广发标普全球农业指数证券投资基金

【2012】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：二〇一二年四月二十日

§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2012年4月17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2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球农业指数(QDII)
基金主代码	270027
交易代码	270027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月28日
报告期末基金份额总额	363,715,145.66份
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%，年跟踪误差不超过5%，实现对标普全球农业指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。 本基金将不低于85%的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,929,277.37
2.本期利润	29,266,848.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0795
4.期末基金资产净值	338,397,193.78
5.期末基金份额净值	0.930

注：1、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。

2、上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。

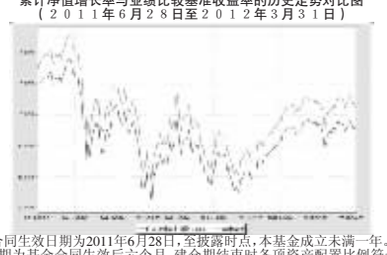
3.2 基金净值表现

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	9.54%	0.85%	10.36%	0.89%	-0.82%	-0.04%

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

广发标普全球农业指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2011年6月28日至2012年3月31日）



注：1、本基金合同生效日期为2011年6月28日，全披露时点，本基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为基金合同生效后六个月，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		
邱炜	本基金的基金经理	2011-6-28	-	4	男，中国籍，统计学博士，持有证券业执业资格证书，2007年5月至2008年7月在摩根大通集团（纽约）任高级分析师兼助理副总裁，2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员，2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理。

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、《广发标普全球农业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，但未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。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

2012年1季度全球证券市场受欧债危机的缓解以及美国经济数据的好转大幅上涨，其中美国纳斯达克综合指数上涨18.67%，标普500指数上涨12.00%，英国富时100指数上涨3.52%，德国DAX指数上涨17.78%，法国CAC40指数上涨8.35%，香港恒生指数上涨11.51%。

1季度中国国内经济增速放缓明显，PMI指数持续在低位，在国内通胀缓解以及货币政策略显放松的影响下，本季度沪深300指数上涨4.65%，上证指数上涨2.88%，深证成份指数上涨2.91%。

广发标普全球农业指数基金在本季度内进行全复制指数操作，并在基金合同允许的范围内对日常申购赎回进行操作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值上涨9.54%，日均偏离度为0.13%，期间跟踪误差0.17%，年化跟踪误差为2.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度面临的国际国内环境仍然复杂，在欧洲随着意大利等国的还债高峰的到来，以及国际市场对西班牙债务问题的担心，是否会再次点燃欧债危机的导火索；美国复苏的进程一波三折，投资者过度依赖美联储的刺激措施，经济数据佳导致QE3的远离或是经济数据差引来QE3的希望，都使得市场处于纠结之中，预计美联储依然会经济做出刺激政策但时间将会后移，这源于美国经济恢复的反复以及就业市场的不稳定；而中国国内则处于经济下滑与通胀的双重影响之下，预计二季度未或许我们将能够看到经济触底的迹象，以及货币政策放松的进一步明朗化。同时，在农业领域内的垄断型企业中长期持续向好的趋势仍然不变，预计食品价格将保持稳定增长的趋势，二季度化肥企业库存将得到改善，全球粮食贸易上市公司基本面将继续保持稳定向好的状态。二季度预计农产品价格将保持稳中向上的状态，尤其是大豆以及玉米的期货价格，但美联储货币政策以及美元价格的波动将在很大程度上对农产品的价格产生影响。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	310,497,708.79	89.39
	其中：普通股	263,919,669.56	75.98
	存托凭证	46,578,039.23	13.41
2	基金投资	8,313,196.73	2.39
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,696,066.35	5.67
8	其他各项资产	8,853,985.53	2.55
9	合计	347,360,957.40	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	173,757,014.34	51.35
英国	36,459,096.47	10.77
新加坡	35,022,682.78	10.35
瑞士	18,690,429.09	5.52
加拿大	16,874,241.12	4.99
挪威	10,710,366.67	3.17
日本	10,701,475.98	3.16
德国	5,597,595.78	1.65
中国香港	2,684,806.56	0.79
合计	310,497,708.79	91.76

