

广发轮动配置混合型证券投资基金

2015年第3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
报告期截止日期:二〇一五年十月二十六日

§ 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。
本基金的基金管理人和基金托管人承诺不从事内幕交易、操纵市场的行为，并遵守基金合同的一般规定。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告期(2015年7月1日起至9月30日止)。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发轮动配置混合
基金代码	000117
交易代码	000117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月28日
报告期末基金份额总额	920,716,283.39份
投资目标	根据经济周期的不同阶段的特征,通过对大类资产配置及行业轮动策略,投资组合的应对投资资产,应对通胀预期,通胀预期、经济复苏和通货紧缩等宏观经济的行业分析,在经济处于不同阶段时,通过小类资产配置和行业配置相对确定性较强的投资行业及个股,根据经济周期的各阶段特征,把握经济周期与行业板块轮动之规律,进行行业轮动以降低风险,同时精选个股,实现基金资产的保值增值。
投资策略	本基金主要通过行业配置和个股精选两个方面来实现投资目标。本基金将通过行业配置,在经济处于不同阶段时,通过小类资产配置和行业配置相对确定性较强的投资行业及个股,根据经济周期的各阶段特征,把握经济周期与行业板块轮动之规律,进行行业轮动以降低风险,同时精选个股,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中债全价指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币基金,但低于股票型基金。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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-463,178,706.70	
2.本期利润	-424,772,464.43	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4322	
4.期末基金份额净值	1,266,351,720.96	
5.期末基金份额净值	1.2757	

注:(1)上述基金业定期报告不包括持有人认购或交易基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2)期末可供分配利润,系指截至报告期末基金财产可分配收益扣减公允价值变动收益后的余额,本期利润为本期已实现收入加上本期利润。

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7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益

-463,178,706.70

2.本期利润

-424,772,464.43

3.加权平均基金份额本期利润

-0.4322

4.期末基金份额净值

1,266,351,720.96

5.期末基金份额净值

1.2757

注:(1)上述基金业定期报告不包括持有人认购或交易基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2)期末可供分配利润,系指截至报告期末基金财产可分配收益扣减公允价值变动收益后的余额,本期利润为本期已实现收入加上本期利润。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内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 净值增长率为% 业绩比较基准收益率为% 收益率差为%

①-③ ②-④

过去三个月 -20.47% 336% -22.30% 2.67% 1.73% 0.89%

3.2.2 基金合同生效以来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

(2013年6月28日至2015年9月30日)

图:广发轮动配置混合型证券投资基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

5.4 管理人报告

5.1 管理人报告

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
报告期截止日期:二〇一五年十月二十六日

§ 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。

本基金的基金管理人和基金托管人承诺不从事内幕交易、操纵市场的行为，并遵守基金合同的一般规定。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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过审计。

本报告期(2015年7月1日起至9月30日止)。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益

1,711,014.67

2.本期利润

7,602,070.26

3.加权平均基金份额本期利润

0.0548

4.期末基金份额净值

169,232,294.13

5.期末基金份额净值

1.231

注:1.本期利润为期间内利息收入、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利润。

2.本期利润不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金业定期报告不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.基金业定期报告不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益

1,711,014.67

2.本期利润

7,602,070.26

3.加权平均基金份额本期利润

0.0548

4.期末基金份额净值

169,232,294.13

5.期末基金份额净值

1.231

注:1.本期利润为期间内利息收入、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利润。

2.本期利润不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金业定期报告不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.基金业定期报告不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益

1,711,014.67

2.本期利润

7,602,070.26

3.加权平均基金份额本期利润

0.0548

4.期末基金份额净值

169,232,294.13

5.期末基金份额净值

1.231

注:1.本期利润为期间内利息收入、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利润。

2.本期利润不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金业定期报告不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.基金业定期报告不包括持有人认购或购买基金份额的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益

-139,172,146.73

2.本期利润

-100,010,126.69

3.加权平均基金份额本期利润

-0.1041

4.期末基金份额净值

411,504,026.24

5.期末基金份额净值

0.796

注:1.上述基金业定期报告不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本基金已实现收益本期利息收入、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利润。

3.基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

4.本基金中财务数据未经过审计。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益

-139,172,146.73

2.本期利润

-100,010,126.69

3.加权平均基金份额本期利润

-0.1041

4.期末基金份额净值

411,504,026.24

5.期末基金份额净值

0.796

注:1.上述基金业定期报告不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本基金已实现收益本期利息收入、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利润。

3.基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

4.本基金中财务数据未经过审计。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9