广发天天利货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§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2016年1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10月1日起至12月31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	291,137,369.28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	256,364,991.25份	27,424,803.57份	7,347,574.46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10月1日-2015年12月31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	2,212,818.90	272,461.90	73,859.31
2.本期利润	2,212,818.90	272,461.90	73,859.31
3.期末基金资产净值	256,364,991.25	27,424,803.57	7,347,574.46

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	0.6910%	0.0035%	0.0882%	0.0000%	0.6028%	0.0035%

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	0.7521%	0.0035%	0.0882%	0.0000%	0.6639%	0.0035%

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	0.6919%	0.0035%	0.0882%	0.0000%	0.6037%	0.0035%

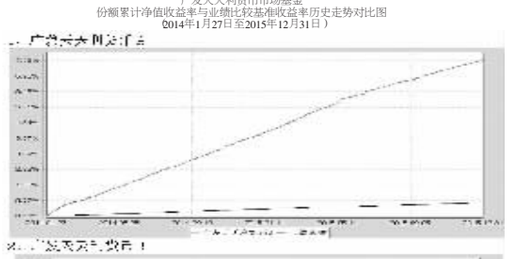
注:本基金收益分配按日结转份额。

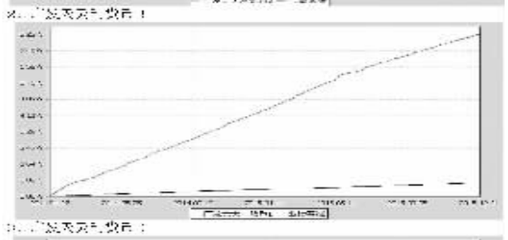
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

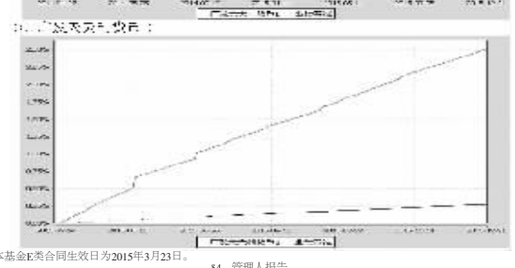
广发天天利货币市场基金

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12月31日)







注:本基金E类合同生效日为2015年3月23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		
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;广发找钱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,持有中国证券投资基金从业证书,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23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日起任广发找钱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年四季度,央行延续了宽松的货币政策,降准、降息、下调公开市场利率、增加MLF操作并降低其利率等手段综合使用,货币市场收益率波动有限,IPO重启也并未造成较大影响,债券收益率继续大幅下行。

展望2016年1季度,基本面方面分歧不大,国内经济仍处于转型中,供给侧改革、去过剩产能、去杠杆成为下一阶段的主旋律,财政政策仍需发力,政府赤子提升,地方债继续置换,因此货币政策也需保持合理宽松。外汇市场是重要的关注点,从近期汇市表现来看,央行开年已经在陆续引导人民币贬值,未来资本外流能否造成内部流动性紧缩尚需关注。

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	189,102,861.79	60.23
	其中:债券	189,102,861.79	60.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	30,454,136.17	9.70
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	20,454,001.17	6.52
3	银行存款和结算备付金合计	90,133,245.55	28.71
4	其他资产	4,254,008.80	1.36
5	合计	313,944,252.31	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	11.51
	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	22,343,868.83	7.67
	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	106
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	50

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	17.38	7.67
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	44.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	41.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	3.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.37	7.67

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	19,984,952.76	6.86
	其中:政策性金融债	19,984,952.76	6.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,964,246.80	30.90
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,153,662.23	27.19
8	其他	-	-
9	合计	189,102,861.79	64.95
10	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	111519052	15恒丰银行CD052	300,000.00	29,769,481.50	10.23
2	071548002	15国开证券CP002	200,000.00	19,999,124.13	6.87
3	071539001	15上海证券CP001	200,000.00	19,997,017.36	6.87
4	011574005	15民媒化SCP005	200,000.00	19,990,259.57	6.87
5	150311	15进出11	200,000.00	19,984,952.76	6.86
6	011599540	15阳泉SCP003	200,000.00	19,979,579.85	6.86
7	111517166	15无大CD166	200,000.00	19,850,306.01	6.82
8	111591783	15宁波银行CD104	200,000.00	19,849,374.98	6.82
9	071540007	15东吴证券CP007	100,000.00	9,998,265.89	3.43
10	111593032	15临京银行CD077	100,000.00	9,684,499.74	3.33

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1478%
报告期内偏离度的最低值	0.0313%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0799%

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报告期内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	4,254,008.80
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,254,008.80

§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	360,772,739.14	55,461,642.14	877,444.62
本报告期基金总申购份额	310,095,082.14	63,808,723.67	47,188,501.12
本报告期基金总赎回份额	414,502,830.03	91,845,562.24	40,718,371.28
报告期末基金份额总额	256,364,991.25	27,424,803.57	7,347,574.46

§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 影响投资者决策的其他重要信息

为了能够更好满足更多投资者的理财需求、更好地服务投资者,按照《广发天天红发起式货币市场基金基金合同》的相关规定,基金管理人决定于2015年12月15日对本基金增设B类基金份额(基金代码为:002183),并自该日起接受投资者对B类基金份额的申购,经与基金托管人广发银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,本公司对原基金合同中有关基金份额类别设置、销售服务费等内容进行相应修改。同时,基金管理人还对《广发天天红发起式货币市场基金托管协议》和《广发天天红发起式货币市场基金招募说明书》中相关条款进行了修改。

