广发核心精选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:中国工商银行股份有限公司
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。

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

基金简称	广发核心精选混合
基金主代码	270008
交易代码	270008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月16日
报告期末基金份额总额	578,814,537.07份
投资目标	通过认真、细致的宏观研究,合理配置股票、债券、现金等资产。应用"核心—卫星"投资策略,投资于具有较高投资价值的股票;在利率合理预期的基础上,进行久期管理,稳健地投资于债券市场。在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用"核心—卫星"的投资策略,在沪深300指数成分股及其备选成分股中精选成长性较强、质地优良,投资价值高的股票构成"核心股票",本基金将较长时间的持有核心股票,直到该股票市场价格超过合理价值。一般情况下,本基金持有的"核心股票"的市值不低于本基金股票市值的80%。
业绩比较基准	80%*沪深300指数+20%*上证国债指数。
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、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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-3,914,747.79
2.本期利润	137,094,866.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.2880
4.期末基金资产净值	1,867,019,046.39
5.期末基金份额净值	3.226

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

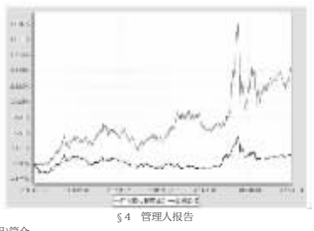
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.91%	0.95%	3.58%	0.41%	6.33%	0.54%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

广发核心精选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

(2008年7月16日至2017年3月31日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴兴武	本基金的基金经理;广发轮动配置混合基金的基金经理	2015-02-17	-	8年	男,中国籍,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,自2009年7月至2010年7月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任职,从事上市公司及行业研究工作,2010年7月20日至2015年2月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和权益投资一部任研究员,2015年2月12日起任广发轮动配置混合基金的基金经理,2015年2月17日起任广发核心精选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 管理人对报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、《广发核心精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 公平交易专项说明

4.3.1 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,超过授资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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(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)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场走势较为明确的延续了去年的主线:第一条是消费,另一条是国内外基建。面对消费类板块的投资机会,基金经理认可逻辑上行业向好的判断,但是较难找到切实完整的证照,因此总体上采取了谨慎参与的策略。基建板块的上涨是大主题结合市场风格叠加的结果,基金经理没有抓到触发主题形成和评估持续程度的脉络,因此基本没有参与。

各类投资机会都需要大量的精力去研究,并配合深入的思考,才能做到可重复的善始善终。本基金更加关注和寻找能够把握和可以复制的投资机会,错过某类投资机会固然需要反思,但对基金净值而言也并非是不可弥补的损失。在这样的逻辑框架下,基金经理选择了可能具备同样涤烦的优质股票作为核心持仓,在一季度获得了较为良好的净值回报。

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9.91%,同期业绩比较基准收益率为3.58%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,本基金认为消费蓝筹的行情可能还能持续一段时间,但是拉长来看,真正的成长股机会更大。一些优质成长股的估值已经调整到合理水平,这部分成长股未来会有较好表现。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,632,650,085.54	83.47
	其中:股票	1,632,650,085.54	83.47
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	310,410,066.75	15.87
7	其他各项资产	12,815,748.46	0.66
8	合计	1,955,875,900.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,919,220.00	0.16
B	采矿业	22,263,181.30	1.19
C	制造业	1,441,209,054.09	77.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,042,938.58	0.86
F	批发和零售业	8,006,559.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,688,949.41	4.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	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	57,325,213.19	3.07
S	综合	-	-
	合计	1,632,650,085.54	87.45

