广发行业领先混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

本基金已根据《香港证券及期货条例》第104条在香港获得证券及期货事务监察委员会(「香港证监会」)认可,并可向香港公众人士发售。香港证监会的认可不等于对本基金的推荐或认许,亦不是对本基金的商业价值或其表现作出保证。本基金获香港证监会认可并不表示本基金适合所有投资者,亦并非认许本基金适合任何特定投资者或特定类别的投资者。本基金只有H类基金单位可供香港投资者认购。

§2 基金产品概况

基金简称	广发行业领先混合
基金主代码	270025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23日
报告期末基金份额总额	2,338,296,822.26份
投资目标	通过挖掘宏观经济周期及行业生命周期的发展趋势,发掘发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业中的领先企业进行投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	(一)资产配置策略 1.大类资产配置 (1)研究部综合宏观经济研究员研究的宏观经济形势,策略研究员研究的市场运行趋势,行业研究员研究的行业投资价值形成《资产配置建议书》。(2)投资决策委员会定期与不定期相结合召开相关会议,根据《资产配置建议书》,综合考虑基金投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,确定本基金股票、债券、现金等的比例。 2.行业配置策略 不同的行业在经济周期的不同阶段呈现出不同的运行态势。本基金将主要通过"广发第先行业评价体系",对行业进行定性、定量分析,同时,结合国内外宏观经济环境及国家相关政策的变化,选择发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业作为本基金行业配置的重点。 (二)股票投资策略 本基金股票投资采用备选库制度,本基金的备选库包括一级库和二级库。一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围。入选条件主要是根据广发企业价值评估体系,通过研究,筛选出基本面良好的股票进入一级库。二级股票库为本基金的风格库。本基金将根据行业配置阶段形成的行业配置范围,从行业地位、治理结构、经营业绩、竞争优势和创新等方面对领先行业内的股票进行定性分析,并结合(P/E)/G1、预期主营业务收入增长率和预期主营业务利润率等定量指标,精选出各领先行业内估值相对合理的优质上市公司,构成本基金的二级库。 (三)债券投资策略 在债券投资上,坚持稳健投资的原则,控制债券投资风险。具体包括利率预测策略、收益率曲线模型、债券资产类别配置和债券分析。 (四)权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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
下属分级基金的基金简称	广发行业领先混合A / 广发行业领先混合H
下属分级基金的交易代码	270025 / 960001
报告期末下属分级基金的份额总额	2,331,956,246.39份 / 6,300,576.21份

§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)	
	广发行业领先混合A	广发行业领先混合H
1.本期已实现收益	-530,538,089.65	-382,045.69
2.本期利润	-1,200,411,740.58	-102,007.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4862	-0.0255
4.期末基金资产净值	4,429,756,433.47	5,062,226.17
5.期末基金份额净值	1.900	0.803

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

1.广发行业领先混合A:

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	-20.17%	3.03%	-10.75%	1.94%	-9.42%	1.09%

2.广发行业领先混合H:

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	-20.18%	3.03%	-10.75%	1.94%	-9.43%	1.09%

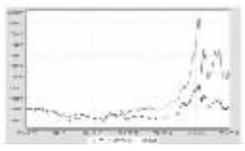
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发行业领先混合型证券投资基金

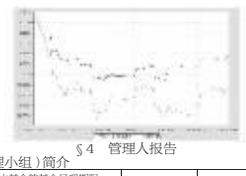
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年11月23日至2016年3月31日)

1. 广发行业领先混合A:



2. 广发行业领先混合H:



§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		
刘晓龙	本基金的基金经理;广发新动力混合基金的基金经理;广发多策略混合基金的基金经理;权益投资一部总经理	2010-11-23	-	9年	男,中国籍,工学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。2007年2月至2010年3月在广发基金管理有限公司研究发展部任行业研究员、研究小组主管。2010年3月11日至2011年3月10日任广发聚丰混合基金的基金经理助理,2010年11月23日起任广发行业领先混合基金的基金经理。2014年3月19日任广发新动力混合基金的基金经理。2015年1月14日起任广发基金有限公司权益投资一部总经理。2015年12月9日任广发多策略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、《广发行业领先混合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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

今年1季度,经济和股市两方面都较为复杂。汇率方面,开年人民币即暴跌,随后国家出面干预,才逐步稳定。国内信贷放量较为明显,引发通胀担忧。国家首次提出供给侧改革,规划宏大,地方开始进入到实际操作层面,效果如何尚不清晰,但是去产能之路注定不平坦,也加剧了市场担忧。

