

广发全球医疗保健指数证券投资基金
2016 年年度报告
2016 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：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

§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 2017 年 3 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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	6
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	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 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	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本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 审计报告	18
6.1 管理层对财务报表的责任	18
6.2 注册会计师的责任	19
6.3 审计意见	19
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	48
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	48
8.4 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	49
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	57
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	58

8.7 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	58
8.8 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	59
8.9 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	59
8.10 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	59
8.11 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
9.3 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	60
§10 开放式基金份额变动	61
§11 重大事件揭示	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
11.2 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	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§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	128,831,567.52 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	标普全球 1200 医疗保健指数（S&P Global 1200 Health Care Sector Index）。
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 负责人	姓名	段西军	李春磊
	联系电话	020-83936666	010-65169830
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	Lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95508
传真		020-89899158	020-65169555
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	广东省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 广发银行大厦四层
邮政编码		510308	510080
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		-	-
办公地址		-	-
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
登载基金年度报告正文的管理人互联	http://www.gffunds.com.cn

网网址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	7,747,143.99	15,805,561.20	4,789,604.16
本期利润	-1,918,545.05	22,504,685.89	21,703,221.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0124	0.1192	0.1426
本期加权平均净值利润率	-1.06%	9.47%	12.95%
本期基金份额净值增长率	-1.03%	11.77%	15.36%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	7,522,525.79	18,184,758.88	7,530,699.07
期末可供分配基金份额利润	0.0584	0.1175	0.0366
期末基金资产净值	150,588,779.85	201,343,313.87	239,582,500.40
期末基金份额净值	1.169	1.301	1.164

3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	28.76%	30.10%	16.40%

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

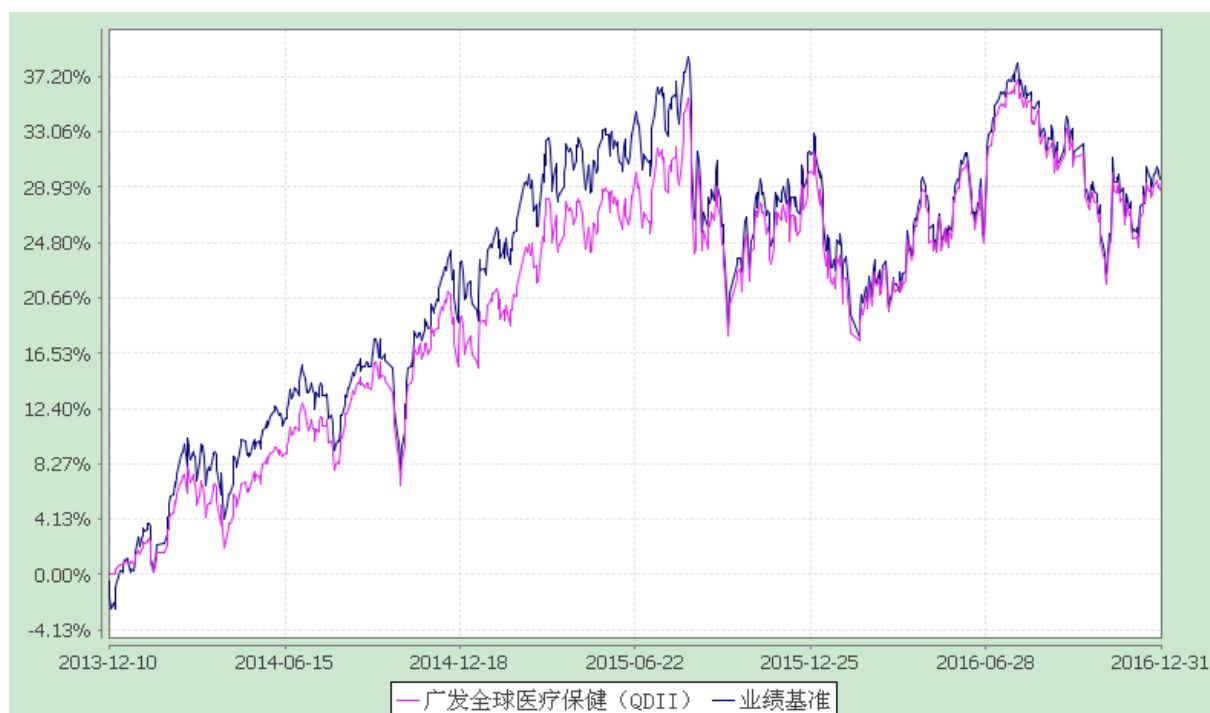
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-1.85%	0.82%	-1.49%	0.88%	-0.36%	-0.06%
过去六个月	-1.68%	0.70%	-1.79%	0.74%	0.11%	-0.04%
过去一年	-1.03%	0.82%	-1.32%	0.86%	0.29%	-0.04%
过去三年	27.61%	0.81%	28.38%	0.86%	-0.77%	-0.05%
自基金合同生效起至今	28.76%	0.80%	29.61%	0.85%	-0.85%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：人民币计价的标普全球 1200 医疗保健指数收益率。

