

广发全球医疗保健指数证券投资基金

2018 年半年度报告

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：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示及目录

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。本半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 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录 3	
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	38
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	48
7.7 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.....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.9 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.....	48
7.10 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.....	48
7.11 投资组合报告附注.....	49
8 基金份额持有人信息	49

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3	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	50
9	开放式基金份额变动	50
10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议	50
10.2	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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	52
11	影响投资者决策的其他重要信息	53
12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发全球医疗保健指数证券投资基金
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	123,359,091.39 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	人民币计价的标普全球 1200 医疗保健指数收益率
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。

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	姓名	段西军	戴辉

负责人	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	4008308003
传真		020-89899158	010-651699555
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	广州市越秀区东风东路713号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市东城区东长安街甲2号
邮政编码		510308	100005
法定代表人		孙树明	杨明生

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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,981,084.88
本期利润	2,795,003.81
加权平均基金份额本期利润	0.0222
本期加权平均净值利润率	1.73%
本期基金份额净值增长率	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	16,096,743.47
期末可供分配基金份额利润	0.1305
期末基金资产净值	163,460,758.74
期末基金份额净值	1.325
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.95%

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
过去一个月	4.25%	0.54%	4.75%	0.46%	-0.50%	0.08%
过去三个月	7.37%	0.65%	7.41%	0.67%	-0.04%	-0.02%
过去六个月	1.77%	0.82%	2.19%	0.86%	-0.42%	-0.04%
过去一年	0.84%	0.66%	1.50%	0.70%	-0.66%	-0.04%
过去三年	15.74%	0.78%	13.29%	0.81%	2.45%	-0.03%
自基金合同生效起至今	45.95%	0.75%	47.50%	0.79%	-1.55%	-0.04%

注：业绩比较基准：人民币计价的标普全球 1200 医疗保健指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来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 2018 年 6 月 30 日)



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 30 个部门：宏观策略部、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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合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		
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；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板 300ETF 基金的基金经理；广发中小板 300 联接基金的基金经理；广发中证环保 ETF 联接基金的基金经理；广发军工 ETF 基金的基金经理；广发中证军工 ETF 联接基金的基	2018-08-06	-	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）、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 日至 2018 年 4 月 25 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

	<p>金经理；广发中证环保 ETF 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；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；广发纳指 100ETF 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；指数投资部总经理助理</p>				<p>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）、广发中证养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</p>
--	---	--	--	--	--

					<p>军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 30 日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理（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）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理（自 2018 年 4 月 26 日起</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>任职)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、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 2018 年 8 月 6 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 2018 年 8 月 6 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 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发港股通恒生综合中型股指证券投资基金(LOF)基金经理 (自 2018 年 8 月 6 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 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广</p>
--	--	--	--	--	--

					发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）。
李耀柱	<p>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；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>	2016-08-23	-	8 年	<p>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</p>

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	---

					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）。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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，投资的债券必须来自公司债券库。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 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

一月份，指数再创新高，市场对经济增长和通胀保持乐观预期，年报行情的开启推动股指大幅上行。

二月份，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，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，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较大，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，指数出现深度回调。

三月份，月初 2 月非农就业数据大幅超预期，显示劳动力市场稳健，指数有所反弹。但随后受科技股负面消息、美联储加息，以及中美贸易摩擦等负面因素影响，指数出现恐慌性抛售，大幅下跌。

四月份，多重利空因素再度来袭，包括美债利率一度突破 3% 的重要关口，美英法联合军事打击叙利亚，引发地缘政治危机再度紧张，中东政治局势的动荡影响市场风险偏好下行，指数承压。

五月份，美国公布 4 月 CPI 同比回升，但环比弱于预期，缓解加息担忧，对市场起到提振作用，另一方面美股一季度披露业绩强劲，多家公司宣布回购股份，指数反弹。随着 5 月 19 日中美两国就双边经贸磋商发表联合声明，双方达成协议，贸易战停火，中方将增加购买商品和服务，减少美对华货物贸易逆差。短期内，中美爆发贸易战的风险暂时解除，市场情绪得到较充分的释放，风险偏好得到明显改善，指数继续上涨。

