广发天天红发起式货币市场基金

2015 第二季度 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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发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	广发天天红
基金主代码	000389
交易代码	000389
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2013年10月22日
报告期末基金份额总额	20,420,140,002.76份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、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	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	广发银行股份有限公司

§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	183,120,271.86
2.本期利润	183,120,271.86
3.期末基金资产净值	20,420,140,002.76

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

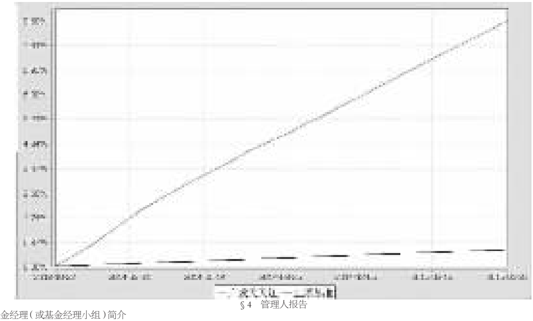
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.1080%	0.0025%	0.0885%	0.0000%	1.0195%	0.0025%

注:本基金利润分配按日结转份额。

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

广发天天红发起式货币市场基金
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10月22日至2015年6月30日)



§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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理;广发钱袋子货币基金的基金经理;广发集鑫债券的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发聚康混合基金的基金经理	2013-10-22	-	7年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员,2012年7月19日起任广发理财年年红债券基金的基金经理,2012年9月20日至2015年5月26日任广发双债添利债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日至2015年5月26日任广发集鑫债券型证券投资基金,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日至2015年4月29日任广发季季利债券基金的基金经理,2015年1月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理,2015年3月25日起任广发聚安混合基金的基金经理,2015年4月9日起任广发聚宝混合基金的基金经理,2015年6月1日起任广发聚康混合基金的基金经理。
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发钱袋子货币市场基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发聚泰混合基金的基金经理	2013-10-22	-	7年	女,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员,2012年12月12日起任广发纯债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10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年5月30日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理,2015年6月8日起任广发聚泰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 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、《广发天天红发起式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

本报告期内经济复苏动能偏弱,促使货币政策持续宽松;虽然中央公布了多个重大投资项目,但从基建增速下滑来看,财政政策尚未发力。大类资产方面,债券收益率陡峭化下行,股票市场在持续上涨后经历了大幅回调,而房地产市场整体回暖。

4月份一次性下调1个百分点的准备金率后,资金面大幅宽松;同时,打新资金在2季度随着大盘新股的发行而大幅扩张,为货币市场提供了充足资金,带动短端资金利率大幅下降。受到银行投资端收益率下行的影响,银行主动控制了负债端的成本,银行定存利率也出现了显著下行。

基于货币市场利率持续下行的判断,本基金继续维持中性偏高的债券比例,尽可能维持较高的剩余期限,并根据新股缴款的节奏,合理安排短期资产的到期分布,防范新股缴款而带来的流动性冲击。

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1.108%,同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度以来,尽管采取了多项宽松措施,但实体经济需求仍然偏弱,工业增加值以及固定资产投资增速均趋于下行,尤其是基建等政府投资项目,实际推动的效果不强。我们看到,地方政府的债务置换计划已经于2季度启动,预计中央政府层面也会启动更为积极的财政政策对冲偏弱的民间投资,所以,我们认为政府投资会在3季度有所恢复。货币政策仍将延续宽松,一方面是受制于经济增速下滑以及通胀低位的宏观环境,另一方面,近期资本市场的大幅震荡已经影响到了金融体系的稳定,货币政策难以趋紧。

IPO的暂停以及权益类市场的大幅调整会将原先的资金分流到以货币基金为主的固定收益类基金,因此,短期内的资金面预计仍会相对宽裕。

本基金将继续维持中性偏高的债券比例和相对偏长的剩余期限,在资产的到期分布方面会相对分散。

§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	8,772,633,343.71	40.53
	其中:债券	8,772,633,343.71	40.53
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	6,347,498,988.08	29.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	1,180,494,277.59	5.45
3	银行存款和结算备付金合计	6,348,021,085.38	29.33
4	其他各项资产	174,052,445.56	0.80
5	合计	21,642,205,862.73	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	12.43	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,211,598,596.10	5.93
	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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	96

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	45.57	5.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	7.81	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	13.48	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	15.72	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	22.54	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	105.13	5.93

