广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指主要消费ETF
场内简称	全指消费
基金主代码	159946
交易代码	159946
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年7月1日
报告期末基金份额总额	57,315,634.00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	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指主要消费指数。
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7月1日(基金合同生效日)-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	2,804,289.65
2.本期利润	-5,656,980.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0520
4.期末基金资产净值	46,989,681.13
5.期末基金份额净值	0.8198

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。

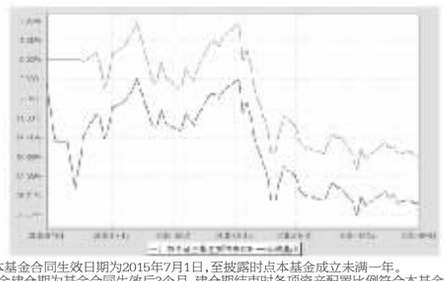
3.2 基金净值表现

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	-18.02%	2.91%	-27.11%	3.47%	9.09%	-0.56%

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

广发中证全指主要消费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7月1日至2015年9月30日)



注:(1)本基金合同生效日期为2015年7月1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		
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300ETF基金的基金经理;广发中小板300ETF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;广发中证全指信息技术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;广发医药卫生联接基金的基金经理;广发可选消费联接基金的基金经理;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发能源联接基金的基金经理;广发金融地产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;数量投资部总经理	2015-07-01	-	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15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能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理,2015年7月1日起任广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理,2015年7月9日起任广发能源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。	

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、《广发中证全指主要消费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,为基金份额持有人谋求最大利益,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。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,本基金建仓对基金业绩影响较大,其净值增长率为-18.02%,同期业绩比较基准收益率为-27.11%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度,由于中小股票估值过高,恐慌情绪蔓延,市场遭遇了大幅下跌。随着政府的救市,流动性的注入,并且一些杠杆工具的被限制,在3季度末市场逐渐趋于平稳,可以预计未来的市场暴涨暴跌的可能性也大幅降低。虽然经济依然弱势,但政府调经济结构的决心未变,预计4季度稳增长政策仍将加码,经济增长将会逐步恢复。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2015年8月24日至本报告期末,本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	46,171,762.11	97.41
	其中:股票	46,171,762.11	97.41
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	1,039,345.82	2.19
7	其他各项资产	186,146.48	0.39
8	合计	47,397,254.41	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,402,573.15	9.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,607,544.07	73.65
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	6,065,620.89	12.91
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	-	-
K	房地产业	301,404.00	0.64
L	租赁和商务服务业	557,437.00	1.19
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	237,912.00	0.51
	合计	46,172,491.11	98.26

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	600519	贵州茅台	23,353	4,444,309.43	9.46
2	600887	伊利股份	271,200	4,171,056.00	8.88
3	000858	五粮液	156,200	4,019,026.00	8.55
4	600518	康美药业	150,000	2,028,000.00	4.32
5	002304	洋河股份	21,300	1,160,637.00	2.47
6	000876	新希望	56,200	1,067,238.00	2.27
7	601933	永辉超市	92,400	937,860.00	2.00
8	000895	双汇发展	48,600	855,360.00	1.82
9	600315	上海家化	22,574	777,900.04	1.66
10	601607	上海医药	43,100	751,664.00	1.60

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	154,575.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	384.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,186.70
8	其他	-
9	合计	186,146.48

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	000858	五粮液	4,019,026.00	8.55	重大事项
2	000876	新希望	1,067,238.00	2.27	重大事项
3	600315	上海家化	777,900.04	1.66	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	255,315,634.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	205,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	57,315,634.00

§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主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二)《广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《广发中证全指主要消费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。

广发基金管理有限公司
二〇一五年十月二十六日

广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发养老指数
基金主代码	000968
交易代码	000968
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月13日
报告期末基金份额总额	149,205,146.76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,按照成份股在中证养老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	95%×中证养老产业指数收益率+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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-20,568,768.14
2.本期利润	-64,199,221.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3914
4.期末基金资产净值	138,103,729.02
5.期末基金份额净值	0.9256

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。

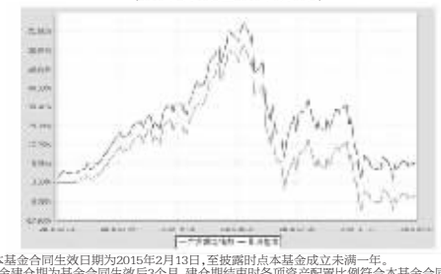
3.2 基金净值表现

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	-26.82%	3.79%	-21.61%	3.43%	-5.21%	0.36%

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

广发中证养老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2月13日至2015年9月30日)



