

**广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金**  
**2017 年年度报告**  
**2017 年 12 月 31 日**

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师的责任	17
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

<b>§8 投资组合报告</b>	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
8.7 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	62
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 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	64
<b>§10 开放式基金份额变动</b>	64
<b>§11 重大事件揭示</b>	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	66
12.1 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	66
<b>§13 备查文件目录</b>	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指信息技术 ETF
场内简称	信息技术
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 8 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	310,828,053.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 2 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调

	整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566
传真		020-89899158	(010)66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510308	100818
法定代表人		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	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国•上海
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2017 年	2016 年	2015 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-32,556,641.34	-61,606,832.64	18,551,321.48
本期利润	7,435,602.84	-133,617,972.19	9,280,836.69
加权平均基金份额本期利润	0.0226	-0.3369	0.0233
本期加权平均净值利润率	2.06%	-29.39%	1.71%
本期基金份额净值增长率	0.85%	-24.43%	44.10%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-42,281,599.64	-14,074,182.57	47,155,271.77
期末可供分配基金份额利润	-0.1360	-0.0368	0.1153
期末基金资产净值	341,355,490.95	416,851,104.85	589,109,804.30
期末基金份额净值	1.0982	1.0889	1.4410
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	9.82%	8.90%	44.10%

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

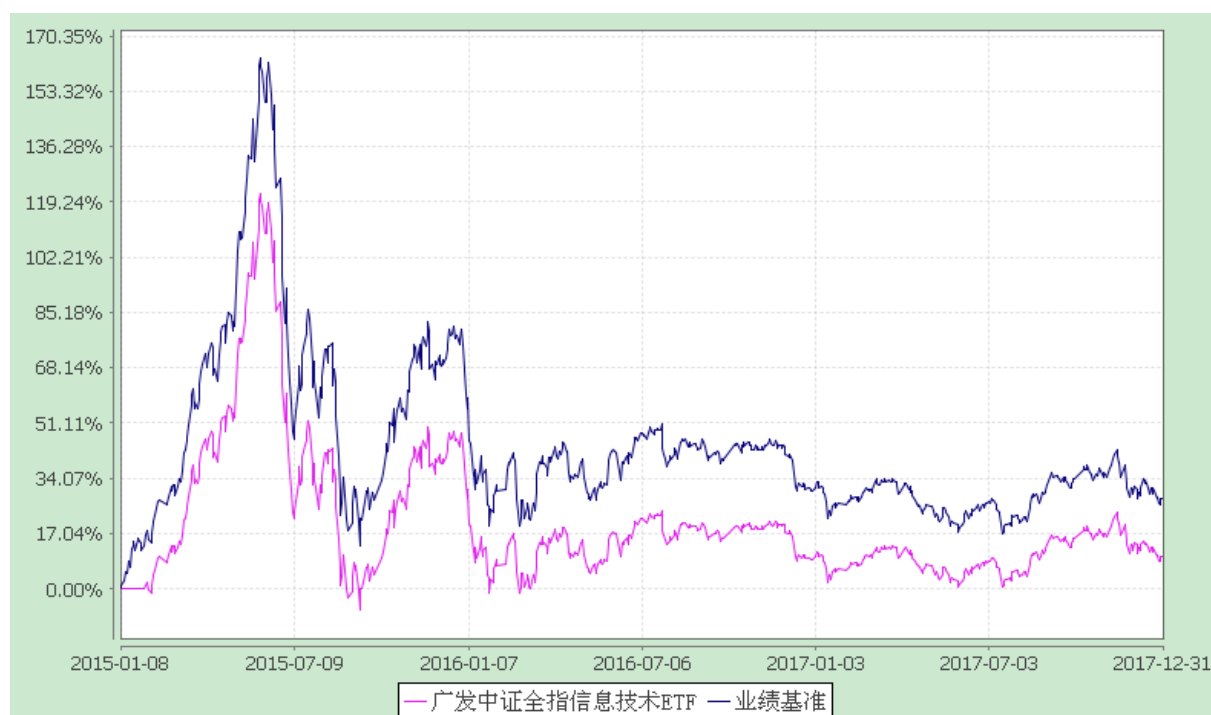
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-4.98%	1.34%	-4.87%	1.39%	-0.11%	-0.05%
过去六个月	1.46%	1.22%	1.04%	1.26%	0.42%	-0.04%
过去一年	0.85%	1.12%	-1.97%	1.15%	2.82%	-0.03%
自基金合同生效起至今	9.82%	2.24%	27.59%	2.30%	-17.77%	-0.06%

