广发活期宝货币市场基金

【2016】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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§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4月19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2016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	273,364,891.13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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	1,783,764.59
2.本期利润	1,783,764.59
3.期末基金资产净值	273,364,891.13

注: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	0.6730%	0.0027%	0.0885%	0.0000%	0.5845%	0.0027%

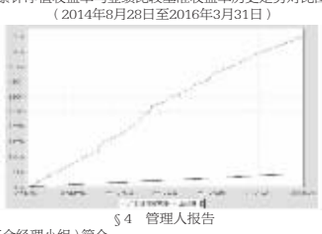
注:本基金收益分配按日结转份额。

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2016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		
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天债券基金的基金经理;广发现金宝纯内货币基金的基金经理;固定收益深圳总经理	2014-08-28	-	16年	女,中国籍,经济学学士,持有中国证券投资基金业从业证书,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4月30日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年12月2日起任广发现金宝纯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4月28日起任广发添鑫短债基金的基金经理。
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;广发聚泰混合基金的基金经理;广发稳鑫保本基金的基金经理	2014-08-28	-	8年	女,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,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30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6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日起任广发添鑫短债基金的基金经理,2015年6月8日起任广发聚泰混合基金的基金经理,2016年3月21日起任广发稳鑫保本基金的基金经理。

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、《广发活期宝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,本基金在关键的春节、季末三月底安排了较多的现金流到期,平时配置则采取了绝对收益为先的原则,总体做到在保证足够流动性的前提下,尽量提高组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发活期宝的净值增长率为0.673%,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

一季度央行继续采取稳健的货币政策,通过公开市场、MLF、降准等多种措施维持国内货币市场流动性合理充裕。但期间还是经历了两次短暂阶段性的高度紧张,分别在春节前和三月最后两天。在整体债市绝对收益率水平较低、广义基金普遍采用利用杠杆策略增厚收益的背景下,央行目前公开市场操作模式以及MPA框架下对于广义货币的调控方向将会对货币类基金流动性管理造成较大的挑战。在目前宏观经济、政策背景下,货币市场利率难以出现大幅下行,与此同时波动性将会继续加大。因此本基金在二季度要以流动性管理为第一要务,月度、季度都将安排较为充裕的现金流到期,并调整组合资产,以流动性较好资产为主。我们将继续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	228,436,132.69	73.51
	其中:债券	228,436,132.69	73.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,000,180.00	12.87
	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	40,183,337.29	12.93
4	其他各项资产	2,128,646.05	0.69
5	合计	310,748,296.03	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	13.09	
	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	36,945,781.52	13.52
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金本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

本基金本报告期内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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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	25.68	13.52
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	69.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	7.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		112.90	13.52

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	30,004,066.20	10.98
	其中:政策性金融债	30,004,066.20	10.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	198,432,066.49	72.59
8	其他	-	-
9	合计	228,436,132.69	83.57
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	111607042	16招行CD042	300,000.00	29,880,206.03	10.93
2	110221	11国开21	200,000.00	20,001,706.42	7.32
3	111610150	16兴业CD150	200,000.00	19,871,075.13	7.27
4	111691846	16广州农村商业银行CD020	200,000.00	19,889,029.93	7.27
5	111619062	16恒丰银行CD062	200,000.00	19,863,062.12	7.27
6	111519106	15恒丰银行CD106	200,000.00	19,862,592.53	7.27
7	130219	13国开19	100,000.00	10,002,360.78	3.66
8	111691533	16苏州银行CD031	100,000.00	9,943,616.71	3.64
9	111691608	16广州农村商业银行CD020	100,000.00	9,942,220.99	3.64
10	111691679	16广州银行CD020	100,000.00	9,941,312.49	3.64

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	0.0859%
报告期内偏离度的最低值	0.0106%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0562%

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	905,374.46
4	应收申购款	1,223,271.59
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,128,646.05

§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	269,763,381.17
本报告期基金总申购份额	138,915,759.27
本报告期基金总赎回份额	131,324,249.31
报告期期末基金份额总额	273,364,891.13

§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)中国证监会批准广发活期宝货币市场基金募集的文件
(二)《广发活期宝货币市场基金基金合同》
(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(四)《广发活期宝货币市场基金托管协议》
(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

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
二〇一六年四月二十二日

广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2016】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:二〇一六年四月二十二日

§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4月19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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300联接
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	768,536,073.59份
投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金主要投资于目标ETF,标的指数成份股、备选成份股,其中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。 (二)目标ETF投资策略 本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。 (三)股票投资策略 根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。 (四)债券投资策略 本基金将通过自上而下的宏观分析,结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置,并根据对个券相对价值的比较,进行个券选择和配置,保证基金资产的流动性。 (五)衍生品投资策略
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年03月20日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年03月31日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。主要采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。本基金投票资产的投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以更好地实现基金的投资目标,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。正常情况下,本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	标的指数为沪深300指数。业绩比较基准为标的指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-104,658,084.66
2.本期利润	-165,657,166.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2198
4.期末基金资产净值	1,088,920,363.82
5.期末基金份额净值	1.4169

