广发集鑫债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§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2015年4月15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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发集鑫债券
基金主代码	000473
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月27日
报告期末基金份额总额	59,826,127.11份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过灵活的资产配置,力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	(一)大类资产配置策略 本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。 (二)债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济走势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。 (三)股票投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下,本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资,以增加基金收益。 (四)权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值,本基金将对权证标的证券的基本面进行研究,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行定价。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:中债总全价指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
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

下属分级基金的基金简称	广发集鑫债券A	广发集鑫债券C
下属分级基金的交易代码	000473	000474
报告期末下属分级基金的份额总额	24,431,443.28份	35,394,683.83份

§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(2015年1月1日-2015年3月31日)	
	广发集鑫债券A	广发集鑫债券C
1.本期已实现收益	203,203.01	223,012.48
2.本期利润	155,228.89	-101,505.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063	-0.0051
4.期末基金资产净值	25,772,317.52	37,568,215.71
5.期末基金份额净值	1.055	1.061

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和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.广发集鑫债券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	0.57%	0.25%	-0.57%	0.12%	1.14%	0.13%

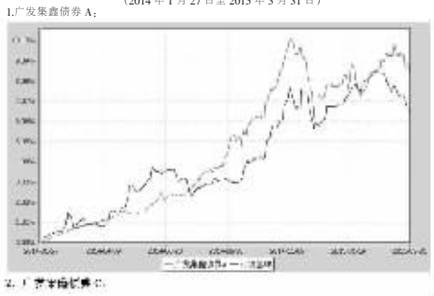
2.广发集鑫债券C:

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	0.66%	0.24%	-0.57%	0.12%	1.23%	0.12%

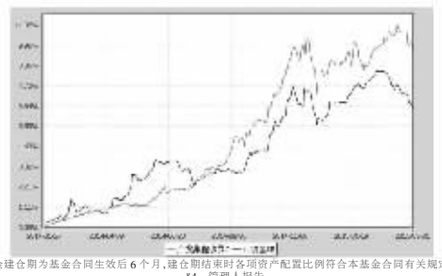
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集鑫债券型证券投资基金
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
(2014年1月27日至2015年3月31日)

1.广发集鑫债券A:



2.广发集鑫债券C:



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发财年年红债券基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发钱袋子货币基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发季季利债券基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理	2014-01-27	-	7年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员,2012年7月19日起任广发理财年年红债券基金的基金经理,2012年9月20日起任广发双债添利债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发集鑫债券型证券投资基金和广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日起任广发季季利债券基金的基金经理,2015年1月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理,2015年3月25日起任广发聚宝混合基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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、《广发集鑫债券型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 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,公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来,债市延续了去年年底的反弹行情,收益率曲线平坦化下行,隐含了强烈的降准、降息预期。这一市场一致预期事后被证明是正确的,央行在2月5日宣布降准,接着又在3月1日宣布降息,但债券市场也由于利好出尽而上涨乏力,陷入调整。在3月中下旬,受地方政府债务供给增加、股市火爆等不利因素影响,债市加速下跌。总体来看,一季度债券收益率先下后上,收益率曲线较年初陡峭化上移。

一季度股市大幅上涨并伴随明显的风格切换,与去年底大股票强、小股票弱的风格相反,以创业板指数为代表的科技股大幅上涨,而传统蓝筹股则陷入溢涨和调整。在3月两会后,受管理层利好股市言论影响,资金加速涌入股市,各板块全面上涨,受股市影响,转债市场也表现良好。