六月份，随着外围扰动因素减缓，投资者情绪修复，指数继续上升趋势，创出新高，美股估值虽然偏高，但指数权重股，受益于特朗普减税政策及盈利数据强劲，且随着美元指数走强，全球资金回流美国，进一步支撑指数上涨。

报告期内，本基金紧密跟踪标的指数。

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 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 2.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济复苏，劳动力市场就业充分，失业率处于历史低位，居民消费需求有望依旧保持强劲，

尤其是对医疗的消费。同时，美国经济的结构变革使得生物、医疗等高科技领域的技术领先优势继续扩大，在全球科技创新的竞争中占据有利地位，目前的估值泡沫仍不显著，未来对指数走势我们仍保持乐观。

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、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》及其他有关法律法规、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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,654,343.53	6,973,968.07
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	153,087,627.56	143,312,691.93
其中：股票投资		148,540,611.11	139,301,286.96
基金投资		4,547,016.45	4,011,404.97
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,727,228.24	6,128.58
应收利息	6.4.7.5	636.36	304.87

应收股利		121,024.32	131,379.29
应收申购款		550,979.54	20,470,583.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	82,955.75	173,273.66
资产总计		164,224,795.30	171,068,329.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4,047,971.53
应付赎回款		482,967.26	381,522.83
应付管理人报酬		107,590.59	101,654.10
应付托管费		33,622.05	31,766.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	139,856.66	260,381.95
负债合计		764,036.56	4,823,297.33
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	123,359,091.39	127,720,721.53
未分配利润	6.4.7.10	40,101,667.35	38,524,311.03
所有者权益合计		163,460,758.74	166,245,032.56
负债和所有者权益总计		164,224,795.30	171,068,329.89

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值人民币 1.325 元, 基金份额总额 123,359,091.39 份。

6.2 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: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		3,879,024.74	18,513,721.80
1.利息收入		22,046.06	5,241.07
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	22,046.06	5,241.07

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）		5,296,389.57	5,712,251.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,673,299.59	4,018,990.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	4,665.57	34,869.30
股利收益	6.4.7.15	1,618,424.41	1,658,391.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,186,081.07	12,887,657.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-278,163.11	-105,518.69
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,833.29	14,090.56
减：二、费用		1,084,020.93	1,022,867.39
1. 管理人报酬		639,792.63	592,605.22
2. 托管费		199,935.18	185,189.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	16,397.37	8,197.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	227,895.75	236,875.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,795,003.81	17,490,854.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,795,003.81	17,490,854.41

6.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	127,720,721.53	38,524,311.03	166,245,032.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,795,003.81	2,795,003.81

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）	-4,361,630.14	-1,217,647.49	-5,579,277.63
其中：1.基金申购款	23,491,939.71	6,666,612.01	30,158,551.72
2.基金赎回款	-27,853,569.85	-7,884,259.50	-35,737,829.35
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）	123,359,091.39	40,101,667.35	163,460,758.74
项目	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017年6月30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）	-	17,490,854.41	17,490,854.41
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）	-17,402,111.31	-4,286,691.82	-21,688,803.13
其中：1.基金申购款	1,512,163.54	512,899.14	2,025,062.68
2.基金赎回款	-18,914,274.85	-4,799,590.96	-23,713,865.81
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）	111,429,456.21	34,961,374.92	146,390,831.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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》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 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	4,654,343.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,654,343.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,988,706.84	148,540,611.11	24,551,904.27

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		3,528,836.38	4,547,016.45	1,018,180.07
其他		-	-	-
合计		127,517,543.22	153,087,627.56	25,570,084.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	636.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	636.36

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	82,955.75
合计	82,955.75

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,007.94
预提费用	138,848.72
合计	139,856.66

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,720,721.53	127,720,721.53
本期申购	23,491,939.71	23,491,939.71
本期赎回（以“-”号填列）	-27,853,569.85	-27,853,569.85
本期末	123,359,091.39	123,359,091.39

