6.1%，结束了自去年 9 月起的连续改善，社融数据增速的剧烈变化以及企业中长期贷款增速的较大波动，促使整体市场上半年先涨后跌且处于宽幅震荡状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 18.31%，C 类基金份额净值增长率为 18.34%，同期业绩比较基准收益率为 19.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来，中美贸易问题的长期性和国内经济下行压力依然是资本市场关注的两个重要因素。虽然外部环境和内部压力可能对出口构成压力，制造业投资短期也难以出现明显改善，但是减税降费和财政政策的积极有望在下半年支撑消费、制造业投资并明显提振基建投资，进而提振市场。

随着科创板开板、MSCI 和富时 A 股权重不断提升，外资和机构在 A 股中占比的不断增长，资本市场环境也在发生着变化，公司治理相对完善和行业中竞争力存在相对优势的公司或许会得到资本市场的更多关注，叠加美联储的降息预期，看好未来市场存在的阶段性机会和结构性行情。

创业板指包含了创业板中 100 只最具代表性的股票。相对而言，其成份股企业竞争力和发展潜力较大，更容易脱颖而出。

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、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.7 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创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式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，广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的管理人——广发基

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2019 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：广发创业板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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 70,687,710.75 | 25,460,720.47 |
| 结算备付金 | | 9,687,986.59 | 12,533,639.38 |
| 存出保证金 | | 335,245.70 | 147,249.18 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 914,827,082.02 | 421,790,289.32 |
| 其中：股票投资 | | 4,054,580.82 | 1,562,983.06 |
| 基金投资 | | 910,772,501.20 | 420,227,306.26 |
| 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 | | 2,155,219.60 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 18,830.53 | 11,393.61 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,210,792.94 | 1,732,739.99 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | 94,709.90 | 70,706.05 |

| | | | |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产总计 | | 999,017,578.03 | 461,746,738.00 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负 债: | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 3,773,190.51 |
| 应付赎回款 | | 6,737,909.54 | 1,102,375.79 |
| 应付管理人报酬 | | 32,690.27 | 16,862.56 |
| 应付托管费 | | 6,538.03 | 3,372.51 |
| 应付销售服务费 | | 118,511.60 | 41,540.91 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 687,250.35 | 463,582.32 |
| 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 | 76,473.17 | 274,345.82 |
| 负债合计 | | 7,659,372.96 | 5,675,270.42 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,150,529,571.75 | 626,480,582.96 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -159,171,366.68 | -170,409,115.38 |
| 所有者权益合计 | | 991,358,205.07 | 456,071,467.58 |
| 负债和所有者权益总计 | | 999,017,578.03 | 461,746,738.00 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，广发创业板 ETF 联接 A 基金份额净值人民币 0.8606 元，基金份额总额 317,569,952.08 份；广发创业板 ETF 联接 C 基金份额净值人民币 0.8621 元，基金份额总额 832,959,619.67 份；总份额总额 1,150,529,571.75 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 87,967,837.59 | -16,627,418.47 |
| 1.利息收入 | | 356,224.78 | 71,901.94 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 356,224.78 | 71,901.94 |
| 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） | | 44,231,986.76 | -2,313,665.31 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -1,136,462.16 | -2,142,361.68 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | 45,328,209.95 | -185,077.72 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 40,238.97 | 13,774.09 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 41,684,998.68 | -14,754,189.12 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 1,694,627.37 | 368,534.02 |
| 减：二、费用 | | 2,523,998.99 | 726,751.35 |
| 1. 管理人报酬 | | 190,570.50 | 34,560.43 |
| 2. 托管费 | | 38,114.07 | 6,912.10 |
| 3. 销售服务费 | | 576,962.60 | 164,905.89 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1,437,011.64 | 368,660.48 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 203,312.83 | 10,827.63 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 78,027.35 | 140,884.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 85,443,838.60 | -17,354,169.82 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 85,443,838.60 | -17,354,169.82 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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） | 626,480,582.96 | -170,409,115.38 | 456,071,467.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 85,443,838.60 | 85,443,838.60 |

