广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

2019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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发电子信息传媒股票
基金主代码	005310
交易代码	005310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月11日
报告期末基金份额总额	38,807,252.22份
投资目标	本基金重点关注电子信息传媒(TMT)产业上市公司的投资机会,通过自下而上的深度挖掘,精选个股,力争为基金份额持有人获取长期稳健的超额回报。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上,判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势,分析不同政策对各类资产的市场影响,评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值,根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置,确定合适的资产配置比例,并适时进行调整。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数收益率*80%+中证全指电信业务指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于高收益风险特征的基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	1,651,754.66
2.本期利润	-3,913,730.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0754
4.期末基金资产净值	32,176,001.45
5.期末基金份额净值	0.8291

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。

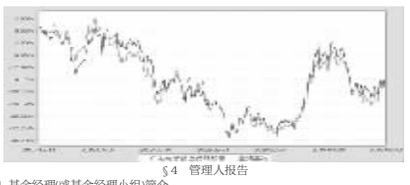
3.2 基金净值表现

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	-7.12%	1.97%	-10.04%	2.03%	2.92%	-0.06%

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

广发电子信息传媒产业精选股票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
(2017年12月11日至2019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		
张继枫	本基金的基金经理	2017-12-11	2019-04-02	6年	张继枫先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究发展部总经理助理、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年6月9日至2019年4月2日),广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金基金经理(自2017年12月11日至2019年4月2日)。
观富钦	本基金的基金经理;研究发展部总经理助理	2018-02-13	-	8年	观富钦先生,管理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广州证券股份有限公司研究所分析师、中投证券有限责任公司研究总部分析师、广发基金管理有限公司研究发展部研究员。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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。金融工程与风险管理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(完全复制指数组合及量化组合除外)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,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度市场出现了回调,其中以成长股居多的中小板和创业板回调较多,期间沪深300指数、中小板指数和创业板指数分别下跌1.21%、10.99%和10.75%。TMT的四大板块电子、计算机、通信、传媒均出现明显的调整,分别下跌10.67%、10.57%、7.79%、15.79%。

中美贸易战的加剧以及流动性的边际收紧是TMT板块回调较多的关键因素,特别是电子行业受到的贸易战的影响更为显著。相应地,本基金也在4月份出现了较大幅度的回调。为了控制回撤风险,管理人在维持此前的行业龙头配置策略的基础上,进一步精简了持仓个股,把更多的仓位集中在确定性和景气度更高的龙头标的上。在子行业配置方面,本基金配置标的依旧集中在消费电子、云计算、5G等几个方向,其中相比一季度主要是增加了信息安全子行业的配置比重。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-7.12%,同期业绩比较基准收益率为-10.04%。

§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	27,952,900.91	86.21
	其中:股票	27,952,900.91	86.21
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	4,381,080.11	13.51
7	其他资产	90,571.93	0.28
8	合计	32,424,552.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	13,229,393.94	41.12
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	13,985,128.97	43.46
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	738,378.00	2.29
S	综合	-	-
	合计	27,952,900.91	86.87

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	002475	立讯精密	99,500	2,466,605.00	7.67
2	300253	卫宁健康	133,344	1,890,817.92	5.88
3	300207	欣旺达	164,009	1,889,383.68	5.87
4	002410	广联达	50,800	1,670,812.00	5.19
5	002415	海康威视	59,527	1,641,754.66	5.10
6	002439	启明星辰	59,500	1,600,550.00	4.97
7	603986	兆易创新	18,200	1,577,940.00	4.90
8	002912	中新赛克	16,700	1,567,629.00	4.87
9	300271	华宇软件	82,300	1,563,700.00	4.86
10	002916	深南电路	14,860	1,514,531.20	4.71

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报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,481.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	928.02
5	应收申购款	73,162.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,571.93

5.11.4报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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	58,557,792.87
本报告期基金总申购份额	10,766,057.25
减:本报告期基金总赎回份额	30,516,597.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	38,807,252.22

§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	14,905,474.61
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	4,903,874.45
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,600.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	25.77

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2019-06-26	-4,903,874.45	-3,951,421.40	0.30%
合计			-4,903,874.45	-3,951,421.40	

§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	10,001,600.16	25.77%	10,001,600.16	25.77%	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	10,001,600.16	25.77%	10,001,600.16	25.77%	三年

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	14,905,474.61	0.00	4,903,874.45	10,001,600.16	25.77%
	2	20190426-20190611	11,023,769.42	0.00	8,000,000.00	3,023,769.42	7.79%
产品特有风险							

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。

§10备查文件目录

10.1备查文件目录

1.中国证监会注册广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金的文件

2.《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式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.《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

10.2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

10.3查阅方式

1.书面查阅:投资者可在营业时间免费查阅,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
二〇一九年七月十八日

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

2019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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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2019年7月16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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发生物科技指数(QDII)
基金主代码	001092
交易代码	001092
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月30日
报告期末基金份额总额	194,826,584.20份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,紧密跟踪纳斯达克生物科技指数,力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化,为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。
投资策略	本基金为被动管理的指数型基金,在正常情况下,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内,年跟踪误差控制在5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金(包括ETF)的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	95%×人民币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)。
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。本基金为被动管理的指数型基金,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	中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	42,163.65
2.本期利润	-1,535,458.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0077
4.期末基金资产净值	193,649,033.85
5.期末基金份额净值	0.994