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	公允价值(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	1,052,499,418.47	5.15
	其中:政策性金融债	1,052,499,418.47	5.15
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	7,720,133,925.24	37.81
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	8,772,633,343.71	42.96
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	140443	14农发43	2,900,000.00	290,385,809.35	1.42
2	140223	14国开23	2,600,000.00	260,959,770.99	1.28
3	120239	12国开39	2,000,000.00	200,637,760.44	0.98
4	011502001	15铁道SCP001	2,000,000.00	199,937,829.80	0.98
5	011537003	15中建材SCP003	1,300,000.00	130,760,014.52	0.64
6	011508002	15华能集SCP002	1,200,000.00	119,951,656.05	0.59
7	011510003	15中电投SCP003	1,200,000.00	119,863,069.43	0.59
8	041556022	15电网CP002	1,200,000.00	119,790,718.89	0.59
9	041462042	14鲁宏桥CP002	1,000,000.00	100,198,363.62	0.49
10	011589001	15鞍钢股SCP001	1,000,000.00	100,004,936.74	0.49

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	46次
报告期内偏离度的最高值	0.4304%
报告期内偏离度的最低值	0.0817%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2918%

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	174,052,445.56
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	174,052,445.56

§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	16,953,755,842.85
本报告期基金总申购份额	29,004,090,955.88
本报告期基金总赎回份额	25,537,706,795.97
报告期期末基金份额总额	20,420,140,002.76

§7 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	申购	2015-04-03	50,000,000.00	50,000,000.00	–
2	申购	2015-04-17	50,000,000.00	50,000,000.00	–
3	赎回	2015-04-23	-20,000,000.00	-20,000,000.00	–
4	申购	2015-04-28	20,000,000.00	20,000,000.00	–
5	赎回	2015-04-30	-30,000,000.00	-30,000,000.00	–
6	分红再投	2015-04-30	481,100.07	481,100.07	–
7	申购	2015-05-07	20,000,000.00	20,000,000.00	–
8	申购	2015-05-12	90,000,000.00	90,000,000.00	–
9	申购	2015-05-22	50,000,000.00	50,000,000.00	–
10	赎回	2015-05-26	-90,000,000.00	-90,000,000.00	–
11	申购	2015-05-28	60,000,000.00	60,000,000.00	–
12	分红再投	2015-05-31	780,058.26	780,058.26	–
13	赎回	2015-06-02	-20,000,000.00	-20,000,000.00	–
14	申购	2015-06-05	130,000,000.00	130,000,000.00	–
15	赎回	2015-06-10	-25,000,000.00	-25,000,000.00	–
16	申购	2015-06-12	20,000,000.00	20,000,000.00	–
17	申购	2015-06-17	35,000,000.00	35,000,000.00	–
18	申购	2015-06-25	50,000,000.00	50,000,000.00	–
19	申购	2015-06-26	50,000,000.00	50,000,000.00	–
20	赎回	2015-06-29	-40,000,000.00	-40,000,000.00	–
21	赎回	2015-06-30	-20,000,000.00	-20,000,000.00	–
22	分红再投	2015-06-30	1,496,362.16	1,496,362.16	–
合计			382,757,520.49	382,757,520.49	

§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	454,070,268.40	2.22%	10,000,800.00	0.05%	三年
基金管理人高级管理人员	4.40	0.00%	–	–	–
基金经理等人员	75,630.17	0.00%	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	454,145,902.97	2.22%	10,000,800.00	0.05%	三年

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发天天红发起式货币市场基金募集的文件;
2.《广发天天红发起式货币市场基金合同》;
3.《广发天天红发起式货币市场基金托管协议》;
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.《广发天天红发起式货币市场基金招募说明书》及其更新版;
6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;
7.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。

广发基金管理有限公司
二〇一五年七月二十一日

广发天天利货币市场基金

2015 第二季度 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	广发天天利货币		
基金主代码	000475		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年1月27日		
报告期末基金份额总额	410,813,285.19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人民币活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,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	中国银行股份有限公司		
下属三级基金的基金简称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E
下属三级基金的交易代码	000475	000476	001134
报告期末下属三级基金的份额总额	390,530,254.73份	20,216,491.02份	66,539.44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(2015年4月1日-2015年6月30日)		
	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E
1.本期已实现收益	2,633,311.09	198,121.14	252.71
2.本期利润	2,633,311.09	198,121.14	252.71
3.期末基金资产净值	390,530,254.73	20,216,491.02	66,539.44

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、广发天天利货币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	1.0039%	0.0140%	0.0873%	0.0000%	0.9166%	0.0140%

