

广发轮动配置混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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1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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，但不保证基金一定盈利。
本基金过往业绩并不代表未来表现。投资人投资有风险，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。

本报告期自2015年10月1日起至12月31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
基金合同生效日	契约型开放式 2013年6月28日
报告期末基金份额总额	997,022,066.89份

投资目标 通过对国民经济运行中的行业特征，通过大类资产配置及行业轮动调整，挖掘相应的投资机会，为投资者创造长期稳定的资产增值。

在投资策略上，坚持配置稳定性与配置灵活性并重，既配置受益于经济和通胀的行业及个股，也关注经济周期变化对行业及个股的影响，把握经济运行中行业板块轮动之机，积极寻找和把握行业的阶段性变化机会，把握经济运行中行业板块轮动之机，同时精选个股，挖掘具有持续成长性的个股。

投资策略 本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、商品期货、商品期权、股票期权、权证及其他金融工具。

业绩比较基准 99%×沪深300指数+2%×中债全债指数

风险收益特征 本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币型基金、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 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

序号	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	797,458,024.70	51.28	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	62,198,964.90	4.00	-
F 批发和零售业	15,615,130.64	1.00	-
G 交通运输、仓储和邮政业	100,993,470.63	6.49	-
H 餐饮和住宿业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	258,439,266.58	16.62	-
J 金融业	-	-	-
K 房地产业	47,463,036.00	3.06	-
L 租赁和商务服务业	51,020,892.30	3.28	-
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	14,621,689.02	0.94	-
R 文化、体育和娱乐业	38,836,146.60	2.50	-
S 综合	27,729,696.06	1.78	-
合计	1,414,376,316.33	90.06	-

6.2.2报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票。

6.3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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600033	曙光股份	6,317,452	0.42
2	300078	康耐恩	1,514,877	0.75
3	300113	超图软件	708,002	0.28
4	002466	天宝实业	445,433	0.03
5	600029	南航航空	6,866,900	0.38
6	600264	天房发展	665,609	0.04
7	300022	聚光科技	1,688,968	0.53
8	002183	贝亚特	1,107,705	0.40
9	600666	慧博科技	1,817,623	0.65
10	600945	中航股份	1,158,200	0.43

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

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130005	13国开05	153,964,734.01	-
2	130004	13国开04	342,561,326.96	-
3	130002	13国开02	1,566,162,368.78	-
4	130001	13国开01	1,753	-

注:1)所列基金投资组合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。
2)期末现金头寸未持有按公允价值计算的货币资金,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 中国工商银行股份有限公司

§ 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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-	153,964,734.01	
2.本期利润	-	342,561,326.96	
3.加权平均基金份额本期利润	0.03620		
4.期末基金份额净值	1.656,162,368.78		

5.1报告期末基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票。

5.2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组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票。

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债券投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的债券。

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按行业分类的债券。

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

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130005	13国开05	153,964,734.01	-
2	130004	13国开04	342,561,326.96	-
3	130002	13国开02	1,566,162,368.78	-
4	130001	13国开01	1,753	-

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组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的资产支持证券。

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十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的贵金属。

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十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的保险。

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证券投资基金组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的证券投资基金。

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股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票。

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债券投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的债券。

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资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的资产支持证券。

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贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的贵金属。

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保险投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的保险。

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证券投资基金组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的证券投资基金。

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股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票。

5.17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债券投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的债券。

5.18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组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的资产支持证券。

5.19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组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的贵金属。

5.20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组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的保险。

5.21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证券投资基金组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的证券投资基金。

5.22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组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的股票。

5.23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债券投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的债券。

5.24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组合