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

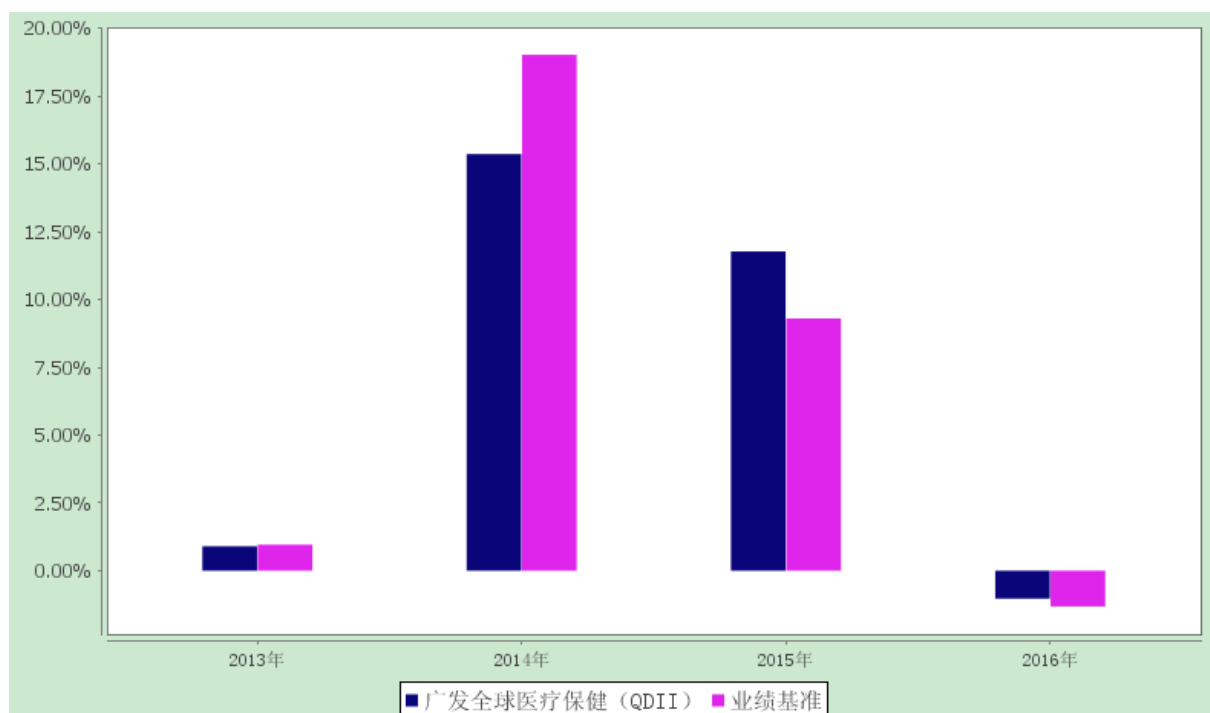
广发全球医疗保健指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2013 年 12 月 10 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发全球医疗保健指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：2013 年合同成立当年按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.100	11,916,504.76	5,392,639.56	17,309,144.32	-
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
合计	1.100	11,916,504.76	5,392,639.56	17,309,144.32	-

§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、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基金管理机构、受托管理保险资金投资管理人、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 25 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、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）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理一百二十五只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型

证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深

300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、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、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 3048 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

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		
李耀柱	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	2016-08-23	-	6 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

	指数 (QDII) 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 (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				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。
邱炜	本基金的基金经理	2013-12-10	2016-08-23	9 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 日至 2016 年 8 月 22 日任广发全球农业指数(QDII) 基金的基金经理, 2012 年 8 月 15 日至 2016 年 8 月 22 日任广发纳斯达克 100 指数(QDII)基金的基金经理, 2013 年 8 月 9 日至 2016 年 8 月 22 日任广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理, 2013 年 11 月 28 日至 2016 年 8 月 22 日任广发亚太中高收益债券 (QDII) 基金的基金经理, 2013 年 12 月 10 日至 2016 年 8 月 22 日任广发全球医疗保健(QDII)基金的基金

					经理，2014 年 1 月 21 日至 2016 年 1 月 27 日任国际业务部副总经理，2015 年 1 月 14 日至 2016 年 1 月 27 日任另类投资部副总经理，2015 年 3 月 30 日至 2016 年 8 月 22 日任广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理，2015 年 6 月 10 日至 2016 年 8 月 22 日任广发纳指 100ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 15 日至 2016 年 8 月 22 日任广发鑫享混合基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日至 2016 年 9 月 24 日任国际业务部总经理。
--	--	--	--	--	---

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 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 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易

模块，确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%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

2016 年初，全球股市受到中国股市连续熔断的影响大幅下行，同时油价在一月份持续下跌引起市场对通缩的担心，风险资产持续暴跌。随着中国叫停熔断政策，欧洲央行在一月末释放宽松信号推动全球股市见底回升。进入二月份，市场对欧洲银行在能源业的敞口的担忧推升市场的避险情绪，市场担心欧洲的银行危机再次到来，风险资产持续暴跌。随着德银公布债券回购计划以及沙特和俄罗斯的冻产计划慢慢让石油价格企稳，风险资产在二月中下旬止跌。全球医疗行业也慢慢筑底。由于加拿大医药公司 VALEANT 控制药价的丑闻与美国限制药价的预期打压医药行业在二级市场的表现，行业指数的走势弱于其它版块，一季度全球医疗保健指数大幅下行。

二季度全球医疗指数总体呈现在底部震荡整固的格局。今年医疗指数跑输大盘主要原因是生物科技行业的大幅跑输，其原因在于美国医药高药价的问题提交到了总统大选的议题，高药价的问题受到监管层的关注，市场预期未来药物价格有一定的压力，从而对生物科技行业的盈利产生影响，所以相关公司的股价一直表现不佳。

