广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金 2018年年度报告摘要

2018年12月31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:二〇一九年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

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及其更新。

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。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发中证全指金融地产ETF
场内简称	全指金融
基金主代码	159940
交易代码	159940
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年3月23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
报告期末基金份额总额	409,059,983.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年4月17日

2.2 基金产品说明

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,因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金融地产指数。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邱春杨	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-83899158	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	4,940,479.73	13,084,795.72	-17,135,534.39
本期利润	-41,067,027.92	33,203,102.76	-17,783,375.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1567	0.1878	-0.1128
本期基金份额净值增长率	-18.48%	22.09%	-7.58%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2137	-0.0355	-0.2100
期末基金资产净值	321,637,713.36	162,087,726.63	113,010,917.00
期末基金份额净值	0.7863	0.9645	0.7900

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)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-8.43%	1.63%	-8.63%	1.64%	0.20%	-0.01%
过去六个月	-2.81%	1.52%	-4.90%	1.53%	2.09%	-0.01%
过去一年	-18.48%	1.40%	-21.62%	1.41%	3.14%	-0.01%
过去三年	-8.01%	1.18%	-20.62%	1.19%	12.61%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-21.37%	1.55%	-24.08%	1.58%	2.71%	-0.03%

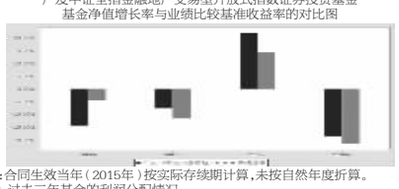
注:业绩比较基准:中证全指金融地产指数。

3.2.2基金份额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

广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金
份额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3月23日至2018年12月31日)

3.2.3基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金
基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年(2015年)按实际存续期计算,未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准,于2003年8月5日成立,注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和31个部门:宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外,还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司(香港子公司),参股了证通股份有限公司。

截至2018年12月31日,本基金管理人管理一百八十一只开放式基金,管理资产规模为4684亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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;广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接