广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§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7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4月15日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚惠混合	
基金主代码	001206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月15日	
报告期末基金份额总额	10,354,292,385.15份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	(一)大类资产配置 本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。 (二)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。 (三)债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济态势、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。 (四)金融衍生品投资策略	
业绩比较基准	三年期定期存款利率(税后)+1%。	
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。	
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	广发聚惠混合A	广发聚惠混合C:
下属分级基金的交易代码	001206	001207
报告期末下属分级基金的份额总额	10,137,868,478.03份	216,423,907.12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4月15日(基金合同生效日)-2015年6月30日)	
	广发聚惠混合A	广发聚惠混合C:
1.本期已实现收益	124,531,110.78	2,033,122.99
2.本期利润	206,388,465.45	6,259,140.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0300
4.期末基金资产净值	10,462,249,480.71	222,872,778.77
5.期末基金份额净值	1.032	1.030

注:(1)本基金合同生效日为2015年4月15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

1、广发聚惠混合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	3.20%	0.26%	0.98%	0.00%	2.22%	0.26%

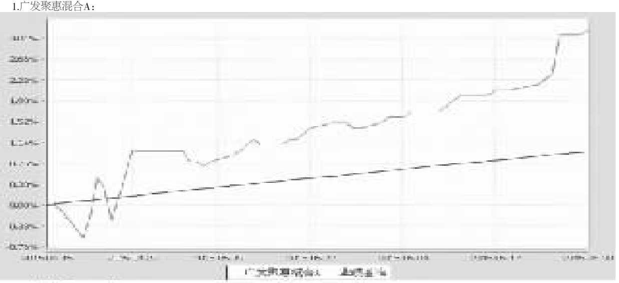
2、广发聚惠混合C::

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	3.00%	0.27%	0.98%	0.00%	2.02%	0.27%

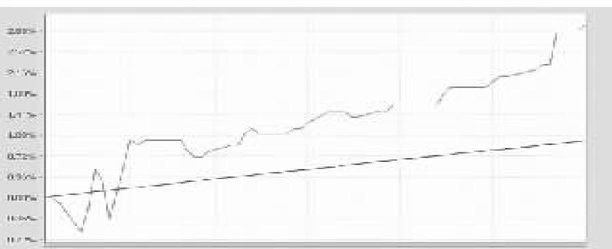
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金
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
(2015年4月15日至2015年6月30日)

1.广发聚惠混合A:



2.广发聚惠混合C:



注:(1)本基金合同生效日期为2015年4月15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		
代宇	本基金的基金经理;广发聚利债券基金的基金经理;广发聚财信用债券基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理;广发集利一年定期开放债券基金的基金经理;广发成长优选混合基金的基金经理;广发安泰回报混合基金的基金经理;广发安心回报混合基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理	2015-04-15	-	10年	女,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书,2005年7月至2011年6月先后任广发基金管理有限公司固定收益部研究员及交易员、国际业务部研究员、机构投资部专户投资经理,2011年7月调入固定收益部任投资人员,2011年8月5日起任广发聚利债券基金的基金经理,2012年3月13日起任广发聚财信用债券基金的基金经理,2013年6月5日起任广发聚鑫债券基金的基金经理,2013年8月21日起任广发集利一年定期开放债券基金的基金经理,2015年2月17日起任广发成长优选混合基金的基金经理,2015年4月15日起任广发聚惠混合基金的基金经理,2015年5月14日起任广发安泰回报混合基金和广发安心回报混合基金的基金经理,2015年5月27日起任广发双债添利债券基金的基金经理。

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、《广发聚惠灵活配置混合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。

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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

2015年第2季度,股市冲高回落,总体上涨,债券市场也最终上涨,但是期间震幅不小。

国内实体经济数据维持于弱势。对政策取向的博弈和资金面主导了资本市场走势。而恰恰二季度政策动作频频,某种程度加剧了债市波动。央行在4月超预期大幅降准,公开市场连续下调逆回购利率,紧接着5月初降息,债券收益率应声而跌,十年国开最低下探到3.77%,交投热情高涨;5月底定向正回购,6月初PSL提供资金,但是宽松的边际效应减弱,地方债供给放大的担忧重新占据主导,收益率筑底回调,十年国开最高大概在4.13%附近,6月末续作中期借贷便利(MLF),6月定向降准并降息,同期股市暴跌,债券收益率才重新下行回稳。