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括智利和巴西在美国上市的ADR。

3、上述英国比重包括俄罗斯在英国上市的GDR。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	132,258,286.48	39.08
工业	25,953,270.64	7.67
非必须消费品	-	-
必须消费品	152,286,151.67	45.00
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	310,497,708.79	91.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称(英文)	公司名称(中文)	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	MON US	MONSANTO CO	孟山都	纽约证券交易所	美国	49,500	24,850,651.72	7.34
2	BRFS US	BRF - BRASIL FOODS SA-ADR	Perdigao公司	纽约证券交易所	美国	190,000	23,930,299.17	7.07
3	ADM US	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM公司	纽约证券交易所	美国	118,000	23,514,749.48	6.95
4	WIL SP	WILMAR INTERNATIONAL LTD	丰益国际有限公司	新加坡证券交易所	新加坡	947,000	23,232,135.13	6.87
5	POT US	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温省钾肥股份有限公司	纽约证券交易所	美国	80,000	23,006,925.36	6.80
6	ABF LN	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	英国联合食品集团	伦敦证券交易所	英国	185,000	22,692,329.40	6.71
7	SYNN VX	SYNGENTA AG-REG	先正达股份公司	瑞士证券交易所	瑞士	8,600	18,690,429.09	5.52
8	DE US	DEERE & CO	迪尔	纽约证券交易所	瑞士	36,600	18,637,044.64	5.51
9	MOS US	MOSAIC CO/THE	Mosaic公司	纽约证券交易所	美国	46,000	16,008,544.96	4.73
10	URKA LI	URALKALI-SPON GDR-REG S	乌拉尔钾肥开放式股份公司	纽约证券交易所	美国	58,000	13,766,767.07	4.07

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	MARKET VECTORS AGRIBUSINESS	ETF	契约型开放式	Van Eck Associates Corp	8,313,196.73	2.46
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 根据公开市场信息，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	8,486,627.03
3	应收股利	229,781.32
4	应收利息	1,883.01
5	应收申购款	72,227.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	63,466.65
8	其他	-
9	合计	8,853,985.53

5.10.4 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。

5.10.5 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中未存在流通受限情况。

§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	366,104,685.46
本报告期基金总申购份额	27,510,699.86
减：本报告期基金总赎回份额	29,900,239.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	363,715,145.66

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发标普全球农业指数证券投资基金募集的文件；

2.《广发标普全球农业指数证券投资基金基金合同》；

3.《广发标普全球农业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.《广发标普全球农业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、公司章程；

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 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

7.3 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
二〇一二年四月二十日

广发策略优选混合型证券投资基金

【2012】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：二〇一二年四月二十日

§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2012年4月17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2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发策略优选混合	
基金主代码	270006	
交易代码	270006	270016
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年5月17日	
报告期末基金份额总额	7,221,450,376.85份	
投资目标	通过综合运用多种投资策略优选股票，分享中国经济和资本市场高速增长的成果，为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。	
投资策略	本基金将主要根据宏观经济政策、资金供求、市场波动周期因素的判断，确定资产配置策略；通过综合运用主题投资、买入持有、逆向投资等多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合；通过利率预测以及收益曲线策略进行债券投资；同时严格遵守有关权证投资的比例限制。	
业绩比较基准	75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数	
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	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(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-431,786,256.85
2.本期利润	178,611,068.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0245
4.期末基金资产净值	8,694,399,358.40
5.期末基金份额净值	1.2040

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。

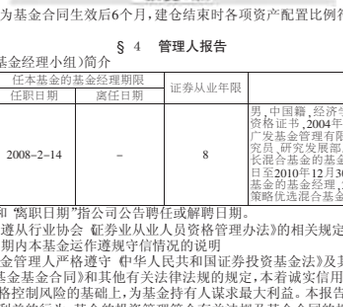
3.2 基金净值表现

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	2.04%	1.52%	3.62%	1.17%	-1.58%	0.35%

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

广发策略优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的历史走势对比图
（2006年5月17日至2012年3月31日）



注：本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓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		
冯永欢	本基金的基金经理	2008-2-14	-	8	男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，2004年2月至2007年3月先后任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究发展部总经理助理、广发稳健增长混合基金的基金经理助理，2007年3月29日至2010年12月30日任广发稳健增长混合基金的基金经理，2008年2月14日起任广发策略优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、《广发策略优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，但未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。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

自去年以来的经济降速趋势仍在延续，一季度的GDP虽然仍处于较高水平，但PMI、发电量、工业增加值、消费等数据显示经济活力较弱。唯一利好因素就是资金价格的下降，风险溢价水平降低，这对股市的上涨起到关键的支撑作用。最近半年以来，各板块相继企稳回升。