考虑到资金面和供给面的不确定性,本基金在一季度的债券操作上控制了组合久期和杠杆,主要配置在短久期信用债和高息存款上,以获取票息收益为主,保证债券部分收益的稳定性,同时适度配置了转债和股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发集鑫A类净值增长率为0.57%,广发集鑫C类净值增长率为0.66%,同期业绩比较基准收益率为-0.57%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场经历了一季度的调整后,目前的收益率水平较年初上升,配置价值有所提升,但利多、利空因素交织,债券收益率将呈现区间波动格局。一方面存在对债市不利的种种因素:股市上涨的赚钱效应通过打新基金等形式分流债券配置资金;IPO对资金面造成阶段性扰动,并提升全市场无风险利率水平;地方政府债扩容增加利率品种供给;在政府出台各类稳经济的政策帮助下,短期内经济有望企稳等;另一方面,管理层降低社会融资成本的意图明显,不断出手平滑短期资金面波动,过高的利率水平不符合政策导向,因此在二季度,本基金在债券操作上将保持灵活,在获取票息的基础上捕捉阶段性机会。

展望二季度,股市的牛市格局不变,但经历了一季度的大幅上涨,可能将再次面临风格切换的选择。可转债方面,存量品种大幅减少,与正股相关性减弱,呈现滞涨趋势,机会更多的存在于新发品种上。本基金在权益品种操作上将保持谨慎,在做好大类风格配置的前提下精选品种,确保净值平稳增长。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金于2015年1月1日至2015年2月26日连续34个工作日出现资产净值低于五千万。

§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	1,595,880.00	1.99
	其中:股票	1,595,880.00	1.99
2	固定收益投资	63,578,059.80	79.33
	其中:债券	63,578,059.80	79.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	13,075,049.03	16.31
7	其他各项资产	1,894,493.91	2.36
8	合计	80,143,482.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,595,880.00	2.52
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,595,880.00	2.52

5.3 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	601318	中国平安	12,000	938,880.00	1.48
2	601988	中国银行	150,000	657,000.00	1.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,599,120.20	4.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	52,752,200.00	83.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,226,739.60	12.99
8	其他	-	-
9	合计	63,578,059.80	100.37

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13铁龙01	112,500	11,362,500.00	17.94
2	1480356	14旗投债	100,000	10,335,000.00	16.32
3	122067	11南钢债	90,000	9,046,800.00	14.28
4	122276	13魏桥01	53,000	5,555,460.00	8.77
5	122921	10郴州债	48,000	4,907,520.00	7.75

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,030.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,750,851.96
5	应收申购款	134,611.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,894,493.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110011	歌华转债	1,006,969.60	1.59
2	110023	民生转债	686,350.00	1.08
3	110028	冠城转债	648,840.00	1.02

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发集鑫债券A	广发集鑫债券C
本报告期期初基金份额总额	26,076,232.43	11,400,036.81
本报告期基金总申购份额	5,573,721.07	32,912,858.67
减:本报告期基金总赎回份额	7,218,510.22	8,918,211.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,431,443.28	35,394,683.83

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会批准广发集鑫债券型证券投资基金募集的文件;
2.《广发集鑫债券型证券投资基金基金合同》;
3.《广发集鑫债券型证券投资基金托管协议》;
4.《广发集鑫债券型证券投资基金托管协议》;
5.法律意见书;
6.基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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

8.3 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。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年四月二十日

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3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:二〇一五年四月二十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月15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2015年1月8日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指信息技术ETF
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
报告期末基金份额总额	400,828,053.00份
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。
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

§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(2015年1月8日(基金合同生效日)-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	18,198,177.51
2.本期利润	114,055,492.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.3324
4.期末基金资产净值	540,649,451.39
5.期末基金份额净值	1.3488

注:(1)本基金合同生效日为2015年1月8日,至披露时点不满一季度。

(2)所述基金财务指标不包括持有人认购和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。

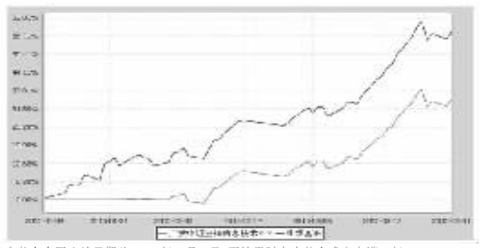
3.2 基金净值表现

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

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	34.88%	1.56%	58.45%	1.88%	-23.57%	-0.32%