值得注意的是,长短收益率在第二季度分化明显,短端收益率在央行持续的宽松政策刺激下,收益率大幅下行;中长端收益率呈"V"型走势,表现为"4月下行、5月上行、6月震荡"的盘面。期限利差频创新高。

股市持续火爆,上证本季创下了5178点的阶段新高,6月13日掉头向下,半个月时间急跌近20%。

截至6月30日,中债综合净价指数上涨1.2%。分品种看,中债国债总净价指数上涨1.27%;中证金融债净价指数上涨1.33%;中证企业债净价指数上涨1.25%。上证综合股指数上涨7.75%。

本基金成立于本季度,成立初期主要通过债券和新股操作积累安全垫,以保证净值平稳增长。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发聚惠A类净值增长率为3.2%,广发聚惠C类净值增长率为3.0%,同期业绩比较基准收益率为0.98%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第3季度,我们认为债券市场的表现将会比较平淡,利率风险虽不大,但是有十分亮眼表现的可能也不大,信用债的分化会继续显著。

2015年第3季度经济预计依旧低迷,通缩风险仍在,经济基本面变化不大,债市的走势更多取决于政策面和资金面。从政策面来看,需求不振的前提下,货币政策走势有望能保持一贯性。但是资金面注定面临两难,一方面,为了转型的顺利进行,主观上不能允许货币市场利率超预期走低,而利率市场化尚未成熟,客观上全社会负债成本难以快速下行;另一方面,为了稳定股市,回顾央行近一个星期的"放水"操作:重启逆回购、增量续作MLF、定向降准和降息、逆回购和降息等,又证伪了宽松的货币政策边际上转向的可能。政府对经济和资本市场托底决心不变,而央行会坚决配合,无论在量上还是在价上。

从长远来看,债市可能持续牛皮市,区间震荡。从基本面来说,强力度维稳使得经济企稳的概率在悄悄增大,积极的财政政策带来的融资需求增加将持续成为悬在债市头顶的利剑,再加上美国九月加息概率很大,使得债券市场的长端下降得特别犹豫,另一方面,央行不管是着意还是被迫维持的货币市场持续宽松,必将使得短久期资产的收益率持续下滑或者保持低位。期限利差屡创新高,难以缩窄,长端波动继续。在这样的背景下,稳健的组合套息依旧可为,积极的组合可在套息基础上适当拉长久期。

股市的急跌使得机会更多。但是可转债市场已经萎缩不少,存量转债也都不算便宜,我们认为可以根据不同产品的风险收益属性差别配置。

第3季度我们计划维持仓位,控制久期,梳理结构,重点在于持有票息。同时密切关注市场机会的变化,择机调整策略,力保组合净值平稳增长。

§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	244,395,724.52	2.29
	其中:股票	244,395,724.52	2.29
2	固定收益投资	2,023,575,718.20	18.92
	其中:债券	2,023,575,718.20	18.92
	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	4,344,650,399.52	40.63
	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	3,956,432,142.61	37.00
7	其他各项资产	125,027,132.49	1.17
8	合计	10,694,081,117.34	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	43,420.05	0.00
B	采矿业	24,750.00	0.00
C	制造业	50,588,178.96	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,900,887.61	0.48
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	4,945,600.44	0.05
J	金融业	134,814,066.74	1.26
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	52,104.72	0.00
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	3,026,716.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	244,395,724.52	2.29

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	601211	国泰君安	3,925,861	134,814,066.74	1.26
2	601985	中国核电	3,631,003	47,457,209.21	0.44
3	600978	宜华木业	1,230,000	27,601,200.00	0.26
4	300267	尔康制药	515,062	17,558,463.58	0.16
5	000839	中信国安	150,000	3,535,500.00	0.03
6	002739	万达院线	12,400	3,026,716.00	0.03
7	000539	粤电力A	252,360	3,013,178.40	0.03
8	000063	中兴通讯	114,800	2,733,388.00	0.03
9	002030	达安基因	45,120	1,998,816.00	0.02
10	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01

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	186,374,019.20	1.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,522,361,901.00	14.25
	其中:政策性金融债	1,522,361,901.00	14.25
4	企业债券	74,697,000.00	0.70
5	企业短期融资券	159,884,000.00	1.50
6	中期票据	79,416,000.00	0.74
7	可转债	842,798.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	2,023,575,718.20	18.94

