广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年一月二十一日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发成长优选混合
基金主代码	000214
交易代码	000214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月11日
报告期末基金份额总额	209,153,607.22份
投资目标	在深入研究的基础上,自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置,对股票、债券和货币市场工具等大类资产配置比例进行动态调整,在降低市场风险的同时追求更高收益。 (二)股票投资策略 本基金将采用成长型股票优选策略,通过定量分析与定性分析,自下而上的精选A股市场中具有持续成长潜力且估值合理的上市公司进行投资。 (三)债券投资策略 在债券投资上,本基金将坚持稳健投资原则,对各类债券品种进行配置。本基金将通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现和确认市场失衡,把握投资机会;在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下,为投资者获得稳定的收益。 (四)金融衍生品投资策略
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:50%×沪深300指数+50%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	29,752,932.69
2.本期利润	-9,992,168.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0332
4.期末基金资产净值	230,340,419.11
5.期末基金份额净值	1.101

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。

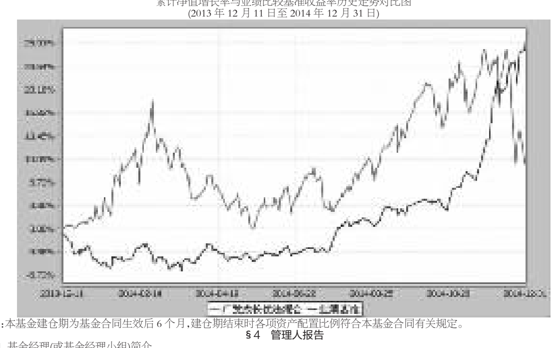
3.2 基金净值表现

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	-6.85%	1.82%	23.71%	0.83%	-30.56%	0.99%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
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11日至2014年12月31日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱纪刚	本基金的基金经理;广发核心精选股票基金的基金经理;广发轮动配置股票基金的基金经理;广发竞争优势混合基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2013-12-11	-	8年	男,中国籍,理学硕士,持有基金业执业资格证书,2006年7月至2006年12月任职于招商证券股份有限公司,2006年12月至2009年8月先后任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究小组组长、广发大盘成长混合基金的基金经理助理、研究发展部副总经理,2009年9月10日起任广发核心精选股票基金的基金经理,2011年3月15日至2012年10月22日任广发聚祥保本混合基金的基金经理,2013年5月28日任广发轮动配置股票基金的基金经理,2013年12月11日任广发成长优选混合基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理,2014年3月12日起任广发竞争优势混合基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

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、《广发成长优选灵活配置混合型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 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需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

4季度,市场发生了翻天覆地的变化,大盘股快速上涨,而小股票与之形成跷跷板效应大幅下跌,市场分化非常明显。上证50上涨59.39%,沪深300上涨44.17%,中证800上涨33.39%,而创业板指数则下跌了4.49%。行业方面分化巨大,金融上涨84.55%,建筑、交运等也大幅上涨,而卫生、农林牧渔、文化传媒等则是下跌的。

关于这种上涨和分化,我们的理解是这样的:上涨的长期逻辑在于国家之前的一系列政策,包括国企改革,反腐败等,使得大家对中国经济长远的前景变得乐观,有了做多的长期基础;而短期逻辑在于各类资金在估值修复的基础上,股市的收益率最具吸引力。一方面,基本面最不确定的传统行业里的公司估值下降到了历史的低点,且在一系列的稳增长政策支持下又面临修复机会,于是在宏观逻辑和投资行为上一致地推动大盘蓝筹股上涨;另一方面,最近几年估值持续抬升的中小盘成长股在这个过程中由于资金流出而出现大幅调整。

关于这种上涨和分化,我们的理解是这样的:上涨的长期逻辑在于国家之前的一系列政策,包括国企改革,反腐败等,使得大家对中国经济长远的前景变得乐观,有了做多的长期基础;煤炭和电力同时涨停在基本面上也说不通;大股票虽然有估值修复的基础,但是其长期增长中枢不会太高,即使估值体系重塑,也不应该跟真正的成长股拉到一个水平线。但是这种市场趋势一旦形成,短期便难以打破循环,而且市场还会自我加强。后期我们预计低估值蓝筹还会轮番进行估值修复,会从金融地产蔓延到各个行业,并逐渐扩散到中速增长的中盘股。这种修复在一段时间内将是无差别的,当然长期会分化。针对这种情况,我们将从长期和短期两方面做准备。

