广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

【2015】第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

§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2015年4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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发现金宝场内货币		
基金主代码	519858		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年12月2日		
报告期末基金份额总额	207,779,103,635.00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: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	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	广发宝A	广发宝B	
下属分级基金的交易代码	519858	519859	
报告期末下属分级基金的份额总额	129,119,516,551.00份	78,659,587,084.00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1月1日-2015年3月31日)	
	广发宝A	广发宝B
1.本期已实现收益	12,775,578.38	8,089,318.05
2.本期利润	12,775,578.38	8,089,318.05
3.期末基金资产净值	1,291,195,165.51	786,595,870.84

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、广发宝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	1.1025%	0.0057%	0.0875%	0.0000%	1.0150%	0.0057%

2、广发宝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	1.2564%	0.0057%	0.0875%	0.0000%	1.1689%	0.0057%

注:本基金收益分配按日结转份额。

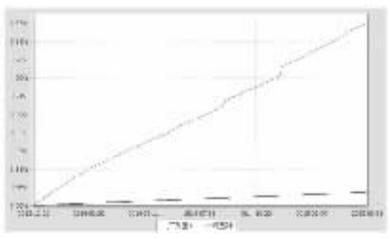
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

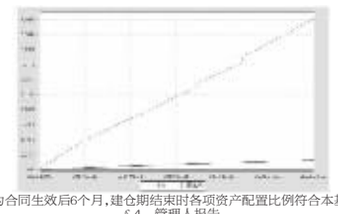
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年12月2日至2015年3月31日)

1、 广发宝A



2、 广发宝B



注:本基金建仓期为合同生效后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。

§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;广发活期宝货币基金的基金经理;固定收益部副总经理	2013-12-02	-	15年	女,中国籍,经济学学士,持有基金业执业证书,2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司江门营业部,2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部工作,2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作,2010年4月29日起任广发货币基金的基金经理,2013年1月14日起任广发理财30天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12月2日起任广发现金宝场内货币基金的基金经理,2014年3月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理。

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、《广发现金宝场内实时申赎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年货币政策逐渐转向偏宽松,央行在第一季度分别降准降息各一次,下调公开市场操作的7天逆回购利率30个基点,降到3.85%。央行的操作向市场注入流动性,增强投资者的信心,货币市场利率显著下降,7天回购利率从5%以上的高位下降至4%,一年AAA短期融资券利率也普遍下降50个基点。

报告期内我们增配收益率较高短期融资券,把握ipo时点做高收益的存款,提高组合收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发现金宝A类净值增长率为1.1025%,广发现金宝B类净值增长率为1.2564%,同期业绩比较基准收益率为0.0875%

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第一季度经济数据持续疲弱,2月份固定资产投资增长13.9%,增速进一步下跌;工业增加值增长6.8%,创09年以来新低;CPI增长1.4%,PPI连续6个月下跌,下跌4.8%。一系列的数据显示了国内经济可能陷入通缩,政府也表明对通缩的担忧,有效应付通缩的办法是增加需求,目前过高的社会融资成本压抑了需求,因此央行在一季度就降准降息,MLF加量,使用各种手段向市场提供流动性,意图降低融资利率。流动性宽裕导致资金流入股票市场,股市屡创多年新高,但炙热的股市进一步吸收央行投放的流动性,因此央行的举措能否大幅降低社会融资成本还需要观察。同时政府推出的置换地方债务方案需要增加国债等政府债券的发行,债券的供给压力需要流动性支持消化,因此央行还会继续增加流动性供给,降准、公开市场操作和MLF等手段会择时使用,预计全年货币市场利率会维持稳定下降,最大的不确定性是ipo的加速发行,但相信央行会有相对应的手段去对冲ipo对资金面造成的压力。

IPO加速发行也会阶段性对货币市场利率造成冲击,我们会紧密跟踪新股发行,合理安排现金流。具体而言,我们将坚持货币市场基金流动性管理工具的投资目标,保持合理的组合平均剩余到期期限,在合规基础上进行组合管理,根据对利率和信用市场变化的规律的深入研究来提高组合收益。

