广发全球医疗保健指数证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年七月二十日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016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
报告期末基金份额总额	166,375,242.90份
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。
投资策略	(一)资产配置策略 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0.35%,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4%。 (二)权益类资产投资策略 1.股票组合构建原则 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投资组合。 2.股票组合构建方法 本基金主要采用完全复制法,即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,并根据标的指数调整股票及其权重的变动进行相应调整。 3.股票组合调整 (1)定期调整 本基金股票组合根据所跟踪的标普全球1200医疗保健指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 (2)不定期调整 1)与指数相关的调整:当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。 2)申购赎回调整:根据本基金的申购赎回情况,对股票投资组合进行调整,以应有效跟踪标的指数。 3)其他调整:对于标的指数成份股,若因其出现停牌限购、存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大的不利的司法诉讼、或者有处分组合投资的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选股、甚至现金来代替,也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的可比股票来代替。 4.衍生品投资策略 本基金基于控制投资组合跟踪误差与流动性管理的需要,可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略,且以标普全球1200医疗保健指数为投资标的的指数基金(包括ETF)。 (三)固定收益类资产投资策略 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。 (四)衍生品投资策略 本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金在金融衍生品的投资中主要通盘有效管理投资策略,对冲某种或价格的特殊交发风险和某种特殊情况下的流动性风险,以及利用金融衍生产品的杠杆作用,达到对标的指数的有效跟踪,即降低在位期望调整率的交易成本。
业绩比较基准	人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,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	广发银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Citibank N.A
境外资产托管人中文名称	美国花旗银行有限公司

§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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	1,366,662.01
2.本期利润	14,700,720.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0884
4.期末基金资产净值	197,779,623.80
5.期末基金份额净值	1.189

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

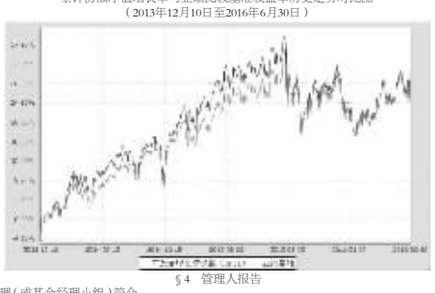
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.99%	0.90%	8.72%	0.93%	-0.73%	-0.03%

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

广发全球医疗保健指数证券投资基金

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

(2013年12月10日至2016年6月30日)



§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		
邵艳	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;广发美太平洋房地产债券(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理;广发纳斯达克生物医药指数(QDII)基金的基金经理;广发鑫享混合基金的基金经理;国际业务部总经理	2013-12-10	-	9年	男,中国籍,统计学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。2007年3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4月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月至2013起任广发全球农业指数(QDII)基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理,2013年8月9日起任广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理,2013年11月26日起任广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理,2013年12月10日起任广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理,2014年1月21日至2016年1月27日任国际业务部副总经理,2015年1月14日至2016年1月27日任另类投资副总经理,2015年3月30日起任广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理,2015年4月10日起任广发纳斯达克生物医药指数(QDII)基金的基金经理,2016年1月15日起任广发鑫享混合基金的基金经理,2016年1月28日起任国际业务部总经理。
罗国庆	本基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;数量投资部副总经理	2015-10-13	-	7年	男,中国籍,经济学硕士,自2009年11月至2013年7月先后在深圳证券信息有限公司和华富基金管理有限公司任研究员及产品设计研究,2013年7月31日至今在广发基金管理有限公司先后任产品经理、量化研究员,2015年10月13日起任广发深证100指数分级基金的基金经理,2016年5月30日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理。

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 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

二季度全球医疗指数总体呈现在底部震荡整固的格局。今年医疗指数跑输大盘主要原因是生物科技行业的大幅跑输,其原因在于美国医药高药价的问题提交到了总统大选的议题,高药价的问题受到监管层的关注,市场预期未来药物价格有一定的压力,从而对生物科技行业的盈利产生影响,所以相关公司的股价一直表现不佳。

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7.99%,同期业绩比较基准收益率为8.72%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,虽然医疗指数今年跑输大市,但是从中长期的角度来看我们仍然看好医疗行业的前景。首先,人类最基本的需求就是人类的健康医疗需求。根据世界卫生组织的统计,人均医疗费用支出每年都在稳定增长,医疗行业会在从中受益。其次,美国监管药价是为了打击虚高的药物价格,对于有真正疗效的药物的价格影响不大,因为本质还是供求关系决定,所以药价最终不会有很大的折让。同时,医疗指数中除了制药还有不少医疗器械和医疗服务公司,这些细分行业不会受到药价的影响,但是也会受益于人类医疗费用支出的增长。我们长期看好医疗指数的趋势。