遗憾的是,我们错判了形势,并未认识到前述情况,由于基金规模较小,我们未向指数靠拢,仍然以选择小股票为主,导致与市场行情格格不入,四季度净值非常不理想。在此我们向投资者表示深深的歉意,我们争取2015年会有好的表现回馈投资者。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为-6.85%,同期业绩比较基准收益率为23.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度,我们认为这种分化还会持续和蔓延;虽然大股票集体上涨的逻辑并不完备;在石油价格大幅下跌的背景下中国石油上涨的基础不牢固;煤炭和电力同时涨停在基本面上也说不通;大股票虽然有估值修复的基础,但是其长期增长中枢不会太高,即使估值体系重塑,也不应该跟真正的成长股拉到一个水平线。但是这种市场趋势一旦形成,短期便难以打破循环,而且市场还会自我加强。后期我们预计低估值蓝筹还会轮番进行估值修复,会从金融地产蔓延到各个行业,并逐渐扩散到中速增长的中盘股。这种修复在一段时间内将是无差别的,当然长期会分化。针对这种情况,我们将从长期和短期两方面做准备。

短期方面,我们会修正之前偏离基准过多的组合情况,将组合适当向指数靠拢,保证短期不会偏离太多,市场即使出现超预期上涨的情况也不至于太被动;长期方面,还是要仔细辨别股票基本面,我们认为无论大小股票,在集体上涨完后都会分化,大盘股估值提升以后,如果基本面跟不上,估值还会掉下去;反之,真正的成长股,到年底必然会回到合理估值,所以长期我们还是选择基本面持续改善,业绩增长能够兑现的行业和公司。行业方面,我们觉得非银金融家电汽车基本面基础比较牢固,而小股票则更需要选个股,行业上相对偏向计算机信息服务高端装备和环保。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	207,591,037.16	87.07
	其中:股票	207,591,037.16	87.07
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,485,257.42	12.37
7	其他各项资产	1,354,905.30	0.57
8	合计	238,431,199.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	158,940,156.02	69.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,545,962.90	8.92
G	交通运输、仓储和邮政业	4,328,500.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,776,418.24	10.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	207,591,037.16	90.12

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002491	通鼎光电	856,106	17,550,173.00	7.62
2	300221	银禧科技	1,283,921	17,076,149.30	7.41
3	002184	海得控制	737,952	16,124,251.20	7.00
4	000153	丰原药业	1,133,212	13,995,168.20	6.08
5	000516	开元投资	861,790	10,522,455.90	4.57
6	000411	英特集团	461,700	10,023,507.00	4.35
7	002111	威海广泰	614,396	9,916,351.44	4.31
8	300359	全通教育	99,995	9,462,526.85	4.11
9	603766	隆鑫通用	612,772	8,235,655.68	3.58
10	002009	天奇股份	389,268	6,956,219.16	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	510,034.75
2	应收证券清算款	60.51
3	应收股利	-
4	应收利息	6,347.81
5	应收申购款	838,462.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,354,905.30

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002184	海得控制	16,124,251.20	7.00	重大事项
2	000411	英特集团	10,023,507.00	4.35	重大事项
3	300359	全通教育	9,462,526.85	4.11	重大事项
4	002009	天奇股份	6,956,219.16	3.02	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	416,840,258.79
本报告期基金总申购份额	90,439,016.02
减:本报告期基金总赎回份额	298,125,667.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	209,153,607.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
本报告期买入/申购总份额	32,936,369.71
本报告期卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	32,936,369.71
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	15.75

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	基金转入	2014-10-15	32,936,369.71	39,589,516.39	-
合计			32,936,369.71	39,589,516.39	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2.《广发成长优选灵活配置混合型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.《广发成长优选灵活配置混合型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。

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;
2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年一月二十一日

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年一月二十一日

§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1月16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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发现金宝场内货币	
基金主代码	519858	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月2日	
报告期末基金份额总额	193,399,414,798.00份	
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发宝A	广发宝B
下属分级基金的交易代码	519858	519859
报告期末下属分级基金的份额总额	139,175,991,169.00份	54,223,423,629.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
	广发宝A	广发宝B
1.本期已实现收益	11,914,478.60	10,596,585.87
2.本期利润	11,914,478.60	10,596,585.87
3.期末基金资产净值	1,391,759,911.69	542,234,236.29