§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	409,957,414.53	17.30
	其中:债券	409,957,414.53	17.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	744,502,498.55	31.41
	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	1,021,897,556.04	43.11
4	其他资产	193,880,754.20	8.18
5	合计	2,370,238,223.32	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	1.98	
	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	-	-
	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

本基金合同约定:"除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	33
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	50
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

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	80.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	1.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	2.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	15.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	3.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.02	-

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	89,991,685.70	4.33
	其中:政策性金融债	89,991,685.70	4.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	319,965,728.83	15.40
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	409,957,414.53	19.73
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	041458021	14山钢CP001	500,000.00	50,000,065.49	2.41
2	011599062	15首旅SCP001	500,000.00	49,993,078.58	2.41
3	011595001	15中化工SCP001	500,000.00	49,987,118.61	2.41
4	140218	14国开18	500,000.00	49,981,369.03	2.41
5	071542002	15西部证券CP002	400,000.00	39,995,525.22	1.92
6	041458046	14魏桥铝电CP001	300,000.00	30,000,240.15	1.44
7	041455025	14天业CP001	300,000.00	30,000,036.09	1.44
8	071506001	15安信CP001	300,000.00	29,998,048.60	1.44
9	041472018	14扬州经开CP001	300,000.00	29,991,494.60	1.44
10	140327	14进出27	200,000.00	20,006,695.91	0.96

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	0.2433%
报告期内偏离度的最低值	0.0430%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0970%

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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,762,744.58
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	10,819,923.79
4	应收申购款	177,298,085.83
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	193,880,754.20

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发宝A	广发宝B
本报告期期初基金份额总额	139,175,991,169.00	54,223,423,629.00
本报告期基金总申购份额	1,046,448,877,796.00	425,517,434,690.00
本报告期基金总赎回份额	1,056,505,352,414.00	401,081,271,235.00
报告期期末基金份额总额	129,119,516,551.00	78,659,587,084.00

§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

1.中国证监会批准广发现金宝场内实时申赎货币市场基金募集的文件;

2.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》;

3.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》;

4.法律意见书;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照;

6.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
二〇一五年四月二十日

广发消费品精选股票型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发消费品精选股票
基金主代码	270041
交易代码	270041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月12日
报告期末基金份额总额	32,524,195.00份
投资目标	在深入研究的基础上,本基金精选消费品行业的优质上市公司进行投资,在严格控制风险的前提下,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合考虑基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例,并定期或不定期地进行调整。本基金将根据对消费品行业各细分子类行业的综合分析,确定各细分子类行业的资产配置比例。在细分子类行业配置的基础上,本基金将选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的消费品行业上市公司进行投资。
业绩比较基准	80%×申银万国消费品指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	10,134,954.80
2.本期利润	18,575,195.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.3537
4.期末基金资产净值	60,148,710.51
5.期末基金份额净值	1.849

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

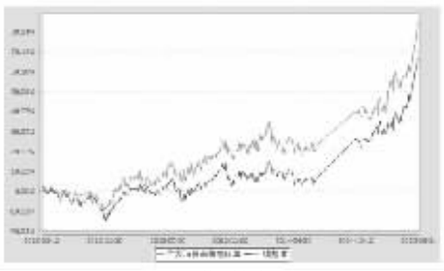
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	31.04%	1.32%	27.62%	0.98%	3.42%	0.34%

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

广发消费品精选股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年6月12日至2015年3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		
程晓	本基金的基金经理;广发大盘成长混合基金的基金经理;广发逆向策略混合基金的基金经理	2014-12-08	-	9年	男,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书,2006年3月至2007年6月任第一上海证券有限公司研究员,2007年6月起先后任广发基金管理有限公司研究员、基金经理助理,2013年2月5日起任广发大盘成长混合基金的基金经理,2014年9月4日起任广发逆向策略混合基金的基金经理,2014年12月8日起任广发消费品精选股票基金的基金经理。

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、《广发消费品精选股票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