本基金在一季度减持了部分业绩低于预期的个股，对持仓结构进行了适当优化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

第一季度本基金净值上涨2.04%，基金基准上涨3.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，疲弱的经济基本面不支撑股市的大幅上涨，在未来相当长的时间内，经济增速将降低到一个较低的水平；短期看，经济仍在下滑中，如果趋势延续，多数行业的盈利能力都将受到影响，未来几个季度中的变数在于政策层面，如果GDP降到8%以内，政策的适当放松（当然不能跟08年底相比）是可能的，投资和信贷可能会看到再次提升，这将对股市构成短期利好。

在行业配置上，我仍然认为消费品等行业受宏观经济影响的波动较小，尽管短期增速放缓，但长期仍有较大发展空间。

§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	6,859,747,659.74	78.68
	其中：股票	6,859,747,659.74	78.68
2	固定收益投资	385,006,000.00	4.42
	其中：债券	385,006,000.00	4.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,459,661,748.93	16.74
6	其他各项资产	14,023,111.83	0.16
7	合计	8,718,438,520.50	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	65,434,210.16	0.75
B	采掘业	54,285,534.87	0.62
C	制造业	4,196,503,119.18	48.27
C0	食品、饮料	2,570,314,408.61	29.56
C1	纺织、服装、皮毛	724,091,665.17	8.33
C2	木材、家具	16,983,331.10	0.20
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	133,585,672.90	1.54
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	330,372,507.40	3.80
C8	医药、生物制品	421,155,534.00	4.84
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,060,031,656.09	12.19
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	41,153,013.88	0.47
H	批发和零售贸易	1,060,045,162.70	12.19
I	金融、保险业	35,052,756.75	0.40
J	房地产业	44,462,000.00	0.51
K	社会服务业	302,780,206.11	3.48
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,859,747,659.74	78.90

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	002304	洋河股份	4,851,549	713,905,435.35	8.21
2	000568	泸州老窖	11,753,977	459,462,960.93	5.28
3	000858	五粮液	11,346,571	372,621,391.64	4.29
4	002029	七匹狼	9,894,646	365,805,062.62	4.21
5	002081	金螳螂	8,960,724	347,588,130.12	4.00
6	600809	山西汾酒	4,341,471	266,436,075.27	3.06
7	002073	软控股份	19,406,285	264,701,727.40	3.04
8	002154	报喜鸟	20,898,022	259,135,472.80	2.98
9	002310	东方园林	2,836,129	257,577,235.78	2.96
10	002375	亚厦股份	8,470,709	245,565,853.91	2.82

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	30,438,000.00	0.35
3	金融债券	354,568,000.00	4.08
	其中：政策性金融债	354,568,000.00	4.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	385,006,000.00	4.43

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110314	11进出14	1,700,000	174,964,000.00	2.01
2	110419	11农发19	1,000,000	98,680,000.00	1.13
3	1101081	11央行票据81	300,000	30,438,000.00	0.35
4	110318	11进出18	300,000	30,294,000.00	0.35
5	110306	11进出06	300,000	30,222,000.00	0.35

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 根据公开市场信息，报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,810,182.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,278,796.44
5	应收申购款	2,934,133.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,023,111.83

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转换期的可转换债券。

5.8.5 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	002081	金螳螂	55,650,000.00	0.64	非公开发行流通受限
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

§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	7,305,967,118.24
本报告期基金总申购份额	92,129,822.59
减：本报告期基金总赎回份额	176,646,563.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,221,450,376.85

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发策略优选混合型证券投资基金募集的文件；

2.《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》；

3.《广发策略优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.《广发策略优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、公司章程；

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 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

7.3 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
二〇一二年四月二十日

广发大盘成长混合型证券投资基金

【2012】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：二〇一二年四月二十日

§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2012年4月17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2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发大盘成长混合	
基金主代码	270007	
交易代码	270007	270017
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年6月13日	
报告期末基金份额总额	12,171,411,041.71份	
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场，通过投资于成长性较好的大市值公司股票，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金通过“自下而上”为主的股票分析流程，以成长性分析为重点，对大市值公司的基本面进行科学、全面的考察，挖掘投资机会，构建股票投资组合；通过利率预测、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析进行债券投资；同时严格遵守有关权证投资的比例限制。	
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*上证国债指数	
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	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(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-147,685,300.79
2.本期利润	440,422,028.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0361
4.期末基金资产净值	7,674,459,419.11
5.期末基金份额净值	0.6305

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