

## 广发逆向策略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  
基金托管人广发证券股份有限公司  
报告送出日期二〇一五年一月二十一日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及董事承诺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。  
基金管理人广发证券股份有限公司根据基金合同规定，于2015年1月16日编制了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证基金管理人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
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。  
基金的投资有风险，投资者在进行投资决策前，应仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件。  
本报告中所列数据截至2014年12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称	广发逆向策略混合
基金主代码	000747
交易代码	000747
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月4日
报告期内基金份额总额	127,088,482.94份
报告期内基金份额净值	2014年9月4日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

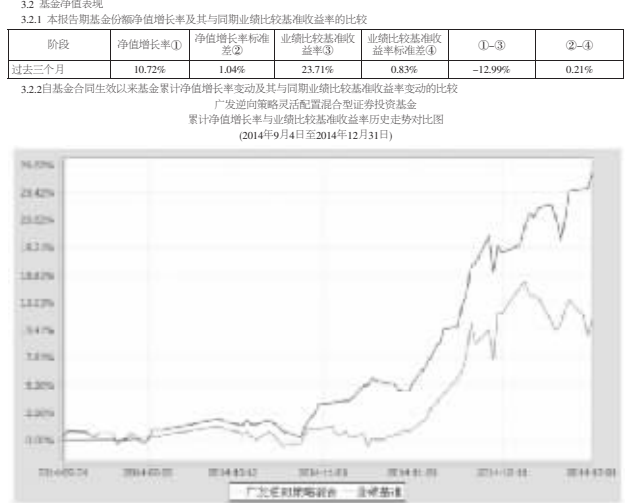
主要财务指标	报告期末
本期利润总额	11,578,104.85
本期净利润	23,212,049.70
3.期末可供分配利润	0.1047
4.期末基金份额净值	141.736,659.95
期末基金份额总额	1,115

**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	10.72%	1.04%	23.71%	0.83%	-12.99%	0.21%

3.2.2 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  
广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金  
报告期内基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率对比图  
(2014年9月4日至2014年12月31日)



**4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

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	002152	广电运通	625,000	13,000,187.20	9.17
2	603111	康华股份	794,105	10,386,393.40	7.33
3	000729	汇川技术	1,270,000	10,147,300.00	6.87
4	002259	金农互联	770,000	9,741,312.00	6.76
5	600666	宁波富海	430,000	9,601,000.00	6.74
6	000651	格力电器	246,000	9,131,520.00	6.44
7	002250	联华科技	572,000	8,466,488.00	5.97
8	002271	东方网电	240,013	8,002,366.82	5.65
9	601877	正泰电器	254,018	7,709,446.30	5.44
10	600309	华芳化学	325,076	7,080,155.28	5.00

**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	129,200,497.39	86.52
2	固定收益投资	129,200,497.39	86.52
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和拆出资金	16,996,689.23	11.38
7	其他各项资产	3,139,153.33	2.10
8	合计	149,336,339.99	100.00

**6.1 广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

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	002152	广电运通	625,000	13,000,187.20	9.17

**8.1 广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**9.1 广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**10.1 广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金投资组合**

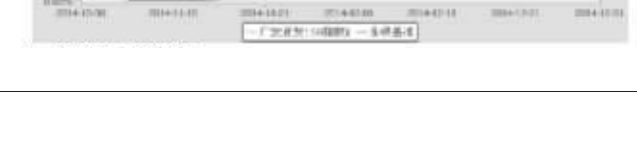
姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**11.1 广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**12.1 广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-09-04	8年	男，中国籍，金融学硕士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。



## 广发活期宝货币市场基金

### 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  
基金托管人广发证券股份有限公司  
报告送出日期二〇一五年一月二十一日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及董事承诺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。  
基金管理人广发证券股份有限公司根据基金合同规定，于2015年1月16日编制了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证基金管理人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
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。  
基金的投资有风险，投资者在进行投资决策前，应仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件。  
本报告中所列数据截至2014年12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称	广发活期宝货币
基金主代码	000748
交易代码	000748
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月28日
报告期内基金份额总额	202,913,865.44份
报告期内基金份额净值	2014年8月28日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

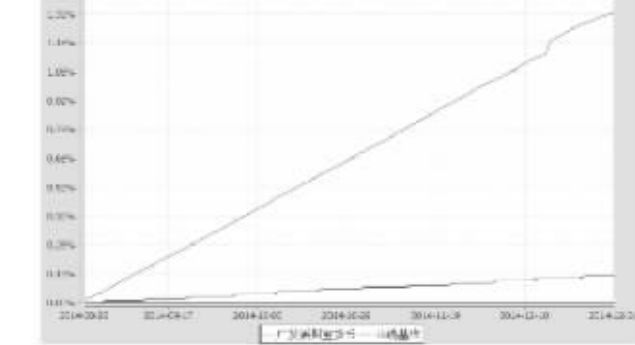
主要财务指标	报告期末
本期利润总额	1,972,484.31
本期净利润	1,972,484.31
3.期末可供分配利润	202,913,865.44