注：业绩比较基准：中证全指信息技术指数收益率。

#### 3.2.2 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2015 年 1 月 8 日至 2017 年 12 月 31 日)

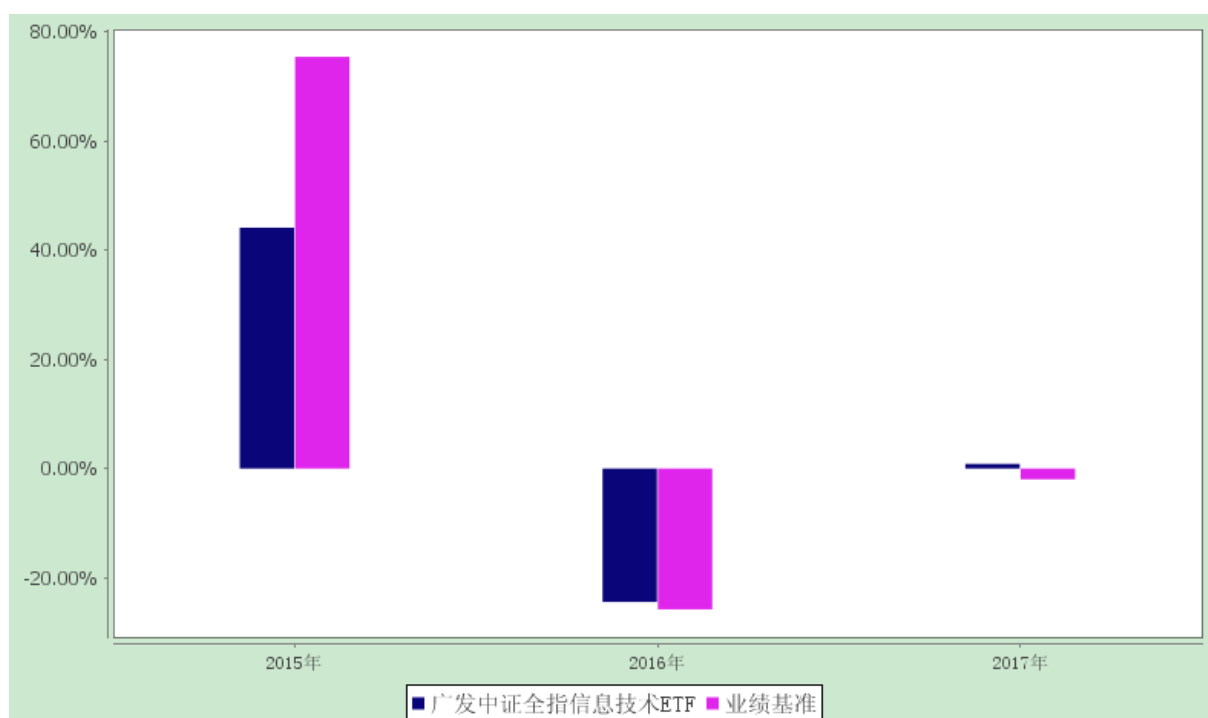


#### 3.2.3 基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金



基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年（2015 年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2015 年 1 月 8 日）至报告期末未进行利润分配。

## §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 29 个部门：权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、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、养老金与战略业务部、

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 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 161 只开放式基金，管理资产规模为 2799 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		
霍华明	本基金的基金经理；广发信息技术联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发中证基建工程指数基金的基金经理	2017-04-20	-	10 年	霍华明先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析员、ETF 基金助理兼研究员。现任广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 20 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 20 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2017 年 4 月 20 日起任职）、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基金经理（自 2017 年 4 月 20 日起任职）、广发中证基建工程指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 2 月 1 日起任职）。
陆志明	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理	2015-01-08	-	19 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司任部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2011 年 6 月 3 日至

	<p>理；广发信息技术联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源 ETF 基金的基金经理；广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理；广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理；广发金融地产联接基金的基金经理；广发能源联接基金的基金经理；广发原材料联接基金的基金经理；广发主要消费联接基金的基金经理；广发全指工业 ETF 联接基金的基金经理；广发中证全指工业 ETF 基金的基金经理；指数投资部副总经理</p>			<p>2016 年 7 月 28 日)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)。现任广发基金管理有限公司指数投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 6 月 3 日起任职)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日起任职)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日起任职)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 1 月 29 日起任职)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日起任职)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日起任职)、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基金经理(自 2015 年 5 月 6 日起任职)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日起任职)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日起任职)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日</p>
--	--	--	--	---

					起任职)、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基金经理(自 2015 年 7 月 9 日起任职)、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基金经理(自 2015 年 7 月 9 日起任职)、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基金经理(自 2015 年 8 月 18 日起任职)、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基金经理(自 2015 年 8 月 18 日起任职)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日起任职)、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基金经理(自 2017 年 6 月 13 日起任职)。
--	--	--	--	--	---

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间

的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 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，未发现本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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### （1）投资策略

作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

##### （2）运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素，作为 ETF 基金，由于本基金规模较小，

申购赎回对本基金的跟踪效果有较大影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为-1.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，A 股市场结构严重分化，代表大盘的沪深 300 指数创新高，而代表小盘的中证 1000 指数表现偏弱。2017 年是以业绩为主线的价值投资大年，白马股备受青睐，周期股与大蓝筹同样取得了不少的涨幅。其主要原因是，2017 年的房地产销售火热，宏观经济的表现超预期，基础建设与社会消费品零售都获得了不少的涨幅，从众多的经济数据来看，经济已经逐渐走稳并有走高的迹象，另外各个行业的行业集中度有提高的趋势。展望 2018 年，国内经济将进一步走强，国内企业的 ROE 有望继续改善，企业净利润同比增速依然可以保持较高水平，更重要的是企业的估值水平尚在合理区域，A 股依然值得配置。互联网是全球未来的发展方向，背后体现了信息技术的潜在产业机会，尤其对软件企业来说，未来充满了机遇和发展，信息技术将会更深一步地推动全球一体化，未来继续看好信息技术板块的业绩表现。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，坚持从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规稽核部门按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

#### 4.7 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、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。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。

#### 4.8 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

德师报(审)字(18)第 P01485 号

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金全体持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“广发中证全指信息技术 ETF”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了广发中证全指信息技术 ETF 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发中证全指信息技术 ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

广发中证全指信息技术 ETF 的基金管理人广发基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括广发中证全指信息技术 ETF 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。



在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估广发中证全指信息技术 ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算广发中证全指信息技术 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督广发中证全指信息技术 ETF 的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发中证全指信息技术 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发中证全指信息技术 ETF 不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

洪锐明 江丽雅

中国·上海

2018 年 3 月 23 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	5,770,496.29	6,729,337.93
结算备付金		415,322.92	10,303.11
存出保证金		7,632.84	7,591.68
交易性金融资产	7.4.7.2	335,486,445.72	411,026,140.90
其中：股票投资		335,486,445.72	411,026,140.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		388,867.45	-
应收利息	7.4.7.5	1,325.85	1,169.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

<b>资产总计</b>		<b>342,070,091.07</b>	<b>417,774,542.71</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		140,642.48	180,722.48
应付托管费		28,128.49	36,144.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	40,322.32	74,990.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	505,506.83	631,579.98
<b>负债合计</b>		<b>714,600.12</b>	<b>923,437.86</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	310,828,053.00	382,828,053.00
未分配利润	7.4.7.10	30,527,437.95	34,023,051.85
<b>所有者权益合计</b>		<b>341,355,490.95</b>	<b>416,851,104.85</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>342,070,091.07</b>	<b>417,774,542.71</b>

注: 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值人民币 1.0982 元, 基金份额总额 310,828,053.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>10,318,191.97</b>	<b>-130,077,551.15</b>
1.利息收入		47,686.00	45,614.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	47,606.92	45,614.79
债券利息收入		79.08	-
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）		-29,667,843.41	-58,021,674.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-31,441,891.55	-59,732,062.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	19,508.07	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,754,540.07	1,710,388.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	39,992,244.18	-72,011,139.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-53,894.80	-90,352.38
<b>减：二、费用</b>		<b>2,882,589.13</b>	<b>3,540,421.04</b>
1. 管理人报酬		1,812,888.69	2,275,498.88
2. 托管费		362,577.79	455,099.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	195,991.22	251,553.82

