广发全球医疗保健指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月三十日

§1 重要提示

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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	广发全球医疗保健(QDII)
基金主代码	000369
交易代码	000369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月10日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	205,766,440.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%,实现对标普全球1200医疗保健指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以实现对标的指数的有效跟踪为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。本基金主要采用完全复制法来跟踪标普全球1200医疗保健指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。
业绩比较基准	标普全球1200医疗保健指数(S&P Global 1200 Health Care Sector Index)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	李春磊
	联系电话	020-83936666	010-65169830
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	400-830-8003
传真		020-89899158	020-65169555

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	–	Citibank N.A
	中文	–	美国花旗银行有限公司
注册地址		–	–
办公地址		–	–
邮政编码		–	–

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
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

§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	2014年	2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	4,789,604.16	928,830.10
本期利润	21,703,221.16	2,309,440.97
加权平均基金份额本期利润	0.1426	0.0094
本期基金份额净值增长率	15.36%	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0366	0.0038
期末基金资产净值	239,582,500.40	247,979,828.45
期末基金份额净值	1.164	1.009

注:1.本基金合同生效日为2013年12月10日。

2.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。

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

4..期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

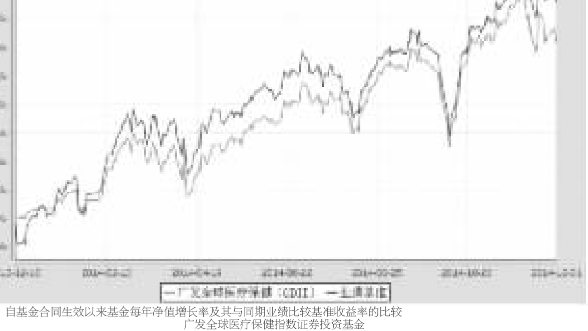
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.66%	0.84%	3.62%	0.90%	-1.96%	-0.06%
过去六个月	5.05%	0.70%	5.97%	0.75%	-0.92%	-0.05%
过去一年	15.36%	0.66%	19.02%	0.74%	-3.66%	-0.08%
自基金合同生效起至今	16.40%	0.64%	20.17%	0.73%	-3.77%	-0.09%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。

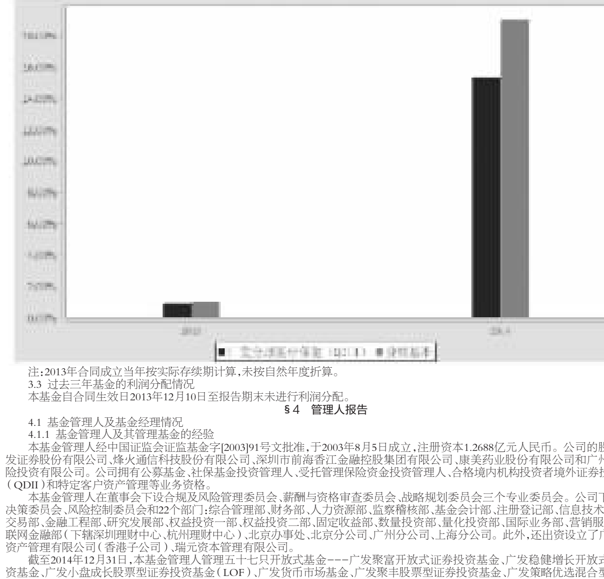
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发全球医疗保健指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年12月10日至2014年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来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

广发全球医疗保健指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:2013年合同成立当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2013年12月10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风险投资有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和22个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、国际业务部、营销服务部、互联网金融部(下辖深圳理财中心、杭州理财中心)、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外,还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司。

截至2014年12月31日,本基金管理人管理五十七只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金,广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发季季利理财债券型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金和广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金,管理资产规模为1334.68亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理;广发标普全球农业指数(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;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;国际业务部副总经理	2013-12-10	–	7.5年	男,中国籍,统计学博士,持有基金业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理,2013年8月9日起任广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理,2013年11月28日起任广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年12月10日起任广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司国际业务部副总经理。

注:(1)基金经理的"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遵规守信情况的说明

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、《广发全球医疗保健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。

