# 广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金

## 【2016】第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§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2016年4月19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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 广发环保指数 |
| 基金主代码 | 001064 |
| 交易代码 | 001064 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年3月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,386,145,127.71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,按照成份股在中证环保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 | 本基金以中证环保产业指数为标的指数。 |
| 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(2016年1月1日-2016年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -51,096,790.28 |
| 2.本期利润 | -266,084,936.08 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1716 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,002,205,063.67 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7230 |

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。

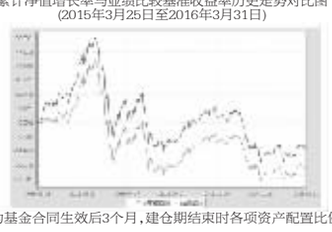
3.2 基金净值表现

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 | -19.00% | 3.22% | -18.62% | 3.12% | -0.38% | 0.10% |

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

广发中证环保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3月25日至2016年3月31日)



注: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 | | |
| 李巍 | 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;广发养老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;广发百发大数据成长混合基金的基金经理;广发百发大数据策略投资部副总经理 | 2015-03-25 | - | 7年 | 男,中国籍,管理学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。2009年8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据投资策略部投资研究员。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26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。2015年11月18日起任广发百发大数据成长混合基金的基金经理。 |
| 刘杰 | 本基金的基金经理;广发沪深300ETF及联接基金的基金经理;广发中证500ETF及联接(LOF)基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理;广发养老指数基金的基金经理 | 2016-01-25 | - | 12年 | 男,中国籍,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司信息技术部工作。2010年11月至2014年3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4月11日至2016年1月17日任广发沪深300指数基金的基金经理。2014年4月11日起任广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理。2015年8月20日起任广发沪深300ETF基金的基金经理。2016年1月18日起任广发沪深300ETF联接基金的基金经理。2016年1月26日起任广发中小板300ETF及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理。 |

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、《广发中证环保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。

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,实现投资风险的事后风险控制。

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、赎回和等权等因素,本基金目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

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-19.00%,同期业绩比较基准收益率为-18.62%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年初,人民币汇率出现了一波较大幅度贬值,同时国内经济下行压力依然存在,熔断机制更是加剧了市场的风险情绪,种种因素的叠加导致了1月份市场的过度反应和持续暴跌。

随着市场恐慌情绪的持续释放,上证指数在2638.30点触底,随后在3000点上下反复震荡,多空力量进行了充分的对弈。3月中旬,美联储选择了不加息,同期国内市场需求面也出现了复苏迹象,周期性行业中短期也受益于供给侧改革的实施,最终促成了股市1季度中后期震荡向上的态势。

展望2季度,市场风险偏好已经有所上升,政策方面尚不存在明显利空预期,进出口数据3月份也好于预期,未来看好中短期震荡向上的投资机会。

随着国内雾霾等环境问题的日益突出,国家政策也在向环保行业进行倾斜,环境改善措施也在逐步推进中,未来环保行业有望得到持续的投入,环保行业存在中长期的投资价值。

§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 | 948,384,760.15 | 94.23 |
| | 其中:股票 | 948,384,760.15 | 94.23 |
| 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 | 54,343,836.97 | 5.40 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,687,562.71 | 0.37 |
| 8 | 合计 | 1,006,416,149.83 | 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

| 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 | 607,064,287.47 | 60.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 157,247,689.82 | 15.69 |
| E | 建筑业 | 41,950,967.17 | 4.19 |
| F | 批发和零售业 | 9,277,960.16 | 0.93 |
| 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 | 30,786,408.30 | 3.07 |
| J | 金融业 | 9,309,580.80 | 0.93 |
| 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 | 8,491,427.00 | 0.85 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 73,205,828.12 | 7.30 |
| 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 | 11,050,610.30 | 1.10 |
| | 合计 | 948,384,760.15 | 94.63 |

5.2.2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 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 | 002431 | 棕榈园林 | 495,273 | 15,749,681.40 | 1.57 |
| 2 | 002180 | 艾派克 | 321,300 | 14,227,164.00 | 1.42 |
| 3 | 600651 | 飞乐音响 | 911,564 | 13,153,868.52 | 1.31 |
| 4 | 300296 | 利亚德 | 550,025 | 13,052,093.25 | 1.30 |
| 5 | 600261 | 阳光照明 | 1,456,169 | 11,751,283.83 | 1.17 |
| 6 | 000012 | 南玻A | 1,069,826 | 11,639,706.88 | 1.16 |
| 7 | 002408 | 齐翔腾达 | 855,700 | 11,338,025.00 | 1.13 |
| 8 | 002131 | 利欧股份 | 672,830 | 11,296,815.70 | 1.13 |
| 9 | 002202 | 金风科技 | 677,477 | 11,124,172.34 | 1.11 |
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 188,776 | 11,101,916.56 | 1.11 |

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 | 476,168.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,961,667.70 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 14,236.23 |
| 5 | 应收申购款 | 235,482.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,687,562.71 |

