

2015年第3季度报告

2015年9月30日

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：广发基金管理有限公司，根据本基金合同规定，于2015年10月21日复核了本报告中的财务数据、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	广发逆向策略混合型证券投资基金
基金代码	000047
交易代码	000047
基金运作方式	契约型开放式
基金经理	王成
基金经理的从业经验	2014年9月1日
报告期末基金份额总额	107,060,856,226份
投资目标	本基金主要通过逆向投资策略进行主动投资管理，在有效控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳健增值。
本基金将通过深入研究行业基本面、政策面和资金面等多方面因素，研判宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同面对各类资产的市场影响，评估权益、债券及货币等各类资产的预期收益和风险，构建高性价比的投资组合。	
投资策略	本基金将通过深入研究行业基本面、政策面和资金面等多方面因素，研判宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同面对各类资产的市场影响，评估权益、债券及货币等各类资产的预期收益和风险，构建高性价比的投资组合。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×中债企业债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于债券型基金和货币市场基金的混合。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

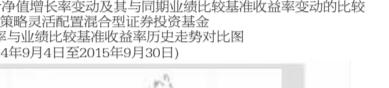
主要财务指标		报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益		8,374,721.46
2.本期利润		-39,140,067.24
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0387
4.期末基金份额净值		150,241,631.11
5.期末基金净值增长率		1.003

(注：①所述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价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本基金采用摊余成本法核算，因此，本期公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润均为金额相等。

3.2.1 本基金报告期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	业绩比较基准			
			收益标准差	收益/基准差		
过去三个月	-17.76%	3.15%	-12.91%	1.67%	-4.49%	-1.49%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



广发逆向策略混合型证券投资基金成立以来净值增长率历史走势图(2014年9月1日至2015年9月30日)

注：净值增长率=（报告期期末基金资产净值-报告期初基金资产净值）/报告期初基金资产净值。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期期末基金资产组合情况

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.4 管理人报告

5.5 报告期末债券回购融资情况

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

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股票投资明细

5.8 报告期末持有的无价证券

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资产支持证券投资明细

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十名贵金属投资明细

5.11 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保险投资明细

5.12 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卖出回购金融资产款

5.13 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买入返售金融资产

5.14 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应收票据

5.15 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应收账款

5.16 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其他资产

5.17 报告期末持有的待摊费用

5.18 报告期末持有的待处理财产损益

5.19 报告期末持有的其他资产

5.20 报告期末持有的其他负债

5.21 报告期末持有的待处理流动资产损溢

5.22 报告期末持有的待处理非流动资产损溢

5.23 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.24 报告期末持有的其他资产减值准备

5.25 报告期末持有的其他负债减值准备

5.26 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.27 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.28 报告期末持有的其他资产减值准备

5.29 报告期末持有的其他负债减值准备

5.30 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.31 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.32 报告期末持有的其他资产减值准备

5.33 报告期末持有的其他负债减值准备

5.34 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.35 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.36 报告期末持有的其他资产减值准备

5.37 报告期末持有的其他负债减值准备

5.38 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.39 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.40 报告期末持有的其他资产减值准备

5.41 报告期末持有的其他负债减值准备

5.42 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.43 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.44 报告期末持有的其他资产减值准备

5.45 报告期末持有的其他负债减值准备

5.46 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.47 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.48 报告期末持有的其他资产减值准备

5.49 报告期末持有的其他负债减值准备

5.50 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.51 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.52 报告期末持有的其他资产减值准备

5.53 报告期末持有的其他负债减值准备

5.54 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.55 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.56 报告期末持有的其他资产减值准备

5.57 报告期末持有的其他负债减值准备

5.58 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.59 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.60 报告期末持有的其他资产减值准备

5.61 报告期末持有的其他负债减值准备

5.62 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.63 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.64 报告期末持有的其他资产减值准备

5.65 报告期末持有的其他负债减值准备

5.66 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.67 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.68 报告期末持有的其他资产减值准备

5.69 报告期末持有的其他负债减值准备

5.70 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.71 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.72 报告期末持有的其他资产减值准备

5.73 报告期末持有的其他负债减值准备

5.74 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.75 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.76 报告期末持有的其他资产减值准备

5.77 报告期末持有的其他负债减值准备

5.78 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.79 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.80 报告期末持有的其他资产减值准备

5.81 报告期末持有的其他负债减值准备

5.82 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.83 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.84 报告期末持有的其他资产减值准备

5.85 报告期末持有的其他负债减值准备

5.86 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.87 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.88 报告期末持有的其他资产减值准备

5.89 报告期末持有的其他负债减值准备

5.90 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.91 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.92 报告期末持有的其他资产减值准备

5.93 报告期末持有的其他负债减值准备

5.94 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.95 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.96 报告期末持有的其他资产减值准备

5.97 报告期末持有的其他负债减值准备

5.98 报告期末持有的待处理流动资产减值准备

5.99 报告期末持有的待处理非流动资产减值准备

5.10 报告期末持有的其他资产减值准备

5.11 报告期末持有的其他负债减值准备</p