

广发沪深300指数证券投资基金

2015 第三季度报告

2015年9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:二〇一五年十月二十六日

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。投资有风险,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300指数
基金代码	270010
交易代码	270010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2008年12月20日
报告期末基金份额总额	756,205,800.60

投资目标
跟踪标的指数的涨跌,追求跟踪标的指数,实现商品指数化投资和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内。

投资策略
本基金为指数型基金,原则上采用完全复制策略,跟踪标的指数沪深300指数的基金份额净值增长率(扣除费用)与业绩比较基准收益率(扣除费用)之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内。

业绩比较基准
95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率

风险收益特征
本基金为被动型指数基金,具有较高风险,较高预期收益特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		2015年7月1日至2015年9月30日
1.本期已实现收益	66,590,171.15	
2.本期公允价值变动损益	-91,446,311.91	
3.本期利润	-24,856,140.76	
4.期末基金份额净值	1.063,622,616.07	
5.期末基金资产净值	1,407	

3.2 基金业绩指标

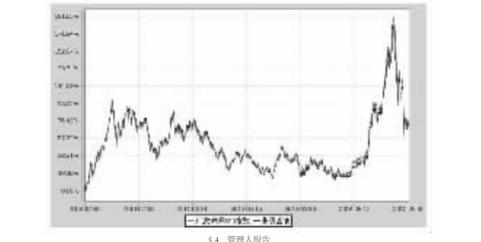
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率超额③	①-②	②-④	
过去三个月	-28.47%	3.45%	-26.96%	3.18%	-1.51%	0.27%

3.2.2 基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①沪深300指数净值增长率;②本基金净值增长率;③业绩比较基准收益率;④沪深300指数净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。



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
刘亮	基金经理	2014-04-01	11年	男,中国籍,工学学士,持有基金从业资格,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司担任研究员,2010年11月至2014年3月担任广发基金管理有限公司数量投资部基金经理助理,2014年3月至2014年11月担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)变更

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。
3、管理人对报告期内本基金基金经理变更情况的说明
4、增聘基金经理:本基金管理人增聘刘亮为广发沪深300指数的证券投资基金基金经理和其他有关法律法规规定,在符合法律法规的前提下,本基金管理人有权聘任或解聘基金经理,聘任或解聘基金经理应经公司董事会审议通过,并报中国证监会备案。刘亮自2014年4月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

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、系统的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控及及时的分析和评估,保证公平交易制度的有效执行。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金管理人坚持“稳健”投资策略,在严格控制风险的前提下,积极把握市场机会,力争实现基金资产的保值增值。

4.5 投资组合报告

4.5.1 报告期末基金资产组合情况

本报告期末基金资产总额	918,121,955.71
本报告基金总资产	830,933,699.12
减:本报告基金负债总额	92,510,444.37
本报告基金份额总额	756,205,800.60

4.5.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资情况

序号	交易方式	交易日期	交易金额(元)	交易费率
1	买入	2015-07-30	-116,759,989.76	-27.98%
2	卖出	2015-07-30	-116,759,989.76	-27.98%
合计			-116,759,989.76	-27.98%

注:报告期内基金投资的前十名证券中不存在流通受限情况。

4.6 投资组合报告

4.6.1 报告期末基金资产组合情况
4.6.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资情况
4.6.3 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

4.7 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.8 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.9 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.10 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.11 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.12 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.13 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.14 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.15 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.16 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

注:本基金本报告期基金资产组合中,建仓日期均与本报告披露日期一致。

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度报告

2015年9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:二〇一五年十月二十六日

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。投资有风险,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发集利一年定期开放债券
基金代码	000627
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日期	2015年8月20日
报告期末基金份额总额	1,773,726,521.21

投资目标
在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略
本基金主要投资于固定收益类金融工具,不直接从一级市场上购入股票,投资范围限于股票二级市场,但不参与一级市场上新股的申购和增发。本基金通过自上而下和自下而上的策略,选择具有良好增长潜力的股票,并综合考虑宏观经济、行业景气度、公司盈利能力和估值等因素,进行个股选择。本基金在严格控制风险的前提下,适度参与可转债投资,并在此基础上,采用稳健的资产配置策略,以期实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准
中证全债指数收益率+0.5%