1、市场运行回顾

经济基本面仍没有改善,PMI继续下滑,"旧经济"继续失速,相关产业链风险持续加大,"新经济"继续受到追捧,无论是政府政策还是市场都表现出空前的热情,中国进入改革预期进行时。"旧经济"遗留下来的货币在经济转型的压力下,开始持续地从"旧经济"中挤出,流向能够分享"新经济"的权益类资产中。而由于新旧经济供给状况差异,宽裕的溢出货币和稀缺的新经济可交易股权形成了持续的供需不平衡,推动了相关股票以及创业板指数屡创新高。随着政府对经济干预的强度持续加大,整个市场的政策属性也越来越强,和2009年以后的市场也越来越相似。客观的说经济很难有本质性改善,但市场对政策的正面预期持续加强,同时政策也持续的给出正反馈,理性地看,尽管新兴产业基本面给出相应同方向反馈,但是强度明显弱于预期。市场的泡沫越来越大,我们会逐步看见部分新兴产业出现竞争恶化以及盈利显著低于预期的状况。客观来看,树不会长到天上。

2、操作回顾

一季度持仓变化不大,仍然持有之前估值偏低股票,卖出了部分估值偏高股票,保证持仓股票仍处于估值较为安全区域。由于持仓股票表现较好,一季度跑赢比较基准。

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31.04%,同期业绩比较基准收益率为27.62%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对市场的判断仍然和年报中相似,认为随着价格的上涨,市场的风险在加大,低风险资产减少的速度也在加快,而投资者也应该开始适当的降低自己对未来的预期收益率,这样有助于降低投资风险。而本基金的持仓也会继续维持在具有安全边际的长期优质企业上,为投资者在控制风险的情况下获取合理的回报。

§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	权益投资	49,880,916.20	80.90
	其中:股票	49,880,916.20	80.90
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	2,800,823.38	4.54
7	其他各项资产	8,977,238.19	14.56
8	合计	61,658,977.77	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	4,522,351.08	7.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,842,565.12	72.89
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	-	-
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	-	-
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	-	-
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	1,516,000.00	2.52
	合计	49,880,916.20	82.93

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	002299	圣农发展	252,082	4,522,351.08	7.52
2	601311	骆驼股份	235,004	4,472,126.12	7.44
3	000729	燕京啤酒	477,064	4,379,447.52	7.28
4	000876	新希望	200,000	4,140,000.00	6.88
5	600398	海澜之家	268,020	3,907,731.60	6.50
6	002152	广电运通	67,700	2,651,809.00	4.41
7	000625	长安汽车	113,012	2,609,447.08	4.34
8	600085	同仁堂	94,002	2,453,452.20	4.08
9	002572	索菲亚	77,022	2,403,086.40	4.00
10	002191	劲嘉股份	110,000	2,373,800.00	3.95

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	42,109.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	687.70
5	应收申购款	8,934,441.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,977,238.19

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	000625	长安汽车	2,609,447.08	4.34	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	48,805,310.72
本报告期基金总申购份额	42,822,149.05
减:本报告期基金总赎回份额	59,103,264.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,524,195.00

§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	22,454,341.32
本报告期买入/申购总份额	0.00
本报告期卖出/赎回总份额	22,454,341.32
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 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	基金转出	2015-03-06	-22,454,341.32	-36,484,599.68	-
合计			-22,454,341.32	-36,484,599.68	

注:转出手续费183,339.70元。

§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消费品精选股票型证券投资基金募集的文件

2.《广发消费品精选股票型证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发消费品精选股票型证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、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
二〇一五年四月二十日

广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

【2015】第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发小盘成长股票(LOF)
场内简称	广发小盘
基金主代码	162703
交易代码	162703
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2005年2月2日
报告期末基金份额总额	2,160,390,313.70份
投资目标	依托中国良好的宏观经济发展形势和资本市场的高速成长,通过投资于具有高成长性的小市值公司股票,以寻求资本的长期增值。
投资策略	1.资产配置区间:股票资产配置比例为60%-95%,债券资产配置比例为0-15%,现金大于等于5%。 2.决策依据:以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。 3.股票投资管理的方法与标准:本基金在投资策略上采取小市值成长导向型,主要投资于基本面良好,具有高成长性的小市值公司股票。 4.债券投资策略:利率预测、收益率曲线模拟、资产配置和债券分析。
业绩比较基准	天相小市值指数。
风险收益特征	较高风险,较高收益。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	958,403,252.11
2.本期利润	1,406,014,459.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.5875
4.期末基金资产净值	5,806,980,104.08
5.期末基金份额净值	2.6879

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 |
|---|---|---|---|---