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发宝A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.3029%	0.0212%	0.0894%	0.0000%	1.2135%	0.0212%

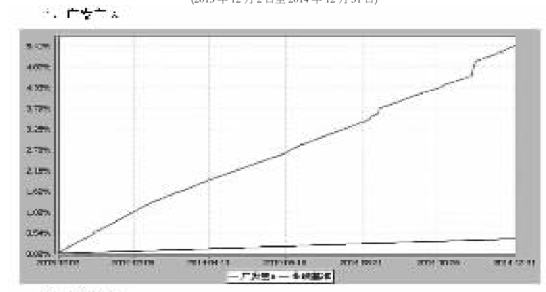
2、广发宝B:

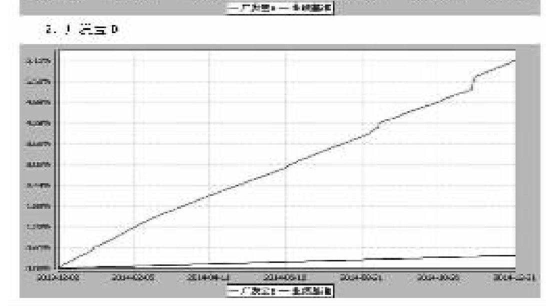
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.4588%	0.0212%	0.0894%	0.0000%	1.3694%	0.0212%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年12月2日至2014年12月31日)





注:本基金建仓期为合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
温秀娟	本基金的基金经理;广发货币基金的基金经理;广发理财30天债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;固定收益部副总经理	2013-12-02	-	14年	女,中国籍,经济学学士,持有基金业执业证书,2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司江门营业部,2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部工作,2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作,2010年4月29日起任广发货币基金的基金经理,2013年1月14日起任广发理财30天债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年12月2日起任广发现金宝场内货币基金的基金经理,2014年3月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理。

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、《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》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 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需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度央行宣布不对称降息,金融机构一年期贷款基准利率下调0.4个百分点至5.6%;一年期存款基准利率下调0.25个百分点至2.75%,同时结合推进利率市场化改革,将金融机构存款利率浮动区间的上限由存款基准利率的1.1倍调整为1.2倍,此举目的在于降低企业融资成本。虽然基准利率下降,但央行维持紧平衡的数量控制政策,在资金紧张的年底,并没有通过公开市场操作向市场注入资金,而选择SLO、MLF、SLF等创新工具向市场传递信号,信息传导较为滞后,导致货币市场利率大幅飙升,7天回购利率一度冲到10%,一年期AAA短融也上升到5.5%的水平,较降息前上升150个bp。

报告期内我们调整组合,增配久期较短的存款和短期融资券来提高流动性,把握年底货币市场利率高企的机会做高收益的存款和回购,提高组合收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发现金宝A类净值增长率为1.3029%,广发现金宝B类净值增长率为1.4588%,同期业绩比较基准收益率为0.0894%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年中国经济进入减速运行的新常态发展阶段,增长率下探7%,CPI也回落到3%以内。从微观的企业层面来看,经济景气度下降,特别房地产业的低迷导致产业链收缩,企业经营困难,加上融资成本高企,财务压力很大,预计陆续有企业要破产,但大规模的破产潮出现概率不大。虽然经济增速下一个台阶是政府的调控目标,但如果经济持续下落导致通缩却不是政府愿意看到的,三架马车中内需和出口维持平稳,固定资产投资受基建和房地产等因素影响,不确定性大,有可能出现大幅滑落,因此如果经济下降速度超过政府承受范围,政府有可能出台一系列财政和货币政策去刺激投资。对货币市场影响最大的是货币政策,2014年定向降准和非对称降息都没改变货币数量紧平衡的局面,社会融资成本居高不下,主要原因在于央行不愿意投放太多货币,避免无效资金再度吹出经济泡沫,但如果要降低社会融资成本,大幅度降准是必要要做的事情,因此政府需要在泡沫和保增长之间权衡,根据经济形势做出政策抉择。第一季度是重要的时间窗口,等待财政部门完成梳理各地方政府的债务,制定新的融资制度之后,刺激政策有可能出台,预计15年可能出现1-3次降准,1次降息。