三季度医疗指数表现与大市持平，安进、百健等生物科技企业业绩超预期刺激整个板块，让市

场重新关注该板块。七月，英国退欧的影响放缓，受到美联储鸽派意向、环球央行推行宽松的货币政策影响，发达国家股市大幅上扬，全球医疗指数也大幅反弹。八月，FOMC 声明对经济的前景乐观，但是短期加息的意愿不大，股指进一步上行。八月下旬公布的 FOMC 会议纪要显示在加息问题上，美联储官员存在分歧，全球主要股市在美国加息的问题上表现高位窄幅震荡。九月，由于部分美联储官员在公开场合演讲，在加息立场上鹰派，美国以及发达国家股市应声调整，医疗指数也随之调整。直到美联储九月的议息会不加息，并且表明低利率环境会延长一段时间，医疗指数也随市场上行。

进入四季度，临近美国总统大选和美联储加息两个关键时间窗口，海外市场动荡不安，希拉里陷入邮件门使得总统选举结果再次变得扑朔迷离，美联储议息会议温和修改措辞，12 月份加息概率提高到 70%，美元指数大跌，市场避险情绪陡升，美股大幅走低，影响全球市场表现疲弱。11 月份，特朗普意外赢得美国总统大选让全球股市大幅震荡，此前市场一致预期希拉里当选，然而竞选结果的相悖使得市场极度恐慌，新兴市场大幅下跌，但随着市场对特朗普政策的解读，恐慌情绪很快缓解，市场迅速恢复平静，发达市场从下跌中迅速反弹。美国 10 年期国债收益率从 11 月 4 日的 1.79% 上升到 11 月 21 日的 2.33，美元指数大幅走强。美国特朗普新政受益板块如美国金融、基建和制造业等板块受到资金青睐，相对地科技板块表现落后。12 月份，美联储加息，美元走强，国际资金回流美国，美国股市进一步走高，纳斯达克 100 指数创出新高。

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-1.03%，同期业绩比较基准收益率为-1.32%。

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 2017 年，作为美国科技股代表的纳斯达克 100 指数仍然有望继续走好。虽然市场担心特朗普上台后，施政重心会由原来的科技行业转为传统行业，这样科技行业会有挤出效应。但是我们认为这种担心是不必要的，因为美国推行制造业回流必然是发挥自身高科技的技术优势才能获得差异化的竞争力，这必然导致美国的科技行业有进一步的飞速发展。我们觉得美国的制造业回流是高端科技制造业的回流，这必然会继续刺激科技行业的飞速发展，例如人工智能、云计算、高端芯片制造和生物科技等行业会吸引更多的资金投资。在中长期，这些行业的公司将会为股东带来不俗的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机

制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

4.7 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、监察稽核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。监察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。

4.8 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，2016 年 2 月 22 日广发全球医疗保健指数证券投资基金每 10 份基金份额分配人民币 1.100 元，美元现汇基金份额的每份额分配金额为人民币份额的每份额分配数额按照权益登记日前一工作日美元估值汇率折算后的美元金额，计算结果以美元为单位，符合基金合同规定。

§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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告 等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

德师报(审)字(17)第 P00518 号

广发全球医疗保健指数证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的广发全球医疗保健指数证券投资基金（以下简称“广发全球医疗保健指数(QDII)”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发全球医疗保健指数(QDII)的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，广发全球医疗保健指数(QDII)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了广发全球医疗保健指数(QDII)2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

中国上海

2017 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-

银行存款	7.4.7.1	7,455,760.16	8,144,189.11
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	143,294,588.33	193,721,071.06
其中：股票投资		139,705,815.18	190,085,338.71
基金投资		3,588,773.15	3,635,732.35
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		606,682.83	-
应收利息	7.4.7.5	178.88	1,034.23
应收股利		151,313.71	234,622.37
应收申购款		-	517,739.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	790,579.16	-
资产总计		152,299,103.07	202,618,656.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		275,287.35	-
应付赎回款		210,664.62	775,158.14
应付管理人报酬		102,250.34	135,208.60
应付托管费		31,953.21	42,252.70
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,090,167.70	322,722.79
负债合计		1,710,323.22	1,275,342.23
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	128,831,567.52	154,715,212.39
未分配利润	7.4.7.10	21,757,212.33	46,628,101.48
所有者权益合计		150,588,779.85	201,343,313.87
负债和所有者权益总计		152,299,103.07	202,618,656.10

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.169 元，基金份额总额 128,831,567.52 份。

7.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		549,046.63	25,575,928.68
1.利息收入		24,816.62	38,519.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,816.62	38,519.39
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）		9,817,365.35	17,125,721.19

其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,812,846.40	12,373,112.95
基金投资收益	7.4.7.13	-	66,446.79
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,004,518.95	4,686,161.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-9,665,689.04	6,699,124.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		297,920.25	1,378,374.24
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	74,633.45	334,189.17
减：二、费用		2,467,591.68	3,071,242.79
1. 管理人报酬		1,446,878.13	1,896,103.68
2. 托管费		452,149.42	592,532.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	26,575.01	81,839.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	541,989.12	500,766.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,918,545.05	22,504,685.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,918,545.05	22,504,685.89

7.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	154,715,212.39	46,628,101.48	201,343,313.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,918,545.05	-1,918,545.05
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）	-25,883,644.87	-5,643,199.78	-31,526,844.65
其中：1.基金申购款	44,935,171.85	6,695,824.88	51,630,996.73
2.基金赎回款	-70,818,816.72	-12,339,024.66	-83,157,841.38
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）	-	-17,309,144.32	-17,309,144.32
五、期末所有者权益（基金净值）	128,831,567.52	21,757,212.33	150,588,779.85
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	205,766,440.10	33,816,060.30	239,582,500.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,504,685.89	22,504,685.89
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）	-51,051,227.71	-9,692,644.71	-60,743,872.42
其中：1.基金申购款	183,394,739.34	49,070,866.53	232,465,605.87
2.基金赎回款	-234,445,967.05	-58,763,511.24	-293,209,478.29