2、广发天天利货币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	1.0644%	0.0140%	0.0873%	0.0000%	0.9771%	0.0140%

3、广发天天利货币E:

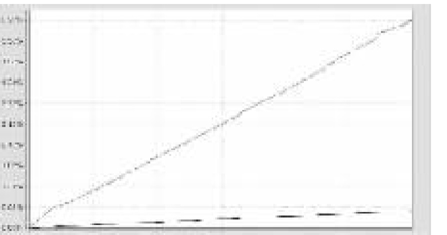
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0021%	0.0140%	0.0873%	0.0000%	0.9148%	0.0140%

注:本基金收益分配按月结转份额。

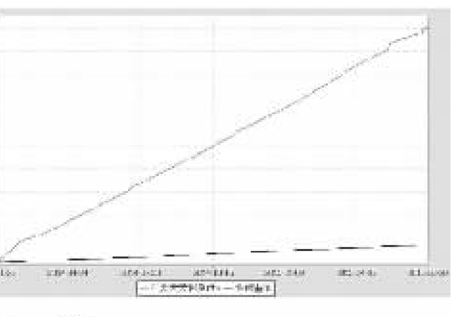
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

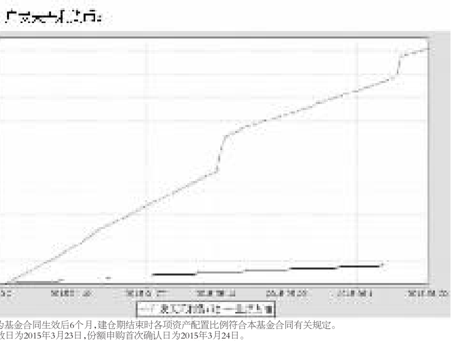
广发天天利货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年1月27日至2015年6月30日)

1、广发天天利货币A



2、广发天天利货币B





注:(1)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。
(2)本基金E类合同生效日为2015年3月23日,份额申购首次确认日为2015年3月24日。

§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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发钱袋子货币基金的基金经理;广发集鑫债券基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发聚康混合基金的基金经理	2014-01-27	–	7年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员,2012年7月19日起任广发理财年年红债券基金的基金经理,2012年9月20日至2015年5月26日任广发双债添利债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日至2015年5月26日任广发集鑫债券型证券投资基金,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日至2015年4月29日任广发季季利债券基金的基金经理,2015年1月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理,2015年3月25日起任广发聚安混合基金的基金经理,2015年4月9日起任广发聚宝混合基金的基金经理,2015年6月1日起任广发聚康混合基金的基金经理。
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发钱袋子货币市场基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发聚泰混合基金的基金经理	2014-01-27	–	7年	女,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员,2012年12月12日起任广发纯债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10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年5月30日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理,2015年6月8日起任广发聚泰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 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、《广发天天利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

2015年2季度,央行延续了宽松的货币政策,于5月11日和6月28日分别降息25基点,并于4月20日大幅下调存款准备金率1%。公开市场操作方面,央行更是逐步引导7天逆回购利率下行105BP,收益率从3.55%逐级下调至2.5%。货币市场资金整体较为宽松,虽然期间仍面临IPO和半年末的影响,但整体市场收益率仍是大幅下行的态势。

报告期内,本基金在确保足够流动性的前提下,尽可能提高了组合的久期,赚取了一定的资本利得。对于存款和短期融资券,则采取收益择高配置的原则,兼顾收益和流动性风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发天天利A净值增长率为1.0039%,广发天天利B净值增长率为1.0644%,广发天天利E净值增长率为1.0021%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年2季度央行延续了宽松的货币政策,4月份大幅降准1%,5月份和6月份分别降息25BP,公开市场操作方面也将7天逆回购利率大幅下调105BP至2.5%。经济基本面继续疲弱,但股市取得了较大幅度的涨幅。股市的赚钱效应以及IPO发行提速对货币市场资金造成一定的分流,而六月开始股市的调整使得这个过程发生了逆转。

展望三季度,预计货币政策仍会延续宽松态势。股市调整以及IPO暂停使得较多增量资金进入债券和货币市场,初期会导致收益率快速下行,但要关注股市企稳以及IPO可能重启以后引发的回流冲击影响。从基本面来看,三季度预计财政政策继续发力,稳增张是否会导致资金流出货币市场、信用扩张能否再增长仍是持续关注的重点。我们将继续在保证合理流动性的前提下,综合运用货币市场工具安排到期现金流,在合规的基础上进行组合管理,争取为投资者获得稳健的投资回报。