公司监察稽核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

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。报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,欧美股市经历短期调整之后,随着欧美大型企业财报数据好于预期,以及美联储继续维持缓步退出QE政策,欧美股市继续受到投资者青睐,美国股市在2月份开始结束调整,延续前期持续上涨的走势,欧洲市场受到乌克兰局势的影响呈现震荡上升。2月份开始,在欧美股市上涨的带动下,标普全球医疗指数也呈现明显涨幅,但从3月份开始,美国纳斯达克指数出现较大调整,互联网科技类和生物科技类股票出现明显回调,标普全球医疗指数中部分生物科技类公司股价也受到影响下跌,指数出现回调,收窄了2月份以来的涨幅。

二季度,标普全球医疗指数是一个创新高的走势,季度初受到成长股三月初开始的调整影响走势有所波动,但由于医疗保健行业的稳健性使得指数早于美股大盘企稳,并不断小幅度创新高。

三季度,标普全球医疗保健指数在短暂回调后继续稳健上扬。7月份,在市场受到阿根廷违约的负面冲击的背景下,指数又受到第一大权重股强生业绩展望不及预期以及部分产品被召回的影响,以至于在7月份出现短暂回调。但是进入8月,成分股中生物科技企业如吉利德、安进等公司公告的新药销售和临床试验等数据均超预期,连同如默克等企业的大型并购利好,使得该指数最终重拾涨势,并且创出历史新高。

四季度,标普全球医疗保健指数继续上行。10月初,指数虽然受到美联储退出QE、欧洲经济复苏乏力和埃博拉病毒肆虐等事件推升全球风险溢价的影响,医疗行业指数小幅回调,但是随着吉利德的新型丙肝药获批,Celgene的盈利继续超市场预期以及安进提高全年展望等利好因素驱动,医疗指数快速回升。同时由于在十月与十一月多个医药学术会议上,多种疗效显著的创新药和新型的医疗设备公布良好的实验数据也推升相关药企的股价,其中医药指数下的生物指数与医疗设备指数表现最为突出。在此多重利好的情况下,医疗保健指数在12月初创出新高。随后由于艾伯维的新获批的丙肝药与吉利德的丙肝药物竞争,市场担心出现价格战而引发医疗行业受到局部的卖压。此外,欧洲经济复苏乏力,希腊提前大选也为欧洲前景蒙上阴影,指数中一些欧洲股票受到整体大市的影响而小幅回落,但是美国的生物医药板块经过短暂大跌后又重拾涨势,在全年相对高位结束2014年的行情。总结2014年,全球医疗保健指数获得不错的涨幅,领涨标普全球的其他行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值收益率为15.36%,同期比较业绩基准收益率为19.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年,全球医疗行业仍然有十分光明的前景。生物技术的突破为很多原来不能治愈的疾病患者带来福音,如治疗癌症的细胞免疫疗法,在美国临床的测试数据中,90%的白血病癌症可以获得治愈,这种技术的突破给整个医疗行业带来的是无限的商机。这些类似的疗效显著的新药产品将在未来3年陆续推出,可以说未来3年是新药面世的高峰期,全球医药企业的增长将受益于这轮新药周期。同时,由于全球经济在缓慢复苏,人均医疗支出也会快速上涨,而权重最大的美国地区人均支出的上涨会对全球医疗板块带来十分正面的影响。我们相信全球医疗保健指数仍将在2015年持续增长并且跑赢大部分其他全球行业指数。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会,按照相关法律法规和证监会的相关规定,负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法,经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性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。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查,确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体流程,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中"基金的收益与分配"之"基金收益分配原则"的相关规定,本基金本报告期内未进行利润分配,符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,广发银行股份有限公司在广发全球医疗保健指数证券投资基金(以下简称"本基金")的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》等相关法律法规,以及基金合同、托管协议的有关规定,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

报告期内,托管人依据相关法律法规、基金合同、托管协议等,对本基金的资产净值计算、利润分配等数据进行了认真复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人存在任何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

