

# 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 2 季度报告

2015 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：二〇一五年七月二十一日

## § 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 2015 年 7 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	629,596,910.25 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。（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。（三）固定收益类投资策略（四）衍生品投资策略
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 4 月 1 日-2015 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,413,405.45
2.本期利润	27,270,805.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0293
4.期末基金资产净值	650,365,398.76

5.期末基金份额净值	1.033
------------	-------

注：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

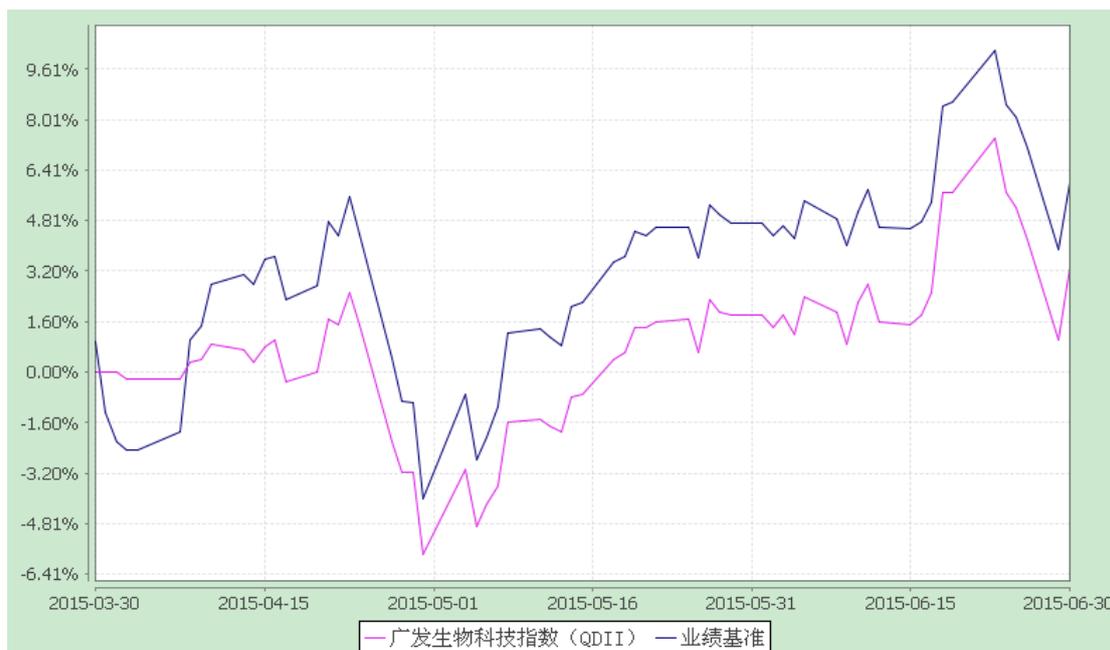
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.30%	1.22%	7.38%	1.34%	-4.08%	-0.12%

#### 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 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日期为 2015 年 3 月 30 日，建仓期为 6 个月，至披露时点，本基金仍处于建仓期，且基金成立未满一年。

#### § 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；广发纳斯达克 100 指数	2015-03-30	-	8 年	男，中国籍，统计学博士，持有基金业执业资格证书，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 日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理，2012 年 8 月 15 日起任广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理，2013 年 8 月 9 日起任广发美国房

	<p>(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; 广发纳斯达克 100E TF 基金的基金经理; 国际业务部副</p>				<p>地产指数证券投资基金的基金经理, 2013 年 11 月 28 日起任广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理, 2013 年 12 月 10 日起任广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理, 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 日起任广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理, 2015 年 6 月 10 日起任广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

	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业绩表现说明

##### 4. 4. 1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度初，在企业盈利超预期和药企重磅药临床数据的利好推动下，纳指生物科技指数在 4 月上半月反弹，从一季度末希腊问题导致的美股低迷局面中走出来。但是 4、5 月份是药物临床数据发布的高峰期，生物科技企业此时波动巨大。四月末，基因疗法公司 Celladon 二期临床试验失败导致了市场对基因疗法的前景产生担忧，生物科技企业被大幅抛售。但是一两个公司的试验数据并不代表整个行业情况，抛售很快结束。随着恐慌抛售潮结束，生物科技板块重拾升势，并在美联储 6 月推迟加息后再次创出历史新高。

