广发钱袋子货币市场基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年七月二十日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发钱袋子
基金主代码	000509
交易代码	000509
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月10日
报告期末基金份额总额	10,118,010,471.99份
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,力争实现稳定的、超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济运行情况、政策形势、信用状态、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的流动性特征、风险特征和估值水平特征,决定基金资产在银行存款、债券等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司

§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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	72,220,229.43
2.本期利润	72,220,229.43
3.期末基金资产净值	10,118,010,471.99

注: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,由于本货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6655%	0.0015%	0.0885%	0.0000%	0.5770%	0.0015%

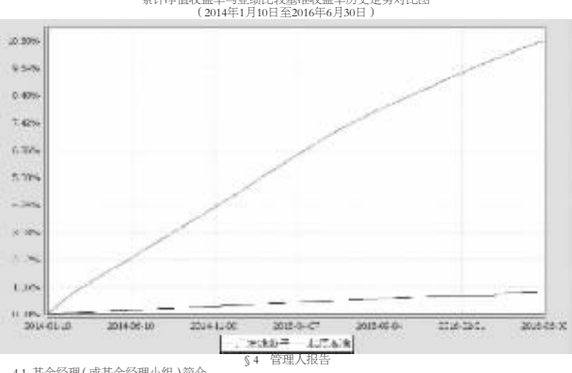
注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发钱袋子货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年1月10日至2016年6月30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		
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发聚泰混合基金的基金经理;广发稳鑫保本基金的基金经理	2014-05-30	-	8年	女,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部任交易员和研究员,2012年12月12日起任广发纯债债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年5月30日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理,2015年6月8日起任广发聚泰混合基金的基金经理,2016年3月21日起任广发稳鑫保本基金的基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发钱袋子货币市场基金基金合同》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,超过投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。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

三季度,央行货币政策维稳态度明显。市场经历了三月底MPA首次考核后谨慎情绪加剧,但二季度资金面在央行MLF和逆回购操作之下基本平稳,六月底货币市场也并未出现大幅波动。中期来看,央行操控能力已经稳住了市场机构信心,预计货币市场利率将保持平稳。债券市场在二季度经历了巨幅震荡。4月后,受宽改增、信用违约事件频发影响,市场出现调整,特别是基金遭遇赎回,造成利率债和信用债齐跌;直到5月营改增补丁出台、城投提前偿还取消、铁物资风波得到后续处理,债市恐慌情绪才有所缓解,利率债收益率也较此前小幅下行。6月初,10年国开债利率在3.30-3.40%左右震荡,10年国债利率也回到3.00%以上;中下旬,市场虽然对MPA考核仍存警惕,但受到美联储加息节奏放缓、英国脱欧事件影响,避险情绪大幅提升,债券市场情绪回暖,收益率出现大幅下行。

本基金在报告期内操作仍以流动性为最重要考虑因素。三月底央行首次执行MPA考核,对市场影响很大。因此四月以来,各类机构普遍对六月底MPA考核时点采取谨慎态度。本基金也准备了大量的现金安排在六月到期。但六月较为平稳的资金面增强了市场信心,因此本基金也适当降低了一个月内到期现金流的安排,增加了流动性与收益兼顾的同业存单的配置,争取总体做到在保证足够流动性的前提下,尽量提高组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发钱袋子净值增长率为0.6655%,同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度,央行货币政策维稳态度明显。市场经历了三月底MPA首次考核后谨慎情绪加剧,但二季度资金面在央行MLF和逆回购操作之下基本平稳,六月底货币市场也并未出现大幅波动。展望三季度,预计央行操控能力可以继续稳定市场信心,货币市场利率将保持平稳。本基金将继续以流动性管理作为第一要务,在合规的基础上进行组合管理,争取为投资者获得稳健的投资回报。

§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	固定收益投资	6,032,313,746.41	52.93
	其中:债券	6,032,313,746.41	52.93
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	935,022,282.53	8.20
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,300,614,162.65	37.74
4	其他各项资产	127,938,104.05	1.12
5	合计	11,395,888,295.64	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	11.68	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,271,549,344.23	12.57
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	10.04	12.57
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	33.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	59.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	6.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		111.37	12.57