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）	154,715,212.39	46,628,101.48	201,343,313.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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》、《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股份有限公司。

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》、《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 2017 年 3 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 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及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及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。

7.4.3 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1.金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资、债券投资和基金投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2.金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 基金投资

买入基金于交易日按基金的公允价值入账，相关的交易费用直接计入当期损益。

卖出基金于交易日确认基金投资收益，卖出基金按移动加权平均法结转成本。

(4) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2. 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3. 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1.利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。

2.投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 基金投资收益于交易日按卖出或赎回基金的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

(4) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(5) 股利收益和基金分红收益于除息日确认,并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票和基金上市所在地适用的预交所得税后的净额入账。

3.公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 0.80\%$ 的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.25\%$ 的年费率逐日计提。

3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

4. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。对于外币认购、申购的份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后外币折算净值低于对应的基金份额面值的可能；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同。美元收益分配金额按除权前一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算为相应的美元金额；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额直接计入汇兑收益项目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额作为公允价值变动处理，直接计入当期损益。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《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》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。
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，股票的股息、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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	7,455,760.16	8,144,189.11
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	7,455,760.16	8,144,189.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		124,903,124.70	139,705,815.18	14,802,690.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		3,063,800.11	3,588,773.15	524,973.04
其他		-	-	-
合计		127,966,924.81	143,294,588.33	15,327,663.52
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		165,663,918.39	190,085,338.71	24,421,420.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		3,063,800.11	3,635,732.35	571,932.24
其他		-	-	-
合计		168,727,718.50	193,721,071.06	24,993,352.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	178.88	1,034.23
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	178.88	1,034.23

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
其他应收款	606,453.77	-
待摊费用	184,125.39	-
合计	790,579.16	-

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	880.80	2,722.79
预提费用	320,000.00	320,000.00
其他应付款	769,286.90	-
合计	1,090,167.70	322,722.79

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,715,212.39	154,715,212.39
本期申购	44,935,171.85	44,935,171.85
本期赎回（以“-”号填列）	-70,818,816.72	-70,818,816.72
本期末	128,831,567.52	128,831,567.52

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。

7.4.7.10 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	18,184,758.88	28,443,342.60	46,628,101.48
本期利润	7,747,143.99	-9,665,689.04	-1,918,545.05
本期基金份额交易产生的变动数	-1,100,232.76	-4,542,967.02	-5,643,199.78
其中：基金申购款	1,502,844.79	5,192,980.09	6,695,824.88
基金赎回款	-2,603,077.55	-9,735,947.11	-12,339,024.66
本期已分配利润	-17,309,144.32	-	-17,309,144.32
本期末	7,522,525.79	14,234,686.54	21,757,212.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	24,056.41	37,498.49
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	760.21	1,020.90
合计	24,816.62	38,519.39

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	59,278,922.97	115,086,468.19
减：卖出股票成本总额	52,466,076.57	102,713,355.24
买卖股票差价收入	6,812,846.40	12,373,112.95

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	-	482,553.08
减：卖出/赎回基金成本总额	-	416,106.29
基金投资收益	-	66,446.79

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,956,577.73	4,587,270.11
基金投资产生的股利收益	47,941.22	98,891.34
合计	3,004,518.95	4,686,161.45

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-9,665,689.04	6,699,124.69
——股票投资	-9,618,729.84	6,422,545.80
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-46,959.20	276,578.89
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-9,665,689.04	6,699,124.69

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	73,744.37	290,656.19
基金转换费收入	889.08	1,970.67
其他	-	41,562.31
合计	74,633.45	334,189.17

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	26,575.01	81,839.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	26,575.01	81,839.94

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	22.30	-
指数使用费	180,327.37	143,766.42
数据费	21,639.45	17,000.39
合计	541,989.12	500,766.81

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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

广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：本报告期内无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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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末无应付关联方佣金余额。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,446,878.13	1,896,103.68
其中：支付销售机构的客户维护费	314,369.57	335,147.57

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	452,149.42	592,532.36

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。

7.4.10.3 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交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31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	863,264.01	24,055.09	4,387,969.81	37,498.30
美国花旗银行股份有限公司	6,592,496.15	1.32	3,756,219.30	2.40

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股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 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参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2016-02-23	-	2016-02-22	1.100	11,916,504.76	5,392,639.56	17,309,144.32	-
合计				1.100	11,916,504.76	5,392,639.56	17,309,144.32	-

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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监察稽核部负责,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。监察稽核部对公司总裁负责。

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、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 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。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资,因此与债券相关的信用风险不重大。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 市场风险

本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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	7,455,760.16	-	-	-	7,455,760.16
交易性金融资产	-	-	-	143,294,588.33	143,294,588.33
应收股利	-	-	-	151,313.71	151,313.71
应收利息	-	-	-	178.88	178.88
应收证券清算款	-	-	-	606,682.83	606,682.83
其他资产	-	-	-	790,579.16	790,579.16
资产总计	7,455,760.16	-	-	144,843,342.91	152,299,103.06