| | | | |
|--|--|-----------------|-------------------|
| 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） | 524,048,988.79 | -74,206,089.90 | 449,842,898.89 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,775,086,521.78 | -195,818,934.54 | 1,579,267,587.24 |
| 2.基金赎回款 | -1,251,037,532.99 | 121,612,844.64 | -1,129,424,688.35 |
| 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） | 1,150,529,571.75 | -159,171,366.68 | 991,358,205.07 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 107,589,752.96 | -2,678,529.38 | 104,911,223.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -17,354,169.82 | -17,354,169.82 |
| 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） | 201,249,188.14 | -7,849,038.03 | 193,400,150.11 |
| 其中：1.基金申购款 | 541,913,267.78 | -10,159,288.90 | 531,753,978.88 |
| 2.基金赎回款 | -340,664,079.64 | 2,310,250.87 | -338,353,828.77 |
| 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） | 308,838,941.10 | -27,881,737.23 | 280,957,203.87 |

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

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金投资基金发起式联接基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可〔2016〕2456 号《关于准予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投资基金发起式联接基金注册的批复》核准，由

广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《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投资基金发起式联接基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2017 年 4 月 27 日向社会公开发行募集并于 2017 年 5 月 25 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 5 月 22 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 25,585,913.01 元，有效认购户数为 908 户。其中广发创业板 ETF 联接 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 22,538,768.61 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 4,009.74 元广发创业板 ETF 联接 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 3,042,990.69 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 143.97 元，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。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息

及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 70,687,710.75 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 70,687,710.75 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | | 2019 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|-------|-----------------|----------------|---------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 3,996,747.53 | 4,054,580.82 | 57,833.29 |
| 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 | | 898,127,814.07 | 910,772,501.20 | 12,644,687.13 |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 902,124,561.60 | 914,827,082.02 | 12,702,520.42 |

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 2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 11,352.66 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | 135.81 |
| 应收结算备付金利息 | 7,342.06 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 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 | 18,830.53 |

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |
| 应收退补款 | 39,035.80 |
| 可收退补款 | 55,674.10 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 94,709.90 |
|----|-----------|

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 687,250.35 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 687,250.35 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 3,635.41 |
| 预提费用 | 72,837.76 |
| 合计 | 76,473.17 |

6.4.7.9 实收基金

广发创业板 ETF 联接 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 289,282,335.18 | 289,282,335.18 |
| 本期申购 | 182,332,114.67 | 182,332,114.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -154,044,497.77 | -154,044,497.77 |
| 本期末 | 317,569,952.08 | 317,569,952.08 |

广发创业板 ETF 联接 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 337,198,247.78 | 337,198,247.78 |
| 本期申购 | 1,592,754,407.11 | 1,592,754,407.11 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,096,993,035.22 | -1,096,993,035.22 |

| | | |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 832,959,619.67 | 832,959,619.67 |
|-----|----------------|----------------|

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

广发创业板 ETF 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 | -44,592,521.97 | -34,260,913.18 | -78,853,435.15 |
| 本期利润 | 12,019,643.54 | 30,159,131.71 | 42,178,775.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,336,892.12 | -3,261,691.64 | -7,598,583.76 |
| 其中：基金申购款 | -26,591,341.59 | 3,265,388.01 | -23,325,953.58 |
| 基金赎回款 | 22,254,449.47 | -6,527,079.65 | 15,727,369.82 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -36,909,770.55 | -7,363,473.11 | -44,273,243.66 |

广发创业板 ETF 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 | -51,578,819.51 | -39,976,860.72 | -91,555,680.23 |
| 本期利润 | 31,739,196.38 | 11,525,866.97 | 43,265,063.35 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -75,666,294.61 | 9,058,788.47 | -66,607,506.14 |
| 其中：基金申购款 | -230,621,390.70 | 58,128,409.74 | -172,492,980.96 |
| 基金赎回款 | 154,955,096.09 | -49,069,621.27 | 105,885,474.82 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -95,505,917.74 | -19,392,205.28 | -114,898,123.02 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 242,486.49 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 1,897.01 |
| 结算备付金利息收入 | 111,841.28 |
| 其他 | - |
| 合计 | 356,224.78 |

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 |
|----|----|
|----|----|

| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 1,066,804.09 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | -2,203,266.25 |
| 合计 | -1,136,462.16 |

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 18,265,796.60 |
| 减：卖出股票成本总额 | 17,198,992.51 |
| 买卖股票差价收入 | 1,066,804.09 |

