

# 广发标普全球农业指数证券投资基金

## 2017 年第 2 季度报告

2017 年 6 月 30 日

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：二〇一七年七月十九日

## § 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 2017 年 7 月 17 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发全球农业指数（QDII）
基金主代码	270027
交易代码	270027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 28 日
报告期末基金份额总额	60,739,172.75 份
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的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%，年跟踪误差不超过 5%，实现对标普全球农业指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗

	<p>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。</p> <p>本基金将不低于 85% 的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
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	中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

### § 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 4 月 1 日-2017 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	1,919,886.84
2.本期利润	47,975.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0008
4.期末基金资产净值	71,671,796.27

5.期末基金份额净值	1.180
------------	-------

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	0.08%	0.59%	0.64%	0.60%	-0.56%	-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

广发标普全球农业指数证券投资基金  
 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

(2011 年 6 月 28 日至 2017 年 6 月 30 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； 广发全球医疗 保健 (QDII) 基金的基金经 理；广发生物 科技指数	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

	(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				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、《广发标普全球农业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 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

二季度指数表现区间震荡。五月，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。同时，指数权重股迪尔公司的业绩超出市场预期，指数表现较好。但是由于六月加息拖累农产品板块的表现，指数高位回落。

报告期内，本基金紧密跟踪标的指数。

#### 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 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.64%。

## § 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	68,681,409.55	94.85

	其中：普通股	65,925,468.33	91.04
	存托凭证	2,755,941.22	3.81
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	3,594,044.12	4.96
8	其他各项资产	135,233.30	0.19
9	合计	72,410,686.97	100.00

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	42,944,742.48	59.92
日本	7,032,817.77	9.81
英国	5,027,697.69	7.01
挪威	3,827,437.42	5.34
新加坡	3,803,510.03	5.31
加拿大	2,996,156.73	4.18
中国香港	2,475,869.11	3.45



以色列	573,178.32	0.80
合计	68,681,409.55	95.83

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、上述美国比重包括巴西在美国上市的 ADR。

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	20,460,734.29	28.55
工业	11,119,598.03	15.51
非必须消费品	-	-
必须消费品	37,101,077.23	51.77
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	68,681,409.55	95.83

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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及存托凭证投资明细

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	DEERE & CO	迪尔	DEUS	纽约证券交易所	美国	7,595.00	6,358,899.29	8.87
2	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSNUS	纽约证券交易所	美国	14,774.00	6,268,322.65	8.75
3	MONSANTO	孟山都	MON	纽约证券	美国	7,433.00	5,959,913.08	8.32

	CO		US	交易所				
4	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels - Midland 公司	ADM US	纽约证券交易所	美国	20,392.00	5,716,380.71	7.98
5	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	英国联合食品集团	ABF LN	伦敦证券交易所	英国	18,427.00	4,768,737.78	6.65
6	KUBOTA CORP	久保田	6326 JP	东京证券交易所	日本	41,700.00	4,760,698.74	6.64
7	BUNGE LTD	Bunge 有限公司	BG US	纽约证券交易所	美国	7,180.00	3,628,558.32	5.06
8	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温省钾肥股份有限公司	POT US	纽约证券交易所	美国	29,693.00	3,278,781.82	4.57
9	WILMAR INTERNATIONAL LTD	丰益国际有限公司	WIL SP	新加坡证券交易所	新加坡	191,900.00	3,162,460.72	4.41
10	AGRIUM INC	加阳公司	AGU CN	多伦多证券交易所	加拿大	4,886.00	2,996,156.73	4.18

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 5.5 报告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。

#### 5.6 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。

#### 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。

#### 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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

#### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

##### 5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	117,761.11
4	应收利息	123.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	17,349.00
8	其他	-
9	合计	135,233.30

##### 5.10.4 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。

### 5.10.5 报告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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	63,223,495.05
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	2,484,322.30
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	60,739,172.75

### § 7 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 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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	20170401-20170630	15,000,347.24	0.00	0.00	15,000,347.24	24.70%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形。个别投资者大额赎回可能使基金无法以合理的价格变现基金资产，也可能因大额赎回导致基金净值发生较大幅度的波动，还可能在个人投资者大额赎回后出现基金净值低于5000万元，致使基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人后期将对大额申赎进行审慎评估并合理应对，同时完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发标普全球农业指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《广发标普全球农业指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《广发标普全球农业指数证券投资基金托管协议》；
- 4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.《广发标普全球农业指数证券投资基金招募说明书》及其更新版；
- 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。

### 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](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇一七年七月十九日