					7
负债					
应付赎回款	-	-	-	210,664.62	210,664.62
应付管理人报酬	-	-	-	102,250.34	102,250.34
应付托管费	-	-	-	31,953.21	31,953.21
应付证券清算款	-	-	-	275,287.35	275,287.35
其他负债	-	-	-	1,090,167.70	1,090,167.70
负债总计	-	-	-	1,710,323.22	1,710,323.22
利率敏感度缺口	7,455,760.16	-	-	143,133,019.69	150,588,779.85
上年度末 2015 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	8,144,189.11	-	-	-	8,144,189.11
交易性金融资产	-	-	-	193,721,071.06	193,721,071.06
应收股利	-	-	-	234,622.37	234,622.37
应收利息	-	-	-	1,034.23	1,034.23
应收申购款	200,866.04	-	-	316,873.29	517,739.33
资产总计	8,345,055.15	-	-	194,273,600.95	202,618,656.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	775,158.14	775,158.14
应付管理人报酬	-	-	-	135,208.60	135,208.60
应付托管费	-	-	-	42,252.70	42,252.70
其他负债	-	-	-	322,722.79	322,722.79
负债总计	-	-	-	1,275,342.23	1,275,342.23
利率敏感度缺口	8,345,055.15	-	-	192,998,258.72	201,343,313.87

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016年12月31日		
	美元 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	6,795,857.86	162,701.55	6,958,559.41
交易性金融资产	98,862,128.08	44,432,460.25	143,294,588.33
应收股利	94,834.68	56,479.03	151,313.71
应收利息	6.17	-	6.17
应收证券清算款	-	606,682.83	606,682.83
其他资产	790,579.16	-	790,579.16
资产合计	106,543,405.95	45,258,323.66	151,801,729.61
以外币计价的负债			
应付赎回款	65,947.84	-	65,947.84
应付证券清算款	275,287.35	-	275,287.35
其他负债	245.01	769,286.90	769,531.91
负债合计	341,480.20	769,286.90	1,110,767.10
资产负债表 外汇风险敞口净额	106,201,925.75	44,489,036.76	150,690,962.51
项目	上年度末		
	2015年12月31日		

	美元 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	3,756,128.89	90.41	3,756,219.30
交易性金融资产	129,159,413.56	64,561,657.50	193,721,071.06
应收股利	154,923.74	79,698.63	234,622.37
应收利息	28.57	-	28.57
应收申购款	116,349.21	-	116,349.21
资产合计	133,186,843.97	64,641,446.54	197,828,290.51
以外币计价的负债			
应付赎回款	446.31	-	446.31
其他负债	1.69	-	1.69
负债合计	448.00	-	448.00
资产负债表 外汇风险敞 口净额	133,186,395.97	64,641,446.54	197,827,842.51

7.4.13.4.2.2 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	上年度末
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	7,534,548.13	9,891,392.13
	所有外币相对人民币贬值 5%	-7,534,548.13	-9,891,392.13

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	139,705,815.18	92.77	190,085,338.71	94.41
交易性金融资产—基金投资	3,588,773.15	2.38	3,635,732.35	1.81
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	143,294,588.33	95.16	193,721,071.06	96.21

7.4.13.4.3.2 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	6,824,151.78	9,245,512.84
	业绩比较基准下降 5%	-6,824,151.78	-9,245,512.84

7.4.14 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附注 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 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 143,294,588.33 元，无属于第二层级和第三层级的余额。(2015 年 12 月 31 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 193,721,071.06 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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	139,705,815.18	91.73
	其中：普通股	139,705,815.18	91.73
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	3,588,773.15	2.36
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	7,455,760.16	4.90
8	其他各项资产	1,548,754.58	1.02
9	合计	152,299,103.07	100.00

8.2 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	95,273,354.93	63.27
瑞士	13,950,164.65	9.26
英国	8,228,644.01	5.46
日本	6,971,717.93	4.63
德国	5,649,515.75	3.75
法国	4,267,807.98	2.83
丹麦	3,055,133.36	2.03
澳大利亚	1,857,276.93	1.23
比利时	301,748.77	0.20
加拿大	150,450.87	0.10
合计	139,705,815.18	92.77

注：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。

8.3 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（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必须消费品	-	-
必须消费品	-	-
保健	139,705,815.18	92.77
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-

合计	139,705,815.18	92.77
----	----------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 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	14,233.00	11,375,181.12	7.55
2	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证 券交易 所	美国	31,708.00	7,144,248.70	4.74
3	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN VX	瑞士证 券交易 所	瑞士	13,727.00	6,944,651.49	4.61
4	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证 券交易 所	美国	14,419.00	5,888,448.38	3.91
5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSEIN	罗氏	ROG VX	瑞士证 券交易 所	瑞士	3,666.00	5,821,820.16	3.87
6	UNITED HEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽约证 券交易 所	美国	4,978.00	5,526,563.06	3.67
7	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,896.00	3,951,552.17	2.62
8	ABBVIE INC	艾伯维有限公司	ABBV US	纽约证 券交易 所	美国	8,496.00	3,690,619.41	2.45
9	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约证 券交易 所	美国	7,177.00	3,546,317.25	2.35
10	BRISTOL	百时美施	BMJ US	纽约证	美国	8,728.00	3,538,316.19	2.35

