广发全球精选股票型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	广发全球精选股票(QDII)	
基金主代码	270023	
交易代码	270023(前端)	-(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年8月18日	
报告期末基金份额总额	748,206,243.10份	
投资目标	通过在全球市场进行积极的资产配置和组合管理,有效分散基金的投资组合风险,实现基金资产的持续,稳健增值。	
投资策略	本基金将通过自上而下的资产配置策略和自下而上的个股精选策略进行基金资产的投资组合构建,注重国际宏观经济环境、政治形势、区域市场和证券市场走势的综合分析,并强调公司品质与成长性的结合,由此确定基金资产在国家与地区间的区域配置以及在股票、债券和现金等各类资产类别上的投资比例,并通过自下而上的个股精选,挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。	
业绩比较基准	60%×MSCI全球指数(MSCI World Index)+40%×恒生指数	
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
境外资产托管人英文名称	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited	
境外资产托管人中文名称	渣打银行(香港)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	-84,306,689.84
2.本期利润	-183,027,411.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3288
4.期末基金资产净值	1,076,019,486.14
5.期末基金份额净值	1.438

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	-12.16%	2.21%	-11.32%	1.22%	-0.84%	0.99%

3.2.2 目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

广发全球精选股票型证券投资基金
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
(2010年8月18日至2015年9月30日)

注:1、本基金建仓期为基金合同生效后六个月,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。

2、本基金自2014年6月10日起,将基金业绩比较基准由"摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数"变更为"60%×MSCI全球指数(MSCI World Index)+40%×恒生指数"。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
Ding Tom Liang(丁粮)	本基金的基金经理	2014-06-09	-	8年	男,新西兰籍,金融学硕士,持有中国基金业执业证书,2007年5月至2009年7月在银华基金管理有限公司历任投资管理部研究员及海外投资部基金经理助理,2009年7月至2011年3月在交银国际资产管理有限公司历任研究员及投资经理,2011年3月28日至2012年4月5日在广发基金管理有限公司任国际业务部研究员,2012年4月6日至2014年6月8日任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理,2014年6月9日起任广发全球精选股票(QDII)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、《广发全球精选股票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

2015年三季度,全球市场均大幅调整,主要负面影响来自于美联储加息预期、新兴市场资本外流和中国经济增速放缓。美联储加息预期随着就业数据、通胀以及其他经济数据和官员言论而大幅波动;在九月备受瞩目的议息会议中,美联储并未触发加息举动,之后较强的就业数据将市场预期重新调低。同时,新兴市场资本外流严重,巴西、马来西亚等国货币兑美元大幅下挫。人民币八月份的一次性调整让市场对人民币贬值和中国经济发展减速格外关注,这也引起了大中华股票市场继六月暴跌后的第二波大幅调整。香港市场尽吐四月以来的估值上调,前三季度回撤超过10%。管理人认为香港市场经历两波市场暴跌后,对经济和流动性的预期均已经非常低,特别是一些对经济较敏感的行业如汽车被市场过分低估,接下来美联储加息的推迟和中国政府的刺激政策将带来市场反弹的机会。2015年三季度,MSCI全球指数下跌8.86%,香港恒生指数下跌20.59%。

三季度本基金保持较低仓位,在市场暴跌过程中较好地保护了净值。2015年三季度,广发全球精选股票基金在国家区域配置方面,主要是对香港市场进行配置,在行业配置方面,我们主要关注科技和金融等行业。

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-12.16%,同期业绩比较基准收益率为-11.32%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为,市场短期内大幅波动较充分地反应了美国加息和中国经济放缓的风险,同时,随着美国就业数据的转差和中国政府对经济各种刺激和改革措施的开展,市场有望恢复性反弹。管理人将根据市场预期的发展灵活调整策略,重点发掘被市场悲观情绪过分低估的公司,坚持从下往上精选个股。

§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	519,171,149.01	45.75
	其中:普通股	514,197,884.67	45.31
	存托凭证	4,973,264.34	0.44
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	9,647,865.65	0.85
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	0.00	0.00
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	405,175,600.13	35.70
8	其他各项资产	200,928,292.64	17.70
9	合计	1,134,922,907.43	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

序号	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	506,329,847.15	47.06
美国	12,841,301.86	1.19
合计	519,171,149.01	48.25

注: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。

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	18,719,187.66	1.74
工业	86,392,870.89	8.03
非必须消费品	42,375,276.88	3.94
必须消费品	-	-
保健	34,460,312.48	3.20
金融	135,558,741.44	12.60
信息技术	146,073,924.95	13.58
电信服务	37,675,179.00	3.50
公共事业	17,915,655.71	1.66
合计	519,171,149.01	48.25

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	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港交易所	中国香港	530,000.00	56,249,288.49	5.23
2	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港交易所	中国香港	500,000.00	37,675,179.00	3.50
3	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港交易所	中国香港	846,000.00	26,630,441.72	2.47
4	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港交易所	中国香港	1,600,000.00	23,849,455.36	2.22
5	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港交易所	中国香港	1,100,000.00	21,714,528.55	2.02
6	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	协合新能源	182 HK	香港交易所	中国香港	50,000,000.00	21,341,060.00	1.98
7	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港交易所	中国香港	2,592,000.00	20,743,510.32	1.93
8	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港交易所	中国香港	600,000.00	19,724,064.30	1.83
9	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向	3818 HK	香港交易所	中国香港	10,000,000.00	15,349,147.00	1.43
10	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	南车时代电气	3898 HK	香港交易所	中国香港	315,000.00	14,750,571.31	1.37

