广发全球医疗保健指数证券投资基金

【2017】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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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2017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	119,088,437.80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	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流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%。
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	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	2,057,551.87
2.本期利润	10,516,096.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0846
4.期末基金资产净值	149,157,461.24
5.期末基金份额净值	1.252

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。

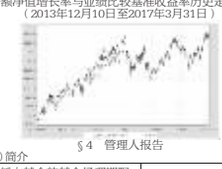
3.2 基金净值表现

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	7.10%	0.56%	6.80%	0.57%	0.30%	-0.01%

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2017年3月31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		
李耀柱	本基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;广发全球农业指数(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;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(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;广发沪港深新起点股票基金的基金经理;广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理	2016-08-23	-	7年	男,中国籍,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,2010年8月至2014年7月在广发基金管理有限公司中央交易部任股票交易员,2014年8月至2015年12月在国际业务部先后任QDII基金的研究员、基金经理助理,2015年12月17日起任广发纳指100ETF基金的基金经理,2016年8月23日起任广发全球农业指数(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)、广发美国房地产指数(QDII)、广发亚太中高收益债券(QDII)、广发全球医疗保健(QDII)和广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理,2016年11月9日起任广发沪港深新起点股票基金的基金经理,2017年3月10日起任广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)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。监察稽核室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

2017年1季度,公司旗下主动管理的股票型基金、混合型基金、债券型基金、QDII基金、指数型基金、FOF基金、MOM基金、专户投资组合、社保基金、企业年金、基本养老保险基金、特定客户资产管理计划、基金专户投资组合、QFII、RQFII、QDII、沪港深、深港通、券商集合理财、基金子公司、基金专户、保险资产管理公司、证券公司、期货公司、银行理财、信托、私募等各类资产管理业务,以及投顾业务、投研业务、风险管理、内控合规、IT、运营、人力资源、财务、市场、品牌、法律、战略、党建、工会、团委、纪委、监察、稽核、内审、董秘、董事会、监事会、总经办、总裁办、分公司、子公司、分支机构、各部门、各岗位、各项目、各产品、各业务、各流程、各制度、各系统、各数据、各人员、各文化、各理念、各品牌、各形象、各公益、各活动、各关系、各合作、各竞争、各对手、各市场、各客户、各股东、各利益、各责任、各义务、各权利、各风险、各机遇、各挑战、各困难、各问题、各矛盾、各冲突、各对抗、各博弈、各平衡、各稳定、各发展、各壮大、各强盛、各辉煌、各荣誉、各奖项、各奖励、各奖杯、各奖牌、各奖状、各奖证、各奖金、各奖学金、各奖励基金、各奖励机构、各奖励组织、各奖励委员会、各奖励委员会主任、各奖励委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会主任委员会、各奖励委员会主任、各奖励委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会、各奖励委员会主任、各奖励委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会、各奖励委员会主任、各奖励委员会主任委员、各奖励委员会主任委员会、各奖励委员会主任委员、各奖励委员会主任