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	511,131.43	558,268.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>7,435,602.84</b>	<b>-133,617,972.19</b>
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>7,435,602.84</b>	<b>-133,617,972.19</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	382,828,053.00	34,023,051.85	416,851,104.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,435,602.84	7,435,602.84
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）	-72,000,000.00	-10,931,216.74	-82,931,216.74
其中：1.基金申购款	130,000,000.00	13,597,959.67	143,597,959.67
2.基金赎回款	-202,000,000.00	-24,529,176.41	-226,529,176.41
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）	310,828,053.00	30,527,437.95	341,355,490.95
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	408,828,053.00	180,281,751.30	589,109,804.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-133,617,972.19	-133,617,972.19
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）	-26,000,000.00	-12,640,727.26	-38,640,727.26
其中：1.基金申购款	256,000,000.00	32,509,415.76	288,509,415.76
2.基金赎回款	-282,000,000.00	-45,150,143.02	-327,150,143.02
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）	382,828,053.00	34,023,051.85	416,851,104.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会

(“中国证监会”) 证监许可[2014]1269 号《关于核准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2015 年 1 月 8 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 12 月 15 日至 2014 年 12 月 26 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 354,828,053.00 元，有效认购户数为 3,988 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 22,681.00 元，折合基金份额 22,681.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，本基金的投资范围包括：中证全指信息技术指数的成份股、备选成份股。可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货、货币市场工具及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准：中证全指信息技术指数收益率。

本基金的财务报表于 2018 年 3 月 23 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1. 金融资产的分类

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

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

##### 2. 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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



1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

股票持有期间获得的股票股利（包括送红股和公积金转增股本），于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

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

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

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

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

卖出权证于交易日确权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 期货投资

期货投资于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。因期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的期货暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

(5) 资产支持证券

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

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益。卖出资产支持证券按移动加权平均法结转成本。

## 2. 贷款及应收款项

### 买入返售金融资产

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

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

## 3. 其他金融负债

### 卖出回购金融资产款

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1、对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2、对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3、当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和市价折扣法等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

4、对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券

除外), 采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值, 另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下:

### (1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

对于长期停牌的股票, 若其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的, 经基金管理人估值委员会同意, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素 (如指数收益法), 调整最近交易市价, 确定公允价值。

非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售份、通过大宗交易取得的带限售期股票等流通受限股票, 考虑估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响, 采用市价折扣法确定公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。

### (2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券 (可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 采用第三方估值机构 (中央国债登记结算公司或中证指数有限公司) 提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

### (3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前, 采用估值技术确定公允价值, 如估值技术难以可靠计量, 则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前, 采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量, 则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权, 以及停止交易但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值, 基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 利息收入

（1）存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

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

（4）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

## 2. 投资收益

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

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

(3) 资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

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

(5) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

## 3. 公允价值变动收益

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

当本基金申购对价中包含可以现金替代时，在本基金补足可以现金替代成分股票（或采取强制退款）之前，该股票估值日与申购日的差额确认为公允价值变动收益，并于补入被替代股票的实际买入日或强制退款计算日转出计入其他收入。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 0.5\%$ 的年费率逐日计提。
2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.1\%$ 的年费率逐日计提。
3. 本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的  $0.03\%$  的年费率逐日计提。
4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。
5. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额

折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；

3、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

4、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发[2017]6 号）的相关规定，本基金自 2017 年 11 月 3 日起，对所持有的流通受限股票的估值技术进行变更。新的估值技术为市价折扣法，考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，其中剩余限售期对应的流动性折扣为关键输入值，流动性折扣越高，对应流通受限股票的公允价值越低。上述流通受限股票是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售份、通过大宗交易取得的带限售期股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人作为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	5,770,496.29	6,729,337.93
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	5,770,496.29	6,729,337.93

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		376,775,825.88	335,486,445.72	-41,289,380.16
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		-	-	-
其他		-	-	-
合计		376,775,825.88	335,486,445.72	-41,289,380.16
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		492,307,765.24	411,026,140.90	-81,281,624.34
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		-	-	-
其他		-	-	-
合计		492,307,765.24	411,026,140.90	-81,281,624.34

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,261.97	1,150.69
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	3.40	3.40
应收结算备付金利息	60.48	15.00
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	1,325.85	1,169.09

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	40,322.32	74,990.92
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	40,322.32	74,990.92

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	320,000.00	330,000.00
应付替代款	14,255.60	11,367.18
可退替代款	145,589.52	257,421.15
应付指数使用费	25,661.71	32,791.65
合计	505,506.83	631,579.98

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	382,828,053.00	382,828,053.00
本期申购	130,000,000.00	130,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-202,000,000.00	-202,000,000.00
本期末	310,828,053.00	310,828,053.00

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-14,074,182.57	48,097,234.42	34,023,051.85
本期利润	-32,556,641.34	39,992,244.18	7,435,602.84
本期基金份额交易产生的变动数	4,349,224.27	-15,280,441.01	-10,931,216.74
其中：基金申购款	-12,422,389.44	26,020,349.11	13,597,959.67
基金赎回款	16,771,613.71	-41,300,790.12	-24,529,176.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,281,599.64	72,809,037.59	30,527,437.95

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	44,720.29	39,674.97
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	261.90	223.50
结算备付金利息收入	2,624.73	5,716.32
其他	-	-
合计	47,606.92	45,614.79

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,256,563.20	-3,719,439.51
股票投资收益——赎回差价收入	-30,185,328.35	-56,012,623.06
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-31,441,891.55	-59,732,062.57

##### 7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	76,100,596.29	93,377,573.75
减：卖出股票成本总额	77,357,159.49	97,097,013.26
买卖股票差价收入	-1,256,563.20	-3,719,439.51

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	226,529,176.41	327,150,143.02
减：现金支付赎回款总额	7,328,791.41	16,886,082.02
减：赎回股票成本总额	249,385,713.35	366,276,684.06
赎回差价收入	-30,185,328.35	-56,012,623.06

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	365,687.15	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	346,100.00	-
减：应收利息总额	79.08	-
买卖债券差价收入	19,508.07	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,754,540.07	1,710,388.56

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,754,540.07	1,710,388.56

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	40,001,144.18	-72,015,979.55
——股票投资	40,001,144.18	-72,015,979.55
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-8,900.00	4,840.00
合计	39,992,244.18	-72,011,139.55

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
手续费返还	-	-
基金转换费收入	-	-
印花税返还	-	-
替代损益	-53,894.80	-105,352.38
其他	-	15,000.00
合计	-53,894.80	-90,352.38

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	195,991.22	251,553.82
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	195,991.22	251,553.82

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	40,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	2,358.15	1,738.56
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	108,773.28	136,529.96
其他	-	-
合计	511,131.43	558,268.52

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	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
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	31,400,454.18	22.25%	890,421.00	0.46%

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	58,039.40	15.87%	-	-

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2017年1月1日至2017年12月31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	29,243.33	26.72%	18,406.87	45.65%
关联方名称	上年度可比期间			
	2016年1月1日至2016年12月31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	829.23	0.59%	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日