	-MYERS SQUIBB CO	贵宝		券交易 所				
11	SANOFI	赛诺菲安 万特公司	SAN FP	巴黎证 券交易 所	法国	6,145.00	3,452,831.99	2.29
12	GILEAD SCIENCE S INC	吉利德科 学	GILD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,902.00	3,428,627.65	2.28
13	GLAXOS MITHKLI NE PLC	葛兰素史 克公司	GSK LN	伦敦证 券交易 所	英国	25,539.00	3,394,562.87	2.25
14	CELGEN E CORP	新基医药	CELG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,057.00	3,257,599.59	2.16
15	BAYER AG-REG	拜耳股份 有限公司	BAYN GR	德国证 券交易 所	德国	4,314.00	3,124,729.78	2.08
16	ALLERG AN PLC	艾尔建有 限公司	AGN US	纽约证 券交易 所	美国	1,965.00	2,862,689.36	1.90
17	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽约证 券交易 所	美国	5,088.00	2,595,980.79	1.72
18	ASTRAZ ENECA PLC	阿斯利康 公共有限 公司	AZN LN	伦敦证 券交易 所	英国	6,511.00	2,458,583.76	1.63
19	NOVO NORDIS K A/S-B	诺和诺德 公司	NOVOB DC	哥本哈 根证券 交易所	丹麦	9,665.00	2,423,250.03	1.61
20	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,136.00	2,234,732.91	1.48
21	ABBOTT LABORA TORIES	雅培制药	ABT US	纽约证 券交易 所	美国	7,718.00	2,056,462.41	1.37
22	THERMO FISHER SCIENTI FIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	纽约证 券交易 所	美国	2,074.00	2,030,053.39	1.35
23	SHIRE PLC	Shire 公司	SHP LN	伦敦证 券交易 所	英国	4,717.00	1,880,103.26	1.25
24	DANAHE	丹纳赫	DHR US	纽约证	美国	3,187.00	1,720,903.77	1.14

	R CORP			券交易 所				
25	AETNA INC	安泰保险	AET US	纽约证 券交易 所	美国	1,832.00	1,575,991.50	1.05
26	EXPRES S SCRIPTS HOLDIN G CO	快捷药方	ESRX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,220.00	1,536,571.86	1.02
27	ANTHE M INC	Anthem 股 份有限公 司	ANTM US	纽约证 券交易 所	美国	1,373.00	1,369,337.51	0.91
28	STRYKE R CORP	史赛克	SYK US	纽约证 券交易 所	美国	1,624.00	1,349,742.08	0.90
29	BECTON DICKINS ON AND CO	碧迪	BDX US	纽约证 券交易 所	美国	1,106.00	1,270,152.91	0.84
30	CIGNA CORP	CIGNA 公 司	CI US	纽约证 券交易 所	美国	1,340.00	1,239,937.42	0.82
31	CSL LTD	CSL 有限 公司	CSL AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	2,382.00	1,201,237.79	0.80
32	MCKESS ON CORP	McKesson 公司	MCK US	纽约证 券交易 所	美国	1,190.00	1,159,418.96	0.77
33	FRESENI US SE & CO KGAA	费森尤斯 集团	FRE GR	德国证 券交易 所	德国	2,092.00	1,135,125.41	0.75
34	TAKEDA PHARM ACEUTI CAL CO LTD	武田药品 工业	4502 JP	东京证 券交易 所	日本	3,900.00	1,123,677.69	0.75
35	HUMAN A INC	Humana 公司	HUM US	纽约证 券交易 所	美国	776.00	1,098,316.34	0.73
36	ASTELL AS PHARMA INC	安斯泰来 制药株式 会社	4503 JP	东京证 券交易 所	日本	11,300.00	1,093,229.67	0.73

37	BOSTON SCIENTI FIC CORP	波士顿科 学	BSX US	纽约证 券交易 所	美国	7,095.00	1,064,585.66	0.71
38	REGENE RON PHARM ACEUTI CALS	再生元制 药股份有 限公司	REGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	395.00	1,005,868.82	0.67
39	ALEXIO N PHARM ACEUTI CALS INC	Alexion 制 药公司	ALXN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,179.00	1,000,666.76	0.66
40	ZOETIS INC	硕腾公司	ZTS US	纽约证 券交易 所	美国	2,577.00	956,937.02	0.64
41	INTUITI VE SURGIC AL INC	直觉外科 手术公司	ISRG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	203.00	893,045.17	0.59
42	OTSUKA HOLDIN GS CO LTD	大塚控股 株式会社	4578 JP	东京证 券交易 所	日本	2,900.00	880,141.19	0.58
43	ACTELI ON LTD-REG	爱可泰隆 有限公司	ATLN VX	瑞士证 券交易 所	瑞士	564.00	849,071.59	0.56
44	CARDIN AL HEALTH INC	康德乐公 司	CAH US	纽约证 券交易 所	美国	1,684.00	840,746.92	0.56
45	ST JUDE MEDICA L INC	圣犹达医 疗用品	STJ US	纽约证 券交易 所	美国	1,491.00	829,410.54	0.55
46	ESSILOR INTERN ATIONA L	法国依视 路国际有 限公司	EI FP	巴黎证 券交易 所	法国	1,039.00	814,975.99	0.54
47	BAXTER INTERN ATIONA L INC	百特	BAX US	纽约证 券交易 所	美国	2,575.00	792,035.44	0.53
48	HCA	HCA 控股	HCA US	纽约证	美国	1,520.00	780,484.64	0.52

	HOLDING GS INC	公司		券交易 所				
49	ZIMMER BIOMET HOLDING GS INC	捷迈巴奥 米特控股 公司	ZBH US	纽约证 券交易 所	美国	1,048.00	750,261.52	0.50
50	EDWARD LIFESCI ENCES CORP	Edwards Lifesciences 公司	EW US	纽约证 券交易 所	美国	1,114.00	724,096.55	0.48
51	ILLUMINA A INC	Illumina 公 司	ILMN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	767.00	681,259.74	0.45
52	VERTEX PHARM ACEUTI CALS INC	维特制药 股份有限 公司	VRTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,290.00	659,252.94	0.44
53	FRESENI US 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	1,104.00	648,966.59	0.43
54	EISAI CO LTD	卫材株式 会社	4523 JP	东京证 券交易 所	日本	1,600.00	639,578.28	0.42
55	MYLAN NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,413.00	638,592.13	0.42
56	CR BARD INC	CR 巴德	BCR US	纽约证 券交易 所	美国	388.00	604,684.97	0.40
57	HOYA CORP	Hoya 株式 会社	7741 JP	东京证 券交易 所	日本	2,000.00	585,302.80	0.39
58	AGILEN T TECHNO LOGIES INC	安捷伦	A US	纽约证 券交易 所	美国	1,693.00	535,072.18	0.36
59	SHIONO GI & CO LTD	盐野义制 药有限公 司	4507 JP	东京证 券交易 所	日本	1,600.00	533,840.01	0.35
60	CERNER	塞纳公司	CERN US	纳斯达	美国	1,568.00	515,253.72	0.34