托管人复核了本基金2014年年度报告中的主要财务指标、基金净值表现、利润分配、年度财务报表、投资组合报告等内容,未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 王明静 洪锐明签字出具了德师报(审)字(15)第P0310号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:广发全球医疗保健指数证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:	–	–
银行存款	12,075,731.48	188,350,585.81
结算备付金	–	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	228,095,779.28	59,310,563.94
其中:股票投资	224,320,519.53	54,061,133.04
基金投资	3,775,259.75	5,249,430.90
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	1,882.74	644,495.24
应收股利	236,297.65	21,616.40
应收申购款	2,505,027.02	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	280,230.92	–
资产总计	243,194,949.09	248,327,261.39
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:	–	–
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	365,579.00	188,009.41
应付赎回款	2,599,976.18	–
应付管理人报酬	152,482.65	113,607.23
应付托管费	47,650.84	35,502.26
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	–	–
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	446,760.02	10,314.04
负债合计	3,612,448.69	347,432.94
所有者权益:	–	–
实收基金	205,766,440.10	245,670,387.48
未分配利润	33,816,060.30	2,309,440.97
所有者权益合计	239,582,500.40	247,979,828.45
负债和所有者权益总计	243,194,949.09	248,327,261.39

注:1.报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币1.164元,基金份额总额205,766,440.10份;2013年12月31日,基金份额净值人民币1.009元,基金份额总额245,670,387.48份。

2.上年度会计期间为2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:广发全球医疗保健指数证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	24,168,019.51	2,513,497.12
1.利息收入	404,596.65	678,243.61
其中:存款利息收入	404,596.65	678,243.61
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)	6,056,404.65	44,055.49
其中:股票投资收益	3,130,492.99	744.89
基金投资收益	309,121.85	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	2,616,789.81	43,310.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	16,913,617.00	1,380,610.87
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	425,750.06	410,587.15
5.其他收入(损失以"-"号填列)	367,651.15	–
减:二、费用	2,464,798.35	204,056.15
1.管理人报酬	1,341,915.06	113,607.23
2.托管费	419,348.44	35,502.26
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	192,264.76	44,632.62
5.利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	511,270.09	10,314.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	21,703,221.16	2,309,440.97
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	21,703,221.16	2,309,440.97

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发全球医疗保健指数证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	245,670,387.48	2,309,440.97	247,979,828.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	21,703,221.16	21,703,221.16
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)	-39,903,947.38	9,803,398.17	-30,100,549.21
其中:1.基金申购款	253,165,596.11	31,798,123.29	284,963,719.40
2.基金赎回款	-293,069,543.49	-21,994,725.12	-315,064,268.61
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)	205,766,440.10	33,816,060.30	239,582,500.40
项目	上年度可比期间 2013年12月10日(基金合同生效日)至2013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)	245,670,387.48	–	245,670,387.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	2,309,440.97	2,309,440.97
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	245,670,387.48	2,309,440.97	247,979,828.45

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:王志伟,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

广发全球医疗保健指数证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2013]1191号文《关于核准广发全球医疗保健指数证券投资基金募集的批复》批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2013年12月10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,基金托管人为广发银行股份有限公司,境外资产托管人为美国花旗银行有限公司。

本基金募集期为2013年11月4日至2013年12月3日,本基金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245,670,387.48元,有效认购户数为3,903户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币17,496.14元,折合基金份额17,496.14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》、《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全球证券市场中的标普全球1200医疗保健指数成份股、备选成份股、以标普全球1200医疗保健指数为投资标的的指数基金(包括 ETF)、新股(一级市场初次发行或增发)等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证(可简称"REITs");已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金业绩比较基准为人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。

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

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2014年12月31日及2013年12月31日的财务状况以及2014年度及2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间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。可比期间的会计年度为2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年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、基金投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资、债券投资和基金投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

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

2.金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 基金投资

买入基金于交易日按基金的公允价值入账,相关的交易费用直接计入当期损益。

卖出基金于交易日确认基金投资收益,卖出基金按移动加权平均法结转成本。

(4) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

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

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

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

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

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

3.其他金融负债

卖出回购金融资产款

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但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,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2. 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

3. 当金融工具不存在活跃市场,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公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债,其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

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、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

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。

2.投资收益

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

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

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

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

(5) 股利收益和基金分红收益于除息日确认,并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票和基金上市所在地适用的预交所得税后的净额入账。

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。

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×0.80%的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率逐日计提。

3. 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。

4. 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、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

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

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。对于外币认购、申购的份额,由于汇率因素影响,存在收益分配后外币折算净值低于对应的基金份额面值的可能;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同。美元收益分配金额按除权前一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算为相应的美元金额;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额直接计入汇兑收益项目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额作为公允价值变动处理,直接计入当期损益。

7.4.4.13 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

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》,同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

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[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1. 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、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. 基金取得的源自境外的收入,其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
广发银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
美国花旗银行有限公司	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司(注)	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
广州科技风险投资有限公司	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

