

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

2015 年第 4 季度报告

2015 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年一月二十日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 1 月 15 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 2015 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 广发生物科技指数（QDII） |
| 基金主代码 | 001092 |
| 交易代码 | 001092 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 3 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 404,557,252.06 份 |
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪纳斯达克生物科技指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化，为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。 |
| 投资策略 | （一）资产配置策略本基金为被动管理的指数型 |

| | |
|--------|---|
| | <p>基金，在正常情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5%以内，年跟踪误差控制在 5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>(二) 权益类投资策略 股票组合构建方法 本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。</p> <p>(三) 固定收益类投资策略 (四) 衍生品投资策略</p> |
| 业绩比较基准 | 95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率+5%×人民币活期存款收益率（税后）。 |
| 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。本基金为被动管理的指数型基金，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 |

§ 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 (2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日) |
|-----------|---|
| 1.本期已实现收益 | -292,443.19 |

| | |
|----------------|----------------|
| 2.本期利润 | 50,176,204.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1209 |
| 4.期末基金资产净值 | 408,967,059.73 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.011 |

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

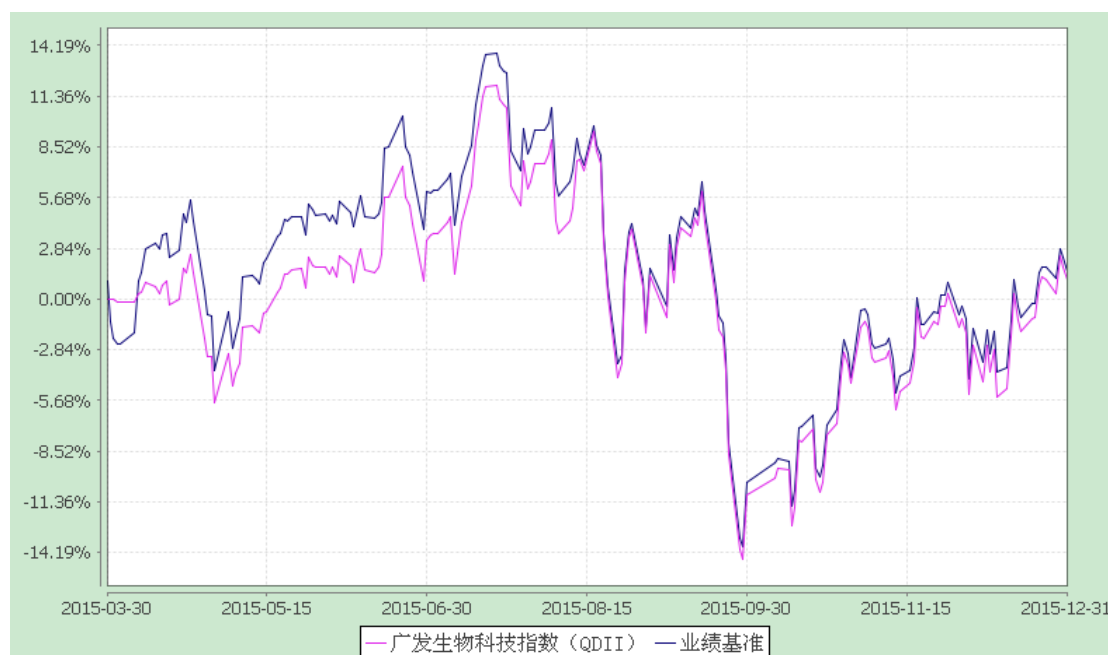
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 13.60% | 1.70% | 13.30% | 1.62% | 0.30% | 0.08% |

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

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金
 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 3 月 30 日至 2015 年 12 月 31 日）



注：（1）本基金合同生效日期为 2015 年 3 月 30 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 | | |
| 邱炜 | 本基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）的基金经理；广发 | 2015-03-30 | - | 8 年 | 男，中国籍，统计学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2007 年 5 月至 2008 年 7 月在摩根大通集团（纽约）任高级分析师兼助理副总裁，2008 年 7 月至 2011 年 6 月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员，2011 年 6 月 28 日起任广发全球农业指数（QDII）基金的基金经理，2012 年 8 月 15 日起任 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|---|
| | <p>纳斯达克 100 指数 (QD II) 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 (QD II) 基金的基金经理; 广发全球医疗保健 (QD II) 基金的基金经理; 广发纳指 100E</p> | | | | <p>广发纳斯达克 100 指数 (QDII) 基金的基金经理, 2013 年 8 月 9 日起任广发美国房地产指数 (QDII) 基金的基金经理, 2013 年 11 月 28 日起任广发亚太中高收益债券 (QDII) 基金的基金经理, 2013 年 12 月 10 日起任广发全球医疗保健 (QDII) 基金的基金经理, 2014 年 1 月 21 日起任广发基金管理有限公司国际业务部副总经理, 2015 年 1 月 14 日起任广发基金管理有限公司另类投资部副总经理, 2015 年 3 月 30 日起任广生物科技指数 (QDII) 基金的基金经理, 2015 年 6 月 10 日起任广发纳指 100ETF 基金的基金经理。</p> |
|--|---|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--------------------------------|--|--|--|--|
| | TF 基金的基金经理；国际业务部副总经理；另类投资部副总经理 | | | | |
|--|--------------------------------|--|--|--|--|