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。

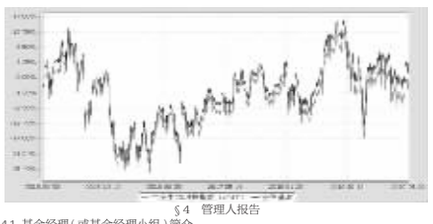
3.2 基金净值表现

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	-0.80%	1.29%	-0.14%	1.32%	-0.66%	-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

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金
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
(2015年3月30日至2019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		
刘杰	本基金的基金经理;广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金及起式联接基金的基金经理;广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证军工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;广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发创业板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;广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理;广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理;广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理;广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理;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;广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理;广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理;广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理;指数投资部总经理助理	2018-08-06	-	15年	刘杰先生,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2018年4月25日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自2017年8月4日至2018年11月30日)。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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。金融工程与风险管理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(完全复制指数组合及量化组合除外)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,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克生物科技指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合,呈现出股票型基金的特征。

在经历了一季度的普遍上涨,二季度全球主要股指迎来了震荡行情。二季度内,标普500指数上涨3.79%,纳斯达克100指数上涨3.96%,德国DAX指数上涨7.57%,法国CAC40指数上涨3.52%,日经225上涨0.33%,香港恒生指数下跌1.75%。

今年一季度末,3月期和10年期美债收益率出现倒挂,引起了市场对于美国经济出现衰退的广泛讨论。虽然经济领先指标、时薪增速持续下滑等因素反映出美国经济似乎已进入增长放缓初期,然而现在就判定美国经济从此步入下行通道还言之过早。目前美国居民杠杆较低,美股估值虽然较高但并未出现泡沫化迹象,同时美国也加强了金融监管,不易爆发系统性风险。整体来看,美国经济全面衰退风险仍然偏低。同时,欧洲经济虽然在短期内还将持续疲软态势,但总体下行空间有限。新兴市场经济较去年出现好转迹象,未来随着美联储降息可能性的上升,美元走弱可能会刺激新兴市场走出衰退。

未来美股市场,拥有全球领先技术的生物、医药等高科技企业依然存在相对优势,而纳斯达克生物科技指数涵盖了全球最优质生物、医药行业龙头公司,值得投资者关注。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-0.80%,同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

§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	179,014,842.78	91.97
	其中:普通股	171,541,290.40	88.13
	存托凭证	7,473,552.38	3.84
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	4,319,735.89	2.22
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	11,020,758.62	5.66
8	其他资产	282,641.86	0.15
9	合计	194,637,979.15	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	179,014,842.78	92.44
合计	179,014,842.78	92.44

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美国、丹麦、开曼群岛、法国、比利时、西班牙、日本、爱尔兰在美国上市的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(%)
公用事业	-	-
能源	-	-
信息技术	-	-
日常消费品	-	-
非日常生活消费品	-	-
房地产	-	-
原材料	-	-
通信服务	-	-
工业	-	-
金融	-	-
医疗保健	179,014,842.78	92.44
合计	179,014,842.78	92.44

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	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克证券交易所	美国	25,270.00	16,059,015.96	8.29
2	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	11,979.00	15,175,832.33	7.84
3	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	31,911.00	14,821,214.95	7.65
4	ILLUMINA INC	Illumina公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,132.00	12,988,685.57	6.71
5	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	7,320.00	11,768,994.17	6.08
6	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Vertex制药股份有限公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	6,987.00	8,808,388.53	4.55
7	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,586.00	7,716,287.02	3.98
8	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,934.00	7,144,156.07	3.69
9	INCYTE CORP	Incyte有限公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	7,559.00	4,415,019.24	2.28
10	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	BioMarin制药股份有限公司	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	6,304.00	3,711,909.02	1.92

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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	PROSHARES ULTRA NASD BIOTECH	ETF基金	开放式	Proshares Trust	4,319,735.89	2.23

5.10投资组合报告附注

5.10.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	660.80
4	应收利息	322.95
5	应收申购款	240,620.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	41,037.93
8	其他	-
9	合计	282,641.86

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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	201,173,718.55
本报告期基金总申购份额	16,944,699.11
减:本报告期基金总赎回份额	23,291,833.46
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	194,826,584.20

§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 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	6,500,100.02	3.34%	10,000,200.02	5.13%	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	6,500,100.02	3.34%	10,000,200.02	5.13%	三年

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会准予广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金募集注册的文件

2.《广发纳斯达克生物科技指数型发起式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.《广发纳斯达克生物科技指数型发起式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

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:投资者可在营业时间免费查阅,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
二〇一九年七月十八日

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

2019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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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2019年7月16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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发恒生中型股指数(LOF)
场内简称	恒生中型
基金主代码	501303
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月21日
报告期末基金份额总额	77,409,179.79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,力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建