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 申购基金份额总额 | 1,648,416,420.00 |
| 减：现金支付申购款总额 | 71,626,850.62 |
| 减：申购股票成本总额 | 1,578,992,835.63 |
| 申购差价收入 | -2,203,266.25 |

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 1,313,400,355.17 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 1,268,072,145.22 |
| 基金投资收益 | 45,328,209.95 |

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 40,238.97 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 40,238.97 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 41,684,998.68 |
| ——股票投资 | 120,097.10 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 41,564,901.58 |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税 | - |
| 合计 | 41,684,998.68 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,277,308.43 |
| 基金转换费收入 | 417,318.94 |
| 合计 | 1,694,627.37 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,342,842.45 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | 94,169.19 |
| 其中：申购费 | 26,841.12 |
| 赎回费 | 20.70 |
| 其他 | 67,307.37 |
| 合计 | 1,437,011.64 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------|----------------------|
| 审计费用 | 17,852.03 |
| 信息披露费 | 54,985.73 |
| 银行汇划费 | 5,189.59 |
| 合计 | 78,027.35 |

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 |
| 广发创业板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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 | 369,819,661.87 | 22.89% | - | - |

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 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|------------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期基金交易成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金交易成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 377,338,103.73 | 27.30% | - | - |

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019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 | 270,445.26 | 22.89% | 270,445.26 | 39.35% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 | - | - | - | - |

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 2019年1月1日至2019年6月 30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日 |
|----|--------------------------------|-------------------------------------|
|----|--------------------------------|-------------------------------------|

| | | |
|-----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 190,570.50 | 34,560.43 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 420,698.06 | 149,612.72 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 38,114.07 | 6,912.10 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 |
|----------------|----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| | |

| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|----------------|---------------------------------|----------------|------------|
| | 广发创业板 ETF 联接 A | 广发创业板 ETF 联接 C | 合计 |
| 广发基金管理有限公司 | - | 420,079.15 | 420,079.15 |
| 广发证券股份有限公司 | - | 1,940.27 | 1,940.27 |
| 中国工商银行股份有限公司 | - | 15,844.81 | 15,844.81 |
| 合计 | - | 437,864.23 | 437,864.23 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 广发创业板ETF联接 A | 广发创业板ETF联接C | 合计 |
| | 广发基金管理有限公司 | - | 68,009.08 |
| 广发证券股份有限公司 | - | 1,780.93 | 1,780.93 |
| 中国工商银行股份有限公司 | - | 12,576.89 | 12,576.89 |
| 合计 | - | 82,366.90 | 82,366.90 |

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 0.20%（2018 年 5 月 16 日以前：0.40%）年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---------------------|----------------------|-------------|----------------------|-------------|
| | 广发创业板ETF联接A | 广发创业板ETF联接C | 广发创业板ETF联接A | 广发创业板ETF联接C |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,002,400.24 | - | 10,002,400.24 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,002,400.24 | - | 10,002,400.24 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 3.15% | - | 7.11% | - |

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

广发创业板 ETF 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。

广发创业板 ETF 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------------|----------------------|------------|----------------------|-----------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 2018年1月1日至2018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 | 70,687,710.75 | 242,486.49 | 14,984,778.54 | 46,498.94 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有 1,035,204,025.00 份目标 ETF 基金广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额，占其总份额的比例为 53.24%。

