

# 广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)

## 2018年第2季度报告

2018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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年七月二十日

## § 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 7 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 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发恒生中型股指数（LOF）
场内简称	恒生中型
基金主代码	501303
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 21 日
报告期末基金份额总额	93,236,247.86 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，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式

	指数化投资。	
业绩比较基准	人民币计价的恒生综合中型股指数收益率 ×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
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	广发恒生中型股指数 (LOF) A	广发恒生中型股指数 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	恒生中型	-
下属分级基金的交易代码	501303	004996
报告期末下属分级基金的份额总额	66,386,325.85 份	26,849,922.01 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 (2018年4月1日-2018年6月30日)	
	广发恒生中型股指数 (LOF) A	广发恒生中型股指数 (LOF) C
1.本期已实现收益	285,597.84	79,863.63
2.本期利润	-460,053.56	-343,527.62

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0062	-0.0120
4.期末基金资产净值	60,761,609.63	24,575,088.28
5.期末基金份额净值	0.9153	0.9153

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、广发恒生中型股指数（LOF）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	-1.56%	1.17%	-2.82%	1.11%	1.26%	0.06%

##### 2、广发恒生中型股指数（LOF）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	-1.73%	1.17%	-2.82%	1.11%	1.09%	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

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)  
 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  
 (2017年9月21日至2018年6月30日)

##### 1. 广发恒生中型股指数（LOF）A：



2. 广发恒生中型股指数 (LOF) C:



注：（1）本基金合同生效日期为2017年9月21日，至披露时点本基金成立未  
满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后6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		
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；广发全 球医疗保健 (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； 广发海外多	2017- 09-21	-	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

	<p>元配置(QDII)基金的基金经理；广发科技动力股票基金的基金经理；国际业务部总经理助理</p>			<p>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）、广发科技动力股票型证券投资基金基金经理（自2018年5月31日起任职）。</p>
--	--	--	--	--

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、《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）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

四月份，中美贸易战为市场波动的主要影响因素，同时美联储加息预期下美元持续走强，港股面临一定调整压力，但香港金管局充足的外汇储备为港币汇率提供有利支撑，资金基本面仍保持稳定，港股整体调整幅度较有限。

五月份，中美就贸易展开谈判，市场情绪经过前期调整得到一定释放，受益于外围美股上涨利好、港股通成交回升，南下资金恢复净流入，港股整体止跌回稳。

六月份，中美贸易战升级，美联储如期加息，全球资金流入美国，而在A股持续下跌以及人民币持续贬值的外围影响下，港股承压，出现一轮较明显的下跌调整。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的A类份额净值增长率为-1.56%，C类份额净值增长率为-1.73%，同期业绩比较基准收益率为-2.82%。

### § 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	80,255,133.88	93.60
	其中：股票	80,255,133.88	93.60
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	4,741,224.40	5.53
7	其他各项资产	743,939.76	0.87
8	合计	85,740,298.04	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 80,255,133.88 元，占基金资产净值比例 94.05%。

## 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
工业	13,283,702.34	15.57
非日常生活消费品	12,813,377.34	15.02
房地产	10,320,984.03	12.09
金融	9,485,179.37	11.12
信息技术	8,594,701.38	10.07
医疗保健	7,991,529.92	9.36
原材料	7,450,457.83	8.73
日常消费品	3,594,695.97	4.21
公用事业	3,271,881.02	3.83
能源	1,899,538.02	2.23
电信业务	1,549,086.66	1.82
合计	80,255,133.88	94.05

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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	00914	海螺水泥	46,000	1,745,217.00	2.05
2	00586	海螺创业	61,500	1,488,113.66	1.74
3	01099	国药控股	40,400	1,074,632.12	1.26
4	02269	药明生物	14,500	1,067,849.38	1.25
5	02202	万科企业	44,500	1,029,867.73	1.21
6	00981	中芯国际	116,500	1,001,855.73	1.17
7	01211	比亚迪股份	23,000	922,056.32	1.08
8	00425	敏实集团	32,000	894,360.48	1.05
9	00014	希慎兴业	24,000	886,266.72	1.04
10	00522	ASM PACIFIC	10,500	878,172.96	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	应收证券清算款	-
3	应收股利	683,799.67
4	应收利息	793.54
5	应收申购款	27,629.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,717.55
8	其他	-
9	合计	743,939.76

### 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

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

项目	广发恒生中型股指 数(LOF)A	广发恒生中型股指 数(LOF)C
本报告期期初基金份额总额	81,100,364.04	29,487,378.11
本报告期基金总申购份额	607,196.22	1,064,353.69
减：本报告期基金总赎回份额	15,321,234.41	3,701,809.79
本报告期基金拆分变动份额	0.00	0.00
本报告期期末基金份额总额	66,386,325.85	26,849,922.01

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）募集的文件

（二）《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）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>。

广发基金管理有限公司

二〇一八年七月二十日