广发策略优选混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	2,414,280,370.06份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	洪源
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-83899158	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	3,123,107,011.06	686,788,114.99	303,056,466.81
本期利润	2,781,544,324.69	639,981,574.29	465,577,837.79
加权平均基金份额本期利润	0.9204	0.1284	0.0761
本期基金份额净值增长率	44.06%	10.37%	6.21%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	1.1361	0.4211	0.2749
期末基金资产净值	5,157,238,860.92	6,193,621,071.17	7,383,216,904.24
期末基金份额净值	2.1361	1.4829	1.3436

注:(1)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。

(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(不含公允价值变动损益)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)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

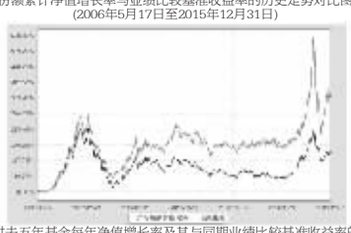
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.83%	2.14%	13.05%	1.25%	14.78%	0.89%
过去六个月	-6.14%	3.37%	-11.09%	2.01%	4.95%	1.36%
过去一年	44.06%	3.04%	6.37%	1.86%	37.68%	1.18%
过去三年	68.85%	2.00%	41.27%	1.34%	27.58%	0.66%
过去五年	36.86%	1.69%	17.98%	1.21%	18.88%	0.48%
自基金合同生效起至今	359.31%	1.73%	145.94%	1.45%	213.37%	0.28%

注:1、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"。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

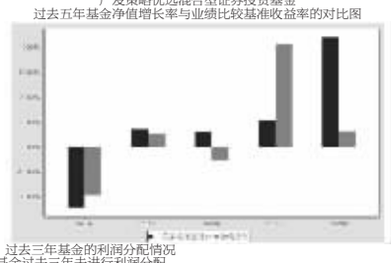
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发策略优选混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年5月17日至2015年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发策略优选混合型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准,于2003年8月5日成立,注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和24个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外,还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司,参股了证通股份有限公司。

截至2015年12月31日,本基金管理人管理八十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发聚优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发安信合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发康康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金,管理资产规模为3300.24亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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,持有中国证券投资基金业从业证书,2006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,持有中国证券投资基金业从业证书,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 管理人对投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,为基金份额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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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,超过授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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则;对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息,对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释;公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析,未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况,表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年注定是中国资本市场值得铭记的一年,全年A股主要指数,先涨后跌,大幅波动。从1月到6月前半月,A股持续上涨且涨幅惊人;但从6月中旬开始,直至9月初,A股持续快速下跌,历经两次"股灾",杀伤力巨大,跌幅最大的创业板指在三个月内跌幅超过50%;9月中旬之后的市场逐步恢复平稳,出现一波幅度向可的反弹。全年,上证综指、深证成指、中小板指和创业板指涨幅分别为9.41%、14.98%、53.7%和84.41%。

宏观经济在2015年全年延续了过去几年的疲弱走势,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,经济震荡寻底的过程仍未结束。如此宏观背景下,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。与此形成鲜明对比的是,以互联网、新型生物技术、环保、工业4.0为代表的各类新兴行业,呈现出很高的景气度,无论在一级市场还是二级市场都迸发出极大活力,并形成明显赚钱效应。配合央行宽松的货币政策带来的全社会无风险利率下行,以及房地产大周期拐点到来后,居民大类资产配置向权益类资产转移的快速推进,A股有增量资金明显涌入。截至6月初,以创业板为代表的A股指数涨幅惊人,其中创业板最高涨幅达到174%,以传统制造业和周期性行业为主的主板指数,虽然其主要成分股基本面一般,但也因为积极转型、拥抱新经济,获得了不小的涨幅,上证综指的最高涨幅也达到了60%。经过前五个月的快速上涨以后,A股市场已经形成了较大泡沫,无论是基本面偏弱的传统行业,还是景气度高但过去两年涨幅巨大的新兴行业;另外一个可怕的变化是,A股投资者的杠杆率水平在该时点已经达到了较高的水平。估值严重泡沫化叠加监管部门在5月底、6月初开始强势规范场外配资等杠杆行为引发了A股在二季度后期的下跌,并延续到整个三季度大部分时间里,下跌速度之快、幅度之大实属罕见。时至8月底,市场的悲观情绪已经非常严重,投资者的杠杆率和风险偏好下降非常快,中国经济及资本市场崩溃论不绝于耳。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。"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,国内无风险利率持续走低等。最为重要的是,经过3季度的快速下跌,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9月初开始了反弹,10月和11月则延续了之前的反弹趋势,十八届五中全会对"创新"的强调更是指明了中国经济转型和改革的方向,推动了以创业板为代表的新兴行业的进一步反弹。12月受不确定因素增多的影响,A股整体呈盘整状态。

报告期内,本基金坚持以中小市值成长股为主要配置方向,积极参与到各种新兴行业和主题类投资中,在上半年获得了较好收益;但在市场出现拐点时,未能及时进行调整组合仓位和结构,净值出现大幅回撤;所幸在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增持,在后续的反弹中取得不错的效果。

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44.05%,同期业绩比较基准收益率为6.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点,我们虽然认为2016年的市场仍会有较大震荡,但无需过分悲观。经济虽然依然在寻底,但企稳的概率在提升,并不会出现系统性风险,中央政府手中的工具库依然丰富;人民币尽管依然有贬值压力,但不会形成快速贬值的预期,中国经济虽然面临诸多困难但依然是全球最具活力的经济体,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,但目前流动性宽松的程度是好于很多时候的。中国经济和A股市场需要更多正能量。