IPO加速发行也会阶段性对货币市场利率造成冲击,我们会紧密跟踪新股发行,合理安排现金流。具体而言,我们将坚持货币市场基金流动性管理工具的投资目标,保持合理的组合平均剩余到期期限,在合规基础上进行组合管理,根据对利率和信用市场变化的规律的深入研究来提高组合收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	479,940,599.65	24.18
	其中:债券	479,940,599.65	24.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	275,001,831.13	13.85
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	100,001,248.63	5.04
3	银行存款和结算备付金合计	1,161,975,981.07	58.54
4	其他资产	68,108,039.96	3.43
5	合计	1,985,026,451.81	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.22	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:"除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	70
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	71.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	10.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	4.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.50	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,971,490.62	3.62
	其中:政策性金融债	69,971,490.62	3.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	409,969,109.03	21.20
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	479,940,599.65	24.82
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041454009	14南山集CP001	700,000.00	70,000,020.97	3.62
2	071408008	14东方证券CP008	700,000.00	69,989,907.62	3.62
3	041458021	14山钢CP001	500,000.00	50,002,015.77	2.59
4	071401014	14招商CP014	500,000.00	49,995,983.50	2.59
5	071422010	14齐鲁证券CP010	500,000.00	49,993,623.41	2.58
6	140218	14国开18	500,000.00	49,964,789.83	2.58
7	041458046	14魏桥铝电CP001	300,000.00	30,000,541.40	1.55
8	041455025	14天业CP001	300,000.00	30,000,073.13	1.55
9	041472018	14扬州经开CP001	300,000.00	29,988,052.83	1.55
10	140204	14国开04	200,000.00	20,006,700.79	1.03

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	19次
报告期内偏离度的最高值	0.4485%
报告期内偏离度的最低值	0.0181%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1923%

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

5.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,442,842.08
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,217,510.98
4	应收申购款	49,447,686.90
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	68,108,039.96

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发宝A	广发宝B
本报告期期初基金份额总额	77,155,528,733.00	83,768,409,618.00
本报告期基金总申购份额	992,634,294,119.00	417,974,464,953.00
本报告期基金总赎回份额	930,613,831,683.00	447,519,450,942.00
报告期期末基金份额总额	139,175,991,169.00	54,223,423,629.00

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发现金宝场内实时申赎货币市场基金募集的文件;
2.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》;
3.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》;
4.法律意见书;
5.基金管理人业务资格批件、营业执照;
6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;
2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年一月二十一日

广发全球医疗保健指数证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:二〇一五年一月二十一日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球医疗保健(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
报告期末基金份额总额	205,766,440.10份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	(一)资产配置策略 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%。 (二)权益类资产投资策略 1、股票组合构建原则 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。 2、股票组合构建方法 本基金主要采用完全复制法,即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,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 3、股票组合调整 (1)定期调整 本基金股票组合根据所跟踪的标普全球1200医疗保健指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 (2)不定期调整 1)与指数相关的调整:当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。 2)申购赎回调整:根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。 3)其他调整:对于标的指数成份股,若因其出现停牌限制、存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大的不利的司法诉讼、或者有充分合理的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选股、甚至现金来代替,也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。 4、目标基金投资策略 本基金基于控制投资组合跟踪误差与流动性管理的需要,可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以标普全球1200医疗保健指数为投资标的的指数基金(包括ETF)。 (三)固定收益类资产投资策略 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。 (四)衍生品投资策略 本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略,对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险,以及利用金融衍生产品的杠杆作用,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。
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。
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
境外资产托管人英文名称	Citibank N.A
境外资产托管人中文名称	美国花旗银行有限公司

§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(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	308,745.23
2.本期利润	2,065,571.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0121
4.期末基金资产净值	239,582,500.40
5.期末基金份额净值	1.164

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。

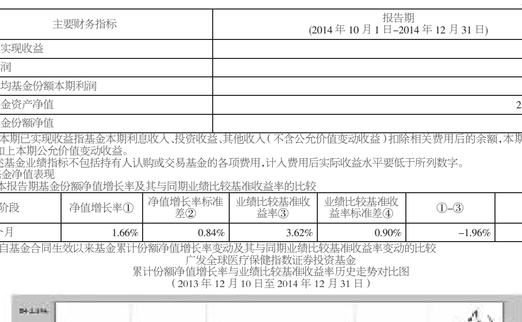
3.2 基金净值表现

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	1.66%	0.84%	3.62%	0.90%	-1.96%	-0.06%

