# 广发中证医疗指数分级证券投资基金

## 2017年第四季度报告

2017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:北京银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年一月二十日

§ 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2018 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 广发医疗指数分级 | | |
| 场内简称 | 医疗分级 | | |
| 基金主代码 | 502056 | | |
| 交易代码 | 502056 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2015年 7 月 23 日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 127,376,396.22 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的最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。 | | |
| 投资策略 | 本基金为指数型基金,主要采用完全复制法,即按照标的指数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。 | | |
| 业绩比较基准 | 95%× 中证医疗指数收益率 +5%× 银行活期存款利率( 税后)。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为完全复制指数的股票型基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,从本基金所分离的两类基金份额来看,广发医疗 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征;广发医疗 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。 | | |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 | | |
| 下属三级基金的基金简称 | 广发医疗指数分级 A | 广发医疗指数分级 B | 广发医疗指数分级 |
| 下属三级基金的交易代码 | 502057 | 502058 | 502056 |
| 报告期末下属三级基金的份额总额 | 7,872,273.00 份 | 7,872,273.00 份 | 111,631,850.22 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 (2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | - 2,649,890.00 |
| 2.本期利润 | - 644,312.06 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | - 0.0047 |
| 4.期末基金资产净值 | 122,660,845.10 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9630 |

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

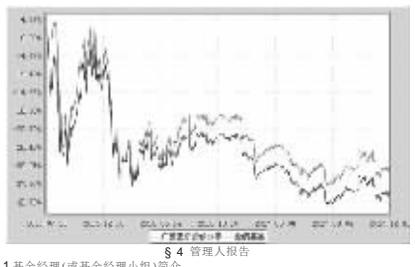
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.65% | 1.36% | - 0.32% | 1.38% | 0.97% | - 0.02% |

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

广发中证医疗指数分级证券投资基金

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 7 月 23 日至 2017 年 12 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 | | |
| 罗国庆 | 本基金的基金经理;广发深证 100 指数分级基金的基金经理;广发中证全指汽车基金的基金经理;广发中证全指建筑材料基金的基金经理;广发家用电器指数基金的基金经理;广发中证传媒 ETF 基金的基金经理;广发中证传媒 ETF 联接基金的基金经理;指数投资部副总经理 | 2015- 10-13 | - | 9年 | 罗国庆先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员,华富基金管理有限公司产品设计研究员,广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员,现任广发基金管理有限公司指数投资部副总经理,广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理( 自 2015 年 10 月 13 日起任职),广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理( 自 2015 年 10 月 13 日起任职),广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理( 自 2017 年 7 月 31 日起任职),广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理( 自 2017 年 8 月 2 日起任职),广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理( 自 2017 年 9 月 13 日起任职),广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金( 自 2017 年 12 月 29 日任职),广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金( 自 2018 年 1 月 2 日起任职)。 |

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、《广发中证医疗指数分级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。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运作分析

运作期间内,本基金的申购赎回及本基金的分级份额的交易、分拆、合并运作正常,运作过程中未发生风险事件。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资,指数样本采用完全复制方法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

基金投资运作方面,报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

回顾 2017 年四季度,市场在 2017 年 10 月中旬出现调整,调整先后顺序从小向大调整。市值最小的先开始调整, 以中证 1000 和创业板综指为代表的小市值股票在 2017 年 10 月 10-12 日就见顶开始回调,随后扩散到二线龙头,这个时候大部分公司回调带动市场综指如上涨综指、万得全 A 开始回调(2017 年 11 月 14 日),而市值最大的一线白马和权重板块最后回调,用上证 50 和沪深 300 为代表来看,他们回调的时间是 2017 年 11 月 22 日。

展望 2018 年一季度行情值得期待。回顾历史,除 2014 年 1 季度之外,历年大盘指数均出现过春季行情:1.从历史经验来看,春季行情主线通常集中在周期、金融和成长股板块表现突出的概率较高;2.春季行情一般始于 1 月下旬至 2 月初。3.估值扩张是推动市场春季行情的最主要因素;4.如果将区间扩展至整个一季度,市场表现将大打折扣。促成春季行情的原因大致可以分为季节性因素、投资者行为因素(国内外资金跨年布局、风险偏好提升)和政策面因素(经济政策预期等)。

4.5 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 0.65%,同期业绩比较基准收益率为 -0.32%。

§ 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 | 115,581,302.53 | 93.42 |
| | 其中:股票 | 115,581,302.53 | 93.42 |
| 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 | 7,655,255.42 | 6.19 |
| 7 | 其他各项资产 | 492,084.13 | 0.40 |
| 8 | 合计 | 123,728,642.08 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 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 | 266,970.19 | 0.22 |
| 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 | 34,112.55 | 0.03 |
| 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 | 32,323.20 | 0.03 |
| 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 | - | - |
| | 合计 | 333,405.94 | 0.27 |

