

广发轮动配置混合型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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，并对内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2016年4月19日复核了本报中的财务指标、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。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

报告书中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3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	000017
交易代码	000017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月20日
报告期末基金份额总额	708,304,392.95份

报告期末基金份额总额

根据本基金合同中不同的投资组合，通过大类资产配置及行业轮动配置，根据相对的投资组合，对资产配置、投资策略、经济衰退和萧条等宏观经济波动的冲击，为投资者提供相对稳定的回报。

投资目标 在经济上升周期加仓配置，由配比收益型、经济波动型的行业及个股；在经济下降周期降低股票配置，将股票配置相对固定和均衡的行业及个股，从而降低组合的波动性，为投资者提供相对稳定的回报。

投资策略 在不同行业之间进行轮动配置，通过行业轮动配置股票型基金，实现基金资产的定期轮动。

业绩比较基准 80%×沪深300指数+20%×中债全债指数

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金，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

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 -167,616,426.20

2.本期利润 -303,236,999.00

3.加权平均基金份额本期利润 -0.3613

4.期末基金资产净值 1,119,654,444.77

5.期末基金份额净值 1.423

注:1) 所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) 本期实现收益指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益(扣除相关费用后的余额)、本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本基金本期份额净值增长率及其同期间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 收益率差值④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.02% 3.24% -10.76% 1.94% -8.07% 1.30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

广发轮动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5月20日至2016年3月31日)

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

吴兴武 基金经理、广发轮动配置混合型基金的基金经理 2015-02-12 - 7年

注:1.“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的年限从行业协会、证券从业人员资格管理平台的有关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

本报告期内基金运作指标符合基金合同的规定。

4.3 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

为评估，保证公平交易的原则。

在投资决策的制衡机制方面，公司制度规定投资决策的必要须来源于各投资部门。重点投资的股

票必须来自基金经理，公司建立了严格的投资决策制度，投资决策在公司内部实行严格控制。

从定期报告上来看，由于经历了一季度的剧烈波动和分化的期间，目前市场处于相对平衡状态，主要特征

体现在股市对美联储加息、国内经济数据等高频利好或利空因素反应较为敏感，波动节奏较快，但是幅度

相对较小，整体波动性较小，基金经理在操作上以规避风险、降低成本、增加收益为目标。

本报告期内，本基金净值呈现阶段性的波动，但整体波动

幅度较小，整体表现良好，不同的投资组合受到公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.4 异常交易行为的专项说明

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

为评估，保证公平交易的原则。

在投资决策的制衡机制方面，公司制度规定投资决策的必要须来源于各投资部门。重点投资的股

票必须来自基金经理，公司建立了严格的投资决策制度，投资决策在公司内部实行严格控制。

从定期报告上来看，由于经历了一季度的剧烈波动和分化的期间，目前市场处于相对平衡状态，主要特征

体现在股市对美联储加息、国内经济数据等高频利好或利空因素反应较为敏感，波动节奏较快，但是幅度

相对较小，整体波动性较小，基金经理在操作上以规避风险、降低成本、增加收益为目标。

本报告期内，本基金净值呈现阶段性的波动，但整体波动

幅度较小，整体表现良好，不同的投资组合受到公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 2,404,806.12

2.本期利润 8,019,599.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.00961

4.期末基金资产净值 178,767,323.55

5.期末基金份额净值 1.224

注:1) 本期已实现收益指基金利息收入、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，其余部分为本期利润。

2) 上述基金的类别指股票型基金。

3) 本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

4.1 报告期内基金管理人运用固有资金进行投资的情况。

5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资的情况

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 2,404,806.12

2.本期利润 8,019,599.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.00961

4.期末基金资产净值 178,767,323.55

5.期末基金份额净值 1.224

注:1) 本期已实现收益指基金利息收入、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，其余部分为本期利润。

2) 上述基金的类别指股票型基金。

3) 本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

4.1 报告期内基金管理人运用固有资金进行投资的情况。

5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资的情况

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 2,404,806.12

2.本期利润 8,019,599.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.00961

4.期末基金资产净值 178,767,323.55

5.期末基金份额净值 1.224

注:1) 本期已实现收益指基金利息收入、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，其余部分为本期利润。

2) 上述基金的类别指股票型基金。

3) 本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

4.1 报告期内基金管理人运用固有资金进行投资的情况。

5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资的情况

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 2,404,806.12

2.本期利润 8,019,599.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.00961

4.期末基金资产净值 178,767,323.55

5.期末基金份额净值 1.224

注:1) 本期已实现收益指基金利息收入、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，其余部分为本期利润。

2) 上述基金的类别指股票型基金。

3) 本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

4.1 报告期内基金管理人运用固有资金进行投资的情况。

5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资的情况

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 2,404,806.12

2.本期利润 8,019,599.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.00961

4.期末基金资产净值 178,767,323.55

5.期末基金份额净值 1.224

注:1) 本期已实现收益指基金利息收入、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，其余部分为本期利润。

2) 上述基金的类别指股票型基金。

3) 本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

4.1 报告期内基金管理人运用固有资金进行投资的情况。

5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资的情况

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年1月1日-2016年3月31日) 上期金额

1.本期已实现收益 2,404,806.12

2.本期利润 8,019,599.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.00961

4.期末基金资产净值 178,767,323.55

5.期末基金份额净值 1.224

注:1) 本期已实现收益指基金利息收入、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，其余部分为本期利润。

2) 上述基金的类别指股票型基金。

3) 本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

4.1 报告期内基金管理人运用固有资金进行投资的情况。

5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资的情况

单位:人民币元