

广发制造业精选股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

1.1 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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月16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,也不保证基金净值不受亏损,投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在基金管理人处。
基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证,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。
本报告中文财务资料未经审计。
本报告日期为2014年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	广发制造业精选股票
基金代码	270028
交易代码	270028(前端)
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
跟踪标的名称	中证制造业综合指数
投资目标	通过深入研究,精选制造业中具有长期增长潜力、估值合理的上市公司股票,在严格控制风险的前提下,力求实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,本基金投资组合的比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%。本基金管理人将根据宏观经济研究对证券市场走势的判断,采用自上而下和自下而上的研究方法,动态调整行业权重,并在此基础上进行个股选择,对具有成长性的个股进行重点投资,并定期跟踪,风险控制措施完善,保证本基金资产在股票、债券和货币市场工具等各类资产配置上,资产配置不断优化。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:80%×中证制造业综合指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为股票基金,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证券市场基金、债券基金和货币基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2014年1月1日至2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-5,806,952.12
2.本期利润	-1,641,872.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.046
4.期末基金资产净值	155,181,207.68
5.期末基金份额净值	1.258

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上述数据。
(2)本期利润为本期基金本期利润减去管理人、托管人、销售机构(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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	-1.09%	1.81%	0.01%	1.37%	-1.11%
过去12个月	-1.09%	1.81%	0.01%	1.37%	-1.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发制造业精选股票型证券投资基金
基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图
(2011年9月20日至2014年3月31日)

5.3 主要财务指标和基金净值表现

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	98,362,906.37	63.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	19,018,030.60	12.31
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	1,651,500.00	1.06
O	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
P	教育、文体和娱乐业	-	-
Q	综合	3,888,000.00	2.51
S	合计	123,003,436.97	79.26

5.4 报告期末按行业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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13
6	002056	华邦制药	150,000	6,135,000.00	3.97
7	002184	南钢转债	404,808	5,077,047.12	3.27
8	300027	银达	199,555	4,462,549.20	2.88
9	300405	天讯科技	149,892	4,241,943.60	2.73
10	300049	福耀玻璃	150,000	3,900,000.00	2.51

5.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介

姓名	职务	任本基金基金经理的任期	最近任职日期	证券从业资格	说明
李斌	基金经理	2011-09-20	-	是	男,中国籍,经济学硕士,持有基金从业资格。曾任中国工商银行总行资产管理部副经理,2009年7月加入广发基金管理有限公司,2010年7月担任广发制造业精选股票型证券投资基金基金经理,2011年9月担任广发制造业精选股票型证券投资基金基金经理,2013年9月担任广发制造业精选股票型证券投资基金基金经理。

注:1、“任职日期”和“解聘日期”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。
3.2 报告期内本基金基金经理变更情况说明
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,《广发制造业精选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。报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法律法规的规定。
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,并通过实时对行为监控及事后的分析评估,保证公平交易原则的实现。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内,公司制定投资策略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。在交易过程中,严格执行投资决策,投资组合经理在授权范围内可自主决策,通过投资流程的严格执行,保证了投资策略的“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。监察稽核部实时监控投资交易流程,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;稽核风控部通过对投资、研究及交易等环节的实时监控,实现投资风险的事后控制。
4.5 报告期内,上述公平交易制度执行情况良好,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。
4.6 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未出现异常交易行为(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的组合除外)同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果出现对大额赎回等特殊情形需要进行反向交易的,则须经公司领导严格审批并留痕备查。
4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
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,《广发制造业精选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。报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法律法规的规定。
4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内,公司制定投资策略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。在交易过程中,严格执行投资决策,投资组合经理在授权范围内可自主决策,通过投资流程的严格执行,保证了投资策略的“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。监察稽核部实时监控投资交易流程,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;稽核风控部通过对投资、研究及交易等环节的实时监控,实现投资风险的事后控制。
4.9 报告期内,上述公平交易制度执行情况良好,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。
4.10 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未出现异常交易行为(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合除外)同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果出现对大额赎回等特殊情形需要进行反向交易的,则须经公司领导严格审批并留痕备查。
4.11 市场流动性
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,《广发制造业精选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。报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法律法规的规定。
4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内,公司制定投资策略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。在交易过程中,严格执行投资决策,投资组合经理在授权范围内可自主决策,通过投资流程的严格执行,保证了投资策略的“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。监察稽核部实时监控投资交易流程,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;稽核风控部通过对投资、研究及交易等环节的实时监控,实现投资风险的事后控制。
4.13 报告期内,上述公平交易制度执行情况良好,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。
4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内,公司制定投资策略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。在交易过程中,严格执行投资决策,投资组合经理在授权范围内可自主决策,通过投资流程的严格执行,保证了投资策略的“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。监察稽核部实时监控投资交易流程,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;稽核风控部通过对投资、研究及交易等环节的实时监控,实现投资风险的事后控制。
4.15 报告期内,上述公平交易制度执行情况良好,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。

5.5 投资组合报告

5.1 报告期末按行业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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13
6	002056	华邦制药	150,000	6,135,000.00	3.97
7	002184	南钢转债	404,808	5,077,047.12	3.27
8	300027	银达	199,555	4,462,549.20	2.88
9	300405	天讯科技	149,892	4,241,943.60	2.73
10	300049	福耀玻璃	150,000	3,900,000.00	2.51

5.2 报告期末按行业公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13
6	002056	华邦制药	150,000	6,135,000.00	3.97
7	002184	南钢转债	404,808	5,077,047.12	3.27
8	300027	银达	199,555	4,462,549.20	2.88
9	300405	天讯科技	149,892	4,241,943.60	2.73
10	300049	福耀玻璃	150,000	3,900,000.00	2.51

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五名股指期货投资明细

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

5.4 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

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

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权证投资明细

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

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五名资产支持证券投资明细

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

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

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

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

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

5.9 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资产支持证券投资明细

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	000001	平安银行	360,000	11,810,000.00	7.51
2	300218	瑞星生物	300,000	8,175,000.00	5.21
3	300213	华昌化工	440,000	8,175,000.00	5.21
4	300266	顺络电子	259,820	7,768,125.51	5.07
5	002529	中铁电气	259,200	6,462,672.24	4.13

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期未进行股指期货交易。
(2) 本基金本报告期未进行股指期货交易。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期未进行国债期货交易。
(2) 本基金本报告期未进行国债期货交易。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.2 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.3 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.4 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.5 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.6 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.7 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.8 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.9 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.10 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.11 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.12 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.13 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.14 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.15 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.16 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.17 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.18 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.19 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.20 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.21 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.22 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.23 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.24 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.25 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.26 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.27 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.28 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.29 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.30 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.31 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.32 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.33 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.34 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.35 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.36 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.37 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.38 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.39 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.40 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.41 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.42 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.43 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.44 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.45 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.46 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.47 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.48 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.49 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.50 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.51 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.52 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.53 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.54 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.55 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.56 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.57 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.58 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.59 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.60 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.61 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.62 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.63 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.64 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.65 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.66 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.67 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定投资范围的股票、债券。

5.12.68