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（2019 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 2019 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 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 2019 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 2019 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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理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。本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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 2019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 | 70,687,710.75 | - | - | - | 70,687,710.75 |
| 结算备付金 | 9,687,986.59 | - | - | - | 9,687,986.59 |
| 存出保证金 | 335,245.70 | - | - | - | 335,245.70 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 914,827,082.02 | 914,827,082.02 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 2,155,219.60 | 2,155,219.60 |
| 应收利息 | - | - | - | 18,830.53 | 18,830.53 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,210,792.94 | 1,210,792.94 |
| 其他资产 | - | - | - | 94,709.90 | 94,709.90 |
| 资产总计 | 80,710,943.04 | - | - | 918,306,634.99 | 999,017,578.03 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 6,737,909.54 | 6,737,909.54 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 32,690.27 | 32,690.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,538.03 | 6,538.03 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 118,511.60 | 118,511.60 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 687,250.35 | 687,250.35 |
| 其他负债 | - | - | - | 76,473.17 | 76,473.17 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,659,372.96 | 7,659,372.96 |
| 利率敏感度缺口 | 80,710,943.04 | - | - | 910,647,262.03 | 991,358,205.07 |
| 上年度末 2018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 | 25,460,720.47 | - | - | - | 25,460,720.47 |
| 结算备付金 | 12,533,639.38 | - | - | - | 12,533,639.38 |
| 存出保证金 | 147,249.18 | - | - | - | 147,249.18 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 421,790,289.32 | 421,790,289.32 |
| 应收利息 | - | - | - | 11,393.61 | 11,393.61 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 应收申购款 | - | - | - | 1,732,739.99 | 1,732,739.99 |
| 其他资产 | - | - | - | 70,706.05 | 70,706.05 |
| 资产总计 | 38,141,609.03 | - | - | 423,605,128.97 | 461,746,738.00 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,773,190.51 | 3,773,190.51 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,102,375.79 | 1,102,375.79 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 16,862.56 | 16,862.56 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,372.51 | 3,372.51 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 463,582.32 | 463,582.32 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 41,540.91 | 41,540.91 |
| 其他负债 | - | - | - | 274,345.82 | 274,345.82 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,675,270.42 | 5,675,270.42 |
| 利率敏感度缺口 | 38,141,609.03 | - | - | 417,929,858.55 | 456,071,467.58 |

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交易性债券投资，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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

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 | | 上年度末 | |
|----|-----------------|-----|------------------|-----|
| | 2019 年 6 月 30 日 | | 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 公允价值 | 占基金 | 公允价值 | 占基金 |
| | | | | |

| | | 资产净 值比例 (%) | | 资产净 值比例 (%) |
|---------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-------------------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 4,054,580.82 | 0.41 | 1,562,983.06 | 0.34 |
| 交易性金融资产—基金投资 | 910,772,501.20 | 91.87 | 420,227,306.26 | 92.14 |
| 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 | 914,827,082.02 | 92.28 | 421,790,289.32 | 92.48 |

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 |
| | | 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 54,770,757.38 | 20,979,287.51 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -54,770,757.38 | -20,979,287.51 |

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

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 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人民币 914,827,082.02 元，无属于第二层级和第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余

额为人民币 421,790,289.32 元，无属于第二层级和第三层级的金额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 4,054,580.82 | 0.41 |
| | 其中：股票 | 4,054,580.82 | 0.41 |
| 2 | 基金投资 | 910,772,501.20 | 91.17 |
| 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 | 80,375,697.34 | 8.05 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,814,798.67 | 0.38 |
| 9 | 合计 | 999,017,578.03 | 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 | 广发创业板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 | 910,772,501.20 | 91.87 |

7.3 报告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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 542,454.22 | 0.05 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,096,065.00 | 0.21 |
| 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 | - | - |
| 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 | 896,967.00 | 0.09 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 26,474.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 99,024.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 48,298.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 149,051.00 | 0.02 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 196,247.60 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,054,580.82 | 0.41 |