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,563,265.85	25,961,045.18	38,524,311.03
本期利润	3,981,084.88	-1,186,081.07	2,795,003.81
本期基金份额交易产生的变动数	-447,607.26	-770,040.23	-1,217,647.49
其中：基金申购款	2,511,705.05	4,154,906.96	6,666,612.01
基金赎回款	-2,959,312.31	-4,924,947.19	-7,884,259.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,096,743.47	24,004,923.88	40,101,667.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	3.53
合计	22,046.06

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	18,375,251.79
减：卖出股票成本总额	14,701,952.20
买卖股票差价收入	3,673,299.59

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出权证成交总额	4,665.57
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	4,665.57

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,582,037.76
基金投资产生的股利收益	36,386.65
合计	1,618,424.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-1,181,415.50
——股票投资	-1,251,990.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	70,575.21
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-4,665.57
——权证投资	-4,665.57
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,186,081.07

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	24,814.02
基金转换费收入	19.27
合计	24,833.29

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	16,397.37
银行间市场交易费用	-
合计	16,397.37

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	119,012.93
指数使用费	78,959.49
数据费	10,087.54
合计	227,895.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
------------	-----------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	639,792.63	592,605.22
其中：支付销售机构的客户维护费	154,285.17	126,267.38

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：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	199,935.18	185,189.15

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
报告期初持有的基金份额	15,313,169.98	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	12.41%	-

注：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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30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	2,256,268.02	10,161.62	4,088,234.79	4,405.01
美国花旗银行有限公司	2,398,097.51	11,880.91	4,502,014.40	836.06

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。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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 2018 年 6 月 30 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券，因此与债券相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	4,654,343.53	-	-	-	4,654,343.53
交易性金融资产	-	-	-	153,087,627.56	153,087,627.56
应收股利	-	-	-	121,024.32	121,024.32
应收利息	-	-	-	636.36	636.36
应收申购款	4,411.03	-	-	546,568.51	550,979.54
应收证券清算款	-	-	-	5,727,228.24	5,727,228.24
其他资产	-	-	-	82,955.75	82,955.75
资产总计	4,658,754.56	-	-	159,566,040.74	164,224,795.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	482,967.26	482,967.26
应付管理人报酬	-	-	-	107,590.59	107,590.59
应付托管费	-	-	-	33,622.05	33,622.05
其他负债	-	-	-	139,856.66	139,856.66
负债总计	-	-	-	764,036.56	764,036.56
利率敏感度缺口	4,658,754.56	-	-	158,802,004.18	163,460,758.74
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,973,968.07	-	-	-	6,973,968.07
交易性金融资产	-	-	-	143,312,691.93	143,312,691.93
应收股利	-	-	-	131,379.29	131,379.29
应收利息	-	-	-	304.87	304.87
应收申购款	26,904.38	-	-	20,443,679.11	20,470,583.49
应收证券清算款	-	-	-	6,128.58	6,128.58
其他资产	-	-	-	173,273.66	173,273.66
资产总计	7,000,872.45	-	-	164,067,457.44	171,068,329.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	381,522.83	381,522.83
应付管理人报酬	-	-	-	101,654.10	101,654.10
应付托管费	-	-	-	31,766.92	31,766.92

应付证券清算款	-	-	-	4,047,971.53	4,047,971.53
其他负债	-	-	-	260,381.95	260,381.95
负债总计	-	-	-	4,823,297.33	4,823,297.33
利率敏感度缺口	7,000,872.45	-	-	159,244,160.11	166,245,032.56

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险，本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2018年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	3,476,207.41	-	92.83	3,476,300.24
交易性金融资产	107,832,368.79	-	45,255,258.77	153,087,627.56
应收股利	69,981.40	-	51,042.92	121,024.32
应收利息	14.23	-	-	14.23
应收证券清算款	2,822,569.24	-	2,904,659.00	5,727,228.24
应收申购款	358,847.60	-	-	358,847.60
其他资产	82,955.75	-	-	82,955.75
资产合计	114,642,944.42	-	48,211,053.52	162,853,997.94
以外币计价的负债				

