广发全球医疗保健指数证券投资基金 2017年年度报告摘要

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：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2018年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	127,720,721.53份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。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%，实现对标普全球1200医疗保健指数的有效跟踪。
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%。本基金主要采用完全复制法来跟踪标普全球1200医疗保健指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。
业绩比较基准	标普全球1200医疗保健指数（S&P Global 1200 Health Care Sector Index）。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人	
名称		广发基金管理有限公司	广发银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	段西军	戴辉	
	联系电话	020-83936666	010-65169958	
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	daihui@cgbchina.com.cn	
客户服务电话		95105828，020-83936999	95508	
传真		020-89899158	020-65169555	

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人	
名称	英文	-	Citibank N.A	
	中文	-	美国花旗银行有限公司	
注册地址		-	10/F Harbourfront II 22 Tak Fund Street Hung Hom, Kowloon, Hong Kong	
办公地址		-	10/F Harbourfront II 22 Tak Fund Street Hung Hom, Kowloon, Hong Kong	
邮政编码		-	-	

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	4,636,960.02	7,747,143.99	15,805,561.20
本期利润	16,060,796.34	-1,918,545.05	22,504,685.89
加权平均基金份额本期利润	0.1380	-0.0124	0.1192
本期基金份额净值增长率	11.38%	-1.03%	11.77%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0984	0.0584	0.1175
期末基金资产净值	166,245,032.56	150,588,779.85	201,343,313.87
期末基金份额净值	1.302	1.169	1.301

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.06%	0.45%	-1.29%	0.48%	0.23%	-0.03%
过去六个月	-0.91%	0.45%	-0.68%	0.50%	-0.23%	-0.05%
过去一年	11.38%	0.49%	11.36%	0.52%	0.02%	-0.03%
过去三年	23.21%	0.77%	20.12%	0.80%	3.09%	-0.03%
自基金合同生效起至今	43.41%	0.74%	44.34%	0.78%	-0.93%	-0.04%

注：（1）本基金的业绩比较基准为：人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。

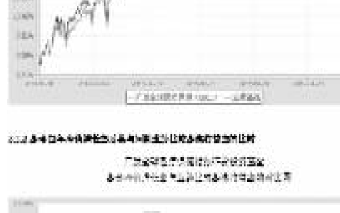
（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

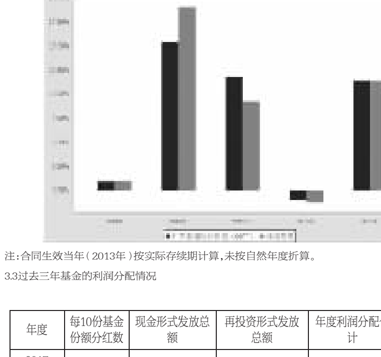
3.2.2基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发全球医疗保健指数证券投资基金

份额累计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12月31日)





注：合同生效当年（2013年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	-	-	-	-	-
2016	1.100	11,916,504.76	5,392,639.56	17,309,144.32	-
2015	-	-	-	-	-
合计	1.100	11,916,504.76	5,392,639.56	17,309,144.32	-

§4管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和29个部门：权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至2017年12月31日，本基金管理人管理161只开放式基金，管理资产规模为2799亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资和养老基金投资组合。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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；广发美国房地产指数(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；广发全球农业指数（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；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发海外多元配置（QDII）基金的基金经理；国际业务部总经理助理	2016-8-23	-	8年	李耀柱先生，理学硕士，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中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2017年11月9日）。现任广发基金管理有限公司国际业务部总经理助理、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2015年12月17日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日起任职）、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年8月23日起任职）、广发沪港深新起点股票型证券投资基金基金经理（自2016年11月9日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自2017年3月10日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2017年9月21日起任职）、广发海外多元配置证券投资基金（QDII）基金经理（自2018年2月8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、《广发全球医疗保健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。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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，医疗保健指数震荡上行。一月份，特朗普进行总统就职典礼，"特朗普"行情有所延续，市场担心新总统抨击制药企业高利润率，医疗行业在一月份表现波动。二月份，市场之前对新总统关于医药行业的价格控制表现得过于悲观，但是实际影响远没有之前预期的大，医疗行业大幅反弹。三月份，虽然美联储表明三月加息的概率大涨，但是美国市场在经历短暂调整后继续走出上涨行情，在中下旬，美联储加息靴子落地，今年加息次数为3次，同时也表示缩表的可能，医疗行业出现了一定的抛压，但是价格整体在高位运行。