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 | 300498 | 温氏股份 | 15,127 | 542,454.22 | 0.05 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 20,420 | 276,691.00 | 0.03 |
| 3 | 300760 | 迈瑞医疗 | 900 | 146,880.00 | 0.01 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 1,900 | 130,872.00 | 0.01 |
| 5 | 300294 | 博雅生物 | 4,700 | 127,605.00 | 0.01 |
| 6 | 300015 | 爱尔眼科 | 4,100 | 126,977.00 | 0.01 |
| 7 | 300122 | 智飞生物 | 2,500 | 107,750.00 | 0.01 |
| 8 | 300601 | 康泰生物 | 1,800 | 94,500.00 | 0.01 |
| 9 | 300136 | 信维通信 | 3,865 | 94,499.25 | 0.01 |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 4,100 | 93,931.00 | 0.01 |
| 11 | 300003 | 乐普医疗 | 4,051 | 93,254.02 | 0.01 |
| 12 | 300408 | 三环集团 | 4,600 | 89,470.00 | 0.01 |
| 13 | 300782 | 卓胜微 | 743 | 80,927.56 | 0.01 |
| 14 | 300024 | 机器人 | 5,270 | 80,262.10 | 0.01 |
| 15 | 300253 | 卫宁健康 | 5,300 | 75,154.00 | 0.01 |
| 16 | 300012 | 华测检测 | 6,000 | 64,800.00 | 0.01 |
| 17 | 300144 | 宋城演艺 | 2,700 | 62,478.00 | 0.01 |
| 18 | 300017 | 网宿科技 | 5,700 | 61,446.00 | 0.01 |
| 19 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,000 | 60,920.00 | 0.01 |
| 20 | 300383 | 光环新网 | 3,400 | 57,018.00 | 0.01 |
| 21 | 300146 | 汤臣倍健 | 2,700 | 52,380.00 | 0.01 |
| 22 | 300070 | 碧水源 | 6,200 | 48,298.00 | 0.00 |
| 23 | 300296 | 利亚德 | 6,116 | 47,888.28 | 0.00 |
| 24 | 300463 | 迈克生物 | 1,800 | 45,234.00 | 0.00 |
| 25 | 300226 | 上海钢联 | 600 | 44,976.00 | 0.00 |
| 26 | 300450 | 先导智能 | 1,300 | 43,680.00 | 0.00 |
| 27 | 300002 | 神州泰岳 | 10,400 | 41,392.00 | 0.00 |
| 28 | 300088 | 长信科技 | 8,100 | 40,986.00 | 0.00 |
| 29 | 300271 | 华宇软件 | 2,000 | 38,000.00 | 0.00 |
| 30 | 300170 | 汉得信息 | 2,700 | 36,693.00 | 0.00 |
| 31 | 300027 | 华谊兄弟 | 7,400 | 36,334.00 | 0.00 |
| 32 | 300315 | 掌趣科技 | 10,200 | 35,190.00 | 0.00 |
| 33 | 300676 | 华大基因 | 600 | 34,224.00 | 0.00 |
| 34 | 300166 | 东方国信 | 2,700 | 33,183.00 | 0.00 |
| 35 | 300285 | 国瓷材料 | 1,950 | 33,169.50 | 0.00 |
| 36 | 300098 | 高新兴 | 4,100 | 32,718.00 | 0.00 |
| 37 | 300072 | 三聚环保 | 4,100 | 32,513.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 38 | 300009 | 安科生物 | 2,000 | 31,800.00 | 0.00 |
| 39 | 300274 | 阳光电源 | 3,400 | 31,790.00 | 0.00 |
| 40 | 300203 | 聚光科技 | 1,300 | 31,070.00 | 0.00 |
| 41 | 300073 | 当升科技 | 1,300 | 29,861.00 | 0.00 |
| 42 | 300377 | 赢时胜 | 2,500 | 28,300.00 | 0.00 |
| 43 | 300068 | 南都电源 | 2,500 | 28,250.00 | 0.00 |
| 44 | 300180 | 华峰超纤 | 2,000 | 28,040.00 | 0.00 |
| 45 | 300207 | 欣旺达 | 2,400 | 27,648.00 | 0.00 |
| 46 | 300182 | 捷成股份 | 6,200 | 27,342.00 | 0.00 |
| 47 | 300058 | 蓝色光标 | 6,200 | 26,474.00 | 0.00 |
| 48 | 300418 | 昆仑万维 | 2,000 | 25,740.00 | 0.00 |
| 49 | 300026 | 红日药业 | 7,400 | 25,530.00 | 0.00 |
| 50 | 300316 | 晶盛机电 | 2,000 | 25,380.00 | 0.00 |
| 51 | 300010 | 立思辰 | 2,700 | 25,353.00 | 0.00 |
| 52 | 300038 | 数知科技 | 2,700 | 25,272.00 | 0.00 |
| 53 | 300001 | 特锐德 | 1,400 | 25,228.00 | 0.00 |
| 54 | 300558 | 贝达药业 | 600 | 24,900.00 | 0.00 |
| 55 | 300413 | 芒果超媒 | 600 | 24,630.00 | 0.00 |
| 56 | 300222 | 科大智能 | 1,800 | 23,436.00 | 0.00 |
| 57 | 300188 | 美亚柏科 | 1,300 | 23,179.00 | 0.00 |
| 58 | 300251 | 光线传媒 | 3,400 | 23,120.00 | 0.00 |
| 59 | 300699 | 光威复材 | 700 | 22,890.00 | 0.00 |
| 60 | 300133 | 华策影视 | 3,320 | 22,343.60 | 0.00 |
| 61 | 300244 | 迪安诊断 | 1,300 | 22,074.00 | 0.00 |
| 62 | 300115 | 长盈精密 | 2,000 | 20,980.00 | 0.00 |
| 63 | 300078 | 思创医惠 | 2,000 | 20,420.00 | 0.00 |
| 64 | 300308 | 中际旭创 | 600 | 20,394.00 | 0.00 |
| 65 | 300367 | 东方网力 | 2,000 | 19,740.00 | 0.00 |
| 66 | 300036 | 超图软件 | 1,300 | 19,214.00 | 0.00 |
