

# 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

## 2018 年第 3 季度报告

### 2018 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	469,851,594.50 份
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	广发创业板 ETF 联接 A	广发创业板 ETF 联接 C
下属两级基金的交易代码	003765	003766
报告期末下属两级基金的份额总额	180,795,409.63 份	289,056,184.87 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

### 2.1.2 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。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018 年 7 月 1 日-2018 年 9 月 30 日)	
	广发创业板 ETF 联接 A	广发创业板 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-14,995,272.73	-27,494,134.31
2. 本期利润	-15,393,395.96	-32,112,055.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0949	-0.1128
4. 期末基金资产净值	146,635,422.82	234,856,241.86
5. 期末基金份额净值	0.8111	0.8125

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

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

###### 1、广发创业板 ETF 联接 A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.78%	1.39%	-11.55%	1.45%	0.77%	-0.06%

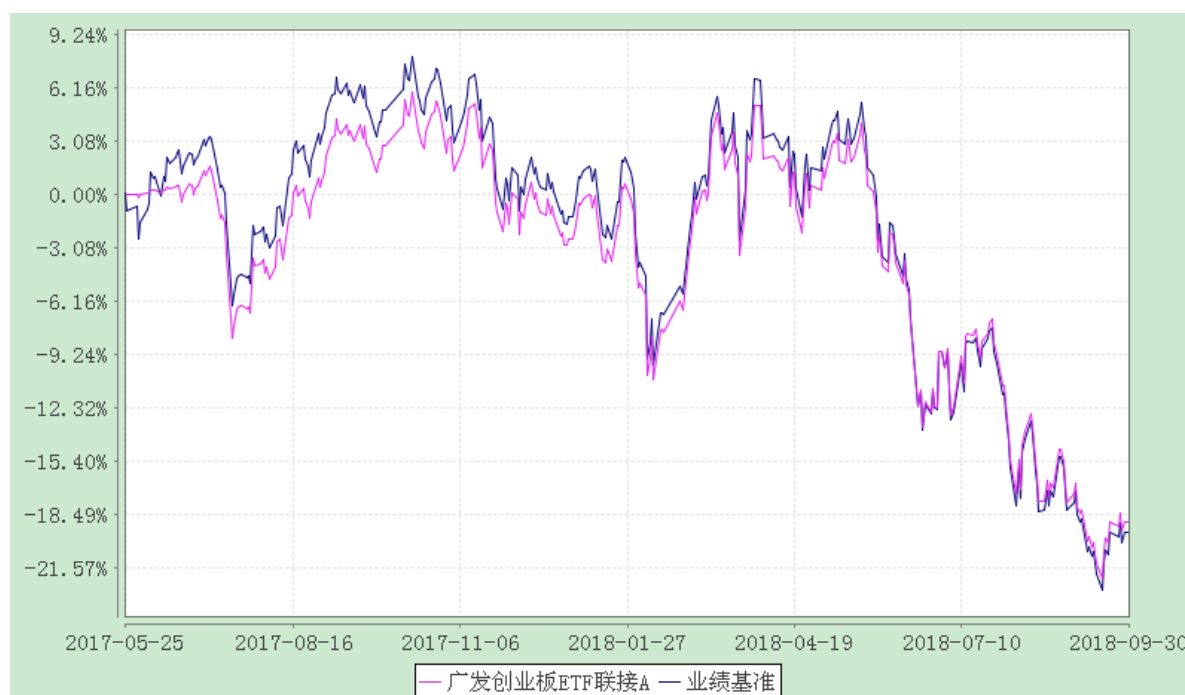
###### 2、广发创业板 ETF 联接 C:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.73%	1.39%	-11.55%	1.45%	0.82%	-0.06%