§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	235,160,551.19	52.83
	其中:债券	235,160,551.19	52.83
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	85,000,447.50	19.10
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	63,582,367.51	14.29
4	其他资产	61,348,807.82	13.78
5	合计	445,092,174.02	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	7.63	
	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	33,861,663.07	8.24
	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。

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	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

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	33.73	8.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	17.04	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	26.80	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	10.95	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	4.89	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	93.41	8.24

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	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	235,160,551.19	57.24
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	071501008	15招商CP008	300,000.00	29,993,688.30	7.30
2	071546004	15国元证券CP004	300,000.00	29,992,582.12	7.30
3	140444	14农发44	200,000.00	20,014,536.74	4.87
4	071543003	15金元证券CP003	200,000.00	20,003,446.24	4.87
5	011537005	15中建材SCP005	200,000.00	19,999,919.05	4.87
6	071507002	15中信建投CP002	200,000.00	19,998,208.31	4.87
7	071524003	15东兴证券CP003	200,000.00	19,998,162.45	4.87
8	041458064	14鲁宏桥CP001	100,000.00	10,092,520.80	2.46
9	041559009	15云锡CP001	100,000.00	10,086,082.40	2.46
10	071521003	15渤海证券CP003	100,000.00	9,999,360.81	2.43

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	17次
报告期内偏离度的最高值	0.3786%
报告期内偏离度的最低值	0.0148%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1972%

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	2,370,475.84
4	应收申购款	58,978,331.98
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	61,348,807.82

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E
本报告期期初基金份额总额	405,788,550.93	30,306,602.50	5,105.04
本报告期基金总申购份额	754,503,919.92	62,230,550.35	87,369.55
本报告期基金总赎回份额	769,762,216.12	72,320,661.83	25,935.15
报告期期末基金份额总额	390,530,254.73	20,216,491.02	66,539.44

§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

一、中国证监会核准广发天天利货币市场基金募集的文件
二、《广发天天利货币市场基金基金合同》
三、《广发天天利货币市场基金托管协议》
四、《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
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
八、中国证监会要求的其他文件

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。

广发基金管理有限公司
二〇一五年七月二十一日

广发稳健增长开放式证券投资基金

2015 第二季度 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	广发稳健增长混合	
基金主代码	270002	
交易代码	270002(前端)	270012(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年7月26日	
报告期末基金份额总额	1,805,029,121.53份	
投资目标	在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增长。	
投资策略	1、资产配置策略 基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,以稳健投资的原则在股票、债券、现金之间进行资产配置。为降低投资风险,股票投资上限为65%,下限为30%。 2、股票投资策略 在股票投资上,运用优化成长投资方法投资于价格低于内在价值的股票。股票投资对象主要是大盘绩优企业和规模适中、管理良好、竞争优势明显、有望成长为行业领先企业的上市公司。 3、债券投资策略 在债券投资上,坚持稳健投资的原则,控制债券投资风险。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。	
业绩比较基准	65%*中信标普300指数收益+35%*中信标普国债指数收益	
风险收益特征	适度风险基础上的基金资产稳健增长。	
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	1,339,613,308.50
2.本期利润	741,564,856.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.3254
4.期末基金资产净值	3,708,730,838.67
5.期末基金份额净值	2.0547

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。

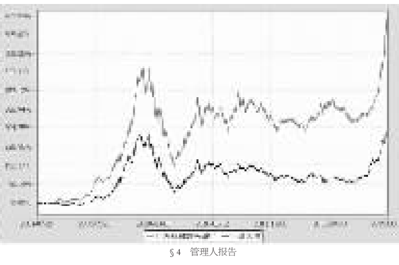
3.2 基金净值表现

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	14.12%	2.13%	7.96%	1.68%	6.16%	0.45%

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

广发稳健增长开放式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004年7月26日至2015年6月30日)



§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		
李琛	本基金的基金经理	2010-12-31	–	15年	女,中国籍,经济学学士,持有基金业执业资格证书,2000年7月至2002年8月任职于广发证券股份有限公司,2002年8月至2007年6月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部中央交易室主管,2007年6月13日至2010年12月30日任广发大盘成长混合基金的基金经理,2010年12月31日起任广发稳健增长混合基金的基金经理,2012年10月23日至2014年3月21日起任广发聚祥保本混合基金的基金经理。
傅友兴	本基金的基金经理;广发聚丰股票基金的基金经理	2014-12-08	–	13年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2002年2月至2006年3月先后任天同基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投委会秘书,2006年4月至2013年2月先后任广发基金管理有限公司研究员、基金经理助理、研究发展部副总经理、研究发展部总经理,2013年2月5日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2014年12月8日起任广发稳健增长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、《广发稳健增长开放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