应付赎回款	150,952.50	-	-	150,952.50
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	383.96	-	-	383.96
负债合计	151,336.46	-	-	151,336.46
资产负债表 外汇风险敞 口净额	114,491,607.96	-	48,211,053.52	162,702,661.48
项目	上年度末			
	2017年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,163,790.90	-	96.28	6,163,887.18
交易性金融资产	99,511,748.25	-	43,800,943.68	143,312,691.93
应收股利	85,879.39	-	45,499.90	131,379.29
应收利息	20.45	-	-	20.45
应收证券清算款	-	-	6,128.58	6,128.58
应收申购款	176,820.35	-	-	176,820.35
其他资产	173,273.66	-	-	173,273.66
资产合计	106,111,533.00	-	43,852,668.44	149,964,201.44
以外币计价的负债				
应付赎回款	115,390.25	-	-	115,390.25
应付证券清算款	1,619,663.78	-	2,428,307.75	4,047,971.53
其他负债	21.17	-	-	21.17
负债合计	1,735,075.20	-	2,428,307.75	4,163,382.95
资产负债表 外汇风险敞 口净额	104,376,457.80	-	41,424,360.69	145,800,818.49

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	8,135,133.07	7,290,040.92
所有外币相对人民币贬值 5%	-8,135,133.07	-7,290,040.92	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	148,540,611.11	90.87	139,301,286.96	83.79
交易性金融资产—基金投资	4,547,016.45	2.78	4,011,404.97	2.41
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	153,087,627.56	93.65	143,312,691.93	86.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	585,117.65	6,912,774.64
业绩比较基准下降 5%	-585,117.65	-6,912,774.64	

6.4.14 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本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 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 153,087,627.56 元，无属于第二层级和第三层级的金额（2017 年 12 月 31 日：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）。

(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。

7 投资组合报告

7.1 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	148,540,611.11	90.45
	其中：普通股	148,258,942.45	90.28
	存托凭证	281,668.66	0.17
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	4,547,016.45	2.77
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	4,654,343.53	2.83
8	其他各项资产	6,482,824.21	3.95
9	合计	164,224,795.30	100.00

7.2 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	103,285,352.34	63.19
瑞士	12,494,033.12	7.64
英国	8,010,153.63	4.90
日本	7,690,873.74	4.71
德国	5,485,368.07	3.36
法国	3,783,005.67	2.31
丹麦	3,262,566.52	2.00
澳大利亚	2,723,004.64	1.67
荷兰	1,259,471.94	0.77
比利时	317,395.24	0.19
加拿大	229,386.20	0.14
合计	148,540,611.11	90.87

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。

7.3 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	148,540,611.11	90.87
合计	148,540,611.11	90.87

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	12,882.00	10,342,419.90	6.33
2	UNITED HEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽约证 券交易 所	美国	4,615.00	7,491,606.31	4.58
3	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证 券交易 所	美国	28,096.00	6,744,451.77	4.13
4	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN SW	瑞士证 券交易 所	瑞士	12,250.00	6,145,637.50	3.76
5	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证 券交易 所	美国	12,921.00	5,189,430.48	3.17
6	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG SW	瑞士证 券交易 所	瑞士	3,374.00	4,959,105.88	3.03
7	ABBVIE INC	艾伯维生 物制药公 司	ABBV US	纽约证 券交易 所	美国	7,279.00	4,462,230.74	2.73
8	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达 克证券	美国	3,198.00	3,905,903.50	2.39