注:(1)本基金合同生效日期为2015年2月13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;广发环保指数基金的基金经理;广发百发大数据精选混合基金的基金经理;数据策略投资部副总经理	2015-02-13	-	6年	男,中国籍,管理学博士,持有基金业执业资格证书,2009年9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,2015年9月14日起任广发百发大数据精选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 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、《广发中证养老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,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,本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回、成份股调整以及等权等因素,本基金成立以来规模稳步增长,目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

报告期内,本基金经历了整体市场大幅下跌阶段,以及沪深市场停牌股票较多等极端情况,给基金的运作和业绩造成了一定的影响。

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-26.82%,同期业绩比较基准收益率为-21.61%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6月中旬以来,中国股市经历了快速下跌的痛苦阶段,蒸发了巨大的社会财富,尤其对高位入市的投资者造成了巨大的伤害。其中,6月中下旬以及7月份股市大跌,部分原因是杠杆等资金快速推高了整体股市估值水平,以及泡沫快速破灭所带来了系统性风险,引起了恐慌,发生了一些过度的连锁反应;8月中下旬的市场下跌则与全球股市和经济的表现和预期有关;9月份股市表现相对平稳,主要是前期政府的持续救市,流动性注入,配以配资规模、股指期货的有效控制,各板块估值和行情表现进入了稳定阶段。而配资和股指期货的有效治理,未来应该不会再频繁地出现系统性踩踏行情,或者说未来将大概率地避免掉再次恐慌性下跌的情况。

近期,人民币汇率、股票市场均出现企稳迹象,同时全球股市也处于回升修复阶段;10月10日,央行推广信贷资产质押再贷款试点政策,股市终于站上了3200点。

目前,国内经济依然处在转型过程中,稳增长、调结构的过程也将是崎岖曲折的,这也是中国未来经济持续增长的必经之路,中国经济长期是看好的。对于股市来说,国内股市主要还是受信心、国内政策和国际股市等因素综合影响,整体上国内股市经历了前期调整和监管整治,近期市场情绪的明显处于好转过程中,市场风险偏好逐步在修复;展望10月份中下旬以及更长一段时间,国内股市将继续处于企稳阶段,并大概率处于修复回升行情;养老产业指数主要包含了医药生物、传媒、消费和保险类股票,而近期市场的修复和诺贝尔医学奖的综合效应,未来养老产业值得关注。

§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	128,896,606.35	92.79
	其中:股票	128,896,606.35	92.79
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	9,816,051.59	7.07
7	其他各项资产	201,139.84	0.14
8	合计	138,913,797.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	63,532,737.97	46.00
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	11,499,535.59	8.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,825,239.77	2.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,153,015.11	12.42
J	金融业	6,531,347.10	4.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,002,061.54	2.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,558,341.36	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,416,823.14	1.03
Q	卫生和社会工作	1,988,449.24	1.44
R	文化、体育和娱乐业	19,389,055.53	14.04
S	综合	-	-
	合计	128,896,606.35	93.33

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	002252	上海莱士	84,400	3,502,600.00	2.54
2	600754	锦江股份	97,793	2,825,239.77	2.05
3	600276	恒瑞医药	58,444	2,699,528.36	1.95
4	300027	华谊兄弟	82,800	2,619,792.00	1.90
5	300017	网宿科技	48,869	2,575,884.99	1.87
6	000963	华东医药	35,916	2,508,732.60	1.82
7	600867	通化东宝	102,500	2,297,025.00	1.66
8	000538	云南白药	35,264	2,256,896.00	1.63
9	300251	光线传媒	81,834	2,249,616.66	1.63
10	002399	海普瑞	90,318	2,190,211.50	1.59

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	63,842.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,817.90
5	应收申购款	135,479.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,139.84

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	600754	锦江股份	2,825,239.77	2.05	重大事项
2	300027	华谊兄弟	2,619,792.00	1.90	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	129,892,181.82
本报告期基金总申购份额	194,443,863.42
减:本报告期基金总赎回份额	175,130,898.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	149,205,146.76

§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(%)	6.70

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	6.70%	10,000,200.02	6.70%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	6.70%	10,000,200.02	6.70%	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养老产业指数型发起式证券投资基金募集的文件

(二)《广发中证养老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)《广发中证养老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
二〇一五年十月二十六日

广发中证医疗指数分级证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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7月23日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发医疗指数分级		
场内简称	医疗分级		
基金主代码	502056		
交易代码	502056		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月23日		
报告期末基金份额总额	43,887,092.94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的最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
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。		
业绩比较基准	95%×中证医疗指数收益率+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,广发医疗A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;广发医疗B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	北京银行股份有限公司		
下属三级基金的基金简称	广发医疗指数分级A	广发医疗指数分级B	广发医疗指数分级
下属三级基金的交易代码	502057	502058	502056
报告期末下属三级基金的份额总额	6,706,261.00份	6,706,261.00份	30,474,570.94份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要