注:广发证券股份有限公司于2014年7月31日对广发基金管理有限公司进行增资,并对其实施控制,广发基金管理有限公司由此成为广发证券股份有限公司的子公司。

除此之外,本报告期内及上年度可比期间不存在其他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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金,本报告期末及上年度末无应付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,341,915.06	113,607.23
其中:支付销售机构的客户维护费	286,270.95	22,169.58

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.80%÷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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	419,348.44	35,502.26

注:本基金的托管费(含境外托管人的托管费)按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。

7.4.8.3 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交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末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。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年12月10日(基金合同生效日)至2013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
广发银行股份有限公司	8,913,264.72	89,528.07	4,961,932.96	34,788.00
美国花旗银行有限公司	3,162,466.76	102.09	3,388,652.85	–

注:本基金的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司和境外资产托管人美国花旗银行有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 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参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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2014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证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014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。

7.4.10 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2014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228,095,779.28元,无属于第二层级和第三层级的余额。(2013年12月31日:第一层级59,310,563.94元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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股票和债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股票和债券的公允价值列入第一层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	224,320,519.53	92.24
	其中:普通股	224,320,519.53	92.24
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	3,775,259.75	1.55
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	12,075,731.48	4.97
8	其他各项资产	3,023,438.33	1.24
9	合计	243,194,949.09	100.00

8.2 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	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	3,775,259.75	1.58
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–

8.3 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	147,390,783.16	61.52
瑞士	26,195,167.72	10.93
英国	14,390,610.06	6.01
德国	9,525,334.80	3.98
法国	7,586,337.38	3.17
日本	7,389,333.06	3.08
丹麦	5,312,493.98	2.22
加拿大	3,144,134.69	1.31
澳大利亚	2,836,441.38	1.18
比利时	549,883.30	0.23
合计	224,320,519.53	93.63

注:国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

8.4 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	–	–
材料	–	–
工业	–	–
非必须消费品	–	–
必须消费品	–	–
保健	224,320,519.53	93.63
金融	–	–
信息技术	–	–
电信服务	–	–
公共事业	–	–
合计	224,320,519.53	93.63

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	26,212.00	16,772,110.71	7.00
2	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN VX	瑞士证券交易所	瑞士	25,171.00	14,315,490.72	5.98
3	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	58,857.00	11,218,547.37	4.68
4	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG VX	瑞士证券交易所	瑞士	6,532.00	10,857,202.32	4.53
5	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	26,801.00	9,313,294.17	3.89
6	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	14,047.00	8,101,985.68	3.38
7	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,048.00	6,869,653.95	2.87
8	BAYER AG-REG	拜耳股份有限公司	BAYN GR	德国证券交易所	德国	7,725.00	6,508,179.63	2.72
9	SANOFI	赛诺菲安万特公司	SAN FP	巴黎证券交易所	法国	11,201.00	6,318,379.89	2.64
10	GLAXO-SMITHK-LINE PLC	葛兰素史克公司	GSK LN	伦敦证券交易所	英国	45,511.00	5,976,564.23	2.49

注:本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

8.6 报告期内权益投资组合的重大变动

8.6.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	14,363,520.96	5.79
2	NOVARTIS AG-REG	NOVN VX	12,785,595.95	5.16
3	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	ROG VX	11,194,775.39	4.51
4	PFIZER INC	PFE US	10,059,499.75	4.06
5	MERCK & CO. INC.	MRK US	8,211,072.62	3.31
6	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	6,937,871.75	2.80
7	SANOFI	SAN FP	6,270,656.55	2.53
8	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	6,252,950.71	2.52
9	BAYER AG-REG	BAYN GR	5,958,595.59	2.40
10	AMGEN INC	AMGN US	5,231,057.85	2.11
11	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	4,603,853.90	1.86
12	ABBVIE INC	ABBV US	4,542,322.80	1.83
13	ASTRAZENECA PLC	AZN LN	4,471,899.46	1.80
14	NOVO NORDISK A/S-B	NOVOB DC	4,231,905.12	1.71
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	4,163,756.49	1.68
16	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	3,822,980.21	1.54
17	CELGENE CORP	CELG US	3,775,410.47	1.52
18	ACTAVIS PLC	ACT US	3,211,540.53	1.30
19	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	3,148,322.12	1.27
20	MEDTRONIC INC	MDT US	3,137,742.54	1.27