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	555,121,959.17	5.49
	其中:政策性金融债	555,121,959.17	5.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,599,400,161.18	15.81
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,877,791,626.06	38.33
8	其他	-	-
9	合计	6,032,313,746.41	59.62
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111593157	15包商银行CD031	5,400,000.00	531,444,609.60	5.25
2	111694517	16农村商业银行CD091	3,800,000.00	374,589,681.91	3.70
3	111593173	15盛京银行CD089	3,500,000.00	344,532,049.77	3.41
4	111611225	16平安CD225	3,000,000.00	298,163,261.56	2.95
5	111610325	16兴业CD325	3,000,000.00	297,990,636.54	2.95
6	111615118	16民生CD118	3,000,000.00	297,934,421.91	2.94
7	111694763	16江西银行CD028	3,000,000.00	297,900,835.68	2.94
8	111694749	16常熟农村商行CD046	3,000,000.00	297,866,978.17	2.94
9	111691659	16洛阳银行CD014	3,000,000.00	295,878,275.76	2.92
10	111608196	16中信CD196	2,800,000.00	278,124,347.38	2.75

5.6 "影子定价"与"摊余成本"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0918%
报告期内偏离度的最低值	-0.0087%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0209%

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

5.8.2本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	39,395,654.78
4	应收申购款	88,542,449.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	127,938,104.05

§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	10,751,183,422.64
本报告期基金总申购份额	7,778,855,387.30
本报告期基金总赎回份额	8,412,028,337.95
报告期期末基金份额总额	10,118,010,471.99

§7 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	2016-04-01	35,000,000.00	35,000,000.00	-
2	分红转投	2016-04-30	1,822,097.33	1,822,097.33	-
3	赎回	2016-05-17	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
4	分红转投	2016-05-31	1,885,955.76	1,885,955.76	-
5	分红转投	2016-06-30	1,559,439.51	1,559,439.51	-
合计			20,267,492.60	20,267,492.60	

§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钱袋子货币市场基金募集的文件;

2.《广发钱袋子货币市场基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发钱袋子货币市场基金托管协议》;

5.法律意见书;

6.基金管理人业务资格批件、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
二〇一六年七月二十日

广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年七月二十日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发趋势优选灵活配置混合
基金主代码	000215
交易代码	000215
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	48,575,609.36份
投资目标	主要通过大类资产配置调整,辅以股票优选,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在投资中追求基金资产的长期稳定增长。在此目标下,本基金在宏观基本面分析的基础上,根据市场趋势的变化进行股票和债券资产的配置,同时,本基金通过实施"行业优选积极轮换"并精选股票的策略,实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	沪深300指数×50%+中证全债指数×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	598,549.97
2.本期利润	688,578.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0146
4.期末基金资产净值	69,192,504.87
5.期末基金份额净值	1.424

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	0.99%	0.23%	-0.81%	0.51%	1.80%	-0.28%

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

广发趋势优选灵活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9月11日至2016年6月30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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年红基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚康混合基金的基金经理;广发稳安保本混合基金的基金经理;广发安泽回报混合基金的基金经理	2015-01-29	-	8年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金从业证书,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员,2012年7月19日起任广发理财年年红债券基金的基金经理,2012年9月20日至2015年5月26日任广发双债添利债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日至2015年7月23日任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日至2015年5月26日任广发集鑫债券型证券投资基金,2014年4月27日至2015年7月23日任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日至2015年4月29日任广发季季利债券基金的基金经理,2015年1月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理,2015年3月25日起任广发聚安混合基金的基金经理,2015年4月9日起任广发聚宝混合基金的基金经理,2015年6月1日起任广发聚康混合基金的基金经理,2016年2月4日起任广发稳安保本混合基金的基金经理,2016年6月17日起任广发安泽回报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、《广发趋势优选灵活配置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。

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,超过投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。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

2季度经济整体形势以维稳为主,尽管爆发了多起信用违约风险,但更大部分的信用事件得以保全。对于整体的经济增速,国家通过基建等渠道予以托底,而短期内不出台强刺激政策已经成为决策层的共识。海外市场的不确定有所增强,人民币国际化进程仍在艰难推进中,但汇率仍处于央行的主动控制中。决策层试图以维稳的方式换取改革的时间,如果这一思路没有调整,预计在未来一段时间乃至2-3年,低增速下的弱平衡将成为常态。

本报告期内,股市和债市都处于震荡行情,基本面因素变化不大,主要是预期扰动带来的区间波动。具有防御性质的资产表现较好,比如中等资质的城投债以及黄金、食品饮料等板块的个股。