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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 | 71,210,848.45 | 58.06 |
| 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 | 4,891,688.38 | 3.99 |
| 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 | 4,743,978.56 | 3.87 |
| 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 | 518,978.00 | 0.42 |
| 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 | 33,882,403.20 | 27.62 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 115,247,896.59 | 93.96 |

5.2.3 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资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 | 300003 | 乐普医疗 | 497,450 | 12,018,392.00 | 9.80 |
| 2 | 002044 | 美年健康 | 484,300 | 10,591,641.00 | 8.63 |
| 3 | 300015 | 爱尔眼科 | 281,775 | 8,678,670.00 | 7.08 |
| 4 | 002223 | 鱼跃医疗 | 258,514 | 5,066,874.40 | 4.13 |
| 5 | 002219 | 恒康医疗 | 429,494 | 5,029,374.74 | 4.10 |
| 6 | 300347 | 泰格医药 | 139,770 | 4,917,108.60 | 4.01 |
| 7 | 002030 | 达安基因 | 236,401 | 4,392,330.58 | 3.58 |
| 8 | 300244 | 迪安诊断 | 152,677 | 3,606,230.74 | 2.94 |
| 9 | 000516 | 国际医学 | 729,242 | 3,565,993.38 | 2.91 |
| 10 | 300253 | 卫宁健康 | 517,786 | 3,474,344.06 | 2.83 |

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 002920 | 德赛西威 | 4,569 | 178,784.97 | 0.15 |
| 2 | 002915 | 中欣氟材 | 1,085 | 38,181.15 | 0.03 |
| 3 | 300730 | 科创信息 | 821 | 34,112.55 | 0.03 |
| 4 | 300664 | 鹏鹞环保 | 3,640 | 32,323.20 | 0.03 |
| 5 | 002922 | 伊戈尔 | 1,245 | 22,248.15 | 0.02 |

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名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 | 63,544.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 194,452.65 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,470.09 |
| 5 | 应收申购款 | 232,617.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 492,084.13 |

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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资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 | 002219 | 恒康医疗 | 5,029,374.74 | 4.10 | 重大事项停牌 |

5.11.5.2 期末积极投资前五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 | 300730 | 科创信息 | 34,112.55 | 0.03 | 新股流通受限 |
| 2 | 300664 | 鹏鹞环保 | 32,323.20 | 0.03 | 新股流通受限 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 广发医疗指数分级 A | 广发医疗指数分级 B | 广发医疗指数分级 |
|---|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 9,632,823.00 | 9,632,823.00 | 96,559,961.29 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - | 108,529,849.44 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | - | - | 100,555,932.87 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - 1,760,550.00 | - 1,760,550.00 | 7,097,972.36 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,872,273.00 | 7,872,273.00 | 111,631,850.22 |

注:拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额及份额折算所得份额

§ 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医疗指数分级证券投资基金募集的文件

(二)《广发中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《广发中证医疗指数分级证券投资基金托管协议》

(四)法律意见书

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。

广发基金管理有限公司

二〇一八年一月二十日

# 广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金

## 2017年第四季度报告

2017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:二〇一八年一月二十日

§ 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 2018 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 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 | |
| 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 | 1,386,898,117.21 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发环保指数 A | 广发环保指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001064 | 002984 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,237,374,843.52 份 | 149,523,273.69 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 (2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日) | |
|---|---|---|
| | 广发环保指数 A | 广发环保指数 C |
| 1.本期已实现收益 | - 17,266,621.11 | - 2,259,109.32 |
| 2.本期利润 | - 49,101,183.65 | - 6,917,335.88 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | - 0.0426 | - 0.0558 |
| 4.期末基金资产净值 | 947,564,771.26 | 114,007,073.41 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7658 | 0.7625 |

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.广发环保指数 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 | - 5.15% | 1.05% | - 5.43% | 1.04% | 0.28% | 0.01% |

2.广发环保指数 C:

| 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 | - 5.21% | 1.05% | - 5.43% | 1.04% | 0.22% | 0.01% |

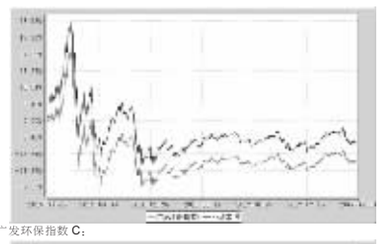
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金

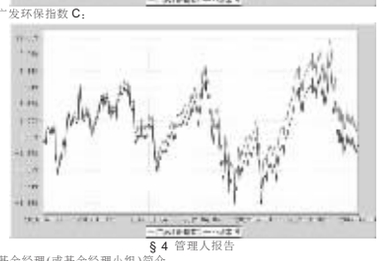
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 3 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)

