广发核心精选混合型证券投资基金

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	广发核心精选混合
基金主代码	270008
交易代码	270008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月16日
报告期末基金份额总额	823,762,072.10份
投资目标	通过认真、细致的宏观研究、合理配置股票、债券、现金等资产,应用“核心—卫星”投资策略,投资于具有较高投价价值的股票;在利率合理预期的基础上,进行久期管理,稳健地投资于债券市场,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用“核心—卫星”的投资策略,在沪深300指数成分股及其备选成分股中精选成长性较强、质地优良、投资价值高的股票构成“核心股票”,本基金将较长时间的持有核心股票,直到该股票市场价格超过合理价值。一般情况下,本基金持有的“核心股票”的市值不低于本基金股票市值的80%。
业绩比较基准	80%*沪深300指数+20%*上证国债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,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	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	255,323,439.74
2.本期利润	363,115,110.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.6955
4.期末基金资产净值	1,660,821,623.06
5.期末基金份额净值	3.171

注:(1)所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。

(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

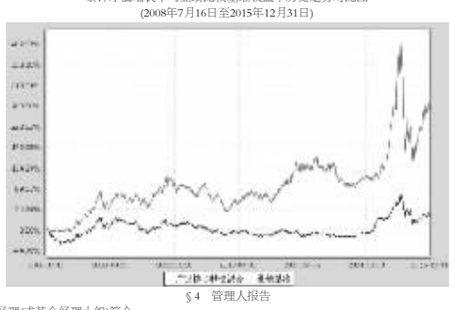
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.97%	2.17%	13.57%	1.34%	14.40%	0.83%

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

广发核心精选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

(2008年7月16日至2015年12月31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		
吴兴武	本基金的基金经理;广发轮动配置混合基金的基金经理	2015-02-17	-	6年	男,中国籍,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,自2009年7月至2010年7月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任职,从事上市公司及行业研究工作,2010年7月20日至2015年2月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和权益投资一部任研究员,2015年2月12日起任广发轮动配置混合基金的基金经理,2015年2月17日起任广发核心精选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、《广发核心精选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

报告期内市场总体呈现平稳上涨走势。上证指数、沪深300、创业板指分别上涨15.93%、16.49%、30.32%。本基金三季度上涨27.97%。

本季度市场上涨的原因:首先是一部分股票在股灾期间已经跌到长期价值区间,有一定修复动力;其次是流动性仍然较为宽裕,所谓“资产荒”的逻辑在上涨过程中得到了强化。从市场风格来看,以高弹性成长股为主线的主题投资仍然相对活跃,虚拟现实、粉丝经济、IP娱乐、云计算等板块涨幅相对靠前,显示市场阶段性的风险偏好仍然较高,延续了上半年的风格。

本基金仍然以投资成长股为主,但是在不同阶段结构有一定差异。在四季度初期持有较多的经典成长股,这类股票的特点是股价上涨主要依靠业绩增长驱动,估值弹性不如高弹性成长股。后期考虑到市场的风险偏好提升,逐渐增加了高弹性成长股的配置。但是总体持仓相对均衡,组合弹性不是很大,走势虽然好于业绩比较基准,但是相比指数中涨幅最好的创业板指数略差。

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27.97%,同期业绩比较基准收益率为13.57%。

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2016年,利率水平已经处于相对低位,货币资产并非首选,债券的收益率也会收窄,权益类资产的投资机会仍然值得重视。

逻辑上来讲,国内经济下行、美元加息周期、汇率风险对权益类资产不利。但是经济下行是常态,多年来的市场表现证明其对价值股偏压制、对成长股则不构成负面影响。后两个问题今年较为突出,加大了市场的复杂程度,具体表现形式很可能是引发市场波动幅度较大。但是总体来看,由于实体经济投资回报持续下降,“资产荒”还会持续,在此背景下,弹性成长股和主题投资仍会阶段性活跃,价值股可能会有跌出来的机会。