##### 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 3.30%，同期比较业绩基准收益率为 7.38%。

#### 4. 5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，生物科技行业仍然是美国经济复苏中高速增长的行业，但是需要关注希腊问题和中国股市流动性问题对全球风险偏好的影响，目前来看希腊问题和中国股市流动性问题是三季度最重要的风险因素。希腊的大选结果表明希腊可以获得债权人让步的可能性十分小，意味着希腊退出欧元区的风险剧增。虽然希腊退欧没有 2011 年的时候影响大，但是还是会对金融市场产生冲击，短期市场会受到卖压。但是我们相信市场对这一点已经消化了很多，现在的欧洲央行有足够的流动性去应对希腊违约以及退欧的影响。而中国也是世界第二个影响市场的风险因素，虽然我们认为中国有能力解决股市的流动性风险，但是短期的冲击会对投资者的短期风险偏好产生影响。但是对于生物科技指数的投资可以不必担心，从美国生物科技行业的基本面来看，今年生物科技行业的整体收入和利润增

速仍然保持高增长，重要药物的临床试验数据也是大部分符合市场预期，未来随着时间的推移，指数的增长将会追随企业盈利的增长。

## § 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	546,472,168.68	80.45
	其中：普通股	533,559,731.33	78.55
	存托凭证	12,912,437.35	1.90
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	68,432,249.33	10.07
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	24,816,112.43	3.65
8	其他各项资产	39,548,635.28	5.82
9	合计	679,269,165.72	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	546,472,168.68	84.03
合计	546,472,168.68	84.03

注：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	546,472,168.68	84.03
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	546,472,168.68	84.03

## 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	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券市场	美国	65,931.00	47,192,110.17	7.26

				易所				
2	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克证 券交易所	美国	16,666. 00	41,157,146 .71	6.33
3	AMGEN INC	安进	AMG N US	纳斯达克证 券交易所	美国	43,279. 00	40,619,932 .70	6.25
4	CELGENE CORP	新基医 药	CEL G US	纳斯达克证 券交易所	美国	56,166. 00	39,740,674 .32	6.11
5	REGENERON PHARMACEUTIC ALS	再生元 制药股 份有限 公司	REG N US	纳斯达克证 券交易所	美国	12,565. 00	39,186,852 .10	6.03
6	MYLAN NV	迈兰公 司	MYL US	纳斯达克证 券	美国	63,225. 00	26,230,085 .95	4.03

				交易所				
7	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion 制药公司	ALX N US	纳斯达克证券交易所	美国	22,065.00	24,385,255.49	3.75
8	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILM N US	纳斯达克证券交易所	美国	17,462.00	23,311,170.98	3.58
9	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	维特制药股份有限公司	VRT X US	纳斯达克证券交易所	美国	28,577.00	21,572,986.71	3.32
10	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	BioMarin 制药股份有限公司	BMR N US	纳斯达克证券交易所	美国	20,541.00	17,176,758.21	2.64

#### 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

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	PROSHARES ULTRA NASD BIOTECH	ETF	契约型开放式	ProShares Trust	68,432,249.33	10.52

### 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	29,528,527.64
3	应收股利	-
4	应收利息	4,572.58
5	应收申购款	3,810,635.06
6	其他应收款	6,204,900.00
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	39,548,635.28

**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	1,051,001,960.92
本报告期基金总申购份额	80,304,555.75
减：本报告期基金总赎回份额	501,709,606.42
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	629,596,910.25

**§ 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	1.59%	10,000,200.02	1.59%	三年
基金管理人高级管理人员	494,589.84	0.08%	-	-	-
基金经理等人员	1,004,016.54	0.16%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	11,498,806.40	1.83%	10,000,200.02	1.59%	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](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇一五年七月二十一日