注:本项及下项8.5.2、8.5.3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。

8.6.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	3,004,310.32	1.21
2	NOVARTIS AG-REG	NOVN VX	2,730,278.87	1.10
3	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	ROG VX	2,531,453.57	1.02
4	PFIZER INC	PFE US	2,323,786.17	0.94
5	MERCK & CO. INC.	MRK US	1,822,398.40	0.73
6	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,541,429.93	0.62
7	SANOFI	SAN FP	1,099,449.40	0.44
8	AMGEN INC	AMGN US	1,073,538.36	0.43
9	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	1,052,951.33	0.42
10	BAYER AG-REG	BAYN GR	994,070.84	0.40
11	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	961,449.09	0.39
12	FOREST LABORATORIES	FRX US	948,487.82	0.38
13	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	942,596.65	0.38
14	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	4502 JP	937,733.66	0.38
15	ASTRAZENECA PLC	AZN LN	918,547.72	0.37
16	ABBVIE INC	ABBV US	913,109.27	0.37
17	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	912,951.44	0.37
18	NOVO NORDISK A/S-B	NOVOB DC	906,747.72	0.37
19	CSL LTD	CSL AU	803,548.90	0.32
20	CELGENE CORP	CELG US	795,757.45	0.32

8.6.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	195,550,319.35
卖出收入(成交)总额	45,167,998.87

8.7 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	3,775,259.75	1.58
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–

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本期未出现被监管部门立案调查,也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2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。

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	236,297.65
4	应收利息	1,882.74
5	应收申购款	2,505,027.02
6	其他应收款	119,464.11
7	待摊费用	160,766.81
8	其他	–
9	合计	3,023,438.33

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未存在流通受限情况。

§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
9,939	20,702.93	75,484,004.25	36.68%	130,282,435.85	63.32%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,999,650.56	1.9438%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年12月10日)基金份额总额	245,670,387.48
本报告期期初基金份额总额	245,670,387.48
本报告期基金总申购份额	253,165,596.11
减:本报告期基金总赎回份额	293,069,543.49
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	205,766,440.10

§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

2014年8月8日,陈伯军因工作调动不再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日,本基金管理人聘任包林生为公司副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

本基金托管人于2014年5月5日在《上海证券报》发布公告,由寻卫国先生担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理,原总经理禄金山先生另有任用。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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	
Morgan Stanley	–	17,770,944.10	7.42%	9,790.94	8.22%	–
Citigroup	–	41,912,576.96	17.50%	12,630.08	10.61%	–
Goldman Sachs Group Inc.	–	50,229,498.47	20.98%	35,160.49	29.54%	–
State Street Global Markets International Ltd.	–	129,528,935.68	54.10%	61,459.54	51.63%	–
China International Capital Corporation Limited	–	–	–	–	–	–
Credit Suisse	–	–	–	–	–	–
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	–	–	–	–	–	–

注:1、为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

i.财务状况良好,经营状况稳定,信誉良好,符合监管标准;

ii.研究实力较强,分析报告质量高,准确及时,同时报告覆盖范围广泛;

ⅲ.交易执行能力强,交易效率高,能保证较佳成交价格,及时反馈交易结果;

iv.清算和交割能力强,能确保流程顺畅以及结果准确;

v.能与服务匹配的合理的佣金和收费标准;

vi.经营行为规范,有健全的内部控制制度;

vii.具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序:

i.本基金管理人组织相关部门人员,根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用的交易单元经纪商。

ii.本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议,并通知基金托管人。

iii.本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分,可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易,佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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		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
Morgan Stanley	–	–	–	–	–	–	7,293,619.35	75.43%
State Street Global Markets International Ltd.	–	–	–	–	–	–	2,375,393.75	24.57%

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据广发基金管理有限公司2014年度股东会第四次会议决议,公司的注册资本由人民币12000万元增加至人民币12688万元,公司股东广发证券股份有限公司认购全部新增注册资本688万元。自此,广发证券股份有限公司的持股比例由原来的48.33%增加至51.13%,其他股东的持股比例相应调整。详见2014年8月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和广发基金管理有限公司网站(http://www.gffunds.com.cn)上刊登的《广发基金管理有限公司关于注册资本及股东出资比例变更的公告》。

广发基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日