广发策略优选混合型证券投资基金

【2015】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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份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	广发策略优选混合	
基金主代码	270006	
交易代码	270006(前端)	270016(后端)
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	2,480,056,908.16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	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

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	-609,271,821.98
2.本期利润	-1,628,688,744.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6351
4.期末基金资产净值	4,144,511,049.52
5.期末基金份额净值	1.6711

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

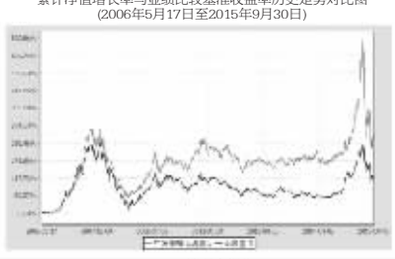
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-26.57%	4.21%	-20.65%	2.51%	-5.92%	1.70%

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历史走势对比图

(2006年5月17日至2015年9月30日)



§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		
李巍	本基金的基金经理;广发制造业精选混合基金的基金经理;广发主题领先混合基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2014-03-17	-	10年	男,中国籍,理学硕士,持有基金业执业资格证书,2005年7月至2010年6月任职于广发证券股份有限公司,2010年7月起在广发基金管理有限公司权益投资一部工作,2011年9月20日起任广发制造业精选股票基金的基金经理,2013年9月9日至2015年2月16日任广发核心精选混合基金的基金经理,2014年3月17日任广发策略优选混合基金的基金经理,2014年7月31日起任广发主题领先混合基金的基金经理,2015年1月14日起任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理。
王小松	本基金的基金经理;广发成长优选混合基金的基金经理;广发内需增长混合基金的基金经理。	2014-12-24	-	8年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书。自2007年7月至2009年9月在联合证券有限责任公司投资银行总部从事投行业务,2009年10月至2013年5月先后在华泰联合证券有限责任公司和国联安基金管理有限公司任研究员,2013年6月起加入广发基金管理有限公司,先后在研究发展部和权益投资一部任研究员,2014年12月24日起任广发策略优选混合基金的基金经理,2015年2月17日起任广发成长优选混合基金的基金经理,2015年6月13日起任广发内需增长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,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。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

3季度,A股主要指数持续下跌,其中虽在7月和9月中下旬出现两次反弹,但整体跌幅仍较大。本季,上证综指、深证成指、中小板指和创业板指跌幅分别为28.63%、30.34%、26.57%和27.14%。

宏观经济在3季度延续了之前的疲弱走势,PMI、投资增速、工业增加值、发电量、大宗工业品价格等主要经济指标均不断走低,且有越来越弱之势,中央政府虽然积极推出各种微刺激和稳增长措施,但效果并不明显,经济寻底过程仍未结束。这种宏观背景下,大部分传统周期性行业和制造业普遍景气度较差,虽然相对估值水平不高,但业绩低于预期的可能性大;同时,部分新兴行业虽然景气度高,业绩增速较快,但经过两年的持续上涨,相对市盈率水平已经非常高。投资者们发现,经过6月后半段的快速调整,A股整体泡沫依然严重,于是在7月上旬继续快速下跌。当然,A股的泡沫化只是本次暴跌的背景原因,更重要的推力在于,监管部门规范场外配资等杠杆行为触发市场开始下跌,市场下跌速度较快导致部分杠杆账户被强制平仓,加速市场下跌,并形成持续负反馈。此种情景,可谓是A股大多数投资者从未经历过的,投资者风险偏好快速下降。所幸国家及时出手稳定市场,提供交易流动性,市场也顺势出现一定反弹。时至8月上旬,市场虽短期稳住,但整体泡沫化及杠杆率较高的问题并未彻底解决;"811汇改"之后的人民币贬值及美元加息预期的提升,导致投资者风险偏好再次快速下降,部分投资者开始全面看空中国经济和人民币资产,认为中国经济的转型与改革已然失败,A股市场开始了新一轮的快速下跌,并导致全球金融市场剧烈波动,甚至有言论认为新一轮全球金融危机已在眼前。其实市场最悲观绝望的时候往往就是机会所在,不经意间,一些向好的因素已在悄然出现。比如,稳增长措施持续落地、经济企稳的概率在提升,央行8月25日的双降显示了我国货币政策的独立性也为"811汇改"的真正目的做了最好的诠释和佐证,国内无风险利率持续走低,美国加息预期减弱等等,最为重要的因素在于,经过本轮快速下跌,已经有一批优秀公司的估值降至合理水平,具备了中长期配置的价值。市场也悄然从九月初开始了反弹。