我们同时认为,过去几年A股投资者持续热衷于高风险偏好标的,这一现状不会一直持续下去。目前我们难以判断这种风险偏好的变化是否在2016年发生,但是注册制的逐步推出,对此会有较为深远的影响,我们会在2016年持续观察风险偏好是否迎来变化拐点。

§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	1,193,336,161.68	71.13
	其中:股票	1,193,336,161.68	71.13
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	463,640,453.75	27.64
7	其他各项资产	20,727,821.87	1.24
8	合计	1,677,704,437.30	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	525,761,272.55	31.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,162,715.70	0.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	165,096,010.60	9.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,649,547.78	14.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	78,689,740.80	4.74
L	租赁和商务服务业	43,637,709.69	2.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	42,223,042.53	2.54
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	90,116,122.03	5.43
S	综合	-	-
	合计	1,193,336,161.68	71.85

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	600303	曙光股份	6,572,153	100,882,548.55	6.07
2	002456	欧菲光	2,782,208	86,304,092.16	5.20
3	002450	康得新	2,156,747	82,172,060.70	4.95
4	002241	歌尔声学	2,356,667	81,540,678.20	4.91
5	600340	华夏幸福	2,561,515	78,689,740.80	4.74
6	600718	东软集团	2,325,700	72,212,985.00	4.35
7	600029	南方航空	7,796,900	66,819,433.00	4.02
8	600115	东方航空	8,574,900	65,254,989.00	3.93
9	600804	鹏博士	2,496,187	59,209,555.64	3.57
10	300251	光线传媒	1,614,597	48,906,143.13	2.94

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	1,917,335.78
2	应收证券清算款	16,956,599.12
3	应收股利	-
4	应收利息	68,008.27
5	应收申购款	1,785,878.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,727,821.87

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§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	524,757,717.57
本报告期基金总申购份额	73,869,084.14
减:本报告期基金总赎回份额	74,864,729.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	523,762,072.10

§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	31,052,690.71
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	31,052,690.71
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.93

7.2 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核心精选混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发核心精选混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发核心精选混合型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.《广发核心精选混合型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
二〇一六年一月二十日

广发沪深300指数证券投资基金

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	广发沪深300指数
基金主代码	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	2008年12月30日
报告期末基金份额总额	727,677,374.64份
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,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 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	15,753,058.07
2.本期利润	178,498,427.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2424
4.期末基金资产净值	1,196,121,913.60
5.期末基金份额净值	1.644

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

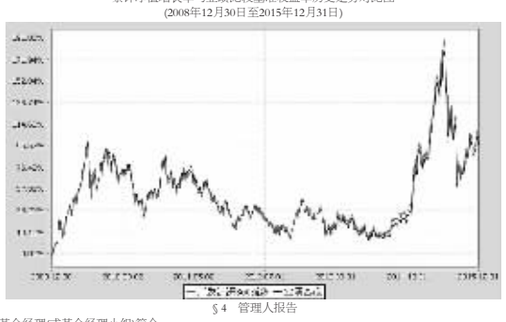
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.84%	1.65%	15.67%	1.59%	1.17%	0.06%

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

广发沪深300指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年12月30日至2015年12月31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		
刘杰	本基金的基金经理;广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理;广发沪深300ETF基金的基金经理	2014-04-01	-	11年	男,中国籍,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司信息技术部工作,2010年11月至2014年3月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员,2014年4月1日起任广发沪深300指数、广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理,2015年8月19日起任广发沪深300ETF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、《广发沪深300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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他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

(1)投资策略

作为指数基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

(2)运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.10%,符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素,本基金目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

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16.84%,同期业绩比较基准收益率为15.67%,较好地跟踪了指数。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度赦市以来,A股市场信心得到了恢复,4季度整体市场保持了震荡向上的走势。四季度,沪深300上涨了16.49%,中证500上涨了24.40%,创业板上涨30.32%,市场风险偏好得到提升。