| 67 | 300433 | 蓝思科技 | 2,700 | 18,819.00 | 0.00 |
| 68 | 300199 | 翰宇药业 | 2,000 | 18,340.00 | 0.00 |
| 69 | 300145 | 中金环境 | 4,100 | 17,794.00 | 0.00 |
| 70 | 300496 | 中科创达 | 600 | 17,448.00 | 0.00 |
| 71 | 300159 | 新研股份 | 3,400 | 16,932.00 | 0.00 |
| 72 | 300482 | 万孚生物 | 400 | 15,080.00 | 0.00 |
| 73 | 300476 | 胜宏科技 | 1,300 | 14,690.00 | 0.00 |
| 74 | 300357 | 我武生物 | 400 | 13,568.00 | 0.00 |
| 75 | 300459 | 金科文化 | 2,000 | 11,380.00 | 0.00 |
| 76 | 300633 | 开立医疗 | 359 | 10,253.04 | 0.00 |
| 77 | 300373 | 扬杰科技 | 600 | 8,994.00 | 0.00 |
| 78 | 300457 | 赢合科技 | 325 | 8,102.25 | 0.00 |
| 79 | 300323 | 华灿光电 | 1,300 | 8,034.00 | 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 | 300498 | 温氏股份 | 202,128,609.58 | 44.32 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 100,432,268.70 | 22.02 |
| 3 | 300015 | 爱尔眼科 | 44,516,210.92 | 9.76 |
| 4 | 300142 | 沃森生物 | 43,442,964.52 | 9.53 |
| 5 | 300003 | 乐普医疗 | 38,335,891.43 | 8.41 |
| 6 | 300124 | 汇川技术 | 38,331,245.85 | 8.40 |
| 7 | 300136 | 信维通信 | 34,040,914.62 | 7.46 |
| 8 | 300122 | 智飞生物 | 32,905,621.98 | 7.22 |
| 9 | 300347 | 泰格医药 | 32,030,205.94 | 7.02 |
| 10 | 300408 | 三环集团 | 30,582,860.52 | 6.71 |
| 11 | 300024 | 机器人 | 30,249,694.86 | 6.63 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 26,560,584.36 | 5.82 |
| 13 | 300017 | 网宿科技 | 25,387,938.49 | 5.57 |
| 14 | 300750 | 宁德时代 | 24,712,450.46 | 5.42 |
| 15 | 300601 | 康泰生物 | 23,186,480.03 | 5.08 |
| 16 | 300144 | 宋城演艺 | 23,129,277.68 | 5.07 |
| 17 | 300383 | 光环新网 | 22,286,105.00 | 4.89 |
| 18 | 300253 | 卫宁健康 | 22,258,320.76 | 4.88 |
| 19 | 300033 | 同花顺 | 21,661,367.96 | 4.75 |
| 20 | 300146 | 汤臣倍健 | 21,381,942.65 | 4.69 |
| 21 | 300070 | 碧水源 | 20,492,849.56 | 4.49 |
| 22 | 300296 | 利亚德 | 19,749,094.82 | 4.33 |
| 23 | 300226 | 上海钢联 | 18,802,269.62 | 4.12 |
| 24 | 300014 | 亿纬锂能 | 18,795,224.60 | 4.12 |
| 25 | 300012 | 华测检测 | 18,409,767.62 | 4.04 |
| 26 | 300450 | 先导智能 | 17,071,524.44 | 3.74 |
| 27 | 300001 | 特锐德 | 16,128,048.00 | 3.54 |
| 28 | 300088 | 长信科技 | 15,854,704.00 | 3.48 |
| 29 | 300271 | 华宇软件 | 15,094,924.00 | 3.31 |
| 30 | 300072 | 三聚环保 | 14,732,610.60 | 3.23 |
| 31 | 300170 | 汉得信息 | 14,515,332.25 | 3.18 |
| 32 | 300274 | 阳光电源 | 14,492,186.80 | 3.18 |
| 33 | 300166 | 东方国信 | 14,404,381.68 | 3.16 |
| 34 | 300073 | 当升科技 | 14,324,745.55 | 3.14 |
| 35 | 300315 | 掌趣科技 | 14,113,029.00 | 3.09 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 36 | 300027 | 华谊兄弟 | 14,092,507.97 | 3.09 |
| 37 | 300212 | 易华录 | 13,985,523.04 | 3.07 |
| 38 | 300098 | 高新兴 | 13,900,797.80 | 3.05 |
| 39 | 300168 | 万达信息 | 13,671,441.78 | 3.00 |
| 40 | 300203 | 聚光科技 | 13,453,465.46 | 2.95 |
| 41 | 300207 | 欣旺达 | 12,710,901.99 | 2.79 |
| 42 | 300009 | 安科生物 | 12,186,928.00 | 2.67 |
| 43 | 300182 | 捷成股份 | 12,068,803.70 | 2.65 |
| 44 | 300418 | 昆仑万维 | 11,881,485.70 | 2.61 |
| 45 | 300699 | 光威复材 | 11,862,869.56 | 2.60 |
| 46 | 300285 | 国瓷材料 | 11,631,783.00 | 2.55 |
| 47 | 300038 | 数知科技 | 11,615,988.20 | 2.55 |
| 48 | 300413 | 芒果超媒 | 11,032,367.00 | 2.42 |
| 49 | 300180 | 华峰超纤 | 10,895,056.80 | 2.39 |
| 50 | 300068 | 南都电源 | 10,886,032.92 | 2.39 |
| 51 | 300251 | 光线传媒 | 10,550,830.00 | 2.31 |
| 52 | 300558 | 贝达药业 | 10,542,754.00 | 2.31 |
| 53 | 300463 | 迈克生物 | 10,421,929.70 | 2.29 |
| 54 | 300316 | 晶盛机电 | 10,248,647.90 | 2.25 |
| 55 | 300058 | 蓝色光标 | 10,225,492.00 | 2.24 |
| 56 | 300377 | 赢时胜 | 10,178,008.90 | 2.23 |
| 57 | 300133 | 华策影视 | 9,801,144.36 | 2.15 |
| 58 | 300244 | 迪安诊断 | 9,795,243.22 | 2.15 |
| 59 | 300010 | 立思辰 | 9,564,415.90 | 2.10 |
| 60 | 300676 | 华大基因 | 9,223,432.38 | 2.02 |