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	150204	15国开04	1,700,000	167,008,000.00	1.56
2	150405	15农发05	1,500,000	147,510,000.00	1.38
3	150210	15国开10	1,400,000	141,302,000.00	1.32
4	150307	15进出07	1,200,000	120,876,000.00	1.13
5	150206	15国开06	1,000,000	100,920,000.00	0.94

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	43,461.00
2	应收证券清算款	95,124,108.38
3	应收股利	-
4	应收利息	29,859,563.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,027,132.49

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	600978	宜华木业	27,601,200.00	0.26	重大事项
2	000839	中信国安	3,535,500.00	0.03	重大事项
3	002739	万达院线	3,026,716.00	0.03	重大事项
4	000539	粤电力A	3,013,178.40	0.03	重大事项
5	300467	迅游科技	1,107,739.80	0.01	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发聚惠混合A	广发聚惠混合C:
基金合同生效日基金份额总额	915,475.82	202,256,153.43
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	13,577,552,814.25	18,588,995.83
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,440,599,812.04	4,421,242.14
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,137,868,478.03	216,423,907.12

注:本基金于本报告期间成立,基金合同生效日为2015年4月15日。

§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聚惠灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
(二)《广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(四)《广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

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
二〇一五年七月二十一日

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§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7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发生物科技指数(QDII)
基金主代码	001092
交易代码	001092
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月30日
报告期末基金份额总额	629,596,910.25份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,紧密跟踪纳斯达克生物科技指数,力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化,为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。
投资策略	(一)资产配置策略本基金为被动管理的指数型基金,在正常情况下,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0.5%以内,年跟踪误差控制在5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。(二)权益类投资策略 股票组合构建方法本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数,以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。(三)固定收益类投资策略(四)衍生品投资策略
业绩比较基准	95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率+5%×人民币活期存款收益率(税后)。
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。本基金为被动管理的指数型基金,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

§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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	4,413,405.45
2.本期利润	27,270,805.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0293
4.期末基金资产净值	650,365,398.76
5.期末基金份额净值	1.033

注:注:1、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。

2、上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。

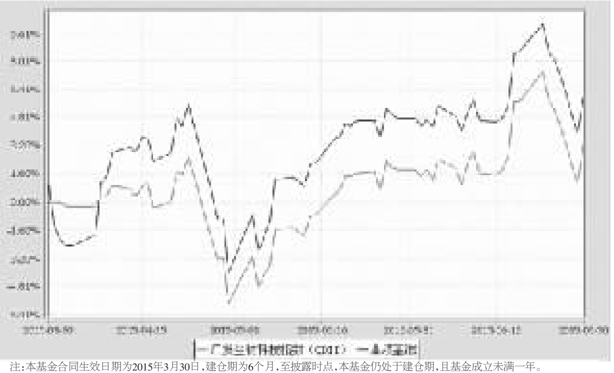
3.2 基金净值表现

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	3.30%	1.22%	7.38%	1.34%	-4.08%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月30日至2015年6月30日)



注:本基金合同生效日期为2015年3月30日,建仓期为6个月,至披露时点,本基金仍处于建仓期,且基金成立未满一年。

§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		
邱炜	本基金的基金经理;广发全球农业指数(QDII)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;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;国际业务部副总经理;另类投资部副总经理	2015-03-30	-	8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,2015年1月14日起任广发基金管理有限公司另类投资部副总经理,2015年3月30日起任广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理,2015年6月10日起任广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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、《广发纳斯达克生物科技指数型发起式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。

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

二季度初,在企业盈利超预期和药企重磅药临床数据的利好推动下,纳指生物科技指数在4月上半月反弹,从一季度末希腊问题导致的美股低迷局面中走出来。但是4、5月份是药物临床数据发布的高峰期,生物科技企业此时波动巨大。四月末,基因疗法公司Celladon二期临床试验失败导致了市场对基因疗法的前景产生担忧,生物科技企业被大幅抛售。但是一两个公司的试验数据并不代表整个行业情况,抛售很快结束。随着恐慌抛售潮结束,生物科技板块重拾升势,并在美联储6月推迟加息后再次创出历史新高。

