

广发策略优选混合型证券投资基金

[2013] 第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§ 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2013年7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，确认报告的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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30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 | 6,044,044,436.72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的持续增长的成果，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、市场波动周期等因素，结合对行业基本面的研究，精选具有成长性、盈利能力强、估值合理的股票进行投资；同时兼顾不同行业、不同风格的股票进行配置，通过半定期调整和定期调整相结合的曲线策略进行债券投资；同时严格遵守有关法规规定的比例限制。

业绩比较基准 本基金自2013年1月17日起，将基金业绩比较基准由“75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“75%*沪深300指数+25%*中证全债指数”。

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 | 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期已实现收益 | -38,334,670.23 | |
| 2.本期利润 | -615,787.96 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0001 | |
| 4.期末基金份额净值 | 7,519,778,940.44 | |
| 5.期末基金资产净值 | 1,2442 | |

注:①所述基金财务数据包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收入水平要低于所列数字。

②本期利润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，本期利润为期末收益减去期初收益。

3.2 基金净值表现**3.2.1 本基金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变动的比较**

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 -0.12% 1.11% -8.60% 1.09% 8.48% 0.02%

较 3.2.2 本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2013年6月30日

注:1.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。
 2.本基金自2013年1月17日起，将基金业绩比较基准由“75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“75%*沪深300指数+25%*中证全债指数”。

§ 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 |
|-----|---|-------------|--------|---|
| 冯永冰 | 本基金的基金经理 消费品种 选股基金 的基金经理 经理; 长治成长 混合基金 的基金经理 | 2008-2-14 | - | 男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业证书，2004年7月28日至2007年3月28日在广发基金管理有限公司从事发展部经理助理、研究发展部经理助理、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日在广发稳健增长混合基金的基金经理，2008年2月1日起担任广发策略优选混合型证券投资基金的基金经理，2012年6月12日起担任广发消费品精选混合型证券投资基金的基金经理，2013年2月5日起担任广发大盘成长混合基金的基金经理。 |

注:1.“任职日期”和“辞职日期”指公司公告聘任或解聘日期。
 2.证券从业的定义从行业协会、证券业协会人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

报告期内，基金管理人严格按照《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财产，本基金未有损害基金持有人利益的行为。本基金报告期内，基金运作合法合规，无损基会持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司通过建立科学、透明的投资决策体系，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反馈机制，确保公平交易制度的执行。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定拟合组投资的股票必须来源于备选股库，重点关注股票的股票必须来源于核心股票库。公司建立严格的授权制度，投资组合经授权范围内可以自主决策，超过投资权限的股票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的公平性进行实时监控及预警，实现投资交易的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资交易的事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.2.1 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.2 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.3 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.4 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.5 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.6 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.7 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.8 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.9 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.10 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.11 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.12 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.13 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.14 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.15 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.16 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.17 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.18 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.19 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.20 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.21 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.22 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.23 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.24 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.25 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.26 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.27 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.28 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.29 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.30 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.31 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.32 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.33 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.34 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.35 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.36 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.37 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.38 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.39 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.40 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.41 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.42 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.43 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.44 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.45 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.46 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.47 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.48 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.49 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.50 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.51 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.52 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.53 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.54 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.55 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.56 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.57 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.58 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.59 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.60 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.61 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.62 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.63 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.64 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.65 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.66 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.67 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.68 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.69 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.70 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.71 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.72 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.73 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.74 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.75 本公司未发现存在利益输送的情况。

4.3.2.76 本公司未发现存在不公平交易的情况。

4.3.2.77 本公司未发现存在内幕交易的情况。

4.3.2.78 本公司未发现存在利用基金交易谋取利益的情况。

4.3.2.79 本公司未发现存在不公平对待不同客户的情况。

4.3.2.80 本公司未发现存在利益输送的情况。

4