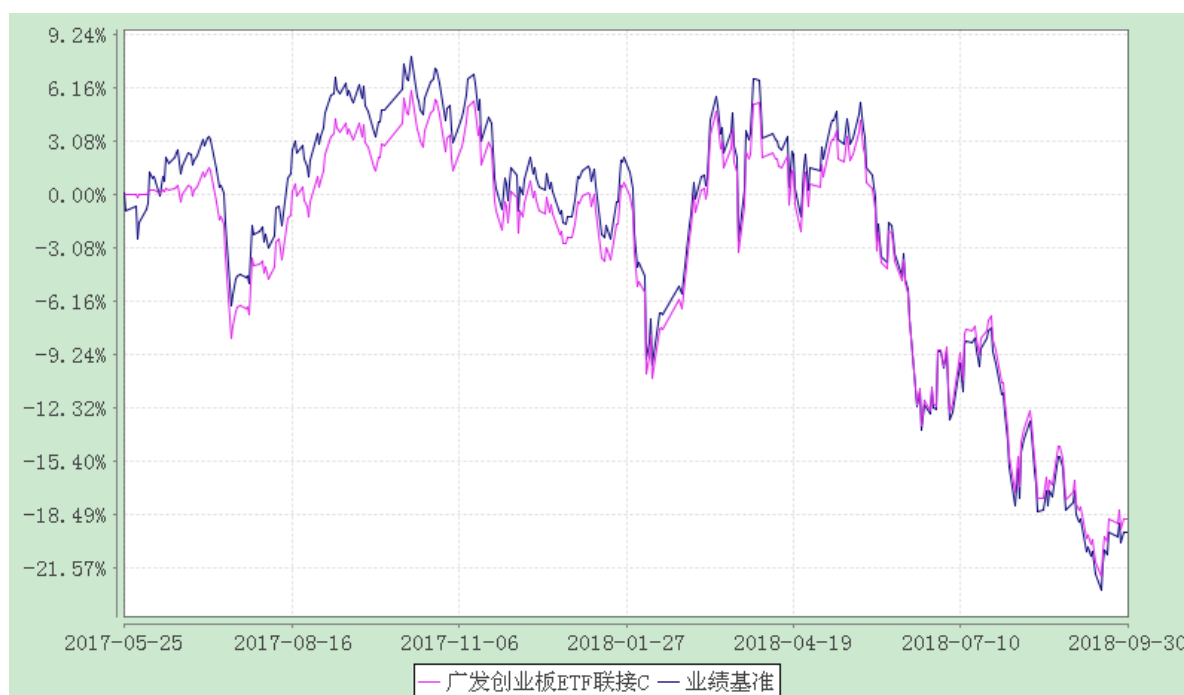
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金  
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  
(2017 年 5 月 25 日至 2018 年 9 月 30 日)

#### 1. 广发创业板 ETF 联接 A:



#### 2. 广发创业板 ETF 联接 C:



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		证券从业 年限	说明
		任职 日期	离任日 期		
刘杰	本基金的基金 经理；广发沪 深 300ETF 联 接基金的基金 经理；广发中 证 500ETF 基 金的基金经理； 广发中证 500ETF 联接 (LOF)基金的基 金经理；广发 沪深 300ETF 基金的 基金经理；广	2017- 05-25	-	14 年	刘杰先生，工学学士，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 证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日）。现任广发基金管理有限 公司指数投资部总经理助理、广 发中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金基金经理（自

	<p>发养老指数基金的基金经理；          广发中小板 300ETF 基金的基金经理；          广发中小板 300 联接基金的基金经理；          广发中证环保 ETF 联接基金的基金经理；          广发军工 ETF 基金的基金经理；          广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理；          广发中证环保 ETF 基金的基金经理；          广发创业板 ETF 基金的基金经理；          广发量化稳健混合基金的基金经理；          广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理；          广发港股通恒生综合中型股指数的基金经理；          广发美国房地产指数（QDII）基金的基金经理；          广发纳斯达克 100 指数（QDII）基金的基金经理；          广发纳指 100ETF 基金的基金经理；          广发全球农业指</p>				<p>2014 年 4 月 1 日起任职）、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 8 月 20 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 18 日起任职）、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 2016 年 1 月 25 日起任职）、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 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 30 日起任职）、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基金经理（自 2016 年 9 月 26 日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 25 日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 25 日起任职）、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经理（自 2017 年 5 月 25 日起任职）、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 日起任职）、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基金经理（自 2018 年 4 月 26 日起任职）、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基</p>
--	---	--	--	--	--