1.广发环保指数 A:



2.广发环保指数 C:



§ 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 300ETF 联接基金的基金经理;广发中证 500ETF 基金的基金经理;广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理;广发沪深 300ETF 基金的基金经理;广发中小板 300ETF 基金的基金经理;广发深证 100 指数分级基金的基金经理;广发中证全指建筑材料基金的基金经理;广发家用电器指数基金的基金经理;广发中证传媒 ETF 基金的基金经理;广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理;广发创业板 ETF 基金的基金经理;广发创业板 ETF 联接基金的基金经理;广发量化稳健混合基金的基金经理;指数投资部总经理助理 | 2016- 01-25 | - | 14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)。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理 自 2014 年 4 月 1 日起任职)、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理( 自 2014 年 4 月 1 日起任职)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理 自 2015 年 8 月 20 日起任职)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理( 自 2016 年 1 月 18 日起任职)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理( 自 2016 年 1 月 25 日起任职)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理( 自 2016 年 1 月 25 日起任职)、广发中证老产业指数型发起式证券投资基金基金经理 自 2016 年 1 月 25 日起任职)、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 日起任职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理( 自 2016 年 9 月 26 日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 自 2017 年 1 月 25 日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理( 自 2017 年 4 月 25 日起任职)、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基金经理( 自 2017 年 5 月 25 日起任职)、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 日起任职)。 |

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。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。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成分股调整、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。

四季度,整体市场风格延续了全年的市场偏好,即大盘蓝筹表现更好,市场继续延续了"白马"行情,从行业角度看,食品饮料、家电、医药等行业表现较好。

2017 年中国经济出现了企稳回升态势,主要受益于供给侧改革和外需改善。出口方面,在全球经济复苏的带动下,2017 年前 11 个月中国货物贸易总额超过 25 万亿元人民币,比上年同期增长 15.6%,增速创 6 年来新高。在内需方面,消费已经成为中流砥柱,2017 年前 3 季度,社会消费品零售总额同比增长 10.4%,增速与上年同期持平。二级市场大趋势的变化,或许能够从经济结构方面的细微变化找到部分答案, 总体上未来也继续看好整体市场的结构性机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金 A 类份额的净值增长率为 -5.15%,C 类份额净值增长率为 -5.21%,同期业绩比较基准收益率为 -5.43%,较好地跟踪了指数。

§ 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 | 994,059,352.06 | 93.26 |
| | 其中:股票 | 994,059,352.06 | 93.26 |
| 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 | 70,069,739.86 | 6.57 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,827,025.11 | 0.17 |
| 8 | 合计 | 1,065,956,117.03 | 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 | 10,189,336.24 | 0.96 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 622,110,988.78 | 58.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 158,590,157.19 | 14.94 |
| E | 建筑业 | 71,619,045.76 | 6.75 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,957.94 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 29,346,308.24 | 2.76 |
| 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 | 92,640,505.11 | 8.73 |
| 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 | 9,545,052.80 | 0.90 |
| | 合计 | 994,059,352.06 | 93.64 |

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 | 002366 | 台海核电 | 468,938 | 12,403,410.10 | 1.17 |
| 2 | 300237 | 美晨科技 | 700,394 | 11,675,567.98 | 1.10 |
| 3 | 002341 | 新纶科技 | 413,900 | 11,382,250.00 | 1.07 |
| 4 | 002080 | 中材科技 | 428,254 | 11,284,492.90 | 1.06 |
| 5 | 002202 | 金风科技 | 596,597 | 11,245,853.45 | 1.06 |
| 6 | 300274 | 阳光电源 | 595,493 | 11,177,403.61 | 1.05 |
| 7 | 300203 | 聚光科技 | 312,006 | 11,091,813.30 | 1.04 |
| 8 | 600388 | 龙净环保 | 636,291 | 11,007,834.30 | 1.04 |
| 9 | 600116 | 三峡水利 | 1,234,283 | 10,985,118.70 | 1.03 |
| 10 | 002573 | 清新环境 | 482,511 | 10,967,475.03 | 1.03 |

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名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 | 74,850.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 14,285.47 |
| 5 | 应收申购款 | 1,737,889.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,827,025.11 |

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 | 002366 | 台海核电 | 1,737,889.02 | 1.17 | 重大事项停牌 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 广发环保指数 A | 广发环保指数 C |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,035,859,570.08 | 63,189,843.58 |
| 本报告期基金总申购份额 | 366,917,733.90 | 229,411,321.45 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 165,402,460.46 | 143,077,891.34 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,237,374,843.52 | 149,523,273.69 |

§ 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 | 广发环保指数 A | 广发环保指数 C |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,200.02 | - |
| 报告期买入 / 申购总份额 | - | - |
| 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,基金管理人运用固有资金(认)申购、赎回或买