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合规守信情况说明

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、《广发纳斯达克生物科技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。

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。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

经历过第三季度的腥风血雨之后，美股终于在四季度迎来了反弹。10月初公布的非农就业数据是这次反弹的导火索。当时，9月新增非农就业人口仅14.2万人，显著低于市场预期的20.1万，市场对于美联储首次加息大幅延后推动美国股市以及其他地区股市的反弹。随后10月中下旬，欧洲和中国央行都释放宽松信号，美国股市继续保持强势。生物科技板块在没有其他特别消息的情况下跟随市场反弹。进入11月，强劲的非农就业数据引发大家对加息的担忧，美国股市承压，涨幅变缓。同时11月中旬的巴黎恐怖袭击事件让整体市场波动加大。12月份，美联储最终在当月FOMC会议上决定加息25个基点，正式开启了加息周期。生物科技行业在经历三季度大幅下跌后，跟随着美国股市大幅反弹。

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13.60%，同期业绩比较基准收益率为13.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年，美国以及全球市场的波动会增加。中国经济转型和美国加息的节奏将是2016年全年的主题。我们认为在这两个宏观因素的叠加下，美国股市将会表现波动，板块的结构性机会会比整体的趋势性机会要大。纳斯达克生物科技指数仍然代表全球医药企业领先技术，该指数的成分股受益于细胞免疫

治疗、基因测序、基因编辑和精准医疗等生物技术细分领域的发展。随着这些技术的发展，生物科技指数成分股的盈利将会持续增长，其企业的价值也将会体现在股价上。

§ 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 | 349,281,567.11 | 84.30 |
| | 其中：普通股 | 341,959,498.88 | 82.53 |
| | 存托凭证 | 7,322,068.23 | 1.77 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 29,308,536.71 | 7.07 |
| 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 | 22,547,943.23 | 5.44 |

| | | | |
|---|--------|----------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 13,186,341.81 | 3.18 |
| 9 | 合计 | 414,324,388.86 | 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 | 349,281,567.11 | 85.41 |
| 合计 | 349,281,567.11 | 85.41 |

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英国、法国在美国上市的 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 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 非必须消费品 | - | - |
| 必须消费品 | - | - |
| 保健 | 349,281,567.11 | 85.41 |
| 金融 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公共事业 | - | - |
| 合计 | 349,281,567.11 | 85.41 |

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 | CELGENE CORP | 新基医药 | CELGUS | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 38,943.00 | 30,284,940.51 | 7.41 |

| | | | | | | | | |
|---|-----------------------------|--------------|---------|-----------|----|-----------|---------------|------|
| 2 | BIOGEN INC | 百健 | BIIB US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 14,858.00 | 29,557,232.76 | 7.23 |
| 3 | AMGEN INC | 安进 | AMGN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 26,457.00 | 27,888,484.77 | 6.82 |
| 4 | GILEAD SCIENCES INC | 吉利德科学 | GILD US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 40,225.00 | 26,431,340.02 | 6.46 |
| 5 | REGENERON PHARMACEUTICALS | 再生元制药股份有限公司 | REGN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,483.00 | 26,378,926.67 | 6.45 |
| 6 | ALEXION PHARMACEUTICALS INC | Alexion 制药公司 | ALXN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 11,943.00 | 14,793,247.11 | 3.62 |
| 7 | ILLUMINA INC | Illumina 公司 | ILMN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 11,128.00 | 13,870,095.57 | 3.39 |
| 8 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 维特制药股份有限公司 | VRTX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 16,475.00 | 13,461,552.61 | 3.29 |
| 9 | MYLAN NV | 迈兰公司 | MYL US | 纳斯达克证券 | 美国 | 37,377.00 | 13,123,399.30 | 3.21 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------|--------------------|----------------|---------------------------|----|---------------|------------------|------|
| | | | | 交易 所 | | | | |
| 10 | INCYT E CORP | Incyte 有限公 司 | INC Y US | 纳斯 达克 证券 交易 所 | 美国 | 14,138.0 0 | 9,956,4 16.75 | 2.43 |

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。

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

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 (人民币 元) | 占基金资 产净值比 例(%) |
|----|---|------|------------|---------------------|--------------------|----------------------|
| 1 | PROSHA RES ULTRA NASD BIOTEC H | ETF | 契约型开 放式 | ProShare s Trust | 29,308,536 .71 | 7.17 |

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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 | 11,459,596.64 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 294.86 |
| 5 | 应收申购款 | 738,250.31 |
| 6 | 其他应收款 | 988,200.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,186,341.81 |

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 | 419,956,795.46 |
| 本报告期基金总申购份额 | 17,333,739.50 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 32,733,282.90 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 404,557,252.06 |

§ 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份 额总数 | 持有份 额 占基金总 份额比例 | 发起份 额总数 | 发起份 额占 基金总份 额比例 | 发起份 额承 诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------------------|---------------|--------------------------|--------------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,200.02 | 2.47% | 10,000,200.02 | 2.47% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 494,589.84 | 0.12% | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 1,004,016.54 | 0.25% | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 11,498,806.40 | 2.84% | 10,000,200.02 | 2.47% | 三年 |

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一) 中国证监会准予广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金募集注册的文件

(二) 《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》

(三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四) 《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金托管协议》

(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

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。

广发基金管理有限公司
二〇一六年一月二十日