

广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金

[2017]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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事及监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，并对其实质性、准确性、完整性和客观性承担个别连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月20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，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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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	-	0.00
B	采矿业	266,214,940.00	6.07%
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,386,060.00	0.27%
D	建筑业	212,432.00	0.04%
E	批发和零售业	43,784,030.00	0.98%
F	交通运输、仓储和邮政业	131,214.00	0.03%
G	住宿和餐饮业	-	0.00%
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00%
I	金融业	-	0.00%
J	房地产业	-	0.00%
K	租赁和商务服务业	-	0.00%
L	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	0.00%
M	水利、环境和公共设施管理业	16,930.00	0.00%
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00%
O	卫生、体育和社会福利业	-	0.00%
P	教育	-	0.00%
Q	卫生和社会工作	-	0.00%
R	文化、体育和娱乐业	16,200,000.00	3.28%
S	综合	-	0.00%
合计		304,811,123.00	6.93%

5.2.2报告期未按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	000667	通化东宝	1,069,937	34,722,715.00	0.60%
2	000002	鞍钢股份	1,000,000	30,400,000.00	0.53%
3	000000	中国石化	1,000,000	27,200,000.00	0.47%
4	000661	中航资本	280,000	20,400,000.00	0.36%
5	000887	伊利股份	1,100,000	20,300,000.00	0.35%
6	000929	首钢股份	2,400,000	19,350,000.00	0.34%
7	000002	平高电气	82,769	17,051,361.04	0.34%
8	000961	九州通	109,965	17,054,616.02	0.34%
9	000075	韶能股份	1,030,000	15,086,200.00	0.30%
10	000023	深天地A	200,000	10,000,000.00	0.18%
合计			5,100,000	119,013,000.00	22.03%

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	面值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-	0.00%
2	地方政府债	-	-	0.00%
3	企业债	109,504,000.00	109,504,000.00	20.01%
4	公司债	109,504,000.00	109,504,000.00	20.01%
5	中期票据	-	-	0.00%
6	企业短期融资券	-	-	0.00%
7	超短期融资券	-	-	0.00%
8	同业存单	-	-	0.00%
9	其他	-	-	0.00%
10	合计	209,008,000.00	209,008,000.00	40.02%

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	面值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	10国开01	900,000	89,546,000.00	16.00%
2	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
3	100002	10国开01	700	79,000.00	0.01%
4	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
5	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
6	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
7	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
8	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
9	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
10	100002	10国开01	200,000	19,880,000.00	3.80%
合计			1,000,000	209,008,000.00	40.02%

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

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	000002	10国开01	900,000	16.00%	
2	100002	10国开01	200,000	3.80%	
3	100002	10国开01	700	0.01%	
4	100002	10国开01	200,000	3.80%	
5	100002	10国开01	200,000	3.80%	
6	100002	10国开01	200,000	3.80%	
7	100002	10国开01	200,000	3.80%	
8	100002	10国开01	200,000	3.80%	
9	100002	10国开01	200,000	3.80%	
10	100002	10国开01	200,000	3.80%	
合计			1,000,000	209,008,000.00	40.02%

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
2	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
3	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
4	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
5	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
6	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
7	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
8	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
9	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
10	广发基金管理有限公司	100,000.00	0.00%
合计		1,000,000.00	0.00%

5.8 报告期内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	000667	通化东宝	1,069,937	34,722,715.00	0.60%
2	000002	鞍钢股份	1,000,000	30,400,000.00	0.53%
3	000000	中国石化	1,000,000	27,200,000.00	0.47%
4	000661	中航资本	280,000	20,400,000.00	0.36%
5	000887	伊利股份	1,100,000	20,300,000.00	0.35%
6	000929	首钢股份	2,400,000	19,350,000.00	0.34%
7	000002	平高电气	82,769	17,051,361.04	0.34%
8	000961	九州通	109,965	17,054,616.02	0.34%
9	000075	韶能股份	1,030,000	15,086,200.00	