回到股市层面,开年的汇率暴跌引发了市场恐慌,叠加了熔断,导致一月份市场持续暴跌,对市场的打击超过去年前两波下跌。股市人气迅速回落,交易环境恶化。

本基金未能预判风险,在年初仓位较高,并且股票组合弹性较大,在1季度遭受了较大损失,在此向持有人致歉。在市场恢复流动性之后,迅速降低了高估值股票的比重,适度降低仓位,组合趋向于防守。增加了优质成长股比重,并增持了养殖股、电解铝等周期性行业。

今年1季度,经济和股市两方面都较为复杂。汇率方面,开年人民币即暴跌,随后国家出面干预,才逐步稳定。国内信贷放量较为明显,引发通胀担忧。国家首次提出供给侧改革,规划宏大,地方开始进入到实际操作层面,效果如何尚不清晰,但是去产能之路注定不平坦,也加剧了市场担忧。

回到股市层面,开年的汇率暴跌引发了市场恐慌,叠加了熔断,导致一月份市场持续暴跌,对市场的打击超过去年前两波下跌。股市人气迅速回落,交易环境恶化。

本基金未能预判风险,在年初仓位较高,并且股票组合弹性较大,在1季度遭受了较大损失,在此向持有人致歉。在市场恢复流动性之后,迅速降低了高估值股票的比重,适度降低仓位,组合趋向于防守。增加了优质成长股比重,并增持了养殖股、电解铝等周期性行业。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发行业领先A份额的净值增长率为-20.17%,同期业绩比较基准收益率为-10.75%。广发行业领先H份额的净值增长率为-20.18%,同期业绩比较基准收益率为-10.75%。

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月份的暴跌,已经彻底击垮了市场的活跃力量。目前的市场,交易结构恶化较为明显。国家资金、公募基金、私募基金以及游资形成了主要的力量,活跃散户在第三次股灾中受损最严重,市场缺乏弱势交易群体。成长股高估值和交易管制进一步削弱了股市的活跃力量,导致整个市场成交量和赚钱效应双降。本质上,市场处在一轮牛市之后的熊市区域,杀跌三轮之后做空力量大大减弱,但是需要较长的时间休养生息。这样的市场结构叠加过三次暴跌之后,短期市场大幅度上攻或者大幅度杀跌都显得力量不足,进入收敛震荡区间。

结构上看,我们认为要适度均衡。一方面,经过反弹,有业绩的成长股又变得很贵,进攻缺乏弹性。而由于战新板暂停,壳股又被炒,加大了借壳难度。往后看,随着时间推移,并购的弊病会逐渐体现,并购的最佳时期大概率已经过去,未来并购要看协同、管控。周期股方面,由于国家推进供给侧改革,对不可能更差的周期行业来说,有了正面的刺激因素,虽然长期属于没落行业,但是以一年或者半年为周期,可能会有主题性机会,相对收益值得适度配置。

2季度,首先保持中低仓位,继续优化组合,降低组合整体估值,做好长期持有的准备;其次,适度增加周期股配置,选择股价和基本面都处于底部,且受到供给侧改革正面推进的行业,如电解铝等;在此基础上,加大个股研究深度,以业绩兑现作为研究第一原则,用个股研究确定性对抗市场波动。争取在2季度能够挽回部分损失。

§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	3,605,842,868.99	80.79
	其中:股票	3,605,842,868.99	80.79
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	838,491,453.18	18.79
7	其他各项资产	18,791,239.24	0.42
8	合计	4,463,125,561.41	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	345,209,963.30	7.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,611,169,279.68	36.33
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	168,185,481.11	3.79
G	交通运输、仓储和邮政业	550,326,870.56	12.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	359,309,252.18	8.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	53,562,048.67	1.21
L	租赁和商务服务业	182,168,511.41	4.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,279,159.60	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,162,377.48	1.88
R	文化、体育和娱乐业	216,469,925.00	4.88
S	综合	-	-
	合计	3,605,842,868.99	81.31

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	601021	春秋航空	6,200,000	287,804,000.00	6.49
2	002462	嘉事堂	4,201,663	155,335,481.11	3.50
3	002466	天齐锂业	900,000	151,020,000.00	3.41
4	002714	牧原股份	2,085,960	126,513,474.00	2.85
5	603678	火炬电子	2,095,394	119,437,458.00	2.69
6	300383	光环新网	2,849,843	113,851,227.85	2.57
7	600703	三安光电	5,500,000	108,130,000.00	2.44
8	300498	温氏股份	2,099,902	108,039,957.90	2.44
9	300113	顺网科技	1,200,000	106,440,000.00	2.40
10	002707	众信旅游	2,202,793	102,143,511.41	2.30