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 | 002180 | 艾派克 | 14,227,164.00 | 1.42 | 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 | 1,549,896,211.35 |
| 本报告期基金总申购份额 | 185,353,387.56 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 348,104,471.20 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,386,145,127.71 |

§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(%) | 0.72 |

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人所有资金 | 10,000,200.02 | 0.72% | 10,000,200.02 | 0.72% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 994,315.79 | 0.07% | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 122,144.86 | 0.01% | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 11,116,660.67 | 0.80% | 10,000,200.02 | 0.72% | 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环保产业指数型发起式证券投资基金募集的文件

(二)《广发中证环保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)《广发中证环保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
二〇一六年四月二十二日

# 广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金

## 【2016】第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§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2016年4月19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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 164,069,983.00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90%。 |
| 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。 |
| 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(2016年1月1日-2016年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -11,830,729.52 |
| 2.本期利润 | -23,797,965.22 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1366 |
| 4.期末基金资产净值 | 122,293,212.57 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7460 |

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 | -12.73% | 2.24% | -12.65% | 2.26% | -0.08% | -0.02% |

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

广发中证全指金融地产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3月23日至2016年3月31日)

注: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及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;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;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发中证全指原材料ETF基金的基金经理;广发主要消费联接基金的基金经理;广发医疗保健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 | 2015-07-09 | - | 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6月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员。2001年6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10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30日起任广发中小板300ETF基金的基金经理。2011年6月30日起任广发中证500ETF基金的基金经理。2011年6月30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13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16日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理。2015年1月20日起任广发中证全指金融地产ETF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26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基金的基金经理。2015年7月23日起任广发医疗保健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、《广发中证全指金融地产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。

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。

报告期内,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,其净值增长率为-12.73%,同期业绩比较基准收益率为-12.65%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1季度受汇率波动、经济下滑、大股东减持等多重因素影响,市场遭遇了股汇双杀的局面,A股市场在1月份与2月份下跌较多,投资者情绪极度悲观,随着外部环境的改善,汇率的稳定,各种经济指标的回暖,3月份市场迎来了幅度较大的反弹。预计未来在没有重大利空的情况下,市场将维持震荡格局。金融地产行业作为蓝筹股,目前估值依然很低,是价值投资者投资的最佳选择。

§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 | 122,026,913.12 | 99.26 |
| | 其中:股票 | 122,026,913.12 | 99.26 |
| 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 | 675,284.14 | 0.55 |
| 7 | 其他各项资产 | 124,388.61 | 0.10 |
| 8 | 合计 | 122,826,565.87 | 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

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 | 403,256.00 | 0.33 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | 94,239,946.30 | 77.00 |
| K | 房地产业 | 26,214,499.17 | 21.42 |
| L | 租赁和商务服务业 | 200,401.80 | 0.16 |
| 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 | 968,309.85 | 0.79 |
| | 合计 | 122,026,913.12 | 99.70 |

5.2.2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 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 | 601318 | 中国平安 | 323,986 | 10,305,994.66 | 8.42 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 902,467 | 8,221,383.27 | 6.72 |
| 3 | 000002 | 万 科A | 321,340 | 7,850,336.20 | 6.41 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 413,056 | 6,414,759.68 | 5.24 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 295,293 | 5,294,603.49 | 4.33 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 318,799 | 5,129,475.91 | 4.19 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 244,000 | 4,343,200.00 | 3.55 |
| 8 | 601328 | 交通银行 | 713,109 | 3,972,017.13 | 3.25 |
| 9 | 601288 | 农业银行 | 1,171,700 | 3,749,440.00 | 3.06 |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 251,600 | 3,595,364.00 | 2.94 |

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根据2015年1月16日中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况,海通证券因存在违规为到期融资融券合约展期问题,受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

本基金公司投资该公司的原因:首先,公司作为国内证券行业龙头之一,在成交量大增、两融业务快速增长、券商创新业务蓬勃发展的时期,有着很强的业绩增长预期和较大发展空间,具备投资价值;其次,券商作为股市高贝塔品种,在股市的繁荣背景下有着较强投资收益预期;最后,本次核查和处罚并不影响公司两融业务的发展,在公司对相关问题做出整改后,将对经营层面不造成任何重大负面影响。综合来看,公司仍然具备投资价值。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

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 | 2,248.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 121,992.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 147.76 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 124,388.61 |

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 | 000002 | 万 科A | 7,850,336.20 | 6.41 | 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 | 203,069,983.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,000,000.00 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 45,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 164,069,983.00 |

§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金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二)《广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《广发中证全指金融地产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。

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
二〇一六年四月二十二日

# 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

## 【2016】第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§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2016年4月19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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 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 |
| 基金主代码 | 001469 |
| 交易代码 | 001469 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年7月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 63,798,998.68份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标ETF,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ETF联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金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0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证全指金融地产指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。 |
| 风险收益特征 | 本基金为ETF联接基金,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,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 |

2.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 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