	CORP			克证券 交易所				
61	SMITH & NEPHEW PLC	施乐辉	SN/ LN	伦敦证 券交易 所	英国	4,768.00	495,394.12	0.33
62	MERCK KGAA	德国默克 集团	MRK GR	德国证 券交易 所	德国	682.00	494,088.01	0.33
63	DENTSP LY SIRONA INC	登士柏西 诺德公司	XRAY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,218.00	487,776.13	0.32
64	LABORA TORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验 控股	LH US	纽约证 券交易 所	美国	534.00	475,565.48	0.32
65	DAIICHI SANKYO CO LTD	第一三共	4568 JP	东京证 券交易 所	日本	3,300.00	470,289.19	0.31
66	AMERIS OURCEB ERGEN CORP	美源伯根	ABC US	纽约证 券交易 所	美国	867.00	470,264.29	0.31
67	QUEST DIAGNO STICS INC	QUEST DIAGNOS TICS	DGX US	纽约证 券交易 所	美国	733.00	467,295.05	0.31
68	TERUMO CORP	泰尔茂株 式会社	4543 JP	东京证 券交易 所	日本	1,800.00	462,843.30	0.31
69	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩 公司	HSIC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	420.00	442,013.15	0.29
70	PERRIG O CO PLC	Perrigo 公 司	PRGO US	纽约证 券交易 所	美国	745.00	430,138.05	0.29
71	ONO PHARM ACEUTI CAL CO LTD	小野药品 工业	4528 JP	东京证 券交易 所	日本	2,800.00	426,397.44	0.28
72	HOLOGI C INC	豪洛捷公 司	HOLX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,451.00	403,831.35	0.27

73	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	136.00	394,882.90	0.26
74	WATERS CORP	活德	WAT US	纽约证 券交易 所	美国	422.00	393,415.17	0.26
75	DAVITA INC	DaVita 股 份有限公 司	DVA US	纽约证 券交易 所	美国	828.00	368,754.27	0.24
76	GENMA B A/S	GENMAB A/S	GEN DC	哥本哈 根证券 交易所	丹麦	317.00	366,036.76	0.24
77	SYSMEX CORP	希森美康 株式会社	6869 JP	东京证 券交易 所	日本	900.00	363,087.96	0.24
78	UNIVER SAL HEALTH SERVICE S-B	Universal Health Services 公 司	UHS US	纽约证 券交易 所	美国	477.00	352,005.99	0.23
79	CENTEN E CORP	Centene 公 司	CNC US	纽约证 券交易 所	美国	893.00	350,064.81	0.23
80	LONZA GROUP AG-REG	龙沙集团 股份有限 公司	LONN VX	瑞士证 券交易 所	瑞士	278.00	334,621.41	0.22
81	COOPER COS INC/THE	库柏股份 有限公司	COO US	纽约证 券交易 所	美国	253.00	307,012.82	0.20
82	UCB SA	优时比公 司	UCB BB	布鲁塞 尔证券 交易所	比利时	678.00	301,748.77	0.20
83	VARIAN MEDICA L SYSTEM S INC	瓦里安医 疗设备有 限公司	VAR US	纽约证 券交易 所	美国	479.00	298,323.05	0.20
84	ENVISIO N HEALTH CARE CORP	ENVISION HEALTHC ARE CORP	EVHC US	纽约证 券交易 所	美国	611.00	268,255.11	0.18

85	COLOPL AST-B	康乐保股 份公司	COLOB DC	哥本哈 根证券 交易所	丹麦	567.00	265,846.57	0.18
86	QIAGEN N.V.	德国 QIAGEN 公共有限 公司	QIA GR	德国证 券交易 所	德国	1,265.00	246,605.96	0.16
87	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	696.00	238,748.25	0.16
88	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	2,113.00	227,103.35	0.15
89	CHUGAI PHARM ACEUTI CAL CO LTD	中外制药	4519 JP	东京证 券交易 所	日本	1,100.00	219,920.59	0.15
90	PERKINE LMER INC	珀金埃尔 默	PKI US	纽约证 券交易 所	美国	580.00	209,823.44	0.14
91	MALLIN CKRODT PLC	Mallinckro dt 公司	MNK US	纽约证 券交易 所	美国	565.00	195,264.76	0.13
92	COCHLE AR LTD	科利耳 (Cochlear) 有限公司	COH AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	309.00	190,187.54	0.13
93	TAISHO PHARM ACEUTI CAL HOLDIN	大正制药 株式会社	4581 JP	东京证 券交易 所	日本	300.00	173,409.81	0.12
94	VALEAN T PHARM ACEUTI CALS INTE	凡利亚药 品国际有 限公司	VRX CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	1,494.00	150,450.87	0.10
95	PATTERS ON COS INC	帕特森公 司	PDCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	421.00	119,827.17	0.08
96	ENDO INTERN	远藤控股 公司	ENDP US	纳斯达 克证券	美国	1,040.00	118,822.49	0.08