				交易所				
9	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约证券交易所	美国	6,504.00	3,684,172.11	2.25
10	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽约证券交易所	美国	8,420.00	3,397,860.97	2.08
11	BAYER AG-REG	拜耳股份公司	BAYN GR	德国证券交易所	德国	4,317.00	3,116,524.43	1.91
12	GLAXOSMITHKLINE PLC	葛兰素史克公司	GSK LN	伦敦证券交易所	英国	23,461.00	3,106,370.61	1.90
13	GILEAD SCIENCE S INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	6,245.00	2,927,156.05	1.79
14	SANOFI	赛诺菲	SAN FP	巴黎证券交易所	法国	5,506.00	2,892,166.77	1.77
15	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMY US	纽约证券交易所	美国	7,850.00	2,874,376.76	1.76
16	ASTRAZENECA PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN LN	伦敦证券交易所	英国	6,077.00	2,762,922.65	1.69
17	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	纽约证券交易所	美国	1,932.00	2,647,926.80	1.62
18	NOVO NORDISK A/S-B	诺和诺德公司	NOVOB DC	哥本哈根证券交易所	丹麦	8,451.00	2,593,470.40	1.59
19	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽约证券交易所	美国	4,587.00	2,589,794.87	1.58
20	CVS HEALTH CORP	CVS 保健公司	CVS US	纽约证券交易所	美国	4,883.00	2,079,075.00	1.27
21	CSL LTD	CSL 有限公司	CSLAU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,173.00	2,046,081.23	1.25
22	BECTON DICKINS	碧迪	BDX US	纽约证券交易所	美国	1,283.00	2,033,648.27	1.24

	ON AND CO			所				
23	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,013.00	1,945,367.21	1.19
24	ANTHEM INC	Anthem 股份有限公司	ANTM US	纽约证券交易所	美国	1,225.00	1,929,312.89	1.18
25	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	纽约证券交易所	美国	2,952.00	1,927,437.81	1.18
26	AETNA INC	安泰保险	AET US	纽约证券交易所	美国	1,571.00	1,907,423.52	1.17
27	ALLERGAN PLC	艾尔建有限公司	AGN US	纽约证券交易所	美国	1,628.00	1,795,878.63	1.10
28	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,395.00	1,784,039.81	1.09
29	STRYKER CORP	史赛克	SYK US	纽约证券交易所	美国	1,543.00	1,723,961.61	1.05
30	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	544.00	1,722,255.46	1.05
31	SHIRE PLC	Shire 公共有限公司	SHP LN	伦敦证券交易所	英国	4,397.00	1,623,108.65	0.99
32	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX US	纽约证券交易所	美国	6,627.00	1,433,836.41	0.88
33	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	快捷药方	ESRX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,698.00	1,378,321.02	0.84
34	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Vertex 制药股份有限公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,223.00	1,375,333.62	0.84
35	CIGNA	信诺公司	CI US	纽约证	美国	1,168.00	1,313,405.69	0.80

	CORP			券交易所				
36	ZOETIS INC	硕腾股份有限公司	ZTS US	纽约证券交易所	美国	2,324.00	1,309,964.79	0.80
37	ILLUMINA INC	illumina 公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	706.00	1,304,652.85	0.80
38	HUMAN A INC	Humana 公司	HUM US	纽约证券交易所	美国	661.00	1,301,706.41	0.80
39	KONINK LIJKE PHILIPS NV	飞利浦公司	PHIA NA	阿姆斯特丹证券交易所	荷兰	4,519.00	1,259,471.94	0.77
40	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	纽约证券交易所	美国	2,366.00	1,155,956.01	0.71
41	FRESENIUS SE & CO KGAA	费森尤斯集团	FRE GR	德国证券交易所	德国	1,967.00	1,035,474.43	0.63
42	ASTELLAS PHARM INC	阿斯泰来制药株式会社	4503 JP	东京证券交易所	日本	9,936.00	1,005,471.00	0.62
43	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	武田药品工业	4502 JP	东京证券交易所	日本	3,587.00	1,005,356.08	0.62
44	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	Edwards Lifesciences 公司	EW US	纽约证券交易所	美国	1,012.00	974,736.60	0.60
45	HCA HEALTH CARE INC	HCA 医疗保健有限公司	HCA US	纽约证券交易所	美国	1,342.00	911,034.36	0.56
46	ESSILOR INTERNATIONAL	法国依视路国际有限公司	EI FP	巴黎证券交易所	法国	963.00	890,838.90	0.54