一方面,我们要对未来保持希望,但另一方面我们必须注意到,经过4季度的反弹,不少公司的估值水平又到了一个较高的水平,泡沫再次滋生;更重要的是,一些不确定的因素开始浮出水面:1)国内的供给侧改革到底会有多大影响,是否会引起不可控的债务风险;2)美联储开启加息周期后是否意味着全球流动性拐点已现;3)全球经济增长乏力,新增长点不足,量宽的货币政策能否对经济恢复增长起到真正的作用;4)联动性日益增强的今天,全球经济或全球金融市场也日益脆弱,是否又会出现新的黑天鹅。

或许我们应以更审慎、中性的态度面对A股市场,不要过多的沉溺于过去一年暴涨暴跌的大喜大悲中。新的一年中,本基金重点配置的方向主要是:1)分红收益率高的蓝筹;2)业绩增长确定、市盈率合理的白马成长股;3)积极转型新兴产业的中小市值公司。寻找真正的成长股才是长期获取超额收益的源泉。

在2016年,本基金希望能为投资者带来较好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会,按照相关法律法规和证监会的相关规定,负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法,经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素,向估值委员会提出估值建议,确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查,确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体流程,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议,由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中"基金收益与分配"之"(三)基金收益分配原则"的相关规定,本基金本年度未进行利润分配,符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对广发策略优选混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,广发策略优选混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发策略优选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,广发策略优选混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发策略优选混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第P0721号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:广发策略优选混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	467,756,623.42	552,512,060.25
结算备付金	33,726,931.88	11,103,800.83
存出保证金	3,336,237.17	1,145,603.27
交易性金融资产	4,738,028,192.43	5,795,926,382.56
其中:股票投资	4,738,028,192.43	5,785,750,382.56
基金投资	-	-
债券投资	-	10,176,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	27,901,416.96
应收利息	130,016.30	113,053.22
应收股利	-	-
应收申购款	524,716.08	1,281,045.46
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,243,500,717.28	6,389,983,362.55
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	49,759,946.21	149,609,876.02
应付赎回款	3,697,237.98	28,289,998.14
应付管理人报酬	6,602,035.41	8,290,355.41
应付托管费	1,100,339.24	1,381,725.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	24,752,905.16	8,069,823.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,392.36	720,512.03
负债合计	86,261,856.36	196,362,291.38
所有者权益:	-	-
实收基金	2,414,280,370.06	4,176,736,653.94
未分配利润	2,742,958,490.86	2,016,884,417.23
所有者权益合计	5,157,238,860.92	6,193,621,071.17
负债和所有者权益总计	5,243,500,717.28	6,389,983,362.55

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值人民币2.1361元,基金份额总额2,414,280,370.06份。

7.2 利润表

会计主体:广发策略优选混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	2,961,421,683.80	785,499,581.78
1.利息收入	5,234,775.14	5,465,701.02
其中:存款利息收入	5,232,767.82	4,362,731.99
债券利息收入	2,007.32	1,102,969.03
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,296,243,056.72	826,627,454.70
其中:股票投资收益	3,279,596,917.21	783,084,770.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,031,585.33	-10,143,835.40
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	12,614,554.18	53,686,519.84
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-341,562,686.37	-46,806,540.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,506,538.31	212,966.76
减:二、费用	179,877,359.11	145,518,007.49
1、管理人报酬	91,272,052.23	100,451,460.02
2、托管费	15,212,008.78	16,741,909.99
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	72,962,392.88	27,881,552.32
5、利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	430,905.22	436,085.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,781,544,324.69	639,981,574.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,781,544,324.69	639,981,574.29

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发策略优选混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,176,736,653.94	2,016,884,417.23	6,193,621,071.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,781,544,324.69	2,781,544,324.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,762,456,283.88	-2,055,470,251.06	-3,817,926,534.94
其中:1.基金申购款	573,557,628.16	585,146,575.34	1,158,704,203.50
2.基金赎回款	-2,336,013,912.04	-2,640,616,826.40	-4,976,630,738.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,414,280,370.06	2,742,958,490.86	5,157,238,860.92
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,495,270,935.05	1,887,945,969.19	7,383,216,904.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	639,981,574.29	639,981,574.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,318,534,281.11	-511,043,126.25	-1,829,577,407.36
其中:1.基金申购款	129,506,067.04	47,234,578.15	176,740,645.19
2.基金赎回款	-1,448,040,348.15	-558,277,704.40	-2,006,318,052.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,176,736,653.94	2,016,884,417.23	6,193,621,071.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:王志伟,主管会计工作负责人:窦刚,会计机构负责人:张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发策略优选混合型证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员("中国证监会")证监基金字[2006]72号《关于同意广发策略优选混合型证券投资基金募集的批复》批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2006年5月17日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金已向中国证监会备案,并获中国证监会基金部函[2006]103号《关于广发策略优选混合型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2006年5月8日至2006年5月15日,本基金为契约型开放式混合型基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币18,417,976,676.64元,有效认购户数为296,219户。其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币1,560,143.78元,利息结转的基金份额1,560,143.78份,按照基金合同的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于2006年5月17日生效,基金合同生效日的基金份额总额为18,417,976,676.64份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金自2013年1月17日起,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"。

本基金的财务报表于2016年3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称"企业会计准则")和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),本基金自2015年3月17日起,对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,估值处理标准另有规定的除外。于2015年3月17日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,其中股权登记日在2015年9月8日之前的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日之后的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股