

## 广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

## [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

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。

基金从业人员承诺:本人已阅读并理解基金合同的规定,于2016年1月15日复核了本基金报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息,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。

报告期间中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称:广发对冲套利

基金主代码:000992

交易代码:000992

基金运作方式:契约型开放式,本基金以定期开放式运作,本基金为定期开放式

基金合同生效日:2015年2月6日

报告期末基金份额总额:1,712,656,632.15份

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,791,270.61	1.02%
R	建筑业	16,609,025.14	0.98%
F	批发和零售业	16,696,149.80	0.98%
G	交通运输、仓储和邮政业	17,225,569.93	0.89%
H	住宿和餐饮业	127,003.00	0.01%
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,638,943.84	0.50%
J	金融业	142,817,870.70	7.38%
K	房地产业	24,676,066.99	1.28%
L	租赁和商务服务业	7,023,614.00	0.36%
M	科学研究和技术服务业	10,302,212.00	0.01%
N	水利、环境和公共设施管理业	16,206.20	0.00%
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	21,657,943.97	1.12%
S	综合	1,004,806.00	0.06%
合计		436,522,493.24	22.67%

## 5.2 报告期末按照行业分类的境内股票投资股票投资组合

本基金追求绝对回报的对冲收益,在有效控制风险的基础上,通过量化模型和基本面投资相结合,对市场进行动态配置,力争实现超越行业平均水平的投资回报。

投资目标:力争在扣除一定的管理费用后,实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略:本基金主要采用对冲套利的运作模式,主要采用向绝对收益的市场中性策略,与量化模型相结合,相辅相成,从而获得超额的绝对收益,同时通过量化模型,在有效控制风险的基础上,通过量化模型和基本面投资相结合,对市场进行动态配置,力争实现超越行业平均水平的投资回报。

业绩比较基准:本基金为绝对收益的市场中性策略基金,因此本基金的业绩比较基准为沪深300指数\*60%+国债收益率\*40%。

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

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 9,567,831.14

2.期初利润 17,301,391.22

3.3权平均基金份额本期利润 0.0063

4.期末基金资产净值 1,934,578,076.05

5.期末基金份额净值 1.130

(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,本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金份额表现情况

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(%) 准净值(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.08% 0.06% -0.40% 0.00% 0.06% 0.05%

3.2.2 日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的历史走势对比图(2015年2月6日至2015年12月31日)

注:(1)本基金合同生效日期为2015年2月6日,至披露时基金成立未满一年。

(2)本基金合同为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

任本基金的基金经理 证券从业年限

辞职日期 离任日期

说明

钟伟 基金的基本管理制度和基金的核算

2015-2-6 - 6年

男,中国籍,数学博士,持有中国证券投资基金业从业证书,2009年7月至2013年11月先后在广发基金管理有限公司任职,2013年11月起在广发基金管理有限公司任职,现任广发基金管理有限公司基金经理,同时兼任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理和广发对冲套利定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1)“任职日期”和“离任日期”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《证券业从业人员执业行为准则》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本公司内部禁止不同部门组合之间(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)或同一组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对应大额赎回等特殊情形需要进行反向交易的,则需经公司领导层审批并报备基金。

4.2.2 公平交易制度的执行情况

4.2.3 公平交易制度的执行情况

4.2.4 公平交易制度的执行情况

4.2.5 公平交易制度的执行情况

4.2.6 公平交易制度的执行情况

4.2.7 公平交易制度的执行情况

4.2.8 公平交易制度的执行情况

4.2.9 公平交易制度的执行情况

4.2.10 公平交易制度的执行情况

4.2.11 公平交易制度的执行情况

4.2.12 公平交易制度的执行情况

4.2.13 公平交易制度的执行情况

4.2.14 公平交易制度的执行情况

4.2.15 公平交易制度的执行情况

4.2.16 公平交易制度的执行情况

4.2.17 公平交易制度的执行情况

4.2.18 公平交易制度的执行情况

4.2.19 公平交易制度的执行情况

4.2.20 公平交易制度的执行情况

4.2.21 公平交易制度的执行情况

4.2.22 公平交易制度的执行情况

4.2.23 公平交易制度的执行情况

4.2.24 公平交易制度的执行情况

4.2.25 公平交易制度的执行情况

4.2.26 公平交易制度的执行情况

4.2.27 公平交易制度的执行情况

4.2.28 公平交易制度的执行情况

4.2.29 公平交易制度的执行情况

4.2.30 公平交易制度的执行情况

4.2.31 公平交易制度的执行情况

4.2.32 公平交易制度的执行情况

4.2.33 公平交易制度的执行情况

4.2.34 公平交易制度的执行情况

4.2.35 公平交易制度的执行情况

4.2.36 公平交易制度的执行情况

4.2.37 公平交易制度的执行情况

4.2.38 公平交易制度的执行情况

4.2.39 公平交易制度的执行情况

4.2.40 公平交易制度的执行情况

4.2.41 公平交易制度的执行情况

4.2.42 公平交易制度的执行情况

4.2.43 公平交易制度的执行情况

4.2.44 公平交易制度的执行情况

4.2.45 公平交易制度的执行情况

4.2.46 公平交易制度的执行情况

4.2.47 公平交易制度的执行情况

4.2.48 公平交易制度的执行情况

4.2.49 公平交易制度的执行情况

4.2.50 公平交易制度的执行情况

4.2.51 公平交易制度的执行情况

4.2.52 公平交易制度的执行情况

4.2.53 公平交易制度的执行情况

4.2.54 公平交易制度的执行情况

4.2.55 公平交易制度的执行情况

4.2.56 公平交易制度的执行情况

4.2.57 公平交易制度的执行情况

4.2.58 公平交易制度的执行情况

4.2.59 公平交易制度的执行情况

4.2.60 公平交易制度的执行情况

4.2.61 公平交易制度的执行情况

4.2.62 公平交易制度的执行情况

4.2.63 公平交易制度的执行情况

4.2.64 公平交易制度的执行情况

4.2.65 公平交易制度的执行情况

4.2.66 公平交易制度的执行情况

4.2.67 公平交易制度的执行情况

4.2.68 公平交易制度的执行情况

4.2.69 公平交易制度的执行情况

4.2.70 公平交易制度的执行情况

4.2.71 公平交易制度的执行情况

4.2.72 公平交易制度的执行情况

4.2.73 公平交易制度的执行情况

4.2.74 公平交易制度的执行情况

4.2.75 公平交易制度的执行情况

4.2.76 公平交易制度的执行情况

4.2.77 公平交易制度的执行情况

4.2.78 公平交易制度的执行情况

4.2.79 公平交易制度的执行情况

4.2.80 公平交易制度的执行情况

4.2.81 公平交易制度的执行情况

4.2.82 公平交易制度的执行情况

4.2.83 公平交易制度的执行情况

4.2.84 公平交易制度的执行情况

4.2.85 公平交易制度的执行情况

4.2.86 公平交易制度的执行情况

4.2.87 公平交易制度的执行情况

4.2.88 公平交易制度的执行情况

4.2.89 公平交易制度的执行情况

4.2.90 公平交易制度的执行情况

4.2.91 公平交易制度的执行情况