47	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion 制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,068.00	877,309.55	0.54
48	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	大塚控股株式会社	4578 JP	东京证券交易所	日本	2,679.00	860,973.53	0.53
49	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK US	纽约证券交易所	美国	970.00	856,174.81	0.52
50	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	371.00	846,867.17	0.52
51	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC US	纽约证券交易所	美国	985.00	803,002.82	0.49
52	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	346.00	783,276.02	0.48
53	DAIICHI SANKYO CO LTD	第一三共	4568 JP	东京证券交易所	日本	3,030.00	769,182.52	0.47
54	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	捷迈巴奥米特控股公司	ZBH US	纽约证券交易所	美国	976.00	719,657.41	0.44
55	HOYA CORP	Hoya 株式会社	7741 JP	东京证券交易所	日本	1,832.00	691,393.66	0.42
56	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	费森尤斯医药用品 AG & Co KGaA	FME GR	德国证券交易所	德国	1,017.00	672,172.49	0.41
57	EISAI CO LTD	卫材株式会社	4523 JP	东京证券交易所	日本	1,424.00	665,818.05	0.41
58	AGILENT	安捷伦	A US	纽约证券交易所	美国	1,536.00	628,485.96	0.38

	TECHNOLOGIES INC			所				
59	LONZA GROUP AG-REG	龙沙集团股份有限公司	LONN SW	瑞士证券交易所	瑞士	357.00	626,902.61	0.38
60	TERUMO CORP	泰尔茂株式会社	4543 JP	东京证券交易所	日本	1,586.00	603,399.89	0.37
61	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	417.00	601,323.09	0.37
62	CERNER CORP	塞纳公司	CERN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,514.00	598,948.26	0.37
63	MYLAN NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,475.00	591,831.71	0.36
64	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验控股	LH US	纽约证券交易所	美国	491.00	583,248.20	0.36
65	ABIOMED INC	Abiomed 股份有限公司	ABMD US	纳斯达克证券交易所	美国	202.00	546,717.09	0.33
66	SMITH & NEPHEW PLC	施乐辉	SN/ LN	伦敦证券交易所	英国	4,279.00	517,751.72	0.32
67	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA 控股股份有限公司	IQV US	纽约证券交易所	美国	777.00	513,184.42	0.31
68	SHIONOGI & CO LTD	盐野义制药有限公司	4507 JP	东京证券交易所	日本	1,416.00	482,814.33	0.30
69	CARDINAL HEALTH INC	康德乐公司	CAH US	纽约证券交易所	美国	1,492.00	482,048.16	0.29
70	WATERS CORP	沃特世公司	WAT US	纽约证券交易所	美国	376.00	481,621.26	0.29
71	QUEST DIAGNOSTICS	Quest Diagnostics	DGX US	纽约证券交易所	美国	652.00	474,283.71	0.29

	STICS INC	股份有限 公司		所				
72	RESMED INC	瑞思迈股 份有限公 司	RMD US	纽约证 券交易 所	美国	685.00	469,462.99	0.29
73	SYSMEX CORP	希森美康 株式会社	6869 JP	东京证 券交易 所	日本	752.00	465,872.09	0.29
74	METTLE R-TOLED O INTERN ATIONA L	梅特勒-托 利多国际 股份有限 公司	MTD US	纽约证 券交易 所	美国	121.00	463,256.15	0.28
75	AMERIS OURCEB ERGEN CORP	美源伯根	ABC US	纽约证 券交易 所	美国	781.00	440,638.23	0.27
76	ONO PHARM ACEUTI CAL CO LTD	小野药品 工业	4528 JP	东京证 券交易 所	日本	2,609.00	405,951.68	0.25
77	MERCK KGAA	德国默克 集团	MRK GR	德国证 券交易 所	德国	620.00	396,687.43	0.24
78	OLYMPU S CORP	奥林巴斯	7733 JP	东京证 券交易 所	日本	1,563.00	388,629.17	0.24
79	INCYTE CORP	Incyte 有 限公司	INCY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	845.00	374,598.81	0.23
80	COLOPL AST-B	康乐保股 份公司	COLOB DC	哥本哈 根证券 交易所	丹麦	561.00	370,961.52	0.23
81	COOPER COS INC/THE	库柏股份 有限公司	COO US	纽约证 券交易 所	美国	235.00	366,101.44	0.22
82	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩 公司	HSIC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	739.00	355,185.44	0.22
83	CHUGAI PHARM ACEUTI CAL CO	中外制药	4519 JP	东京证 券交易 所	日本	994.00	346,011.74	0.21