风险收益特征
本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		2015年7月1日至2015年9月30日
1.本期已实现收益	118,533,800.41	
2.本期公允价值变动损益	13,849,470.01	
3.本期利润	132,383,270.42	
4.期末基金份额净值	1.069,766,345.05	
5.期末基金资产净值	372,240,714.91	

3.2 基金业绩指标

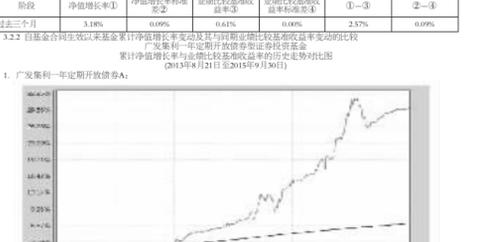
阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率超额③	①-②	②-④	
过去三个月	3.16%	0.09%	0.61%	0.00%	2.55%	0.09%

3.2.2 基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①本基金净值增长率;②业绩比较基准收益率;③业绩比较基准收益率与本基金净值增长率变动的比较

3.3 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。



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
刘亮	基金经理	2014-04-01	11年	男,中国籍,工学学士,持有基金从业资格,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司担任研究员,2010年11月至2014年3月担任广发基金管理有限公司数量投资部基金经理助理,2014年3月至2014年11月担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)变更

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。
3、管理人对报告期内本基金基金经理变更情况的说明
4、增聘基金经理:本基金管理人增聘刘亮为广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理和其他有关法律法规规定,在符合法律法规的前提下,本基金管理人有权聘任或解聘基金经理,聘任或解聘基金经理应经公司董事会审议通过,并报中国证监会备案。刘亮自2014年4月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

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、系统的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控及及时的分析和评估,保证公平交易制度的有效执行。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金管理人坚持“稳健”投资策略,在严格控制风险的前提下,积极把握市场机会,力争实现基金资产的保值增值。

4.5 投资组合报告

4.5.1 报告期末基金资产组合情况

本报告期末基金资产总额	918,121,955.71
本报告基金总资产	830,933,699.12
减:本报告基金负债总额	92,510,444.37
本报告基金份额总额	756,205,800.60

4.5.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资情况

序号	交易方式	交易日期	交易金额(元)	交易费率
1	买入	2015-07-30	-116,759,989.76	-27.98%
2	卖出	2015-07-30	-116,759,989.76	-27.98%
合计			-116,759,989.76	-27.98%

注:报告期内基金投资的前十名证券中不存在流通受限情况。

4.6 投资组合报告

4.6.1 报告期末基金资产组合情况
4.6.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资情况
4.6.3 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

4.7 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.8 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.9 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.10 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.11 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.12 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.13 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.14 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.15 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.16 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

注:本基金本报告期基金资产组合中,建仓日期均与本报告披露日期一致。

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:二〇一五年十月二十六日

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。投资有风险,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发集利一年定期开放债券
基金代码	000627
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日期	2015年8月20日
报告期末基金份额总额	1,773,726,521.21

投资目标
在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略
本基金主要投资于固定收益类金融工具,不直接从一级市场上购入股票,投资范围限于股票二级市场,但不参与一级市场上新股的申购和增发。本基金通过自上而下和自下而上的策略,选择具有良好增长潜力的股票,并综合考虑宏观经济、行业景气度、公司盈利能力和估值等因素,进行个股选择。本基金在严格控制风险的前提下,适度参与可转债投资,并在此基础上,采用稳健的资产配置策略,以期实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准
中证全债指数收益率+0.5%

风险收益特征
本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		2015年7月1日至2015年9月30日
1.本期已实现收益	118,533,800.41	
2.本期公允价值变动损益	13,849,470.01	
3.本期利润	132,383,270.42	
4.期末基金份额净值	1.069,766,345.05	
5.期末基金资产净值	372,240,714.91	