详情可见本基金管理人于2015年12月11日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司官方网站发布的《关于广发天天红发起式货币市场基金增加基金份额类别并修改基金合同的公告》。

§9备查文件目录

9.1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

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。

广发基金管理有限公司
二〇一六年一月二十日

广发稳健增长开放式证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1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10月1日起至12月31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	1,582,930,461.43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	沪深300指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%	
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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	135,231,505.30
2.本期利润	306,092,335.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.1889
4.期末基金资产净值	3,376,140,158.91
5.期末基金份额净值	2.1328

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	9.57%	0.90%	10.76%	1.07%	-1.19%	-0.17%

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12月31日)

注:自2015年11月2日起,本基金的业绩比较基准由原"中信标普300指数收益率×65%+中信标普国债指数收益率×35%"变更为"沪深300指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%"。

§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		
李探	本基金的基金经理	2010-12-31	-	15年	女,中国籍,经济学学士,持有中国证券投资基金从业证书,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;广发聚丰混合基金的基金经理	2014-12-08	-	13年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金从业证书,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、研究发展部副经理,研发发展部副总经理,2013年2月5日起任广发聚丰混合基金的基金经理,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

在三季度报告的投资展望中,本基金认为,"2015年四季度股市的投资环境变得相对有利,……股市的整体估值明显下降,部分股票逐步走入价值投资区间。"然而,市场的实际走势比之前预判的更为强劲。四季度,沪深300指数涨16.49%,中证500涨24.4%,创业板指涨30.32%。分行业看,四季度计算机、房地产、基础化工、通信等行业涨幅超过45%,钢铁、银行、交运等行业涨幅较小。

正所谓知易行难。本基金曾计划在四季度"以更乐观的视角研判市场,加强选股和操作灵活性,更积极的投资"。然而面对教育、体育、云计算、车联网等各种主题的快速轮动,本基金的投资操作表现得不尽如人意。四季度,基金净值的表现低于自己的预期。

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9.57%,同期业绩比较基准收益率为10.76%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在2016年的起点,经历去年4季度股市的大幅反弹,A股估值层面的吸引力大幅下降。本基金预计,一季度宏观经济将保持低位运行,上市公司的盈利层面仍难有起色。大小非减持解禁以及新股发行将加大市场供应压力。此外,近期信用利差持续上行,是一个值得密切关注的宏观信号。本基金认为,进入2016年,面对高企的估值与金融市场可能的复杂变化,投资会面对更多的困难与挑战。本基金将以审慎的态度,尽力保持追求收益与控制风险的平衡,以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	1,486,706,332.06	40.67
	其中:股票	1,486,706,332.06	40.67
2	固定收益投资	1,535,756,000.00	42.01
	其中:债券	1,535,756,000.00	42.01
	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	200,000,000.00	5.47
	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	393,588,803.46	10.77
7	其他各项资产	39,383,367.68	1.08
8	合计	3,655,434,503.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	39,582,000.00	1.17
B	采矿业	198,556,422.06	5.88
C	制造业	1,037,987,624.92	30.74
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	95,022,152.76	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,798,132.32	0.59
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	95,760,000.00	2.84
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	1,486,706,332.06	44.04

5.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	600398	海澜之家	11,893,902	166,038,871.92	4.92
2	000876	新希望	7,599,983	133,835,700.63	3.96
3	600867	通化东宝	4,298,198	116,782,039.66	3.46
4	300008	上海佳豪	3,600,000	95,760,000.00	2.84
5	600511	国药股份	2,499,996	94,799,848.32	2.81
6	002394	联发股份	4,199,859	78,243,373.17	2.32
7	600987	航民股份	5,899,985	77,407,803.20	2.29
8	600066	宇通客车	2,800,000	62,972,000.00	1.87
9	002604	龙力生物	4,200,000	62,160,000.00	1.84
10	000418	小天鹅A	2,500,000	60,000,000.00	1.78

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	1,535,756,000.00	45.49
	其中:政策性金融债	1,535,756,000.00	45.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,535,756,000.00	45.49

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	150416	15农发16	2,800,000	280,644,000.00	8.31
2	150211	15国开11	1,700,000	170,493,000.00	5.05
2	150411	15农发11	1,700,000	170,493,000.00	5.05
3	140202	14国开02	1,500,000	162,600,000.00	4.82
4	150206	15国开06	1,500,000	150,645,000.00	4.46
5	150311	15进出11	1,500,000	150,150,000.00	4.45

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	2,359,722.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,394,894.87
5	应收申购款	628,750.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,383,367.68

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	000876	新希望	133,835,700.63	3.96	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	1,650,360,234.62
本报告期基金总申购份额	30,894,835.53
减:本报告期基金总赎回份额	98,324,608.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,582,930,461.43

§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影响投资者决策的其他重要信息

广发基金管理有限公司根据《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》、《广发稳健增长开放式证券投资基金基金合同》的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定将业绩比较基准进行调整,并相应修改有关基金合同的相关内容。

详情可见本基金管理人于2015年11月2日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司官方网站发布的《关于广发聚富开放式证券投资基金和广发稳健增长开放式证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

§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。

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
二〇一六年一月二十日

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|---