	LTD							
84	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,311.00	344,805.91	0.21
85	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	瓦里安医疗设备有限公司	VAR US	纽约证券交易所	美国	439.00	330,321.05	0.20
86	UCB SA	优时比公司	UCB BB	布鲁塞尔证券交易所	比利时	616.00	317,395.24	0.19
87	DENTSPERLY SIRONA INC	登士柏西诺德公司	XRAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,092.00	316,252.57	0.19
88	SONOVA HOLDING AG-REG	瑞士峰力听力集团控股公司	SOON SW	瑞士证券交易所	瑞士	263.00	311,717.27	0.19
89	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	Universal Health Services 公司	UHS US	纽约证券交易所	美国	418.00	308,213.93	0.19
90	DAVITA INC	DaVita 股份有限公司	DVA US	纽约证券交易所	美国	670.00	307,835.99	0.19
91	GENMAB A/S	Genmab 股份有限公司	GEN DC	哥本哈根证券交易所	丹麦	292.00	298,134.60	0.18
92	PERRIGO CO PLC	Perrigo 公司	PRGO US	纽约证券交易所	美国	618.00	298,133.28	0.18
93	GRIFOLS SA-ADR	基立福公司	GRFS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,980.00	281,668.66	0.17
94	COCHLEAR LTD	科利耳 (Cochlear) 有限公司	COH AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	275.00	269,087.45	0.16
95	QIAGEN N.V.	德国 QIAGEN 公共有限公司	QIA GR	德国证券交易所	德国	1,108.00	264,509.29	0.16
96	PERKINE	珀金埃尔	PKI US	纽约证	美国	531.00	257,287.35	0.16

	LMER INC	默		券交易所				
97	STRAUMAN HOLDING AG-REG	斯特劳曼控股公司	STMN SW	瑞士证券交易所	瑞士	51.00	256,606.92	0.16
98	NEKTAR THERAPEUTICS	内克塔治疗公司	NKTR US	纳斯达克证券交易所	美国	773.00	249,747.47	0.15
99	SONIC HEALTH CARE LTD	Sonic 医疗保健有限公司	SHL AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,039.00	244,498.69	0.15
100	VALEANT PHARMACEUTICALS INTL	凡利亚药品国际有限公司	VRX CN	多伦多证券交易所	加拿大	1,490.00	229,386.20	0.14
101	ROCHE HOLDING AG-BR	罗氏	RO SW	瑞士证券交易所	瑞士	130.00	194,062.94	0.12
102	ENVISION HEALTH CARE CORP	Envision Healthcare Corp	EVHC US	纽约证券交易所	美国	581.00	169,185.20	0.10
103	RAMSAY HEALTH CARE LTD	拉姆塞医疗保健集团	RHC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	619.00	163,337.27	0.10

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	AMGEN INC	AMGN US	3,836,670.23	2.31
2	CVS HEALTH CORP	CVS US	2,122,934.26	1.28