报告期内,本基金对市场下跌的速度和投资者情绪的变化估计不足,未能及时控制好仓位,造成较大回撤;但在8月底市场最悲观的时候并未盲目悲观,而是精选了一批优质的成长股进行了增持,在9月份取得了不错的效果。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为-26.57%,同期业绩比较基准收益率为-20.65%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前的时点,我们对未来一个季度的市场并不悲观。经济虽然依然在寻底,但企稳的概率在提升;人民币虽然依然有贬值压力,但不会形成快速贬值的预期,人民币资产依然是全球范围内最具吸引力的资产之一;改革与转型的进程纵有波折,但仍在稳步推进;投资者风险偏好虽然很难完全修复,但也很难再差,且已开始恢复;还有我们一直强调的流动性宽松并未变化,居民大类资产配置向权益类资产转移的速度虽会放缓但不会停止。中国经济和A股市场需要更多正能量。

前途虽然光明,但过程的曲折性也不能忽视。4季度,本基金将会以审慎的态度采取均衡的配置策略,包括灵活的仓位选择和多样化的风格资产。"互联网+"这类弹性标的的配置比例会低于上半年,更加偏好基本面扎实、估值合理的白马成长股。寻找真正的成长股才是长期获取超额收益的源泉。

在2015年4季度,本基金希望能为投资者带来较好的收益。

§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	3,443,097,343.22	81.63
	其中:股票	3,443,097,343.22	81.63
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	769,520,096.23	18.24
7	其他各项资产	5,333,004.32	0.13
8	合计	4,217,950,443.77	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	193,980,962.42	4.68
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,837,674,127.09	44.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	92,819,781.60	2.24
F	批发和零售业	6,895.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	60,607,335.49	1.46
H	住宿和餐饮业	31.90	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	761,066,411.99	18.36
J	金融业	156.24	0.00
K	房地产业	5,946,239.80	0.14
L	租赁和商务服务业	421,275,674.88	10.16
M	科学研究和技术服务业	2,684.70	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	48,571,380.66	1.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,145,661.25	0.51
S	综合	-	-
	合计	3,443,097,343.22	83.08

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	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	002183	怡亚通	9,311,110	404,009,062.90	9.75
2	600446	金证股份	9,754,959	247,873,508.19	5.98
3	300207	欣旺达	9,727,926	243,003,591.48	5.86
4	002169	智光电气	11,098,666	196,779,348.18	4.75
5	300113	顺网科技	3,822,363	168,107,524.74	4.06
6	300136	信维通信	5,642,195	156,683,755.15	3.78
7	002236	大华股份	4,197,813	141,928,057.53	3.42
8	300203	聚光科技	5,228,116	125,736,189.80	3.03
9	300226	上海钢联	2,199,989	116,467,417.66	2.81
10	300017	网宿科技	2,012,581	106,083,144.51	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,932,387.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	141,743.97
5	应收申购款	1,258,872.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,333,004.32

5.11.4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。

5.11.5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	002183	怡亚通	404,009,062.90	9.75	重大事项
2	600446	金证股份	247,873,508.19	5.98	重大事项

§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	2,713,768,615.65
本报告期基金总申购份额	340,021,775.24
减:本报告期基金总赎回份额	573,733,482.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,480,056,908.16

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 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;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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

8.3 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
二〇一五年十月二十六日

广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通银行股份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	广发成长优选混合
基金主代码	000214
交易代码	000214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月11日
报告期末基金份额总额	441,616,712.45份
投资目标	在深入研究的基础上,自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置,对股票、债券和货币市场工具等大类资产配置比例进行动态调整,在降低市场风险的同时追求更高收益。 (二)股票投资策略 本基金将采用成长型股票优选策略,通过定量分析与定性分析,自下而上的精选A股市场中具有持续成长潜力且估值合理的上市公司进行投资。 (三)债券投资策略 在债券投资上,本基金将坚持稳健投资原则,对各类债券品种进行配置。本基金将通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现和确认市场失衡,把握投资机会;在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下,为投资者获得稳定的收益。 (四)金融衍生品投资策略
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:50%×沪深300指数+50%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	10,921,369.85
2.本期利润	2,268,145.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0034
4.期末基金资产净值	576,857,568.80
5.期末基金份额净值	1.306

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

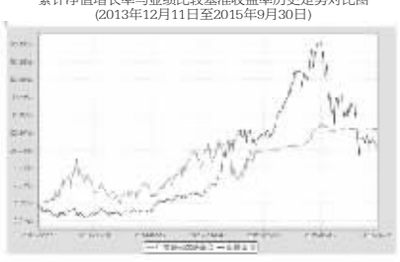
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.46%	0.09%	-12.91%	1.67%	13.37%	-1.58%

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

广发成长优选灵活配置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历史走势对比图

(2013年12月11日至2015年9月30日)