5.2.2报告期末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	002572	索菲亚	2,547,466	175,520,407.40	9.40
2	000820	神雾节能	4,227,556	172,864,764.84	9.26
3	300156	神雾环保	4,751,848	166,314,680.00	8.91
4	300476	胜宏科技	4,371,611	101,115,362.43	5.42
5	300136	信维通信	2,498,972	85,839,688.20	4.60
6	002530	丰东股份	2,075,925	76,477,077.00	4.10
7	002838	道恩股份	1,069,835	69,774,638.70	3.74
8	002343	慈文传媒	1,480,889	57,325,213.19	3.07
9	002217	合力泰	2,693,104	52,461,665.92	2.81
10	002045	国光电器	3,117,835	49,261,793.00	2.64

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

本基金本报告期末未持有债券。

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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	564,032.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,396.44
5	应收申购款	12,225,319.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,815,748.46

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	469,102,183.56
本报告期基金总申购份额	164,003,876.01
减:本报告期基金总赎回份额	54,291,522.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	578,814,537.07

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	31,052,690.71
本报告期买入/申购总份额	4,711,795.84
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	35,764,486.55
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.18

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2017-03-08	4,711,795.84	14,819,597.92	-
合计			4,711,795.84	14,819,597.92	

注:申购手续费1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发核心精选混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发核心精选混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发核心精选混合型证券投资基金托管协议》;

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《广发核心精选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日

广发沪港深新机遇股票型证券投资基金

[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:中国工商银行股份有限公司
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。

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

基金简称	广发沪港深股票
基金主代码	001764
交易代码	001764
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月27日
报告期末基金份额总额	1,722,216,927.04份
投资目标	本基金在深入研究的基础上,精选质地优良的境内市场股票以及香港市场股票进行投资,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为一只股票型基金,其股票投资比例占基金资产的比例不低于80%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内,本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析,合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	45%×沪深300指数收益率+45%×恒生指数收益率+10%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资于港股通标的股票,需承担汇率风险及境外市场风险。
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

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,952,620.03
2.本期利润	96,121,549.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0776
4.期末基金资产净值	1,864,955,982.18
5.期末基金份额净值	1.083

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

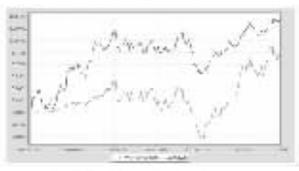
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.17%	0.80%	6.27%	0.44%	3.90%	0.36%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

广发沪港深新机遇股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年5月27日至2017年3月31日)



注:(1)本基金合同生效日期为2016年05月27日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余昊	本基金的基金经理;广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理;广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)	2016-06-07	-	7年	男,中国籍,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,2010年6月至2013年9月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和国际业务部任研究员,2013年9月10日至2014年3月25日任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理助理,2014年6月4日至2015年4月19日任国际业务部专户投资经理,2015年4月20日至2016年6月6日任国际业务部研究员,2016年6月7日起任广发沪港深股票基金的基金经理,2016年10月27日起任广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理,2017年2月28日起任广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)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 管理人对报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、《广发沪港深新机遇股票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 公平交易专项说明

4.3.1 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,超过授资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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(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)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,全球市场从特朗普当选的冲击中逐步恢复正常,新兴市场和科技板块均从负面影响中反转,美元指数跌回大选前,美国国债收益率虽有回调但仍然大幅高于大选前。经济方面,全球普遍趋势向好,美国企业盈利结束连续的季度同比下降,恢复同比上升;欧洲PMI等数据向好,同时核心国家通胀有所起色;中国受益于库存周期和设备投资周期,大部分行业数据均体现景气度大幅提高。一季度全球权益市场表现普遍不错,而香港市场由于其既受益于特朗普交易的反转,也受益于中国经济反转,因此1季度香港市场少见的领涨全球主要市场。

港股通对港股的支持作用持续体现,一方面南下每日净流入继续放量,另一方面南下资金的成交量已经占比超过10%,港股投资者结构正如管理人预期的正发生根本性的变化,未来港股有望迎来较长时间景气期,体现在港股和A股的估值体系融合,以及中国企业ROE结束多年的连续下滑实现反转。 2017年一季度,恒生指数上涨9.60%,沪深300指数上涨4.41%,中证全债指数下跌0.33%。