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 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,478,780.52 | 0.54 |
| 2 | 300628 | 亿联网络 | 1,871,762.75 | 0.41 |
| 3 | 300676 | 华大基因 | 1,725,715.62 | 0.38 |
| 4 | 300529 | 健帆生物 | 1,602,662.00 | 0.35 |
| 5 | 300616 | 尚品宅配 | 1,473,389.00 | 0.32 |
| 6 | 300618 | 寒锐钴业 | 1,323,054.43 | 0.29 |
| 7 | 300747 | 锐科激光 | 1,106,684.00 | 0.24 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 8 | 300666 | 江丰电子 | 984,260.00 | 0.22 |
| 9 | 300308 | 中际旭创 | 963,019.00 | 0.21 |
| 10 | 300454 | 深信服 | 941,317.00 | 0.21 |
| 11 | 300474 | 景嘉微 | 814,703.00 | 0.18 |
| 12 | 300741 | 华宝股份 | 650,443.00 | 0.14 |
| 13 | 300634 | 彩讯股份 | 282,308.00 | 0.06 |
| 14 | 300770 | 新媒股份 | 109,668.38 | 0.02 |
| 15 | 300498 | 温氏股份 | 96,037.68 | 0.02 |
| 16 | 300762 | 上海瀚讯 | 69,065.34 | 0.02 |
| 17 | 002955 | 鸿合科技 | 66,646.52 | 0.01 |
| 18 | 300773 | 拉卡拉 | 65,461.50 | 0.01 |
| 19 | 300145 | 中金环境 | 62,784.00 | 0.01 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 61,596.40 | 0.01 |