随着12月美国加息、人民币贬值、注册制改革预期、供给侧改革和大股东减持限制到期等众多因素的叠加,12月末1月初市场风险偏好明显降低。展望未来,中国经济中长期看好,但短期依然处于调结构稳增长的痛苦阶段,A股市场可能呈现震荡行情,风险与投资机会并存。

结合风险和机会,我们认为目前估值仅11倍左右且处于历史底部的沪深300指数,是个兼顾风险和收益的良好投资标的,沪深300的大盘蓝筹覆盖面相对于与上证50、上证180要大,代表性要好,风险相对于创业板等高估值板块要小,因此对于部分投资者而言,风险相对较小的沪深300指数基金是个不错的享受行情反弹的品种。

§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	1,119,061,229.63	92.56
	其中:股票	1,119,061,229.63	92.56
2	固定收益投资	128,100.00	0.01
	其中:债券	128,100.00	0.01
	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	-	-
	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	87,165,071.52	7.21
7	其他各项资产	2,669,614.12	0.22
8	合计	1,209,024,015.27	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	1,019,435.76	0.09
B	采矿业	38,442,690.33	3.21
C	制造业	362,170,345.12	30.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,405,698.16	3.80
E	建筑业	42,897,048.39	3.59
F	批发和零售业	23,067,691.49	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	42,876,871.85	3.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,525,894.21	5.73
J	金融业	387,406,885.12	32.39
K	房地产业	58,609,782.92	4.90
L	租赁和商务服务业	11,457,028.61	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,692,253.49	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,424,258.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	19,860,555.53	1.66
S	综合	6,204,790.65	0.52
	合计	1,119,061,229.63	93.56

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	601318	中国平安	1,239,170	44,610,120.00	3.73
2	600016	民生银行	3,380,150	32,584,646.00	2.72
3	600036	招商银行	1,466,720	26,386,292.80	2.21
4	601166	兴业银行	1,513,901	25,842,290.07	2.16
5	000002	万 科A	872,900	21,324,947.00	1.78
6	601328	交通银行	3,229,565	20,798,398.60	1.74
7	600837	海通证券	1,291,644	20,433,808.08	1.71
8	600030	中信证券	999,206	19,334,636.10	1.62
9	600000	浦发银行	1,052,376	19,226,909.52	1.61
10	601288	农业银行	4,246,096	13,714,890.08	1.15

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	128,100.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	128,100.00	0.01

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	123001	蓝标转债	1,281	128,100.00	0.01

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	411,308.39
2	应收证券清算款	1,425,086.97
3	应收股利	-
4	应收利息	15,801.22
5	应收申购款	817,417.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,669,614.12

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	000002	万 科A	21,324,947.00	1.78	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	756,205,800.46
本报告期基金总申购份额	260,346,016.89
减:本报告期基金总赎回份额	288,874,442.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	727,677,374.64

§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沪深300指数证券投资基金募集的文件;

2.《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》;

3.《广发沪深300指数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.《广发沪深300指数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
二〇一六年一月二十日

广发活期宝货币市场基金

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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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
报告期末基金份额总额	265,763,381.17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,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	兴业银行股份有限公司

§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	1,994,475.55
2.本期利润	1,994,475.55
3.期末基金资产净值	265,763,381.17

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	0.8062%	0.0070%	0.0894%	0.0000%	0.7168%	0.0070%

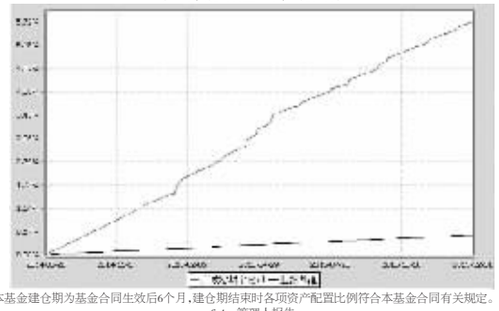
注:本基金收益分配按日结转份额。

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

广发活期宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年8月28日至2015年12月31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		
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