

广发小盘成长股票型证券投资基金 (LOF)

2015 第一季度报告

2015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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年4月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有投资损失,投资者应在作出投资决策前自行阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务数据未经审计。
本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况	
基金名称	广发小盘成长股票(LOF)
场内简称	广发小盘
基金代码	162700
场内基金代码	162703
基金运作方式	上市开放式基金
基金合同生效日	2005年12月21日
报告期末基金份额总额	2,160,390,313.70份
投资目标	依托中国经济的长期发展形势和资本市场的成长,通过投资于具有成长性的小盘上市公司,寻求资本增值的长期目标。
投资策略	1.资产配置策略:股票资产比例70%-95%,债券资产比例70-15%,现金大于等于5%。 2.个股投资策略:结合行业、公司基本面等有关法律法规为决策依据,并以标的基金管理人认为具有良好投资价值。 3.风险控制策略:严格控制仓位,本基金在投资管理中采取小盘成长投资策略,主要投资于小盘成长型股票,具有成长性良好、估值合理。 4.融券投资策略:利率较低,收益来源有限,资产净值波动率降低。
业绩比较基准	天相小盘指数
风险收益特征	中高风险,收益较高
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期 (2015年1月1日至2015年3月31日)
1.本期已实现收益	958,403,252.11
2.本期利润	1,806,014,459.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.8375
4.期末基金资产净值	5,806,980,104.68
5.期末基金份额净值	2.6791

注:1)上述基金财务指标不包括持有人认购及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公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比						
阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	29.94%	1.63%	36.56%	1.50%	-7.61%	0.28%

3.2.2 本基金合同生效日以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比			
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去三年	29.94%	1.50%	28.44%

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

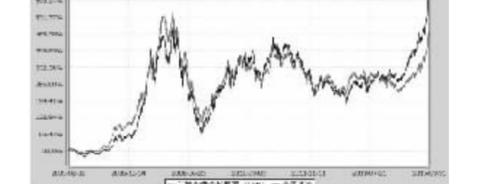


图1:本基金合同生效日以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

4.1 基金投资组合情况				
姓名	职务	任本基金基金经理的任期	证券从业年限	说明
陈皓	基金经理	2005-02-02	21年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金从业资格证券投资基金证书,1999年7月任职于广发基金管理有限公司,2001年12月2001年8月任职于广发基金管理有限公司,2003年8月15日至2004年11月20日先后担任广发基金管理有限公司基金经理,2005年2月21日起担任“广发小盘成长”基金经理,2009年4月16日起担任“广发稳健增长”基金经理,2009年4月16日起担任“广发聚瑞”基金经理,2014年11月21日起担任“广发聚鑫”基金经理,2014年11月21日起担任“广发聚财”基金经理,2014年11月21日起担任“广发聚源”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)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.2 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.3 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.4 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.5 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.6 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.7 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.8 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.9 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.10 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.11 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.12 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
3)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。
4)“任职日期”和“解聘日期”指中国证监会作出核准决定的日期。

4.13 基金投资组合情况				
序号	名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	66,974,411	20,208,178.70	0.03
2	债券	15,033,322	22,256,357.78	4.00
3	货币	10,000,000	20,000,000.00	3.56
4	权证	9,424,332	20,206,842.40	3.45
5	021146	5,009,576	19,575,291.92	3.42
6	600896	11,509,892	19,075,891.84	3.32
7	600069	10,709,702	17,627,185.30	3.09
8	000786	4,999,922	15,847,521.50	2.71
9	000228	6,551,185	14,361,807.80	2.47
10	300096	6,608,122	14,329,602.52	2.47

注:1)“任职日期”和“解聘日期”指公司公告聘任或解聘日期。
2)“任职