本基金以获取低风险的绝对回报作为投资目标,一直维持较低的股票仓位,并通过新股和转债的网下申购增厚组合收益。权益类资产配置方面,仍以稳定增长的防御性股票为主;债券方面,以短期限品种为主。

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0.99%,同期业绩比较基准收益率为-0.81%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在维稳的政策导向下,低增速下的弱平衡已然成为常态。资产价格的波动未必体现为真实的市场情况:控制得住,自然希冀为资产价格的稳步上涨,而如果一旦失控,各类力量的胶着与对峙,资产价格的波动也会超乎预期。我们认为,下半年仍处于风险期,风险始终存在,不会缺席,只是具体的时点上难以把握。

在资金如此之多、投资渠道相对受限、风险又比较大的背景下,资金对于资产的追逐很可能会放大,近一年主要资产的表现已经证明了这一点。在绝对回报率不断下降的历史背景下,接受预期回报的下降仍将是个缓慢的过程。对于债券市场而言,现在远没有到悲观的时点,毕竟收益率系统性上行的条件还不具备。如果保守操作,持有中短期限、高等级信用债获取票息的同时,还能获取几个利率债的波段机会,仍可能获取战胜通胀率的收益率表现。权益类方面,立足于国内这么大的需求市场,仍将出现能够维持较高增速的上市公司,我们将继续坚持价值投资的方向,精选维持中高增速成长的优质企业。

本基金以获取低风险的绝对回报作为投资目标,后续将继续维持较低的权益类仓位,具体以低估值、稳定增长的品种为主。同时,积极参与新股和转债的网下申购。如果中长端利率倘绝对收益率上行较多,将择机提高该类资产的配置比例。

§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	12,978,045.65	18.65
	其中:股票	12,978,045.65	18.65
2	固定收益投资	53,709,770.00	77.17
	其中:债券	53,709,770.00	77.17
	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	725,983.75	1.04
7	其他各项资产	2,186,408.84	3.14
8	合计	69,600,208.24	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,251,628.01	16.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	39,015.80	0.06
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	1,075,200.00	1.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	603,600.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	8,601.84	0.01
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	12,978,045.65	18.76

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	600079	人福医药	204,011	3,421,264.47	4.94
2	600066	宇通客车	110,000	2,178,000.00	3.15
3	600703	三安光电	100,000	1,997,000.00	2.89
4	600276	恒瑞医药	42,720	1,713,499.20	2.48
5	600418	江淮汽车	100,000	1,268,000.00	1.83
6	300339	润和软件	30,000	1,075,200.00	1.55
7	002127	新民科技	60,000	603,600.00	0.87
8	600867	通化东宝	28,800	595,872.00	0.86
9	603737	三棵树	362	42,020.96	0.06
10	601611	中国核建	1,865	39,015.80	0.06

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,971,000.00	2.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,949,000.00	72.19
	其中:政策性金融债	49,949,000.00	72.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,789,770.00	2.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,709,770.00	77.62

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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160209	16国开09	300,000	29,949,000.00	43.28
2	150416	15农发16	200,000	20,000,000.00	28.90
3	019518	15国债18	19,710	1,971,000.00	2.85
4	132004	15国盛EB	17,000	1,645,770.00	2.38
5	132006	16皖新EB	1,440	144,000.00	0.21

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	16,521.37
2	应收证券清算款	800,221.89
3	应收股利	-
4	应收利息	799,095.50
5	应收申购款	570,570.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,186,408.84

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002127	南极电商	603,600.00	0.87	重大事项
2	601611	中国核建	39,015.80	0.06	重大事项

§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	46,144,755.14
本报告期基金总申购份额	4,965,872.10
减:本报告期基金总赎回份额	2,535,017.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,575,609.36

§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

1.中国证监会批准广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发趋势优选灵活配置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"发"趋势优选灵活配置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
二〇一六年七月二十日

广发全球精选股票型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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:二〇一六年七月二十日

§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2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球精选股票(QDII)
基金主代码	270023
交易代码	270023(前端) -(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月18日
报告期末基金份额总额	681,127,114.96份
投资目标	通过在全球市场进行积极的资产配置和组合管理,有效分散基金的投资组合风险,实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将通过自上而下的资产配置策略和自下而上的个股精选策略进行基金资产的投资组合构建,注重国际宏观经济环境、政治形势、区域市场和证