进入二季度，医疗保健指数走出一波上涨趋势。四月份，美国众议院共和党议员未能获得足够支持票以通过其医改法案，市场处于观望状态，医疗行业表现波动，于月末小幅上扬。五月份，马克龙以65%得票率赢得法国总统大选，由于马克龙主张亲欧，支持全球化，以及欧盟建设，他的当选将巩固欧盟稳定性，市场对欧洲再次出现政治风险的担心消退，欧美股市风险偏好提升，欧美股市上涨，医疗指数随之上涨。六月份，特朗普政府在药价监管方面的措施力度不及早前预期的严厉，加之大型生物制药企业业绩表现良好，市场预期未来FDA新药审批加速，并购条件放松，对大型药企形成利好，医疗指数继续上涨。参议院共和党领导人于6月22日提出了新的医疗保健改革法案，废除了奥巴马医改税，重组了基于收入的保险客户的补贴，逐步淘汰了医疗补助计划，但该法案遭受民主党及共和党保守派的的反对，医改方案受阻，医疗指数于月末回落。

三季度，指数震荡整固后重拾上升趋势。七月份，权重股强生、诺华等发布财报，收入高于预期，且发布多个新产品，但由于特朗普政府提出的医保法案在参议院受阻，多名参议员对草案表示拒绝，月底废除奥巴马医改的第三次投票失败，医疗保健指数在小幅上涨后回落。八月份，朝鲜半岛危机，地缘政治的风险加剧，弗吉尼亚的种族危机和美国政府内部分歧引发股市下行，JP摩根发布医药行业报告，提出行业竞争加剧，高杠杆限制发展等问题，利空市场情绪，八月指数总体下行。九月份，美国开展了针对吗啡类药品生产商的调查，辉瑞制药对强生提出诉讼，事件对医疗指数产生负面影响，欧洲央行决议维持主要再融资利率与资产购买规模不变，符合市场预期，欧洲股市大体上呈上涨走势，医疗指数也随市场上行。

四季度，医疗指数先抑后扬。十月，美国共和党和民主党达成了旨在稳定奥巴马医改的协议，协议带来了医疗保险市场稳定的希望，医疗板块走高。随后受生物医药公司营业收入和盈利不及预期的负面数据拖累，指数出现大幅调整。十一月，指数企稳反弹，随后进入震荡整固，市场对2018年的乐观期望得以保持，主要因素是临床突破与创新产品的推出，以及FDA加快批准重要新药的举措，支撑医疗指数指数上涨。

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11.38%，同期业绩比较基准收益率为11.36%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年二月，美国非农数据远超预期，引发通胀上升的预期，市场对美联储加快加息节奏的担忧，导致美股出现大幅回调，美债利率大涨，十年期国债收益率触及2.9%，在短短一个月内涨幅达到40个基点，引发投资者对利率过快上行后对估值压制的担忧。叠加上前期美股涨幅多大，技术面上处于超买状态，盈利盘的获利了结给指数带来很大卖压。在指数大幅波动下跌的过程中，被动指数和量化的程序化交易拥挤交易也放大加剧了市场的波动。

但美股的基本面并未下行，经济数据强劲，部分权重股公布的2017年业绩数据有不俗表现。对医疗指数未来走势，我们认为短期内受利率快速上升，加息预期的负面影响，指数很可能将会震荡调整一段时间，尤其是成长型股票，在利率上行周期内受估值压制的影响更大。但从长期来看，我们对美国经济基本面和生物科技公司的财务状况，都持较为乐观的态度，且FDA加速新药审批流程也利好指数，在这波调整过后，待估值回到较为合理的位置，指数有望继续重启上升通道。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中"基金收益与分配"之"基金收益分配原则"的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对广发全球医疗保健指数证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告 等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 洪锐明 江丽雅签字出具了德师报(审)字(18)第P01505号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发全球医疗保健指数证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：	-	-
银行存款	6,973,968.07	7,455,760.16
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	143,312,691.93	143,294,588.33
其中：股票投资	139,301,286.96	139,705,815.18
基金投资	4,011,404.97	3,588,773.15
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	6,128.58	606,682.83
应收利息	304.87	178.88
应收股利	131,379.29	151,313.71
应收申购款	20,470,583.49	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	173,273.66	790,579.16
资产总计	171,068,329.89	152,299,103.07
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	4,047,971.53	275,287.35
应付赎回款	381,522.83	210,664.62
应付管理人报酬	101,654.10	102,250.34
应付托管费	31,766.92	31,953.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,381.95	1,090,167.70
负债合计	4,823,297.33	1,710,323.22
所有者权益：	-	-
实收基金	127,720,721.53	128,831,567.52
未分配利润	38,524,311.03	21,757,212.33
所有者权益合计	166,245,032.56	150,588,779.85
负债和所有者权益总计	171,068,329.89	152,299,103.07

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值人民币1.302元，基金份额总额127,720,721.53份。