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

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年1月8日至2015年3月31日)



注:(1)本基金合同生效日为2015年1月8日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后3个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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		
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理;广发深100指数分级基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;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;数量投资部总经理	2015-01-08	-	16年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年8月9日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理,2011年6月3日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金的基金经理,2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理,2015年1月8日起任广发中证全指信息技术联接基金的基金经理,2015年1月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年3月23日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理。

注:备注

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 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。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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建仓、申购、赎回和成份股调整因素,作为ETF基金,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为31.76%,同期业绩比较基准收益率为33.18%,较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年1季度,整体市场延续了上涨趋势,全指信息指数上涨63.58%,位列市场前列,同期中小板、创业板涨幅靠前,大盘蓝筹涨幅靠后,差异明显,市场存在轮动效应,牛市行情得到市场认可。

展望2季度,在宏观经济继续呈现弱势运行的情况下,政府依旧会推进结构调整,行业改革的宏观政策,为未来经济的健康持续发展做铺垫,同时政府也希望通过股市进行配合,因此未来市场总体向上的趋势未发生变化。

工业4.0和互联网+说明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。

§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	514,070,520.11	94.59
	其中:股票	514,070,520.11	94.59
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	26,500,504.17	4.88
7	其他各项资产	2,907,730.88	0.54
8	合计	543,478,755.16	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	262,584,277.77	48.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	248,049,135.62	45.88
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	-	-
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	-	-
S	综合	3,417,750.00	0.63
	合计	514,051,163.39	95.08

5.3 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	600570	恒生电子	124,060	13,507,652.80	2.50
2	600804	鹏博士	379,360	12,386,104.00	2.29
3	000725	京东方A	2,581,100	10,401,833.00	1.92
4	002415	海康威视	311,586	9,565,690.20	1.77
5	300104	乐视网	101,800	9,540,696.00	1.76
6	300059	东方财富	266,049	7,827,161.58	1.45
7	600100	同方股份	450,400	7,391,064.00	1.37
8	002230	科大讯飞	140,800	7,321,600.00	1.35
9	600588	用友网络	142,500	6,505,125.00	1.20
10	000503	海虹控股	141,300	6,504,039.00	1.20

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 鹏博士电信传媒集团股份有限公司(股票代码:600804)于2014年10月24日收到中国证券监督管理委员会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司出具警示函措施的决定》,就公司在过去2011-2014年三个年度对现金流量表的部分项目归类出现错误被进行警示并责令整改。

本基金投资该公司的主要原因是:1、公司是中国第四大固网通信运营商,这几年业务发展呈现高速增长状况。2、运营商具备向互联网业务发展的天然潜质,公司在家庭互联网、云计算等方向做出了诸多努力。3、因为智能家居的发展以及涉及家庭重大开支决策的教育、医疗业务出现互联网的发展趋势,我们认为家庭这一场景将会成为互联网公司的重要战略点,另一家上市公司乐视网发展智能电视证明了这一趋势。总的老说,鹏博士具备良好发展的基本面,庞大用户资源的禀赋、处于互联网下一战略要地,所以进入了较好的投资时点。证监局出具的警示函,与公司基本面无关,也非公司主观意愿,因此并不过多影响投资决策。

除上述证券外,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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	202,848.72
2	应收证券清算款	2,629,453.96
3	应收股利	-
4	应收利息	5,233.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	70,194.92
8	其他	-
9	合计	2,907,730.88

5.11.4 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。

5.11.5 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	300059	东方财富	7,827,161.58	1.45	重大事项
2	000503	海虹控股	6,504,039.00	1.20	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	354,828,053.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	274,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	228,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	400,828,053.00

§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 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 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。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年四月二十日

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:二〇一五年四月二十日

广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月15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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指医药卫生ETF
基金主代码	159938
交易代码	159938
基金运作方式