二季度,经济运行仍旧疲弱,但政策刺激持续不断。股市方面,场外资金加速入场,导致4、5月份股指加速上涨;然而,进入6月中旬,股市掉头向下。二季度,沪深300指数涨10.41%,中证500涨22.79%,创业板指涨22.42%。分行业看,二季度军工、交运、轻工、机械等行业涨幅超过35%。

本基金在二季度加强组合结构调整力度,取得了较好收益;但进入6月下旬,伴随股指回调,基金净值回撤较大。

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14.12%,同期业绩比较基准收益率为7.96%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

"欢乐的时光总是短暂的,永远有一个错误在前方等着你。"4、5月的股指飙升,令市场开始欢呼一个伟大投资时代的来临;而6月中旬以后股指的深度调整,让我们见识了市场的冷酷与变幻莫测。由于杠杆、高企的估值、流动性冲击、救市扰动等多因素的交织,从某种角度而言,在未来的一个阶段,股市的走向更像是未知的领域。

在短期内,投资者的情绪才是最重要的。市场情绪从一个极端迈向另一个极端,会导致股价面临极大的不确定性;不过,经历恐慌之后,市场反而可能孕育转机。本基金将在仔细审视组合内持股公司价值的基础上,加强灵活性,持续地为持有人谋求基金净值的稳健增长。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,702,655,295.91	43.54
	其中:股票	1,702,655,295.91	43.54
2	固定收益投资	1,474,576,000.00	37.71
	其中:债券	1,474,576,000.00	37.71
	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	696,234,414.79	17.81
7	其他各项资产	36,788,062.52	0.94
8	合计	3,910,253,773.22	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	73,080,000.00	1.97
B	采矿业	24,750.00	0.00
C	制造业	1,183,222,773.45	31.90
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	138,100,000.00	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	46,332,000.00	1.25
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	257,189,070.16	6.93
J	金融业	–	–
K	房地产业	4,358,750.00	0.12
L	租赁和商务服务业	347,952.30	0.01
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	1,702,655,295.91	45.91

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	002632	道明光学	8,238,478	195,499,082.94	5.27
2	601311	骆驼股份	8,000,000	186,400,000.00	5.03
3	002152	广电运通	5,200,000	168,168,000.00	4.53
4	600037	歌华有线	4,800,000	151,200,000.00	4.08
5	600335	国机汽车	5,000,000	138,100,000.00	3.72
6	600750	江中药业	3,600,000	115,884,000.00	3.12
7	002250	联化科技	5,000,000	112,000,000.00	3.02
8	300036	超图软件	2,399,926	88,029,285.68	2.37
9	600973	宝胜股份	5,200,000	79,196,000.00	2.14
10	002299	圣农发展	3,600,000	73,080,000.00	1.97

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	公允价值(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	1,473,455,000.00	39.73
	其中:政策性金融债	1,473,455,000.00	39.73
4	企业债券	1,121,000.00	0.03
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	1,474,576,000.00	39.76

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150403	15农发03	1,700,000	171,037,000.00	4.61
2	140202	14国开02	1,500,000	159,600,000.00	4.30
3	150206	15国开06	1,500,000	151,380,000.00	4.08
4	140223	14国开23	1,500,000	150,600,000.00	4.06
5	150211	15国开11	1,500,000	150,525,000.00	4.06

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。

5.11.2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	1,739,454.77
2	应收证券清算款	1,114,386.20
3	应收股利	–
4	应收利息	30,809,925.07
5	应收申购款	3,124,296.48
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	36,788,062.52

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	002632	道明光学	195,499,082.94	5.27	重大事项
2	601311	骆驼股份	186,400,000.00	5.03	重大事项
3	600335	国机汽车	138,100,000.00	3.72	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	2,827,751,100.75
本报告期基金总申购份额	62,336,208.77
减:本报告期基金总赎回份额	1,085,058,187.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,805,029,121.53

§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稳健增长开放式证券投资基金募集的文件;
2.《广发稳健增长开放式证券投资基金基金合同》;
3.《广发稳健增长开放式证券投资基金托管协议》;
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.《广发稳健增长开放式证券投资基金招募说明书》及其更新版;
6.广发基金管理有限公司批准成立批件、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
二〇一五年七月二十一日