	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,812,888.69	2,275,498.88
其中：支付销售机构的客户维护费	36,801.45	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	362,577.79	455,099.82

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发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	206,844,198.00	66.55%	243,381,837.00	63.57%
广发证券股份有限公司	1,843,666.00	0.59%	2,233,845.00	0.58%

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	5,770,496.29	44,720.29	6,729,337.93	39,674.97

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

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

## 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股流通受限	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

## 7.4.12.2 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
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-
300356	光一科技	2017-12-26	重大事项停牌	6.99	-	-	27,502.00	384,992.84	192,238.98	-
002579	中京电子	2017-11-16	重大事项停牌	10.20	2018-02-05	9.18	21,600.00	222,523.28	220,320.00	-
300523	辰安科技	2017-10-20	重大事项停牌	47.30	2018-02-06	42.57	5,820.00	397,230.42	275,286.00	-
002189	利达光电	2017-09-08	重大事项停牌	18.08	2018-03-07	16.53	15,301.00	410,169.54	276,642.08	-
000971	高升控股	2017-10-16	重大事项停牌	16.79	2018-01-09	16.89	24,607.00	539,790.97	413,151.53	-

002425	凯撒文化	2017-12-28	重大事项停牌	7.21	2018-01-22	7.35	64,200.00	549,165.39	462,882.00	-
300339	润和软件	2017-12-28	重大事项停牌	10.48	2018-01-05	10.73	47,200.00	848,554.28	494,656.00	-
300032	金龙机电	2017-11-27	重大事项停牌	13.89	-	-	39,946.00	823,146.38	554,849.94	-
300010	立思辰	2017-11-17	重大事项停牌	11.17	2018-02-22	10.05	51,324.00	1,221,468.69	573,289.08	-
300364	中文在线	2017-12-28	重大事项停牌	9.23	2018-01-05	10.00	65,380.00	1,017,800.28	603,457.40	-
000034	神州数码	2017-09-29	重大事项停牌	21.60	-	-	45,400.00	1,115,188.89	980,640.00	-
002745	木林森	2017-12-28	重大事项停牌	45.50	2018-01-05	46.50	27,800.00	1,304,664.22	1,264,900.00	-
300383	光环新网	2017-11-07	重大事项停牌	13.19	2018-03-19	14.51	97,002.00	1,625,500.25	1,279,456.38	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	3.92	2018-01-24	13.80	327,720.00	6,778,206.99	1,284,662.40	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项停牌	17.40	-	-	106,780.00	2,095,063.82	1,857,972.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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、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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券，因此与债券相关的信用风险不重大。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	5,770,496.29	-	-	-	5,770,496.29
结算备付金	415,322.92	-	-	-	415,322.92
存出保证金	7,632.84	-	-	-	7,632.84
交易性金融资产	0.00	-	-	335,486,445.72	335,486,445.72
应收证券清算款	-	-	-	388,867.45	388,867.45
应收利息	-	-	-	1,325.85	1,325.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,193,452.05	-	-	335,876,639.02	342,070,091.07
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	140,642.48	140,642.48
应付托管费	-	-	-	28,128.49	28,128.49

应付交易费用	-	-	-	40,322.32	40,322.32
其他负债	-	-	-	505,506.83	505,506.83
负债总计	-	-	-	714,600.12	714,600.12
利率敏感度缺口	6,193,452.05	-	-	335,162,038.90	341,355,490.95
<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	6,729,337.93	-	-	-	6,729,337.93
结算备付金	10,303.11	-	-	-	10,303.11
存出保证金	7,591.68	-	-	-	7,591.68
交易性金融资产	-	-	-	411,026,140.90	411,026,140.90
应收利息	-	-	-	1,169.09	1,169.09
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,747,232.72	-	-	411,027,309.99	417,774,542.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	180,722.48	180,722.48
应付托管费	-	-	-	36,144.48	36,144.48
应付交易费用	-	-	-	74,990.92	74,990.92
其他负债	-	-	-	631,579.98	631,579.98
负债总计	-	-	-	923,437.86	923,437.86
利率敏感度缺口	6,747,232.72	-	-	410,103,872.13	416,851,104.85

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.2.1 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	335,486,445.72	98.28	411,026,140.90	98.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	335,486,445.72	98.28	411,026,140.90	98.60

##### 7.4.13.4.3.2 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	16,603,563.90	20,517,736.67
	业绩比较基准下降 5%	-16,603,563.90	-20,517,736.67

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项



## 1. 公允价值

### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

### (2) 以公允价值计量的金融工具

#### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

#### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 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 324,632,482.19 元，属于第二层级的余额为 9,569,301.13 元，属于第三层级的余额为 1,284,662.40 元（2016 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 372,549,641.37 元，属于第二层级的余额为 38,024,342.10 元，属于第三层级的余额为 452,157.43 元）。

#### (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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层级的余额为人民币 1,284,662.40 元；本报告期内由第二层级转入第三层级的金额为人民币 5,023,947.60 元，转出第三层级的金额为人民币 452,157.43 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 -3,739,285.20 元（均为权益工具产生），除上述变动外，该层级金融资产无其他变动；本基金本期末持有的该层级金融工具为乐视网，金额为人民币 1,284,662.40 元，估值技术为市价折扣法，重大不可观察输入值为折扣率，与公允价值正（负）相关。

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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	335,486,445.72	98.08

	其中：股票	335,486,445.72	98.08
2	基金投资	-	-
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	6,185,819.21	1.81
8	其他各项资产	397,826.14	0.12
9	合计	342,070,091.07	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	204,969,263.77	60.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,003,884.44	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	126,557,951.77	37.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	603,457.40	0.18
S	综合	289,524.00	0.08
	合计	335,490,505.72	98.28

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	002415	海康威视	501,393	19,554,327.00	5.73
2	000725	京东方 A	3,226,800	18,683,172.00	5.47
3	600703	三安光电	318,000	8,074,020.00	2.37
4	002230	科大讯飞	128,005	7,570,215.70	2.22
5	002008	大族激光	112,330	5,549,102.00	1.63
6	002236	大华股份	227,197	5,245,978.73	1.54
7	002456	欧菲科技	250,650	5,160,883.50	1.51
8	000413	东旭光电	534,215	5,010,936.70	1.47
9	002475	立讯精密	207,002	4,852,126.88	1.42
10	300059	东方财富	358,886	4,647,573.70	1.36
11	002241	歌尔股份	257,652	4,470,262.20	1.31
12	000503	海虹控股	94,300	4,069,988.00	1.19
13	002405	四维图新	125,915	3,322,896.85	0.97
14	600804	鹏博士	188,851	3,216,132.53	0.94
15	600271	航天信息	146,914	3,164,527.56	0.93
16	600570	恒生电子	64,960	3,014,144.00	0.88
17	002558	巨人网络	79,660	2,931,488.00	0.86
18	300408	三环集团	137,100	2,763,936.00	0.81
19	600584	长电科技	124,200	2,649,186.00	0.78