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3.30%,同期比较业绩基准收益率为7.38%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,生物科技行业仍然是美国经济复苏中高速增长的行业,但是需要关注希腊问题和中国股市流动性问题对全球风险偏好的影响,目前来看希腊问题和中国股市流动性问题是三季度最重要的风险因素。希腊的大选结果表明希腊可以获得债权人让步的可能性十分小,意味着希腊退出欧元区的风险剧增。虽然希腊退欧没有2011年的时候影响大,但是还是会对金融市场产生冲击,短期市场会受到卖压。但是我们相信市场对这一点已经消化了很多,现在的欧洲央行有足够的流动性去应对希腊违约以及退欧的影响。而中国也是世界第二个影响市场的风险因素,虽然我们认为中国有能力解决股市的流动性风险,但是短期的冲击会对投资者的短期风险偏好产生影响。但是对于生物科技指数的投资可以不必担心,从美国生物科技行业的基本面来看,今年生物科技行业的整体收入和利润增速仍然保持高增长,重要药物的临床试验数据也是大部分符合市场预期,未来随着时间的推移,指数的增长将会追随企业盈利的增长。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	546,472,168.68	80.45
	其中:普通股	533,559,731.33	78.55
	存托凭证	12,912,437.35	1.90
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	68,432,249.33	10.07
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	24,816,112.43	3.65
8	其他各项资产	39,548,635.28	5.82
9	合计	679,269,165.72	100.00

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	546,472,168.68	84.03
合计	546,472,168.68	84.03

注:注:1、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。

2、上述美国比重包括注册地为英国、法国在美国上市的ADR。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	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	546,472,168.68	84.03
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	546,472,168.68	84.03

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及存托凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	65,931.00	47,192,110.17	7.26
2	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	16,666.00	41,157,146.71	6.33
3	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	43,279.00	40,619,932.70	6.25
4	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克证券交易所	美国	56,166.00	39,740,674.32	6.11
5	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	12,565.00	39,186,852.10	6.03
6	MYLAN NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达克证券交易所	美国	63,225.00	26,230,085.95	4.03
7	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	22,065.00	24,385,255.49	3.75
8	ILLUMINA INC	Illumina公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	17,462.00	23,311,170.98	3.58
9	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	维特制药股份有限公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	28,577.00	21,572,986.71	3.32
10	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	BioMarin 制药股份有限公司	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	20,541.00	17,176,758.21	2.64

5.5报告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。

5.6报告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

5.7报告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。

5.8报告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投资。

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十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRA NASD BIOTECH	ETF	契约型开放式	ProShares Trust	68,432,249.33	10.52

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	29,528,527.64
3	应收股利	-
4	应收利息	4,572.58
5	应收申购款	3,810,635.06
6	其他应收款	6,204,900.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,548,635.28

5.10.4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。

5.10.5 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

报告期期初基金份额总额	1,051,001,960.92
本报告期基金总申购份额	80,304,555.75
减:本报告期基金总赎回份额	501,709,606.42
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	629,596,910.25

§7 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	10,000,200.02	1.59%	10,000,200.02	1.59%	三年
基金管理人高级管理人员	494,589.84	0.08%	-	-	-
基金经理等人员	1,004,016.54	0.16%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,498,806.40	1.83%	10,000,200.02	1.59%	三年

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会准予广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金募集注册的文件
(二)《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》
(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(四)《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

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。

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
二〇一五年七月二十一日

广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§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7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发环保指数
基金主代码	001064
交易代码	001064
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月25日
报告期末基金份额总额	1,219,890,758.03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	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	本基金以中证环保产业指数为标的指数。
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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	309,733,857.23
2.本期利润	265,978,946.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.1257
4.期末基金资产净值	1,249,814,886.52
5.期末基金份额净值	1.0245

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。

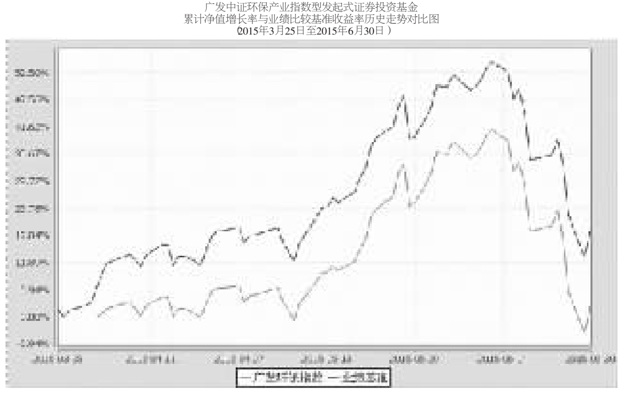
3.2 基金净值表现

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

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	2.44%	3.19%	15.61%	2.88%	-13.17%	0.31%