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

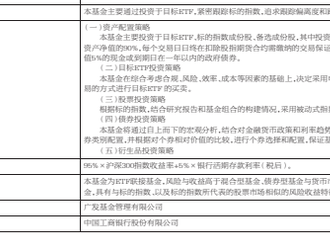
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.81%	2.42%	-13.06%	2.31%	-0.76%	0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计份额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2016年3月31日)



注:经2016年1月25日中国证监会的备案确认,本基金变更了投资范围开更名为广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§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及联接(LOF)基金的基金经理;广发沪深300ETF基金的基金经理;广发中小板300ETF联接基金的基金经理;广发养老指数基金的基金经理;广发环保指数基金的基金经理	2014-04-01	-	12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策略投资研究员,2014年4月1日至2016年1月17日任广发沪深300指数基金的基金经理,2014年4月1日起任广发中证500ETF及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理,2015年8月20日起任广发沪深300ETF基金的基金经理,2016年1月18日起任广发沪深300ETF联接基金的基金经理,2016年1月25日起任广发中小板300ETF及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理。

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交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》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,本基金日均跟踪误差为0.07%,符合要求。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素;作为ETF基金,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响相对较小。

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-12.96%,同期业绩比较基准收益率为-13.75%,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

2016年初,人民币汇率出现了一波较大幅度贬值,同时国内经济下行压力依然存在,熔断机制更是加剧了市场的风险情绪,种种因素的叠加导致了1月份市场的过度反应和持续暴跌。

随着市场恐慌情绪的持续释放,上证指数在2638.30点触底,随后在3000点上下反复震荡,多空力量进行了充分的对弈。3月中旬,美联储选择了不加息,同期国内市场需求面也出现了复苏迹象,周期性行业中短期也受益于供给侧改革的实施,最终促成了股市1季度中后期震荡向上的态势。

展望2季度,市场风险偏好已经有所上升,政策方面尚不存在明显利空预期,进出口数据3月份也好于预期,未来看好中短期震荡向上的投资机会。

沪深300指数目前估值水平较低,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	239,277,774.06	21.65
	其中:股票	239,277,774.06	21.65
2	基金投资	793,170,358.75	71.76
3	固定收益投资	22,000.00	0.00
	其中:债券	22,000.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	61,300,277.02	5.55
8	其他各项资产	11,494,784.70	1.04
9	合计	1,105,265,194.53	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	793,170,358.75	72.84

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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	197,945.54	0.02
B	采矿业	8,047,181.00	0.74
C	制造业	67,064,054.19	6.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,603,692.04	0.79
E	建筑业	8,017,519.66	0.74
F	批发和零售业	4,998,761.22	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	10,050,626.28	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,750,827.90	1.26
J	金融业	90,276,054.17	8.29
K	房地产业	22,182,908.89	2.07
L	租赁和商务服务业	3,064,112.48	0.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,364.82	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	220,816.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	1,925,722.08	0.18
S	综合	475,485.70	0.04
	合计	239,277,774.06	21.97

5.3.2 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。

5.4 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	000002	万 科A	872,900	16,419,249.00	1.51
2	600000	浦发银行	562,476	10,085,194.68	0.93
3	601318	中国平安	296,170	9,421,167.70	0.87
4	600036	招商银行	536,720	8,635,824.80	0.79
5	000651	格力电器	422,066	8,606,925.74	0.79
6	600837	海通证券	569,544	8,138,783.76	0.75
7	600016	民生银行	815,350	7,427,839.50	0.68
8	601166	兴业银行	379,601	5,895,203.53	0.54
9	601328	交通银行	976,065	5,436,682.05	0.50
10	600276	恒瑞医药	114,655	5,415,156.65	0.50

5.5 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)	22,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,000.00	0.00

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	113010	江南转债	220	22,000.00	0.00

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 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1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。

5.12.2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。

5.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	107,146.41
2	应收证券清算款	10,145,870.21
3	应收股利	-
4	应收利息	13,690.81
5	应收申购款	355,813.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	872,263.80
9	合计	11,494,784.70

5.12.4 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。

5.12.5 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	16,419,249.00	1.51	重大事项
2	000651	格力电器	8,606,925.74	0.79	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	727,677,374.64
本报告期基金总申购份额	269,715,721.96
减:本报告期基金总赎回份额	224,857,023.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	768,536,073.59

§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

广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金原名为"广发沪深300指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,于2015年12月4日至2016年1月14日15:00止以通讯方式召开了广发沪深300指数证券投资基金的基金份额持有人大会,审议变更广发沪深300指数证券投资基金的投资范围及其相关事宜,将广发沪深300指数证券投资基金变更为广发沪深300ETF联接基金,该次会议决议的生效日为2016年1月18日。

有关重要事项详情可见本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站(www.gffunds.com.cn)于2015年12月4日和2015年12月7日刊登的《关于广发沪深300指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》,及2016年1月19日刊登的《关于广发沪深300指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§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.《广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
9.《广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

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-fun