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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证	FOSUN INTERNATIONAL-RIGHTS	0.00	0.00
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

注:本基金报告期内持有FOSUN INTERNATIONAL-RIGHTS认股权证,取得成本为0.00元,由于报告期末行权价格高于复兴国际股票收盘价,权证估值价格为0.00元。

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 NASDAQ BIOTECHNOLOGY	ETF	契约型开放式	Blackrock Fund Advisors	9,647,865.65	0.90
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

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	597,075.41
4	应收利息	28,273.64
5	应收申购款	200,302,943.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,928,292.64

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	646,914,659.49
本报告期基金总申购份额	258,635,235.58
减:本报告期基金总赎回份额	157,343,651.97
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	748,206,243.10

§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亚太(除日本)精选股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发亚太(除日本)精选股票型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.《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金托管协议》;

5.《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金份额持有人大会表决结果的公告》;

7.中国证监会批准广发全球精选股票型证券投资基金募集的文件;

8.《广发全球精选股票型证券投资基金基金合同》;

9.《广发全球精选股票型证券投资基金招募说明书》;

10.《广发全球精选股票型证券投资基金托管协议》;

11.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

12.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
二〇一五年十月二十六日

广发全球医疗保健指数证券投资基金

【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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发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	164,377,015.82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被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0.5%,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5%。 (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股票组合。 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分股权重成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成分股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分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:根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。 3)其他调整:对于标的指数成份股,若因其出现停牌限制,存在严重的流动性困难,或者财务风险较大,或者间断度大的不利的司法诉讼,或者有充分市场合理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、近价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。 4.目标基金投资策略 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遵循有效管理投资策略,对外某些成份股的特殊交发风险和其他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,同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。	
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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,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	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	上期金额
1.本期已实现收益	-
2.本期利润	-
3.加权平均基金份额本期利润	-
4.期末基金资产净值	-
5.期末基金份额净值	-

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	-4.76%	1.23%	-7.09%	1.24%	2.33%	-0.01%

3.2.2 目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2015年9月30日)

注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
邱伟	本基金的基金经理;广发中证全指医药卫生指数基金的基金经理;广发中证全指信息技术指数基金的基金经理;广发医疗保健指数基金的基金经理;广发中证全指证券公司指数基金的基金经理;广发中证全指金融地产指数(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;广发生物科技指数(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	2013-12-10	-	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)任战略分析师兼投资理副总裁,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

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,除2只法规限制投资的指数样本证券采用样本替代投资方法之外,其余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-33.42%,同期业绩比较基准收益率为-29.30%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

清理场外配资结束后,在量化宽松的大背景下,投资者风险偏好短期有望提升,反弹时机步入右侧,四季度震荡向上行情为大概率。深证100指数由深市规模大、成交活跃的100只样本证券构成,包含了大量成长性好的股票,行业分布较为均匀。深证100指数是分享经济结构转型和恢复性增长的良好工具,也是进行长期投资的优秀标的。2015年,预计深港通将会推出,作为深市100只权重股票的指数,未来深证100指数会有不错的表现。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	185,124,556.58	92.01
	其中:普通股	185,124,556.58	92.01
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	3,505,945.19	1.74
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	11,472,370.00	5.70
8	其他各项资产	1,093,534.54	0.54
9	合计	201,196,414.31	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

序号	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	119,246,341.98	60.40
瑞士	21,600,670.30	10.94
英国	11,009,500.85	5.58
德国	8,089,340.87	4.10
日本	7,928,300.08	4.02
法国	6,696,392.55	3.39
丹麦	5,288,237.82	2.68
加拿大	2,735,088.55	1.39
澳大利亚	2,046,507.52	1.04
比利时	484,176.06	0.25
合计	185,124,556.58	93.76

注: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。

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	185,124,556.58	93.76
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	185,124,556.58	93.76

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	20,897.00	12,409,210.24	6.28
2	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN VX	瑞士证券交易所	瑞士	20,230.00	11,776,850.70	5.96
3	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	46,574.00	9,305,877.96	4.71
4	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG VX	瑞士证券交易所	瑞士	5,302.00	8,872,961.86	4.49
5	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	11,074.00	6,916,998.10	3.50
6	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	21,256.00	6,678,308.01	3.38
7	SANOFI	赛诺菲安万特公司	SAN FP	巴黎证券交易所	法国	9,093.00	5,527,455.68	2.80
8	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽约证券交易所	美国	7,193.00	5,308,249.95	2.69
9	ALLERGAN PLC	眼力健有限公司	AGN US	纽约证券交易所	美国	2,972.00	5,138,781.04	2.60
10	BAYER AG-REG	拜耳股份有限公司	BAYN GR	德国证券交易所	德国	6,267.00	5,136,142.16	2.60

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投资。

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	3,505,945.19	1.78
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

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	1,870.36
4	应收利息	522,448.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,609.69
8	其他	-
9	合计	1,093,534.54

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	197,828,957.44
本报告期基金总申购份额	60,704,595.25
减:本报告期基金总赎回份额	94,156,536.87
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	164,377,015.82

§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