3	ZOETIS INC	ZTS US	1,385,551.39	0.83
4	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	1,261,189.46	0.76
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	771,676.31	0.46
6	PFIZER INC	PFE US	757,604.61	0.46
7	NOVARTIS AG-REG	NOVN SW	748,816.16	0.45
8	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZBH US	714,902.54	0.43
9	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	ROG SW	594,642.17	0.36
10	ABIOMED INC	ABMD US	560,255.71	0.34
11	ABBVIE INC	ABBV US	543,255.02	0.33
12	MERCK & CO. INC.	MRK US	542,674.79	0.33
13	BECTON DICKINSON AND CO	BDX US	444,384.53	0.27
14	BAYER AG-REG	BAYN GR	417,832.95	0.25
15	ASTRAZENECA PLC	AZN LN	414,016.98	0.25
16	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	412,896.35	0.25
17	MEDTRONIC PLC	MDT US	387,500.12	0.23
18	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	357,307.73	0.21
19	SANOFI	SAN FP	334,784.44	0.20
20	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	333,597.59	0.20

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 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。

7.5.2 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	AMGEN INC	AMGN US	4,058,807.93	2.44
2	ZOETIS INC	ZTS US	1,228,481.26	0.74
3	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	845,631.72	0.51
4	NOVARTIS AG-REG	NOVN SW	725,502.67	0.44
5	CR BARD INC	BCR US	721,197.45	0.43
6	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	710,252.35	0.43
7	PFIZER INC	PFE US	679,802.62	0.41
8	ABBVIE INC	ABBV US	593,800.52	0.36
9	MERCK & CO. INC.	MRK US	505,049.01	0.30
10	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	ROG SW	445,874.17	0.27

11	CELGENE CORP	CELG US	364,749.53	0.22
12	NOVO NORDISK A/S-B	NOVOB DC	284,774.93	0.17
13	MEDTRONIC PLC	MDT US	272,069.16	0.16
14	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	258,115.79	0.16
15	ASTRAZENECA PLC	AZN LN	255,245.85	0.15
16	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	245,778.16	0.15
17	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	241,945.52	0.15
18	ELI LILLY & CO	LLY US	238,848.74	0.14
19	BAYER AG-REG	BAYN GR	233,750.68	0.14
20	SANOFI	SAN FP	229,301.63	0.14

7.5.3 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	24,971,227.41
卖出收入（成交）总额	18,375,251.79

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 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。

7.10 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 HEALTHC ARE ET	ETF	契约型 开放式	BlackRock Fund Advisors	4,547,016.45	2.78

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	5,727,228.24
3	应收股利	121,024.32
4	应收利息	636.36
5	应收申购款	550,979.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	82,955.75
8	其他	-
9	合计	6,482,824.21

7.11.4 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。

7.11.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
8,635	14,285.94	50,272,287.35	40.75%	73,086,804.04	59.25%

8.2 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	2,472,735.32	2.0045%
------------------	--------------	---------

8.3 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

9 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	127,720,721.53
本报告期基金总申购份额	23,491,939.71
减：本报告期基金总赎回份额	27,853,569.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	123,359,091.39

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金托管人于 2018 年 6 月经证监会核准，由梁冰女士担任广发银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 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。

10.6 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和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	-	38,592,643.25	100.00%	10,364.78	100.00%	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Citigroup	-	-	-	-	-	-	465,036.27	100.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于增加浙江金观诚为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
2	广发基金管理有限公司关于增加四川天府银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
3	广发基金管理有限公司关于增加华宝证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
4	广发基金管理有限公司关于增加北京钱景基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
5	广发基金管理有限公司关于增加中正达广为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-02-05
6	广发基金管理有限公司关于增加挖财基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-02-05
7	广发基金管理有限公司关于广发全球医疗保健指数证券投资基金取消申购限额业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-15
8	关于广发全球医疗保健指数证券投资基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22
9	广发基金管理有限公司关于调整旗下部分基金 C 类收费模式业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22

10	广发基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-30
11	广发基金管理有限公司关于增加信诚基金销售为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-05-25
12	广发基金管理有限公司关于增加国融证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-06-26

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180101-20180630	34,622,800.43	-	-	34,622,800.43	28.07%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发全球医疗保健指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发全球医疗保健指数证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 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

12.3 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

二〇一八年八月二十四日