	数（QDII）基金的基金经理；广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理；广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理；指数投资部总经理助理			基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库，投资的债券必须来自公司债券库。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。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

## 4. 报告期内基金的投资策略和运作分析

### （1）投资策略

作为 ETF 联接基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，主要持有广发创业板 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，进一步降低基金的跟踪误差。

### （2）运作分析

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是基金成份股调整、申购和赎回因素，本基金目前规模水平下，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

综合受到中美贸易战、去杠杆以及近期股票质押风险等不利因素的影响，整体市场的表现较欠佳，各大指数近期均已达到或接近近 3 年的底部区域，市场情绪较差，市场信心不足，同时市场风险也一定程度得到释放，未来机遇与挑战并存。国际方面，由于原油价格上行、美债收益率上行、美股高波动趋势、中美摩擦等潜在风险点尚未消除，应以谨慎为主；国内方面，随着地方政府参与解决股权质押风险、沪伦通开通在即等积极因素汇聚，未来市场有一定修复市场情绪的可能。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-10.78%，C 类份额净值增长率为-10.73%，同期业绩基准收益率为-11.55%。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,708,638.43	0.44
	其中：股票	1,708,638.43	0.44
2	基金投资	346,988,016.94	90.13
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	32,667,043.75	8.49
8	其他各项资产	3,621,569.33	0.94
9	合计	384,985,268.45	100.00

### 5.2 期末投资目标基金明细

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	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	346,988,016.94	90.96

	开放式指数证券投资基金			公司		
--	-------------	--	--	----	--	--

### 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.3.1 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	158,360.40	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	873,492.64	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,980.00	0.00
F	批发和零售业	10,119.00	0.00
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	405,719.33	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,100.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	42,344.00	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	89,866.50	0.02
R	文化、体育和娱乐业	103,656.56	0.03
S	综合	-	-
	合计	1,708,638.43	0.45

#### 5.3.2 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。

### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例(%)
1	300498	温氏股份	6,820	158,360.40	0.04
2	300003	乐普医疗	2,778	84,312.30	0.02
3	300059	东方财富	7,200	81,000.00	0.02
4	300618	寒锐钴业	520	66,315.60	0.02
5	300324	旋极信息	5,915	56,133.35	0.01
6	300124	汇川技术	1,941	53,765.70	0.01
7	300015	爱尔眼科	1,450	46,762.50	0.01
8	300142	沃森生物	2,100	45,780.00	0.01
9	300133	华策影视	4,700	45,026.00	0.01
10	300408	三环集团	2,100	43,659.00	0.01

#### 5.5 报告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。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.8 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。

#### 5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.10 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。

#### 5.11 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。

### 5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

5.12.2 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。

#### 5.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	92,466.28
2	应收证券清算款	2,220,777.11
3	应收股利	-
4	应收利息	7,315.33
5	应收申购款	1,286,573.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	14,437.04
9	合计	3,621,569.33

#### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300324	旋极信息	56,133.35	0.01	重大事项停牌

## §6 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
本报告期期初基金份额总额	140,617,923.88	168,221,017.22

本报告期基金总申购份额	63,003,625.93	309,624,334.73
减：本报告期基金总赎回份额	22,826,140.18	188,789,167.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	180,795,409.63	289,056,184.87

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,400.24
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,400.24
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	2.13

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

## §8 报告期末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	10,002,40 0.24	2.13%	10,002,40 0.24	2.13%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	101,600.6 0	0.02%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,104,00 0.84	2.15%	10,002,40 0.24	2.13%	三年

## §9 备查文件目录

### 9.1 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) 《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招募说明书》及其更新版
- (六) 法律意见书
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (八) 基金托管人业务资格批件、营业执照

### 9.2 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

### 9.3 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  
二〇一八年十月二十五日