一季度,本基金利用十二月特朗普当选带来的新兴市场风险偏好降低的机会,提高了仓位。一季度在行业配置方面,本基金主要关注科技、金融、工业和医药。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为10.17%,同期业绩比较基准收益率为6.27%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为港股的强势不是短期的波动而是一个较长期的投资者结构改变带来的景气,但中间肯定还是有反复有波动的。二季度市场风险相较一季度提高,预期一季度的指数和个股全面上涨,会在二季度过渡到个股分化的表现。全年如果全球风险偏好下降带来的潜在港股回调,在港股通和中国经济触底的大背景下,将是较好的新的投资时点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,698,706,364.61	90.79
	其中:股票	1,698,706,364.61	90.79
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	155,501,864.82	8.31
7	其他各项资产	16,903,011.42	0.90
8	合计	1,871,111,240.85	100.00

注:权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为1,645,413,597.41元,占基金总资产比例87.94%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	-	-
C	制造业	53,267,737.68	2.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,029.52	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,292,767.20	2.86

5.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

序号	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
电信业务	79,375,705.88	4.26
非日常生活消费品	140,617,590.78	7.54
工业	164,766,153.49	8.83
公用事业	76,705,056.00	4.11
金融	348,027,937.91	18.66
能源	125,575,693.78	6.73
信息技术	236,558,126.37	12.68
医疗保健	99,388,090.50	5.33
原材料	96,924,828.37	5.20
合计	1,367,939,183.08	73.35

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

(3)通过深港通机制投资的港股公允价值为277,474,414.33元,占基金资产净值比例14.88%,未在上表中列示。

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	00700	腾讯控股	900,000	178,019,650.80	9.55
2	02628	中国人寿	6,000,000	127,042,749.00	6.81
3	00939	建设银行	18,000,000	99,876,375.00	5.36
4	00371	北控水务集团	15,000,000	76,705,056.00	4.11
5	00386	中国石油化工股份	12,000,000	67,116,924.00	3.60
6	00753	中国国航	11,000,000	61,426,190.10	3.29
7	00027	银河娱乐	1,500,000	56,663,196.75	3.04
8	02607	上海医药	3,000,000	54,199,579.50	2.91
9	00354	中国软件国际	13,000,000	51,589,476.90	2.77
10	00347	鞍钢股份	10,000,000	49,094,787.00	2.63

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

本基金本报告期末未持有债券。

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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,963,014.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	225,201.90
4	应收利息	58,517.53
5	应收申购款	656,277.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,903,011.42

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	999,268,081.81
本报告期基金总申购份额	1,078,281,750.11
减:本报告期基金总赎回份额	355,332,904.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,722,216,927.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准广发沪港深新机遇股票型证券投资基金募集的文件

(二)《广发沪港深新机遇股票型证券投资基金基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发沪港深新机遇股票型证券投资基金托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日

广发沪港深新起点股票型证券投资基金

[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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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。

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

基金简称	广发沪港深新起点股票
基金主代码	002121
交易代码	002121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
报告期末基金份额总额	586,057,296.68份
投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票,在深入研究的基础上,精选质地优良的股票进行投资,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	股票投资比例占基金资产的比例不低于80%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内,本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析,合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	45%×沪深300指数收益率+45%×恒生指数收益率+10%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资于港股通标的股票,需承担汇率风险及境外市场风险。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	17,934,077.45
2.本期利润	75,880,067.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.1279
4.期末基金资产净值	644,459,598.21
5.期末基金份额净值	1.100

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.40%	0.67%	6.27%	0.44%	7.13%	0.23%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

广发沪港深新起点股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月2日至2017年3月31日)

注:(1)本基金合同生效日期为2016年11月02日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后6个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李耀柱	本基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;广发全球农业指数(QDII)的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经