**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	0.9722%	0.0049%	0.0049%	0.0000%	0.0873%	0.0049%

3.2.2 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  
广发活期宝货币市场基金  
报告期内基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率对比图  
(2014年8月28日至2014年12月31日)



**4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**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	2,832,300.81	92.07
2	固定收益投资	2,832,300.81	92.07
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和拆出资金	178,440,772.26	5.83
7	其他各项资产	65,430,755.26	2.10
8	合计	3,076,176,729.33	100.00

**6.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

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	600016	民生银行	6,754,062	73,444,194.56	2.45
2	601186	中国银行	3,603,600	55,448,716.00	1.85
3	600776	开开股份	3,856,165	38,870,143.20	1.30
4	000728	汇川技术	1,252,926	38,406,304.42	1.28
5	600036	招商银行	3,515,712	38,016,334.88	1.27
6	600519	浦发银行	1,490,417	35,487,020.43	1.18
7	601601	中信证券	1,081,082	34,918,848.60	1.17
8	000002	万科A	2,503,550	34,799,505.00	1.16
9	600049	华谊集团	4,786,841	34,623,938.25	1.16
10	600360	华侨城A	1,106,000	34,272,695.68	1.14

**8.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**9.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**10.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

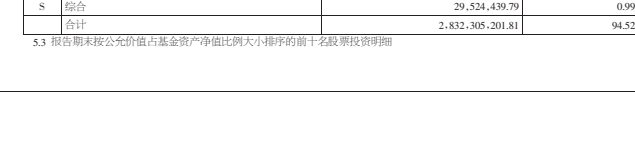
姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**11.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**12.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。



基金管理人广发基金管理有限公司  
基金托管人广发证券股份有限公司  
报告送出日期二〇一五年一月二十一日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及董事承诺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。  
基金管理人广发证券股份有限公司根据基金合同规定，于2015年1月16日编制了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证基金管理人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
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。  
基金的投资有风险，投资者在进行投资决策前，应仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件。  
本报告中所列数据截至2014年12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称	广发活期宝货币
基金主代码	000748
交易代码	000748
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月28日
报告期内基金份额总额	202,913,865.44份
报告期内基金份额净值	2014年8月28日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

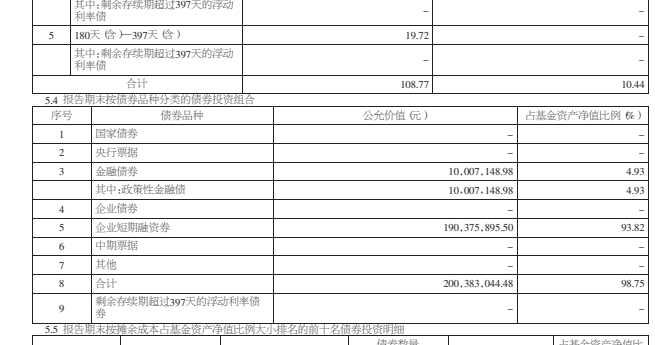
主要财务指标	报告期末
本期利润总额	1,972,484.31
本期净利润	1,972,484.31
3.期末可供分配利润	202,913,865.44

**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	0.9722%	0.0049%	0.0049%	0.0000%	0.0873%	0.0049%

3.2.2 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  
广发活期宝货币市场基金  
报告期内基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率对比图  
(2014年8月28日至2014年12月31日)



**4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**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	2,832,300.81	92.07
2	固定收益投资	2,832,300.81	92.07
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和拆出资金	178,440,772.26	5.83
7	其他各项资产	65,430,755.26	2.10
8	合计	3,076,176,729.33	100.00

**6.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

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	600016	民生银行	6,754,062	73,444,194.56	2.45
2	601186	中国银行	3,603,600	55,448,716.00	1.85
3	600776	开开股份	3,856,165	38,870,143.20	1.30
4	000728	汇川技术	1,252,926	38,406,304.42	1.28
5	600036	招商银行	3,515,712	38,016,334.88	1.27
6	600519	浦发银行	1,490,417	35,487,020.43	1.18
7	601601	中信证券	1,081,082	34,918,848.60	1.17
8	000002	万科A	2,503,550	34,799,505.00	1.16
9	600049	华谊集团	4,786,841	34,623,938.25	1.16
10	600360	华侨城A	1,106,000	34,272,695.68	1.14

**8.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

**9.1 广发活期宝货币市场基金投资组合**

姓名	职务	在任职本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏奕	基金经理	2014-08-28	14年	男，中国籍，经济学博士，持有基金从业资格。曾任广发证券股份有限公司资产管理部副经理，2007年6月起担任广发基金管理有限公司研究员，2013年2月2日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年12月18日起担任广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。