20	600100	同方股份	234,600	2,299,080.00	0.67
21	002049	紫光国芯	47,900	2,298,721.00	0.67
22	300296	利亚德	114,710	2,235,697.90	0.65
23	603019	中科曙光	54,900	2,209,176.00	0.65
24	000050	深天马 A	110,804	2,183,946.84	0.64
25	002217	合力泰	205,916	2,059,160.00	0.60
26	000977	浪潮信息	102,710	2,041,874.80	0.60
27	002065	东华软件	248,700	2,039,340.00	0.60
28	600588	用友网络	96,400	2,038,860.00	0.60
29	300433	蓝思科技	68,280	2,038,158.00	0.60
30	002179	中航光电	51,714	2,036,497.32	0.60
31	300017	网宿科技	190,203	2,023,759.92	0.59
32	002185	华天科技	224,388	1,911,785.76	0.56
33	300088	长信科技	243,300	1,905,039.00	0.56
34	600666	奥瑞德	106,780	1,857,972.00	0.54
35	002410	广联达	94,500	1,852,200.00	0.54
36	002624	完美世界	51,600	1,726,536.00	0.51
37	000066	中国长城	233,147	1,699,641.63	0.50
38	002517	恺英网络	75,800	1,683,518.00	0.49
39	600718	东软集团	114,300	1,675,638.00	0.49
40	000997	新大陆	93,412	1,674,877.16	0.49
41	002439	启明星辰	71,600	1,671,860.00	0.49
42	002273	水晶光电	70,800	1,670,172.00	0.49
43	600183	生益科技	95,800	1,653,508.00	0.48
44	600260	凯乐科技	56,600	1,647,626.00	0.48
45	000970	中科三环	112,129	1,612,415.02	0.47
46	300315	掌趣科技	288,226	1,602,536.56	0.47
47	002600	江粉磁材	184,440	1,543,762.80	0.45
48	002195	二三四五	260,864	1,523,445.76	0.45
49	600460	士兰微	98,300	1,516,769.00	0.44
50	300182	捷成股份	168,621	1,451,826.81	0.43
51	300115	长盈精密	72,041	1,445,862.87	0.42
52	300033	同花顺	28,590	1,428,928.20	0.42
53	601231	环旭电子	86,760	1,368,205.20	0.40
54	000938	紫光股份	18,900	1,361,367.00	0.40
55	000988	华工科技	79,484	1,317,844.72	0.39
56	002268	卫士通	55,926	1,287,416.52	0.38
57	300104	乐视网	327,720	1,284,662.40	0.38
58	300168	万达信息	95,140	1,282,487.20	0.38
59	300383	光环新网	97,002	1,279,456.38	0.37
60	002174	游族网络	57,204	1,275,649.20	0.37
61	600074	ST 保千里	128,900	1,272,243.00	0.37
62	002373	千方科技	86,700	1,270,155.00	0.37
63	002745	木林森	27,800	1,264,900.00	0.37

64	002138	顺络电子	75,689	1,254,923.62	0.37
65	300418	昆仑万维	60,900	1,252,713.00	0.37
66	600410	华胜天成	115,774	1,217,942.48	0.36
67	002152	广电运通	159,939	1,189,946.16	0.35
68	600171	上海贝岭	71,700	1,166,559.00	0.34
69	002153	石基信息	42,600	1,135,716.00	0.33
70	300324	旋极信息	77,352	1,131,659.76	0.33
71	000636	风华高科	94,400	1,121,472.00	0.33
72	600797	浙大网新	94,400	1,115,808.00	0.33
73	300166	东方国信	88,774	1,114,113.70	0.33
74	300002	神州泰岳	181,686	1,111,918.32	0.33
75	002280	联络互动	143,400	1,098,444.00	0.32
76	002389	南洋科技	51,300	1,083,969.00	0.32
77	002354	天神娱乐	61,840	1,057,464.00	0.31
78	600601	方正科技	290,200	1,056,328.00	0.31
79	300271	华宇软件	70,922	1,055,319.36	0.31
80	002635	安洁科技	40,250	1,050,122.50	0.31
81	600728	佳都科技	126,646	1,044,829.50	0.31
82	600751	天海投资	169,900	1,038,089.00	0.30
83	300496	中科创达	31,971	1,033,302.72	0.30
84	002371	北方华创	24,742	1,025,308.48	0.30
85	300113	顺网科技	55,526	1,015,570.54	0.30
86	300170	汉得信息	85,053	1,012,130.70	0.30
87	600446	金证股份	65,902	997,756.28	0.29
88	600667	太极实业	111,000	994,560.00	0.29
89	000034	神州数码	45,400	980,640.00	0.29
90	600330	天通股份	88,200	974,610.00	0.29
91	300137	先河环保	45,602	954,449.86	0.28
92	000021	深科技	96,800	941,864.00	0.28
93	300102	乾照光电	92,915	934,724.90	0.27
94	002421	达实智能	152,560	922,988.00	0.27
95	300323	华灿光电	56,000	912,800.00	0.27
96	300287	飞利信	122,186	905,398.26	0.27
97	600563	法拉电子	17,586	893,544.66	0.26
98	002308	威创股份	72,772	887,818.40	0.26
99	002555	三七互娱	42,900	881,166.00	0.26
100	002436	兴森科技	146,542	863,132.38	0.25
101	300367	东方网力	56,925	858,429.00	0.25
102	300128	锦富技术	83,413	857,485.64	0.25
103	000727	华东科技	358,600	853,468.00	0.25
104	002156	通富微电	64,029	846,463.38	0.25
105	600651	飞乐音响	91,806	840,024.90	0.25
106	002368	太极股份	32,714	829,954.18	0.24
107	002036	联创电子	51,101	829,369.23	0.24