7.2 利润表

会计主体：广发全球医疗保健指数证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	18,108,172.69	549,046.63
1.利息收入	20,841.92	24,816.62
其中：存款利息收入	20,841.92	24,816.62
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	7,035,374.03	9,817,365.35
其中：股票投资收益	4,417,886.43	6,812,846.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	34,869.30	-
股利收益	2,582,618.30	3,004,518.95
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	11,423,836.32	-9,665,689.04
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-396,675.40	297,920.25
5.其他收入（损失以"-"号填列）	24,795.82	74,633.45
减：二、费用	2,047,376.35	2,467,591.68
1. 管理人报酬	1,190,235.07	1,446,878.13
2. 托管费	371,948.54	452,149.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,280.83	26,575.01
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	471,911.91	541,989.12
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	16,060,796.34	-1,918,545.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	16,060,796.34	-1,918,545.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发全球医疗保健指数证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2017年1月1日至2017年12月31日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益（基金净值）	128,831,567.52	21,757,212.33	150,588,779.85	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,060,796.34	16,060,796.34	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-1,110,845.99	706,302.36	-404,543.63	
其中：1.基金申购款	36,565,032.42	11,234,154.70	47,799,187.12	
2.基金赎回款	-37,675,878.41	-10,527,852.34	-48,203,730.75	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-	
五、期末所有者权益（基金净值）	127,720,721.53	38,524,311.03	166,245,032.56	
项目	上年度可比期间			
	2016年1月1日至2016年12月31日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益（基金净值）	154,715,212.39	46,628,101.48	201,343,313.87	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,918,545.05	-1,918,545.05	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-25,883,644.87	-5,643,199.78	-31,526,844.65	
其中：1.基金申购款	44,935,171.85	6,695,824.88	51,630,996.73	
2.基金赎回款	-70,818,816.72	-12,339,024.66	-83,157,841.38	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-17,309,144.32	-17,309,144.32	
五、期末所有者权益（基金净值）	128,831,567.52	21,757,212.33	150,588,779.85	

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

广发全球医疗保健指数证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2013]1191号文《关于核准广发全球医疗保健指数证券投资基金募集的批复》批准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》("基金合同")发起，于2013年12月10日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为广发银行股份有限公司，境外资产托管人为美国花旗银行有限公司。

本基金募集期为2013年11月4日至2013年12月3日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币245,670,387.48元，有效认购户数为3,903户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币17,496.14元，折合基金份额17,496.14份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括全球证券市场中的标普全球1200医疗保健指数成份股、备选成份股、以标普全球1200医疗保健指数为投资标的的指数基金（包括ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证（可简称"REITs"）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金业绩比较基准为人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。

本基金的财务报表于2018年3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称"企业会计准则"）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1.证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
美国花旗银行有限公司	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司）	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,190,235.07	1,446,878.13
其中：支付销售机构的客户维护费	214,674.72	314,369.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.80%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	371,948.54	452,149.42

注：本基金的托管费（含境外托管人的托管费）按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	15,313,169.98	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	15,313,169.98	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.99%	-

注：基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
广发银行股份有限公司	2,152,549.09	11,714.81	863,264.01	24,055.09	
美国花旗银行有限公司	4,821,418.98	9,121.67	6,592,496.15	1.32	

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司和境外资产托管人美国花旗银行有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
BCR US	CR巴德	2017-12-29	重大事项	2,164.39	-	-	332.00	330,501.91	718,576.95	-

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注7.4.4.5。

（ii）各层级金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为142,594,114.98元，属于第二层级的余额为718,576.95元，无属于第三层级的金额(2016年12月31日：属于第一层级的余额为143,294,588.33元，无属于第二层级和第三层级的金额)。

（iii）公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	139,301,286.96	81.43
	其中：普通股	139,041,296.89	81.28
	存托凭证	259,990.07	0.15
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	4,011,404.97	2.34
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	6,973,968.07	4.08
8	其他各项资产	20,781,669.89	12.15
9	合计	171,068,329.89	100.00

8.2期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	ISHARES GLOBAL HEALTH CARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	4,011,404.97	2.41

8.3期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	95,500,343.28	57.45
瑞士	13,648,722.83	8.21
英国	6,999,188.67	4.21
日本	6,791,730.75	4.09
德国	5,250,391.45	3.16
法国	3,824,083.95	2.30
丹麦	3,554,854.72	2.14
澳大利亚	2,151,213.32	1.29
荷兰	1,077,850.29	0.65
比利时	310,330.08	0.19
加拿大	192,577.62	0.12
合计	139,301,286.96	83.79

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西班牙在美国上市的ADR。

8.4期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	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	-	-
电信业务	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	139,301,286.96	83.79
合计	139,301,286.96	83.79

