

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:二〇一六年三月二十八日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年3月22日复核了本报告期内财务数据、净值数据、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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摘要。
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。
本报告自2015年3月30日起至12月31日止。

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况), Content (Fund name, manager, etc.).

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.4 境外投资机构和境内资产托管人), Content (Details of foreign investors and custodians).

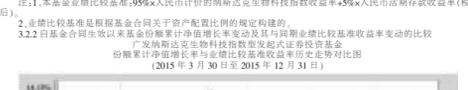
2.5 估值方式
本基金按照《证券投资基金会计核算业务指引》估值。

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要指标
3.1.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item (e.g., 本期基金份额净值增长率), Value.

注1:本基金合同生效日为2015年3月30日,截至报告期末不满一年。
注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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注1:本基金业绩比较基准为:95%人民市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)。
注2:业绩比较基准是根据基金合同资产配置比例确定的指标。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率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发起式证券投资基金业绩比较基准(2015年3月30日至2015年12月31日)



注:本基金合同于2015年3月30日生效,合同生效当期按实际存续计算,不按整个自然年度进行计算。
3.3 本基金的投资组合情况
3.3.1 基金资产组合情况

Table with 2 columns: Item (e.g., 权益投资), Value.

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及基金经理简介

4.1.2 基金经理报告期内变动情况
4.1.3 基金经理报告期内变动原因

4.2 基金管理人报告期内变动情况
4.2.1 基金管理人报告期内变动原因

4.3 基金托管人报告期内变动情况
4.3.1 基金托管人报告期内变动原因

4.4 基金管理人报告期内变动情况
4.4.1 基金管理人报告期内变动原因

4.5 基金管理人报告期内变动情况
4.5.1 基金管理人报告期内变动原因

4.6 基金管理人报告期内变动情况
4.6.1 基金管理人报告期内变动原因

4.7 基金管理人报告期内变动情况
4.7.1 基金管理人报告期内变动原因

4.8 基金管理人报告期内变动情况
4.8.1 基金管理人报告期内变动原因

4.9 基金管理人报告期内变动情况
4.9.1 基金管理人报告期内变动原因

4.10 基金管理人报告期内变动情况
4.10.1 基金管理人报告期内变动原因

4.11 基金管理人报告期内变动情况
4.11.1 基金管理人报告期内变动原因

4.12 基金管理人报告期内变动情况
4.12.1 基金管理人报告期内变动原因

4.13 基金管理人报告期内变动情况
4.13.1 基金管理人报告期内变动原因

4.14 基金管理人报告期内变动情况
4.14.1 基金管理人报告期内变动原因

广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金 2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

本报告期末,本基金净值增长率为1.10%,同期业绩比较基准收益率为1.57%。
4.5 报告期内宏观经济、证券市场及行业走势的回顾展望

回顾2015年,美国及全球股市的波动加剧,中国经济转型和英国加息的节奏成为2015年全年的主题,我们认为在两个宏观背景的叠加下,美国股市将会表现疲弱,欧股的走势则会呈现震荡态势,纳斯达克生物科技指数仍会保持较强的行业景气度,其指数较受受益于全球医药行业,因而预期,美国纳斯达克生物科技指数在2015年仍将保持较强的增长态势,中国股市在2015年仍将保持较强的增长态势。

4.6 报告期内基金投资策略和运作情况的说明
4.6.1 报告期内基金投资策略和运作情况的说明

4.7 报告期内基金业绩比较基准的说明
根据本基金合同中“基金收益与分配”(三)基金收益分配原则”的相关规定,本基金本报告期内进行利润分配符合规定。

5.1 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.2 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.3 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.4 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.5 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.6 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.7 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.8 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.9 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.10 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.11 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.12 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.13 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.14 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.15 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.16 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.17 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.18 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.19 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.20 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.21 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.22 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.23 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.24 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

5.25 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《广发纳斯达克生物科技指数发起式证券投资基金的托管协议》,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同约定,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管理人应尽的义务。

注:1、国家/地区:分别指根据发行和托管地在哪个证券市场确定。
2、上述美国比重是指注册地为美国、托管在美国的ADR。
8.4 期末按行业分类的权益投资明细

Table with 5 columns: Industry, Sector, Fund Name, Value, Percentage.

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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
8.6 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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
8.7 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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
8.8 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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
8.9 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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
8.10 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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
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权益投资明细

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
8.12 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

Table with 5 columns: Rank, Name, Code, Value, Percentage.