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

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,597,376,018.80 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 18,265,796.60 |

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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 | 335,245.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,155,219.60 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 18,830.53 |
| 5 | 应收申购款 | 1,210,792.94 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 94,709.90 |
| 9 | 合计 | 3,814,798.67 |

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 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 广发创业板 ETF 联接 A | 58,106 | 5,465.36 | 10,043,761.86 | 3.16% | 307,526,190.22 | 96.84% |
| 广发创业板 ETF 联接 C | 22,883 | 36,400.80 | 525,876,875.35 | 63.13% | 307,082,744.32 | 36.87% |
| 合计 | 80,989 | 14,206.00 | 535,920,637.21 | 46.58% | 614,608,934.54 | 53.42% |

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 | 广发创业板 ETF 联接 A | 322,639.01 | 0.1016% |
| | 广发创业板 ETF 联接 C | 2,619,950.83 | 0.3145% |
| | 合计 | 2,942,589.84 | 0.2558% |

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 | 广发创业板 ETF 联接 A | 0~10 |
| | 广发创业板 ETF 联接 C | >100 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 广发创业板 ETF 联接 A | 0 |
| | 广发创业板 ETF 联接 C | 0 |
| | 合计 | 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 | 10,002,400.24 | 0.87% | 10,002,400.24 | 0.87% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 1,958,016.83 | 0.17% | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 132,606.48 | 0.01% | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 12,093,023.55 | 1.05% | 10,002,400.24 | 0.87% | 三年 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 广发创业板 ETF 联接 A | 广发创业板 ETF 联接 C |
|--------------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 5 月 25 日）基金份额总额 | 22,542,778.35 | 3,043,134.66 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 289,282,335.18 | 337,198,247.78 |
| 本报告期基金总申购份额 | 182,332,114.67 | 1,592,754,407.11 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 154,044,497.77 | 1,096,993,035.22 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 317,569,952.08 | 832,959,619.67 |

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

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|-------|--------|------------------|--------------|------------|------------|--------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 广发证券 | 7 | 369,819,661.87 | 22.89% | 270,445.26 | 22.89% | 减少 1 个 |
| 方正证券 | 5 | 1,245,505,628.39 | 77.11% | 910,842.35 | 77.11% | 减少 2 个 |
| 万和证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 5 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中原证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 3 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 4 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|--------|
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 华林证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 2 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 民生证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 华菁证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 天风证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 4 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 6 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 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。

10.7.2 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 |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | 377,338,103.73 | 27.30% |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | 1,004,913,626.52 | 72.70% |
| 万和证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中原证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华林证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 兴业 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国元 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 联讯 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 上海 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 上海 华信 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华福 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财富 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国都 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 第一 创业 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中天 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西藏 东方 财富 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华菁证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 中泰 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华创 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 | 关于增加云南红塔银行为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-06-24 |
| 2 | 关于增加徽商期货为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-06-14 |
| 3 | 关于增加晋中银行为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-06-05 |
| 4 | 关于增加和耕传承为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-05-16 |
| 5 | 关于增加汇林保大为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-05-08 |
| 6 | 关于调整旗下基金首次申购、追加申购及定期定额投资最低数额限制的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-04-01 |
| 7 | 关于增加民生证券为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-03-14 |
| 8 | 关于增加广州银行为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-02-28 |
| 9 | 关于增加腾安基金为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019-01-24 |

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 | 20190528-20190605 | - | 577,781,621.96 | 393,930,000.0 | 183,851,621.96 | 15.98% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|----------------|---|----------------|--------|
| | | | | | 0 | | |
| | 2 | 20190225-20190312,20190315-20190527,20190606-20190630 | - | 239,406,272.44 | - | 239,406,272.44 | 20.81% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准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募集的文件
- (二) 《广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发创业板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

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：投资者可在营业时间免费查阅，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
二〇一九年八月二十八日