108	300053	欧比特	57,950	826,367.00	0.24
109	002222	福晶科技	45,300	825,819.00	0.24
110	002463	沪电股份	154,799	825,078.67	0.24
111	002402	和而泰	88,110	808,849.80	0.24
112	002449	国星光电	46,418	803,959.76	0.24
113	300020	银江股份	68,640	803,088.00	0.24
114	300188	美亚柏科	39,984	798,880.32	0.23
115	002139	拓邦股份	67,300	796,159.00	0.23
116	603000	人民网	73,402	794,943.66	0.23
117	600756	浪潮软件	43,100	766,749.00	0.22
118	002106	莱宝高科	74,835	761,071.95	0.22
119	300373	扬杰科技	25,312	758,600.64	0.22
120	600562	国睿科技	31,505	756,435.05	0.22
121	300431	暴风集团	34,681	756,045.80	0.22
122	002055	得润电子	36,500	745,695.00	0.22
123	002123	梦网荣信	71,600	741,060.00	0.22
124	300077	国民技术	73,942	739,420.00	0.22
125	300297	蓝盾股份	77,498	739,330.92	0.22
126	603678	火炬电子	26,000	722,020.00	0.21
127	300310	宜通世纪	61,758	715,775.22	0.21
128	002657	中科金财	31,197	711,915.54	0.21
129	300317	珈伟股份	45,261	708,787.26	0.21
130	002649	博彦科技	56,089	696,064.49	0.20
131	002618	丹邦科技	50,300	689,110.00	0.20
132	300078	思创医惠	63,827	688,693.33	0.20
133	002261	拓维信息	88,400	684,216.00	0.20
134	002095	生意宝	19,611	683,639.46	0.20
135	300476	胜宏科技	28,450	681,377.50	0.20
136	300212	易华录	25,007	677,689.70	0.20
137	002690	美亚光电	35,100	676,377.00	0.20
138	002063	远光软件	63,466	674,643.58	0.20
139	000823	超声电子	49,400	669,370.00	0.20
140	002104	恒宝股份	75,400	661,258.00	0.19
141	300377	赢时胜	53,117	656,526.12	0.19
142	600536	中国软件	39,502	653,758.10	0.19
143	002376	新北洋	58,619	651,257.09	0.19
144	000733	振华科技	43,655	650,459.50	0.19
145	002544	杰赛科技	41,295	649,570.35	0.19
146	300036	超图软件	41,962	647,893.28	0.19
147	300202	聚龙股份	35,880	644,046.00	0.19
148	300096	易联众	57,101	633,821.10	0.19
149	600360	华微电子	77,950	622,041.00	0.18
150	300458	全志科技	21,449	610,438.54	0.18
151	300065	海兰信	33,300	606,726.00	0.18

152	600289	ST 信通	60,900	605,346.00	0.18
153	002113	天润数娱	49,200	603,684.00	0.18
154	300364	中文在线	65,380	603,457.40	0.18
155	002161	远 望 谷	67,816	600,849.76	0.18
156	002636	金安国纪	37,872	599,513.76	0.18
157	300327	中颖电子	19,051	592,867.12	0.17
158	600552	凯盛科技	80,200	591,074.00	0.17
159	002197	证通电子	47,440	588,730.40	0.17
160	600363	联创光电	46,800	587,808.00	0.17
161	300288	朗玛信息	24,500	584,080.00	0.17
162	002642	荣之联	44,500	583,395.00	0.17
163	300183	东软载波	29,970	576,023.40	0.17
164	603328	依顿电子	39,976	573,655.60	0.17
165	300010	立思辰	51,324	573,289.08	0.17
166	300467	迅游科技	12,100	568,095.00	0.17
167	600764	中电广通	20,400	567,324.00	0.17
168	300226	上海钢联	14,824	555,900.00	0.16
169	300032	金龙机电	39,946	554,849.94	0.16
170	600986	科达股份	50,078	548,854.88	0.16
171	300666	江丰电子	7,900	546,443.00	0.16
172	603005	晶方科技	15,362	541,971.36	0.16
173	002079	苏州固锝	58,000	541,140.00	0.16
174	300075	数字政通	33,201	537,192.18	0.16
175	002484	江海股份	57,661	536,247.30	0.16
176	300352	北信源	134,429	535,027.42	0.16
177	603160	汇顶科技	5,500	533,170.00	0.16
178	300219	鸿利智汇	47,000	527,810.00	0.15
179	300300	汉鼎宇佑	30,400	512,240.00	0.15
180	300044	赛为智能	33,888	508,658.88	0.15
181	002464	金利科技	17,920	505,344.00	0.15
182	300043	星辉娱乐	81,700	500,004.00	0.15
183	002253	川大智胜	24,406	499,590.82	0.15
184	002093	国脉科技	52,600	499,174.00	0.15
185	300339	润和软件	47,200	494,656.00	0.14
186	300085	银之杰	35,973	489,232.80	0.14
187	000662	天夏智慧	32,900	489,223.00	0.14
188	600602	云赛智联	71,500	489,060.00	0.14
189	300131	英唐智控	71,204	488,459.44	0.14
190	002474	榕基软件	57,901	487,526.42	0.14
191	002279	久其软件	46,932	483,399.60	0.14
192	603444	吉比特	2,600	478,218.00	0.14
193	300369	绿盟科技	52,533	478,050.30	0.14
194	600652	游久游戏	65,600	477,568.00	0.14
195	603888	新华网	20,150	476,547.50	0.14

196	300232	洲明科技	33,100	473,330.00	0.14
197	300223	北京君正	13,343	472,875.92	0.14
198	603989	艾华集团	12,200	468,724.00	0.14
199	300456	耐威科技	10,350	466,578.00	0.14
200	300031	宝通科技	31,400	466,290.00	0.14
201	002425	凯撒文化	64,200	462,882.00	0.14
202	300256	星星科技	50,901	462,690.09	0.14
203	002331	皖通科技	44,801	459,658.26	0.13
204	002655	共达电声	47,600	456,960.00	0.13
205	002638	勤上股份	99,670	456,488.60	0.13
206	300502	新易盛	15,700	455,143.00	0.13
207	600571	信雅达	41,101	439,369.69	0.13
208	000555	神州信息	37,161	436,641.75	0.13
209	002414	高德红外	25,220	423,948.20	0.12
210	002288	超华科技	74,100	420,888.00	0.12
211	000676	智度股份	37,600	418,112.00	0.12
212	600800	天津磁卡	64,300	417,950.00	0.12
213	300303	聚飞光电	114,972	417,348.36	0.12
214	300074	华平股份	50,103	416,856.96	0.12
215	000971	高升控股	24,607	413,151.53	0.12
216	300359	全通教育	42,200	407,652.00	0.12
217	002658	雪迪龙	31,910	407,490.70	0.12
218	300231	银信科技	35,543	406,967.35	0.12
219	300679	电连技术	4,400	405,328.00	0.12
220	600288	大恒科技	46,143	402,366.96	0.12
221	002177	御银股份	80,200	400,198.00	0.12
222	300567	精测电子	3,000	400,020.00	0.12
223	600237	铜峰电子	74,300	399,734.00	0.12
224	002766	索菱股份	28,100	397,615.00	0.12
225	300349	金卡智能	9,900	392,040.00	0.11
226	300184	力源信息	34,400	390,096.00	0.11
227	603118	共进股份	44,160	387,283.20	0.11
228	300130	新国都	16,226	387,152.36	0.11
229	300245	天玑科技	27,300	378,378.00	0.11
230	300410	正业科技	10,700	374,500.00	0.11
231	002859	洁美科技	10,500	374,325.00	0.11
232	300066	三川智慧	82,000	373,100.00	0.11
233	300007	汉威电子	27,446	363,933.96	0.11
234	300229	拓尔思	25,400	363,474.00	0.11
235	000536	华映科技	73,436	362,773.84	0.11
236	300520	科大国创	13,480	356,680.80	0.10
237	300050	世纪鼎利	45,201	355,731.87	0.10
238	002841	视源股份	4,900	355,250.00	0.10
239	603881	数据港	7,600	347,396.00	0.10