§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	183,532,749.72	92.38
	其中:普通股	182,824,008.96	92.03
	存托凭证	728,740.76	0.37
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	3,653,800.75	1.84
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	10,408,218.05	5.24
8	其他各项资产	1,075,365.89	0.54
9	合计	198,690,134.41	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	122,890,651.07	62.14
瑞士	19,710,840.96	9.97
英国	10,530,413.55	5.32
日本	9,594,548.57	4.85
德国	6,792,079.26	3.43
法国	5,681,392.32	2.87
丹麦	4,983,006.30	2.52
澳大利亚	2,653,662.50	1.34
比利时	428,694.00	0.22
加拿大	287,461.19	0.15
合计	183,532,749.72	92.81

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泽西岛在美国上市的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	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	183,532,749.72	92.81
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	183,532,749.72	92.81

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	18,954.00	15,245,925.87	7.71
2	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN VX	瑞士证券交易所	瑞士	18,571.00	10,134,832.55	5.12
3	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	41,967.00	9,798,646.19	4.95
4	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG VX	瑞士证券交易所	瑞士	4,808.00	8,384,010.20	4.24
5	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	19,141.00	7,312,310.51	3.70
6	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽约证券交易所	美国	6,581.00	6,161,957.72	3.12
7	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMY US	纽约证券交易所	美国	11,461.00	5,589,813.47	2.83
8	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约证券交易所	美国	9,603.00	5,525,462.72	2.79
9	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,289.00	5,336,268.22	2.70
10	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	9,491.00	5,250,181.12	2.65

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。

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	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	3,653,800.75	1.85
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

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	-
3	应收股利	192,492.63
4	应收利息	521.91
5	应收申购款	882,351.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,075,365.89

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	165,887,108.88
本报告期基金总申购份额	20,083,033.28
减:本报告期基金总赎回份额	19,594,899.26
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	166,375,242.90

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发全球医疗保健指数证券投资基金募集的文件;

2.《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发全球医疗保健指数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
二〇一六年七月二十日

广发深证100指数分级证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年七月二十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发深证100指数分级
场内简称	深100基
基金主代码	162714
交易代码	162714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月7日
报告期末基金份额总额	59,642,073.22份
投资目标	本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争把制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.35%,年跟踪误差不超过4%,未来对深证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,主要采用完全复制法,即按照标的指数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。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,广发深证100A份额具有较风险、较富相对稳定的特征;广发深证100B份额具有高风险、高预期收益的特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属三级基金的基金简称	广发深证100指数分级A / 广发深证100指数分级B / 广发深证100指数分级
下属三级基金的场内简称	深证100A / 深证100B / 深100基
下属三级基金的交易代码	150083 / 150084 / 162714
报告期末下属三级基金的份额总额	7,188,814.00份 / 7,188,815.00份 / 45,264,444.22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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	264,115.47
2.本期利润	555,359.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	58,248,331.44
5.期末基金份额净值	0.9766

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

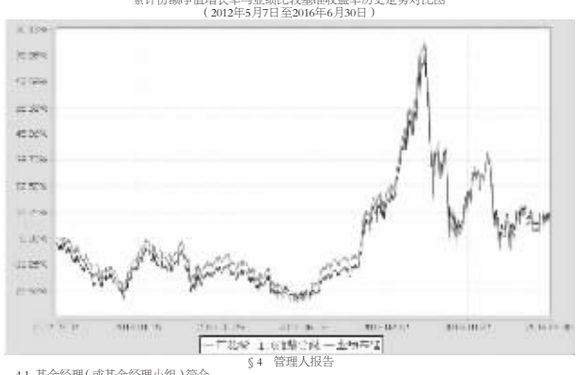
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.88%	1.36%	-0.16%	1.22%	1.04%	0.14%

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

广发深证100指数分级证券投资基金

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

(2012年5月7日至2016年6月30日)



