

广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金

[2014] 第三季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

重要提示

基金管理人的董事局及董事会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:中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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,保证本报告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。

报告书中数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 广发竞争优势混合

基金主代码 000529

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金经理 谢晖

基金合同生效日 2014年3月12日

报告期末基金份额总额 1,580,891,220.00份

投资目标 本基金通过投资于具有良好成长性的股票,并适当配置债券、权证等资产,积极把握由此带来的获利机会,力求实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 (一)资产配置策略 本基金主要通过以下方式的分析和研究,关注宏观经济政策、政策导向和金融市场动态等因素,评估投资回报、风险及收益,从而决定资产配置比例。本基金将综合考虑宏观经济环境、行业景气度、公司基本面、估值水平、资金面、政策面、市场情绪等多方面因素,适时进行资产配置。(二)股票投资策略 本基金将股票投资作为以获取绝对收益为目标的主要投资方向,主要投资于具有较高内在价值的股票,以此为基础构建股票投资组合。(三)债券投资策略 本基金将债券投资作为资产配置的重要组成部分,通过利率预期、信用评价、久期管理、风险管理等策略,构建债券投资组合。

投资策略 (四)衍生品投资策略 本基金利用利率期货、国债期货、股指期货、商品期货、期权等金融衍生品种,在严格控制风险的前提下,结合对市场的判断,选择适当的时机,在适当的时机买入或卖出金融衍生品种,以期获得超额收益。

(五)其他投资策略 本基金将根据法律法规的规定,参与一级市场新股申购、可转债申购、增发新股、配股、可分离交易的优先股、可交换债、股票期权及其他金融衍生品种的投资。

投资策略 (六)资产配置策略 本基金将股票投资作为资产配置的主要方向,并结合对宏观经济、行业景气度、公司基本面、估值水平、资金面、政策面、市场情绪等多方面因素,适时进行资产配置。

(七)其他各项资产 1,456,922.24 0.08

7 合计 1,734,069,453.25 100.00

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 1,560,837,307.58 90.01

其中:股票 1,560,837,307.58 90.01

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

货币市场基金 - -

3 货币市场投资 - -

4 货币类金融资产 - -

5 其他金融类资产 - -

6 银行存款和结算备付金合计 171,775,845.40 9.91

7 其他各项资产 1,456,922.24 0.08

8 合计 1,734,069,453.25 100.00

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 - -

B 制造业 18,823,595.34 1.12

C 制造业 980,748,811.71 58.49

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 38,806,444.94 2.31

E 建筑业 19,131,542.32 1.14

F 批发和零售业 55,305,488.60 3.30

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 315,944,422.67 18.82

J 金融业 - -

K 房地产业 14,946,328.80 0.89

L 采矿业和服务业 7,397,445.00 0.44

M 科学研究和技术服务业 2,462,741.30 0.15

N 水利、环境和公共设施管理业 86,292,555.40 5.15

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 9,664,699.50 0.58

R 文化、体育和娱乐业 11,662,542.00 0.70

S 综合 - -

8 合计 1,560,837,307.58 93.08

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 代码名称 股票简称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002353 环旭电子 环旭电子 6,611,433.60 3.38

2 300287 飞利信 飞利信 54,919,132.40 3.28

3 002450 康得新 康得新 53,733,690.32 3.20

4 002326 大华股份 大华股份 1,764,322 48,642,357.54 2.90

5 002491 通鼎光电 20,059,079 40,769,764.20 2.43

6 600976 武汉凡谷 1,401,574 40,505,488.60 2.42

7 300367 东方国信 388,699 39,258,599.00 2.34

8 002296 旗滨集团 1,155,607 36,690,522.25 2.19

9 000910 万里扬 1,290,134 36,407,581.48 2.17

10 002437 丽珠医药 35,821,745.00 2.14

5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

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

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及投资明细

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股指期货投资明细

5.10 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国债期货投资明细

5.11 本基金的“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.基金管理人对从业人员行为规范的说明

4.2 报告期内基金管理人未出现影响基金运作的重大事件。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金投资组合的执行情况

4.5 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.6 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.7 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.8 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.9 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.10 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.11 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.12 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.13 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.14 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.15 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.16 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.17 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.18 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.19 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.20 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.21 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.22 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.23 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.24 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.25 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.26 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.27 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.28 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.29 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.30 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.31 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.32 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.33 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.34 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.35 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.36 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.37 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.38 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.39 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.40 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.41 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.42 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.43 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.44 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.45 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.46 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.47 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.48 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.49 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.50 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.51 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.52 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.53 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.54 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.55 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.56 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.57 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.58 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.59 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.60 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.61 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.62 报告期内基金投资组合的偏离度情况

4.63 报告期内基金投资组合的偏离度情况