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.5期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值比例（%）
1	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	12,489.00	11,401,937.76	6.86
2	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN SW	瑞士证券交易所	瑞士	12,297.00	6,792,087.74	4.09
3	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	27,752.00	6,568,030.43	3.95
4	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽约证券交易所	美国	4,548.00	6,551,529.22	3.94
5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	3,304.00	5,459,261.09	3.28
6	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	12,776.00	4,697,472.45	2.83
7	ABBVIE INC	艾伯维有限公司	ABBV US	纽约证券交易所	美国	7,392.00	4,671,170.99	2.81
8	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,362.00	3,820,231.79	2.30
9	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约证券交易所	美国	6,266.00	3,306,171.25	1.99
10	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMY US	纽约证券交易所	美国	7,630.00	3,055,172.37	1.84

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.6报告期内权益投资组合的重大变动

8.6.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	KONINKLIJKE PHILIPS NVR- NY	PHG US	1,195,349.03	0.79
2	KONINKLIJKE PHILIPS NV	PHIA NA	1,082,474.01	0.72
3	INCYTE CORP	INCY US	823,482.14	0.55
4	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALGN US	495,710.09	0.33
5	IDEXX LABORATORIES INC	IDXX US	467,878.11	0.31
6	IQVIA HOLDINGS INC	IQV US	436,923.72	0.29
7	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	433,848.96	0.29
8	OLYMPUS CORP	7733 JP	405,091.67	0.27
9	RESMED INC	RMD US	371,445.75	0.25
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	348,142.11	0.23
11	NOVARTIS AG-REG	NOVN SW	325,599.10	0.22
12	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	ROG SW	288,476.57	0.19
13	PFIZER INC	PFE US	261,213.81	0.17
14	SONOVA HOLDING AG-REG	SOON SW	260,392.03	0.17
15	GRIFOLS SA-ADR	GRFS US	251,625.56	0.17
16	STRAUMANN HOLDING AG-REG	STMN SW	231,411.76	0.15
17	MERCK & CO. INC.	MRK US	228,089.31	0.15
18	ROCHE HOLDING AG-BR	RO SW	208,357.06	0.14
19	ABBVIE INC	ABBV US	176,171.86	0.12
20	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	TMO US	149,729.41	0.10

注：本项及下项8.5.2、8.5.3的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	1,952,626.12	1.30
2	PFIZER INC	PFE US	1,171,060.13	0.78
3	NOVARTIS AG-REG	NOVN VX	1,090,809.68	0.72
4	KONINKLIJKE PHILIPS NVR- NY	PHG US	1,083,612.52	0.72
5	MERCK & CO. INC.	MRK US	993,164.51	0.66
6	ACTELION LTD-REG	ATLN SW	967,837.70	0.64
7	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	ROG VX	951,120.25	0.63
8	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZBH US	836,451.82	0.56
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	811,317.25	0.54
10	ALLERGAN PLC	AGN US	774,111.28	0.51
11	AMGEN INC	AMGN US	714,888.24	0.47
12	SANOFI	SAN FP	649,148.46	0.43
13	ABBVIE INC	ABBV US	637,042.64	0.42
14	MEDTRONIC PLC	MDT US	608,768.17	0.40
15	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	540,466.21	0.36
16	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	529,272.48	0.35
17	BAYER AG-REG	BAYN GR	522,160.03	0.35
18	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	500,750.00	0.33
19	CELGENE CORP	CELG US	490,843.99	0.33
20	NOVO NORDISK A/S-B	NOVOB DC	440,946.56	0.29

8.6.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	11,296,626.69
卖出收入（成交）总额	27,229,913.65

8.7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。

8.8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。

8.9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。

8.10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投资。

8.11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

金额单位：人民币元

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	ISHARES GLOBAL HEALTH CARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	4,011,404.97	2.41

8.12投资组合报告附注

8.12.1根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	6,128.58
3	应收股利	131,379.29
4	应收利息	304.87
5	应收申购款	20,470,583.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	173,273.66
8	其他	-
9	合计	20,781,669.89

8.12.4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。

8.12.5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。

§9基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
8,259	15,464.43	50,272,287.35	39.36%	77,448,434.18	60.64%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,469,834.39	1.9338%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年12月10日)基金份额总额	245,670,387.48
本报告期期初基金份额总额	128,831,567.52
本报告期基金总申购份额	36,565,032.42
减：本报告期基金总赎回份额	37,675,878.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	127,720,721.53

§11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回原告诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Citigroup	-	35,787,831.70	96.15%	11,070.85	91.69%	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	1,432,852.22	3.85%	1,002.96	8.31%	-
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
GMAP	-	-	-	-	-	-

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i.财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；

ii.研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；

iii.交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；

iv.清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；

v.能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；

vi.经营行为规范，有健全的内部控制制度；

vii.具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

i.本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。

ii.本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。

iii.本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分，可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170101-20171231	34,622,800.43	0.00	0.00	34,622,800.43	27.11%
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。							

广发基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日