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根据公开市场信息,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	2,119,565.62
2	应收证券清算款	9,649,987.60
3	应收股利	-
4	应收利息	119,807.18
5	应收申购款	6,901,878.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,791,239.24

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	002714	牧原股份	126,513,474.00	2.85	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发行业领先混合A	广发行业领先混合H
本报告期初基金份额总额	2,517,134,026.65	439,048.55
本报告期基金总申购份额	529,718,795.73	6,309,742.60
减:本报告期基金总赎回份额	714,896,575.99	448,214.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,331,956,246.39	6,300,576.21

§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

项目	广发行业领先混合A	广发行业领先混合H
报告期期初管理人持有的本基金份额	37,081,876.63	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期末管理人持有的本基金份额	37,081,876.63	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.59	-

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 备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发行业领先混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发行业领先混合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.《广发行业领先混合型证券投资基金托管协议》;

5.《广发行业领先混合型证券投资基金基金招募说明书》及更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、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

广发中证全指信息技术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	广发中证全指信息技术ETF
场内简称	信息技术
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年1月8日
报告期末基金份额总额	440,828,053.00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	中证全指信息技术指数。
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	-15,361,907.65
2.本期利润	-111,498,575.66
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2637
4.期末基金资产净值	508,561,540.16
5.期末基金份额净值	1.1537

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	-19.94%	3.43%	-19.92%	3.49%	-0.02%	-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

广发中证全指信息技术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1月8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及联接基金的基金经理;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;广发中证全指主要消费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	2015-01-29	-	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6月在深圳证券信息有限公司任部门总监。2010年6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日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理。2012年6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基金的基金经理。2015年1月29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2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16日起任广发可选消费联接基金的基金经理。2015年6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、《广发中证全指信息技术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主动型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联接基金,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,其净值增长率为-19.94%,同期业绩比较基准收益率为-19.92%。

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。互联网+是全球未来的发展方向,背后体现了信息技术的潜在产业机会,尤其对软件企业来说,未来充满了机遇和发展,信息技术将会更深一步地推动全球一体化,未来继续看好信息技术板块的业绩表现。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,293,889.33	3.69
	其中:股票	12,293,889.33	3.69
2	基金投资	290,360,405.59	87.24
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,527,007.89	8.57
8	其他各项资产	1,633,102.21	0.49
9	合计	332,814,405.02	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	290,360,405.59	90.02

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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	6,459,100.46	2.00
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	32,056.00	0.01
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	5,732,906.28	1.78
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	-	-
S	综合	69,826.59	0.02
	合计	12,293,889.33	3.81

5.3.2 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。

5.4 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	000725	京东方A	123,000	313,650.00	0.10
2	300104	乐视网	6,600	306,174.00	0.09
3	300059	东方财富	6,000	265,800.00	0.08
4	300451	创业软件	1,300	204,477.00	0.06
5	002415	海康威视	6,500	200,330.00	0.06
6	300324	旋极信息	3,900	189,540.00	0.06
7	300017	网宿科技	2,500	146,025.00	0.05
8	600570	恒生电子	2,500	145,850.00	0.05
9	600703	三安光电	6,500	127,790.00	0.04
10	600804	鹏博士	6,000	127,380.00	0.04

5.5 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。

5.6 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。

5.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1恒生电子股份有限公司(股票代码:600570)于2015年8月15日公告收到收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(沪证专调查字2015356号)。因恒生网络涉嫌违反证券、期货法律法规,根据《中华人民共和国证券法》、《期货交易管理条例》的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对恒生网络进行立案调查。并与2015年9月7日公告收到公司控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称"恒生网络")的通知,恒生网络并刘晔峰先生、官晓岚先生于2015年9月7日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")行政处罚事先告知书(处罚字[2015]68号)。

本基金公司投资该公司的原因是:恒生电子作为国内金融IT的龙头公司,历年来业绩表现优秀。虽然子公司因为HOMS系统全型账户开立问题被证监会处罚,但其作为金融创新的业务,原有的私募托管功能依然可以合法的运作,公司也在积极寻找新的创新模式,包括和阿里巴巴旗下的蚂蚁金服的深度合作,都为公司未来开发新的增长点提供了基础,而且处罚事项已经告一段落,并没有影响到公司长远的发展逻辑。

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出发的情况。

5.12.2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。

5.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	118,601.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,422.10
5	应收申购款