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

广发全球医疗保健指数证券投资基金
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
(2013年12月10日至2014年12月31日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理;广发标普全球农业指数(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;国际业务部副总经理	2013-12-10	-	7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。

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 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需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,全球医疗保健行业继续是标普全球行业指数中的领跑者。10月初,指数虽然受到美联储退出QE,欧洲经济复苏乏力和埃博拉病毒的肆虐推升了全球的风险溢价的影响,医疗行业指数小幅回调,但是随后吉利德的新型丙肝药获批,Celgene的盈利继续超市场预期与安进提高全年展望等利好因素驱动,医疗指数快速回升。同时由于在十月与十一月多个医药学术会议上,多种疗效显著的创新药和新型的医疗设备公布良好的实验数据也推升相关药企的股价,其中医药指数下的生物指数与医疗设备指数表现最为突出。在此多重利好的情况下,医疗保健指数在12月初创出新高。随后由于艾伯维的新获批的丙肝药与吉利德的丙肝药物竞争,市场担心价格战导致医疗行业受到局部的卖压。此外,欧洲经济复苏乏力,希腊提前大选也为欧洲前景蒙上阴影,指数中一些欧股受到整体大市的影响而小幅回落,但是美国的生物医药板块经过短暂大跌后又重拾涨势,在全年相对高位结束2014年的行情。总结2014年,全球医疗保健指数获得不错的涨幅,领涨标普全球的其他行业。

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1.66%,同期比较业绩基准收益率为3.62%。

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2015年,全球医疗行业仍然有十分光明的前景。生物技术的突破为很多原来不能治愈的疾病患者带来福音,如治疗癌症的细胞免疫疗法,在美国临床的测试数据中,90%的白血病癌症可以获得治愈,这种技术的突破给整个医疗行业带来的是无限的商机。这些类似的疗效显著的新药产品将在未来3年连续推出,可以说未来3年是新药面世的高峰期,全球医药企业的增长将受益于这轮新药周期。同时,由于全球经济在缓慢复苏,人均医疗支出也会快速上涨,而权重最大的美国地区人均支出的上涨会对全球医疗板块带来十分正面的影响。我们相信全球医疗保健指数仍然在2015年持续增长并且跑赢大部分其他全球行业指数。

§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	224,320,519.53	92.24
	其中:普通股	224,320,519.53	92.24
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	3,775,259.75	1.55
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	12,075,731.48	4.97
8	其他各项资产	3,023,438.33	1.24
9	合计	243,194,949.09	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	147,390,783.16	61.52
瑞士	26,195,167.72	10.93
英国	14,390,610.06	6.01
德国	9,525,334.80	3.98
法国	7,586,337.38	3.17
日本	7,389,333.06	3.08
丹麦	5,312,493.98	2.22
加拿大	3,144,134.69	1.31
澳大利亚	2,836,441.38	1.18
比利时	549,883.30	0.23
合计	224,320,519.53	93.63

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。

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	224,320,519.53	93.63
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	224,320,519.53	93.63

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	26,212.00	16,772,110.71	7.00
2	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN VX	瑞士证券交易所	瑞士	25,171.00	14,315,490.72	5.98
3	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	58,857.00	11,218,547.37	4.68
4	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG VX	瑞士证券交易所	瑞士	6,532.00	10,857,202.32	4.53
5	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	26,801.00	9,313,294.17	3.89
6	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	14,047.00	8,101,985.68	3.38
7	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,048.00	6,869,653.95	2.87
8	BAYER AG-REG	拜耳股份有限公司	BAYN GR	德国证券交易所	德国	7,725.00	6,508,179.63	2.72
9	SANOFI	赛诺菲安万特公司	SAN FP	巴黎证券交易所	法国	11,201.00	6,318,379.89	2.64
10	GLAXOSMITHKLINE PLC	葛兰素史克公司	GSK LN	伦敦证券交易所	英国	45,511.00	5,976,564.23	2.49

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	3,775,259.75	1.58
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

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	-
3	应收股利	236,297.65
4	应收利息	1,882.74
5	应收申购款	2,505,027.02
6	其他应收款	119,464.11
7	待摊费用	160,766.81
8	其他	-
9	合计	3,023,438.33

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	-	-

注: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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	165,828,644
本报告期基金总申购份额	95,385,828.43
减:本报告期基金总赎回份额	55,448,032.33
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	205,766,440.10

§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 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;
2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年一月二十一日