	ATIONA L PLC			交易所				
--	-----------------	--	--	-----	--	--	--	--

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	DANAHER CORP	DHR US	2,117,747.09	1.05
2	SHIRE PLC	SHP LN	805,794.53	0.40
3	SHIRE PLC-ADR	SHPG US	744,301.03	0.37
4	CENTENE CORP	CNC US	506,100.62	0.25
5	SYSMEX CORP	6869 JP	485,518.26	0.24
6	GENMAB A/S	GEN DC	439,101.66	0.22
7	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	MTD US	433,635.38	0.22
8	HOLOGIC INC	HOLX US	417,065.44	0.21
9	COOPER COS INC/THE	COO US	345,092.46	0.17
10	DENTSPLY SIRONA INC	XRAY US	302,119.77	0.15
11	ENVISION HEALTHCARE CORP	EVHC US	275,590.48	0.14
12	NOVARTIS AG-REG	NOVN VX	271,592.15	0.13
13	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	262,606.55	0.13
14	AMGEN INC	AMGN US	222,840.40	0.11
15	ALLERGAN PLC	AGN US	168,308.49	0.08
16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	ROG VX	166,579.46	0.08
17	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	160,474.62	0.08
18	MERCK & CO. INC.	MRK US	138,958.99	0.07
19	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	138,129.14	0.07
20	ABBVIE INC	ABBV US	127,276.38	0.06

注：本项及下项 8.5.2、8.5.3 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。

8.5.2 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	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	4,509,275.26	2.24
2	NOVARTIS AG-REG	NOVN VX	3,064,808.26	1.52
3	PFIZER INC	PFE US	2,795,039.65	1.39
4	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	ROG VX	2,359,181.95	1.17
5	MERCK & CO. INC.	MRK US	2,358,182.42	1.17
6	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,994,829.60	0.99
7	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	1,852,424.59	0.92
8	AMGEN INC	AMGN US	1,826,909.75	0.91
9	MEDTRONIC PLC	MDT US	1,648,026.11	0.82
10	ABBVIE INC	ABBV US	1,472,750.22	0.73
11	ALLERGAN PLC	AGN US	1,436,605.91	0.71
12	GLAXOSMITHKLINE PLC	GSK LN	1,393,568.08	0.69
13	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMJ US	1,370,062.49	0.68
14	SANOFI	SAN FP	1,339,193.86	0.67
15	CELGENE CORP	CELG US	1,251,526.26	0.62
16	BAXALTA INC	BXLT US	1,222,755.29	0.61
17	NOVO NORDISK A/S-B	NOVOB DC	1,212,624.65	0.60
18	BAYER AG-REG	BAYN GR	1,154,519.77	0.57
19	ELI LILLY & CO	LLY US	1,073,120.39	0.53
20	ASTRAZENECA PLC	AZN LN	1,053,228.31	0.52

8.5.3 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	11,705,282.88
卖出收入（成交）总额	59,278,922.97

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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 HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	3,588,773.15	2.38
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.11.3 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	606,682.83

3	应收股利	151,313.71
4	应收利息	178.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	606,453.77
7	待摊费用	184,125.39
8	其他	-
9	合计	1,548,754.58

8.11.4 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。

8.11.5 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未存在流通受限情况。

9 基金份额持有人信息

9.1 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
8,897	14,480.34	34,959,117.37	27.14%	93,872,450.15	72.86%

9.2 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	2,455,324.48	1.9058%

9.3 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

§10 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	154,715,212.39
本报告期基金总申购份额	44,935,171.85
减：本报告期基金总赎回份额	70,818,816.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	128,831,567.52

§11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 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

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。自 2016 年 10 月 13 日起，本基金管理人聘任张敬晗为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，寻卫国先生不再担任基金托管人资产托管部总经理职务，蒋柯先生临时主持部门工作。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会报告。

11.3 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，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 4 月 18 日,本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书(【2016】34 号)。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改,进一步梳理了股票入库的流程,并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	63,771,865.25	92.40%	20,224.22	84.63%	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	5,246,814.01	7.60%	3,672.81	15.37%	-
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。

11.8 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广发全球医疗保健指数证券投资基金 2017 年交易市场休市日暂停申购赎回的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-12-29
2	广发基金管理有限公司关于开展邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-12-22
3	广发基金管理有限公司关于增加弘业期货为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-11-10
4	广发基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-10-27
5	广发基金管理有限公司关于增加奕丰金融为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-10-13
6	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-09-20
7	广发基金管理有限公司广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-08-23
8	广发基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞	《中国证券报》、《证券时	2016-08-11

	为旗下部分基金代销机构的公告	报》、《上海证券报》	
9	广发基金管理有限公司关于增加万得投顾为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-29
10	广发基金管理有限公司关于增加广源达信为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-18
11	广发基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-14
12	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暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-05
13	广发基金管理有限公司旗下 QDII 基金资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-07-01
14	广发基金管理有限公司关于增加天津银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-27
15	广发基金管理有限公司关于增加苏宁基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-07
16	广发基金管理有限公司关于增加德州银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-06
17	广发基金管理有限公司关于增加大智慧财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-20
18	广发基金管理有限公司关于增加徽商银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-17
19	广发基金管理有限公司关于增加汇成基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-13
20	广发基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-05
21	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恢复申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-30
22	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暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-22
23	广发基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-18
24	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收益分配公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-16
25	广发基金管理有限公司旗下 QDII 基金资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04
26	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04

§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

二〇一七年三月二十八日