240	300047	天源迪科	31,402	346,992.10	0.10
241	300386	飞天诚信	21,540	341,624.40	0.10
242	300311	任子行	24,261	339,654.00	0.10
243	300366	创意信息	28,000	336,560.00	0.10
244	300613	富瀚微	1,600	335,808.00	0.10
245	002587	奥拓电子	48,250	333,407.50	0.10
246	300379	东方通	26,100	329,904.00	0.10
247	300295	三六五网	17,600	328,240.00	0.10
248	603258	电魂网络	10,000	324,900.00	0.10
249	300302	同有科技	28,100	324,274.00	0.09
250	300299	富春股份	37,100	324,254.00	0.09
251	300351	永贵电器	22,500	319,500.00	0.09
252	300205	天喻信息	33,825	317,955.00	0.09
253	300248	新开普	23,700	317,580.00	0.09
254	603228	景旺电子	5,900	317,243.00	0.09
255	603636	南威软件	27,200	312,256.00	0.09
256	603920	世运电路	15,800	310,628.00	0.09
257	300319	麦捷科技	46,485	306,801.00	0.09
258	300333	兆日科技	35,103	300,130.65	0.09
259	300209	天泽信息	16,401	299,810.28	0.09
260	300440	运达科技	30,200	298,980.00	0.09
261	300331	苏大维格	17,700	297,537.00	0.09
262	600876	洛阳玻璃	14,700	296,352.00	0.09
263	000045	深纺织 A	30,200	294,450.00	0.09
264	300494	盛天网络	15,800	292,300.00	0.09
265	300348	长亮科技	19,400	292,164.00	0.09
266	002315	焦点科技	13,404	289,928.52	0.08
267	000532	华金资本	27,600	289,524.00	0.08
268	300465	高伟达	31,262	289,173.50	0.08
269	002232	启明信息	27,278	288,601.24	0.08
270	300052	中青宝	20,251	288,576.75	0.08
271	603528	多伦科技	32,600	287,858.00	0.08
272	300346	南大光电	11,000	287,430.00	0.08
273	300419	浩丰科技	29,300	280,694.00	0.08
274	300051	三五互联	29,287	279,690.85	0.08
275	300025	华星创业	45,400	277,848.00	0.08
276	002189	利达光电	15,301	276,642.08	0.08
277	603595	东尼电子	3,600	276,480.00	0.08
278	600892	大晟文化	29,500	276,415.00	0.08
279	300523	辰安科技	5,820	275,286.00	0.08
280	300493	润欣科技	19,400	273,152.00	0.08
281	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.08
282	002076	雪 莱 特	47,800	266,724.00	0.08
283	600353	旭光股份	43,400	264,740.00	0.08

284	300446	乐凯新材	11,700	259,155.00	0.08
285	300378	鼎捷软件	17,343	256,156.11	0.08
286	603918	金桥信息	14,200	254,180.00	0.07
287	002577	雷柏科技	15,000	251,700.00	0.07
288	300368	汇金股份	29,200	250,536.00	0.07
289	300449	汉邦高科	12,600	247,464.00	0.07
290	300513	恒泰实达	7,400	247,160.00	0.07
291	300479	神思电子	11,700	246,870.00	0.07
292	300076	GQY 视讯	39,796	245,541.32	0.07
293	300623	捷捷微电	3,400	244,800.00	0.07
294	603133	碳元科技	7,500	243,675.00	0.07
295	002017	东信和平	27,740	242,170.20	0.07
296	600476	湘邮科技	14,800	239,760.00	0.07
297	603189	网达软件	14,700	239,022.00	0.07
298	002782	可立克	16,800	235,536.00	0.07
299	300518	盛讯达	4,500	235,350.00	0.07
300	002401	中远海科	19,600	234,808.00	0.07
301	300531	优博讯	14,800	234,728.00	0.07
302	300165	天瑞仪器	36,101	229,241.35	0.07
303	300468	四方精创	5,700	227,031.00	0.07
304	300127	银河磁体	13,000	225,030.00	0.07
305	603508	思维列控	5,800	224,170.00	0.07
306	002579	中京电子	21,600	220,320.00	0.06
307	002137	麦达数字	30,600	213,894.00	0.06
308	002388	新亚制程	27,000	213,300.00	0.06
309	603936	博敏电子	7,400	212,750.00	0.06
310	002771	真视通	11,100	208,680.00	0.06
311	300597	吉大通信	10,000	208,600.00	0.06
312	603660	苏州科达	6,000	207,660.00	0.06
313	002845	同兴达	7,300	207,393.00	0.06
314	300678	中科信息	3,600	207,252.00	0.06
315	300661	圣邦股份	2,200	207,240.00	0.06
316	300099	精准信息	34,401	206,750.01	0.06
317	002815	崇达技术	6,400	201,984.00	0.06
318	300516	久之洋	4,373	198,577.93	0.06
319	603933	睿能科技	3,700	197,358.00	0.06
320	300356	光一科技	27,502	192,238.98	0.06
321	002866	传艺科技	5,200	191,412.00	0.06
322	300627	华测导航	4,300	190,533.00	0.06
323	300602	飞荣达	3,600	187,560.00	0.05
324	603559	中通国脉	4,800	185,328.00	0.05
325	603039	泛微网络	2,900	184,701.00	0.05
326	300533	冰川网络	3,600	182,268.00	0.05
327	300657	弘信电子	3,800	181,184.00	0.05