3.2 基金业绩指标

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率超额③	①-②	②-④	
过去三个月	3.16%	0.09%	0.61%	0.00%	2.55%	0.09%

3.2.2 基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①本基金净值增长率;②业绩比较基准收益率;③业绩比较基准收益率与本基金净值增长率变动的比较

3.3 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。



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
刘亮	基金经理	2014-04-01	11年	男,中国籍,工学学士,持有基金从业资格,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司担任研究员,2010年11月至2014年3月担任广发基金管理有限公司数量投资部基金经理助理,2014年3月至2014年11月担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)变更

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。
3、管理人对报告期内本基金基金经理变更情况的说明
4、增聘基金经理:本基金管理人增聘刘亮为广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理和其他有关法律法规规定,在符合法律法规的前提下,本基金管理人有权聘任或解聘基金经理,聘任或解聘基金经理应经公司董事会审议通过,并报中国证监会备案。刘亮自2014年4月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

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、系统的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控及及时的分析和评估,保证公平交易制度的有效执行。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金管理人坚持“稳健”投资策略,在严格控制风险的前提下,积极把握市场机会,力争实现基金资产的保值增值。

4.5 投资组合报告

4.5.1 报告期末基金资产组合情况

本报告期末基金资产总额	918,121,955.71
本报告基金总资产	830,933,699.12
减:本报告基金负债总额	92,510,444.37
本报告基金份额总额	756,205,800.60

4.5.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资情况

序号	交易方式	交易日期	交易金额(元)	交易费率
1	买入	2015-07-30	-116,759,989.76	-27.98%
2	卖出	2015-07-30	-116,759,989.76	-27.98%
合计			-116,759,989.76	-27.98%

注:报告期内基金投资的前十名证券中不存在流通受限情况。

4.6 投资组合报告

4.6.1 报告期末基金资产组合情况
4.6.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资情况
4.6.3 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

4.7 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.8 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.9 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.10 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.11 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.12 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.13 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.14 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.15 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

4.16 基金管理人运用基金资产进行股指期货投资情况

报告期内,本基金管理人未运用基金资产进行股指期货投资。

注:本基金本报告期基金资产组合中,建仓日期均与本报告披露日期一致。

广发活期宝货币市场基金

2015 第三季度报告

2015年9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:二〇一五年十月二十六日

1.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。投资有风险,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	广发活期宝
基金代码	000748
交易代码	000748
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年4月20日
报告期末基金份额总额	239,601,205.20

投资目标
在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的保值增值。

投资策略
本基金主要投资于货币市场工具,在严格控制风险的前提下,积极把握市场机会,力争实现基金资产的保值增值。

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,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

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		2015年7月1日至2015年9月30日
1.本期已实现收益	2,315,429.88	
2.本期公允价值变动损益	2,315,429.88	
3.本期利润	4,630,859.76	
4.期末基金份额净值	239,601,205.20	

3.2 基金业绩指标

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率超额③	①-②	②-④	
过去三个月	0.9133%	0.0109%	0.8964%	0.0000%	0.9019%	0.0109%

3.2.2 基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①本基金净值增长率;②业绩比较基准收益率;③业绩比较基准收益率与本基金净值增长率变动的比较



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
刘亮	基金经理	2014-04-20	7年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金从业资格,2008年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司担任研究员,2010年11月至2014年3月担任广发基金管理有限公司数量投资部基金经理助理,2014年3月至2014年11月担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)变更

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。
3、管理人对报告期内本基金基金经理变更情况的说明
4、增聘基金经理:本基金管理人增聘刘亮为广发活期宝货币市场基金基金经理和其他有关法律法规规定,在符合法律法规的前提下,本基金管理人有权聘任或解聘基金经理,聘任或解聘基金经理应经公司董事会审议通过,并报中国证监会备案。刘亮自2014年4月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理,2014年11月1日起担任广发沪深300ETF基金基金经理。