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

广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金
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3月25日至2015年6月30日)



注:注:(1)本基金合同生效日期为2015年3月25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,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		
季峰	本基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;广发养老指数基金的基金经理;数据策略投资部副总经理	2015-03-25	-	6年	男,中国籍,管理学博士,持有基金业执业资格证书,2009年8月至2011年8月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作,2011年9月至2014年10月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员,2014年10月21日任广发中证全指可选消费ETF的基金经理,2014年11月24日起任广发百发100指数基金的基金经理,2015年2月13日起任广发养老指数基金的基金经理,2015年3月18日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理,2015年3月25日起任广发环保指数基金的基金经理。

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 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、《广发中证环保产业指数型发起式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。

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

作为指数基金,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,本基金处于建仓期,期间整体市场上涨较快,建仓期相对于目标指数,基金投资操作处于不利地位。

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2.44%,同期业绩比较基准收益率为15.61%。

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6月中下旬,受场外配资以及创业板高估值等因素影响,沪深市场出现了强烈的短期下挫;截至7月中旬,整体市场恐慌情绪得到有效遏制,市场中短期处于触底反弹阶段。中证环保指数二季度涨幅16.43%。

我们认为6月底7月初,整体市场存在过度悲观的情绪,而随着现代通讯技术的进步,也进一步导致了过度恐慌,进而体现为诸多股票流动性的极度枯竭,而流动性枯竭会导致估值非理性降低,抑制股价。

中短期内,整体市场依然处于反弹恢复阶段,环保行业也将存在中短期投资机会。

§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	1,209,640,677.82	87.74
	其中:股票	1,209,640,677.82	87.74
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	62,543,047.47	4.54
7	其他各项资产	106,539,623.72	7.73
8	合计	1,378,723,349.01	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	10,719,273.15	0.86
C	制造业	831,906,445.67	66.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	170,404,991.12	13.63
E	建筑业	79,953,246.45	6.40
F	批发和零售业	11,459,748.16	0.92
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	21,210,935.48	1.70
J	金融业	10,481,562.00	0.84
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	1,612.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	73,502,862.99	5.88
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	1,209,640,677.82	96.79

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	000786	北新建材	1,750,884	33,494,410.92	2.68
2	300203	聚光科技	799,206	32,919,295.14	2.63
3	002080	中材科技	1,364,197	31,690,296.31	2.54
4	300323	华灿光电	2,448,397	26,075,428.05	2.09
5	002203	海亮股份	1,994,030	23,589,374.90	1.89
6	300197	铁汉生态	762,777	21,090,784.05	1.69
7	002310	东方园林	647,932	18,511,417.24	1.48
8	600416	湘电股份	1,005,916	18,056,192.20	1.44
9	601877	正泰电器	571,493	17,956,310.06	1.44
10	002630	华西能源	624,100	16,856,941.00	1.35

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	1,190,488.66
2	应收证券清算款	93,773,670.06
3	应收股利	-
4	应收利息	13,686.42
5	应收申购款	11,561,778.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,539,623.72

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	000786	北新建材	33,494,410.92	2.68	重大事项
2	300203	聚光科技	32,919,295.14	2.63	重大事项
3	002080	中材科技	31,690,296.31	2.54	重大事项
4	300323	华灿光电	26,075,428.05	2.09	重大事项
5	002203	海亮股份	23,589,374.90	1.89	重大事项
6	300197	铁汉生态	21,090,784.05	1.69	重大事项
7	002310	东方园林	18,511,417.24	1.48	重大事项
8	600416	湘电股份	18,056,192.20	1.44	重大事项
9	601877	正泰电器	17,956,310.06	1.44	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,790,916,390.08
本报告期基金总申购份额	718,602,392.04
减:本报告期基金总赎回份额	2,289,628,024.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,219,890,758.03

§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	10,000,200.02
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	10,000,200.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.82

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	10,000,200.02	0.82%	10,000,200.02	0.82%	三年
基金管理人高级管理人员	994,315.79	0.08%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,994,515.81	0.90%	10,000,200.02	0.82%	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中证环保产业指数型发起式证券投资基金募集的文件
(二)《广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金合同》
(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(四)《广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

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。

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
二〇一五年七月二十一日