328	300541	先进数通	7,300	179,580.00	0.05
329	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.05
330	603025	大豪科技	6,000	176,520.00	0.05
331	300570	太辰光	8,360	176,312.40	0.05
332	300480	光力科技	10,648	175,692.00	0.05
333	300380	安硕信息	8,290	174,919.00	0.05
334	300532	今天国际	7,500	173,925.00	0.05
335	002876	三利谱	2,900	173,565.00	0.05
336	300566	激智科技	4,550	169,715.00	0.05
337	300648	星云股份	2,500	169,200.00	0.05
338	300590	移为通信	5,800	162,864.00	0.05
339	300462	华铭智能	6,700	160,867.00	0.05
340	002808	苏州恒久	12,800	153,472.00	0.04
341	002813	路畅科技	4,400	153,208.00	0.04
342	603322	超讯通信	3,300	152,988.00	0.04
343	300508	维宏股份	2,100	152,208.00	0.04
344	300162	雷曼股份	18,240	140,630.40	0.04
345	603383	顶点软件	3,100	139,469.00	0.04
346	603421	鼎信通讯	5,400	137,808.00	0.04
347	300543	朗科智能	4,400	137,236.00	0.04
348	002869	金溢科技	4,300	136,396.00	0.04
349	300571	平治信息	2,900	135,720.00	0.04
350	300609	汇纳科技	3,700	133,570.00	0.04
351	300469	信息发展	3,300	132,330.00	0.04
352	300560	中富通	3,800	131,252.00	0.04
353	300579	数字认证	2,900	130,500.00	0.04
354	300582	英飞特	7,400	130,240.00	0.04
355	002855	捷荣技术	9,900	128,502.00	0.04
356	300542	新晨科技	4,400	126,632.00	0.04
357	300515	三德科技	10,900	125,677.00	0.04
358	002861	瀛通通讯	4,500	121,275.00	0.04
359	603380	易德龙	5,800	118,726.00	0.03
360	603186	华正新材	4,700	112,518.00	0.03
361	002806	华锋股份	4,900	110,397.00	0.03
362	002819	东方中科	4,100	106,600.00	0.03
363	603138	海量数据	2,400	106,296.00	0.03
364	300588	熙菱信息	3,600	104,760.00	0.03
365	002870	香山股份	4,000	103,840.00	0.03
366	300546	雄帝科技	4,900	103,586.00	0.03
367	300561	汇金科技	3,100	102,052.00	0.03
368	300552	万集科技	3,900	100,503.00	0.03
369	603738	泰晶科技	4,100	99,548.00	0.03
370	002849	威星智能	3,100	88,629.00	0.03
371	002835	同为股份	7,800	87,750.00	0.03

372	300556	丝路视觉	4,000	86,320.00	0.03
373	300551	古鳌科技	2,700	71,928.00	0.02
374	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
375	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
376	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
377	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
378	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
379	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
380	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
381	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
382	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
383	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
384	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
385	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	3,305,256.00	0.79
2	002558	巨人网络	2,894,021.00	0.69
3	000066	中国长城	2,656,384.50	0.64
4	002624	完美世界	2,192,696.00	0.53
5	000413	东旭光电	1,963,992.00	0.47
6	300104	乐视网	1,834,049.11	0.44
7	002745	木林森	1,201,906.00	0.29
8	600751	天海投资	1,132,320.70	0.27
9	300433	蓝思科技	1,042,919.95	0.25
10	002635	安洁科技	1,014,728.00	0.24
11	000050	深天马 A	1,012,717.00	0.24
12	603444	吉比特	888,421.00	0.21
13	600703	三安光电	828,027.00	0.20
14	300323	华灿光电	814,983.00	0.20
15	603888	新华网	792,021.00	0.19
16	300043	星辉娱乐	789,592.00	0.19
17	603678	火炬电子	739,905.00	0.18
18	002180	纳思达	737,615.00	0.18
19	002475	立讯精密	726,301.00	0.17
20	300088	长信科技	686,887.00	0.16

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002129	中环股份	2,320,658.00	0.56
2	000748	长城信息	2,097,007.50	0.50
3	000725	京东方 A	1,701,805.00	0.41
4	600151	航天机电	1,093,670.00	0.26
5	600654	*ST 中安	842,440.87	0.20
6	002241	歌尔股份	774,100.00	0.19
7	002230	科大讯飞	764,797.00	0.18
8	300340	科恒股份	759,159.00	0.18
9	002180	纳思达	749,105.00	0.18
10	002456	欧菲科技	745,046.00	0.18
11	000503	海虹控股	728,376.00	0.17
12	600850	华东电脑	727,928.86	0.17
13	002008	大族激光	696,834.00	0.17
14	600100	同方股份	639,156.00	0.15
15	600584	长电科技	633,884.00	0.15
16	600703	三安光电	626,726.00	0.15
17	600845	宝信软件	593,884.00	0.14
18	002609	捷顺科技	568,134.00	0.14
19	600718	东软集团	566,551.17	0.14
20	601519	*ST 智慧	566,087.00	0.14

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	76,304,415.18
卖出股票的收入（成交）总额	76,100,596.29

## 8.5 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。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2** 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,632.84
2	应收证券清算款	388,867.45

3	应收股利	-
4	应收利息	1,325.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	397,826.14

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
7,637	40,700.28	212,482,867.00	68.36%	98,345,186.00	31.64%

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发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	206,844,198.00	66.55%
2	常州对外贸易有限公司	2,000,000.00	0.64%
3	广发证券股份有限公司	1,843,666.00	0.59%
4	罗建明	1,765,000.00	0.57%

5	胡余炳	1,700,000.00	0.55%
6	李尚宾	758,800.00	0.24%
7	马玉芬	699,806.00	0.23%
8	朱淑仪	603,700.00	0.19%
9	宋为	559,800.00	0.18%
10	许根银	548,667.00	0.18%
11	姚臻	513,900.00	0.17%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 1 月 8 日)基金份额总额	354,828,053.00
本报告期期初基金份额总额	382,828,053.00
本报告期基金总申购份额	130,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	202,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	310,828,053.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

### 11.3 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。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 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。

#### 11.5 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。

#### 11.6 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、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	
银河证券	2	85,427,419.47	60.55%	62,473.32	57.07%	-
广发证券	3	31,400,454.18	22.25%	29,243.33	26.72%	-
招商证券	2	24,267,319.77	17.20%	17,746.79	16.21%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市

场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

## 2、交易席位选择流程：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	194,099.70	53.08%	-	-	-	-
广发证券	58,039.40	15.87%	-	-	-	-
招商证券	113,548.05	31.05%	-	-	-	-

### 11.8 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广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-04-20

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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
广发中证全指信息技术交易型开放式指数	1	20170101-20171231	243,381,837.00	156,565,961.00	193,103,600.00	206,844,198.00	66.55%

证券投资基金发起式 联接基金							
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>							

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- （二）《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 13.2 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

### 13.3 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

二〇一八年三月二十七日