§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		
代宇	本基金的基金经理;广发聚利债券基金的基金经理;广发聚财信用债券基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理;广发聚利一年定期开放债券基金的基金经理;广发聚惠混合基金的基金经理;广发安泰回报混合基金的基金经理;广发安心回报混合基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理	2015-02-17	-	10年	女,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书,2005年7月至2011年6月先后任广发基金管理有限公司固定收益部研究员及交易员、国际业务部研究员、机构投资部专户投资经理,2011年7月调入固定收益部任投资人员,2011年8月5日起任广发聚利债券基金的基金经理,2012年3月13日起任广发聚财信用债券基金的基金经理,2013年6月5日至2015年7月23日任广发聚鑫债券基金的基金经理,2013年6月21日起任广发集利一年定期开放债券基金的基金经理,2015年2月17日起任广发成长优选混合基金的基金经理,2015年4月15日起任广发聚惠混合基金的基金经理,2015年5月14日起任广发安泰回报混合基金和广发安心回报混合基金的基金经理,2015年5月27日起任广发双债添利债券基金的基金经理。
王小松	本基金的基金经理;广发策略优选混合基金的基金经理;广发内需增长混合基金的基金经理	2015-02-17	-	8年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书。自2007年7月至2009年9月在联合证券有限责任公司投资银行总部从事投行业务,2009年10月至2013年5月先后在华泰联合证券有限责任公司和国联安基金管理有限公司任研究员,2013年6月起加入广发基金管理有限公司,先后在研究发展部和权益投资一部任研究员,2014年12月24日起任广发策略优选混合基金的基金经理,2015年2月17日起任广发成长优选混合基金的基金经理,2015年6月13日起任广发内需增长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、《广发成长优选灵活配置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,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。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

三季度,各项经济指标依然未见起色,宏观经济继续疲软。尽管政府一直采取积极的财政政策和宽松的货币政策应对,但是从其政策目标来看,可能更多是防止下滑失速,而非刺激经济复苏。人民币贬值作为导火索,导致股市再次大幅下跌。

三季度,流动性继续保持充裕,资金从股市向债市回流,推升债券资产价格。因此本基金保持很低的股票持仓,重点配置了债券等资产。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为0.46%,同期业绩比较基准收益率为-12.91%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管股市经过两轮调整已回落到较低的位置,但是经济基本面依然没有改善的迹象,市场情绪修复也需要时间,因此四季度市场可能会震荡,出现趋势性机会概率偏小。

本基金会维持现在的配置策略,重点配置债券资产,也会重点关注股票市场下跌后出现的一些投资机会。我们会继续做好流动性管理,控制风险,以期获得更好的绝对回报。

§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	8,666,319.26	1.49
	其中:股票	8,666,319.26	1.49
2	固定收益投资	492,359,676.40	84.67
	其中:债券	492,359,676.40	84.67
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	72,000,588.00	12.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,091,042.08	0.36
7	其他各项资产	6,412,671.73	1.10
8	合计	581,530,297.47	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	2,135.16	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	35,398.74	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,297.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,421.12	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,168.71	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	949.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,591,948.75	1.49
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,666,319.26	1.50

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	600763	通策医疗	116,501	8,591,948.75	1.49
2	300451	创业软件	83	8,873.53	0.00
3	300467	迅游科技	104	5,675.28	0.00
4	300437	清水源	91	5,270.72	0.00
5	002758	华通医药	94	4,990.86	0.00
6	300469	信息发展	96	4,900.80	0.00
7	300452	山河药辅	71	4,451.70	0.00
8	300480	光力科技	63	3,277.26	0.00
9	300458	全志科技	42	3,234.00	0.00
10	603023	威帝股份	119	3,110.66	0.00

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	-	-
3	金融债券	300,203,398.40	52.04
	其中:政策性金融债	300,203,398.40	52.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	139,983,000.00	24.27
6	中期票据	50,920,000.00	8.83
7	可转债	1,253,278.00	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	492,359,676.40	85.35

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

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	150213	15国开13	2,000,000	203,440,000.00	35.27
2	011523004	15大唐SCP004	900,000	89,973,000.00	15.60
3	101561007	15国电集MTN002	500,000	50,920,000.00	8.83
4	150417	15农发17	500,000	50,290,000.00	8.72
5	011512004	15华能SCP004	500,000	50,010,000.00	8.67

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	216,008.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,186,563.98
5	应收申购款	10,099.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,412,671.73

5.11.4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。

5.11.5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	600763	通策医疗	8,591,948.75	1.49	重大事项
2	300467	迅游科技	5,675.28	0.00	重大事项

§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	1,421,628,444.32
本报告期基金总申购份额	30,815,188.35
减:本报告期基金总赎回份额	1,010,826,920.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	441,616,712.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.广发基金管理有限公司开放式基金业务规则;

4.《广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5.法律意见书;

6.基金管理人业务资格批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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

8.3 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
二〇一五年十月二十六日

广发纯债债券型证券投资基金

【2015】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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份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