§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基金及联接基金的基金经理;广发中证全指信息技术ETF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;广发可选消费联接基金的基金经理;广发医药卫生联接基金的基金经理;广发信息技术联接基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理;广发医药卫生ETF联接基金的基金经理;广发中证全指金融地产ETF联接基金的基金经理;广发中证全指医疗ETF基金的基金经理;广发医药卫生联接基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF联接基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;广发信息技术联接基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;广发原材料联接基金的基金经理;广发主要消费联接基金的基金经理;数量投资部副总经理	2012-05-07	-	17年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。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2008年4月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年4月9日至2016年3月29日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300ETF基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300ETF联接基金的基金经理,2012年3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11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30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,2015年4月13日起任广发可选消费联接基金的基金经理,2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理,2015年6月25日起任广发中证全指医疗ETF基金的基金经理,2015年7月31日起任广发中证全指可选消费ETF联接基金的基金经理,2015年7月9日起任广发医药联接和广发金融地产联接基金的基金经理,2015年7月23日起任广发医疗指数分级基金的基金经理,2015年8月18日起任广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理,2016年5月30日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理。
罗国庆	本基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;数量投资部副总经理	2015-10-13	-	7年	男,中国籍,经济学硕士,自2009年11月至2013年7月先后在深圳证券信息有限公司和华富基金管理有限公司任研究员及产品设计研究,2013年7月31日至今在广发基金管理有限公司先后任产品经理、量化研究员,2015年10月13日起任广发深证100指数分级和广发医疗指数分级基金的基金经理,2016年5月30日起任广发基金管理有限公司数量投资部副总经理。

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、《广发深证100指数分级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

本季度内,本基金的申购赎回及本基金的分级份额的交易、分拆、合并运作正常,运作过程中未发生风险事件。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资,指数样本采用完全复制方法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

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0.88%,同期业绩比较基准收益率为-0.16%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度整个A股市场震荡上行,市场的悲观情绪逐渐消除,尽管英国脱欧是全球经济疲软,蛋糕做不大导致全球政治经济动荡的缩影。但短期来说并不会是主导A股走势的主要因素。从市场盘面看,6月最后一周资金开始关注国防军工、券商等前期涨幅偏小的行业,一定程度上说明市场逐步认可7-8月利空因素较少转向乐观的逻辑。短期当前市场情绪偏乐观。长期需要关注汇率、流动性以及改革转型。尤其是改革转型,随着下半年供给侧改革的深入,由于改革转型刺激以及下半年利空事件较少,相信会有一波吃饭行情的机会,我们的投资观点是谨慎和敬畏市场的同时,密切关注市场动态,把握下半年由于改革转型的A股吃饭行情。

§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	52,833,872.42	89.90
	其中:股票	52,833,872.42	89.90
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	3,917,840.69	10.07
7	其他各项资产	18,258.15	0.03
8	合计	58,769,971.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资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	31,025.52	0.05
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	3,798.45	0.01
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	-	-
	合计	34,733.97	0.07

5.2.2指数投资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	274,547.60	0.47
B	采矿业	207,076.77	0.36
C	制造业	26,848,665.59	46.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	393,113.86	0.67
E	建筑业	299,748.30	0.51
F	批发和零售业	1,037,825.04	1.78
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	7,119,079.92	12.22
J	金融业	7,820,607.58	13.43
K	房地产业	5,214,254.94	8.95
L	租赁和商务服务业	627,999.05	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,315,238.68	2.26
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	1,237,051.58	2.12
S	综合	403,930.80	0.69
	合计	52,799,138.45	90.64

5.2.3报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

5.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	000002	万 科A	171,266	3,117,041.20	5.35
2	000651	格力电器	104,022	2,295,765.54	3.94
3	000333	美的集团	70,688	1,676,719.36	2.88
4	000001	平安银行	174,109	1,514,748.30	2.60
5	000858	五 粮 液	40,348	1,312,520.44	2.25
6	000725	京东方A	541,837	1,251,689.67	2.15
7	300104	乐视网	22,615	1,196,539.65	2.05
8	000776	广发证券	66,600	1,116,216.00	1.92
9	002024	苏宁云商	95,564	1,037,825.04	1.78
10	300059	东方财富	46,320	1,028,304.00	1.77

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002799	环球印务	432	18,852.48	0.03
2	002802	洪汇新材	603	9,093.24	0.02
3	300520	科大国创	369	3,708.45	0.01
4	002805	丰元股份	531	3,079.80	0.01

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。