

广发策略优选混合型证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12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:二〇一四年一月二十二日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事会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2014年1月17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,复核结果表明不存在虚假记载、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。
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。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。
§ 2 基金产品概况
基金简称: 广发策略优选混合
基金代码: 270006
交易代码: 270006
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日: 2006年4月17日
报告期末基金份额总额: 5,495,270,935.05份
投资目标: 通过在行业间多点投资策略,分享中国经济和资本市场的增长,为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。
投资策略: 本基金主要根据宏观经济政策、资金供求、市场运行周期的判断,确定资产配置策略,通过综合运用主题投资、买入持有、投资多种投资策略选出投资价值较高的公司股票和债券,并结合宏观经济政策、资金供求、市场运行周期的判断以及收益曲线策略进行价值投资;同时严格遵守有关法律法规和基金合同的约定,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准: 本基金的业绩比较基准为“沪深300指数*60%+中证国债指数*25%+新华巴克莱资本中国债券指数*5%”。
风险收益特征: 高风险、较高收益。
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

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	301,792,441.36	2.本期利润	70,129,118.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0125	4.期末基金份额净值	7,383,216,094.24
5.期末基金份额净值	1.3436		

注:(1)本基金财务指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金期初的收入,投资人收益,其他收入(不包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的公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)期间基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较	
阶段	净值增长率①
净净值增长率②	业绩比较基准收益率③
①-③	②-④
过去三个月	0.92%
1.25%	-3.04%
0.85%	3.96%
4.04%	

3.2.2报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

*广发策略优选混合型证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

(2006年5月17日至2013年12月31日)

注:1.本基金合同生效后6个月,结合净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图。

2.本基金在2013年1月10日,将基金业绩比较基准由“沪深300指数*60%+中证国债指数*25%+新华巴克莱资本中国债券指数”变更为“75%*沪深300指数+25%中债全债指数”。

3.2.3报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

3.3 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	301,792,441.36	2.本期利润	70,129,118.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0125	4.期末基金份额净值	7,383,216,094.24
5.期末基金份额净值	1.3436		

注:(1)本基金财务指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金期初的收入,投资人收益,其他收入(不包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的公允价值变动收益。

3.2.4报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

3.2.5报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.2.6报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

3.2.7报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品及期权投资明细

3.2.8报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名期货投资明细

3.2.9报告期期末基金资产净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

3.2.10报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券回购投资明细

3.2.11报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证衍生品投资明细

3.2.12报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

3.2.13报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

3.2.14报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名其他投资明细

3.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	301,792,441.36	2.本期利润	70,129,118.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0125	4.期末基金份额净值	7,383,216,094.24
5.期末基金份额净值	1.3436		

注:(1)本基金财务指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金期初的收入,投资人收益,其他收入(不包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的公允价值变动收益。

3.2.15报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

3.2.16报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.2.17报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

3.2.18报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品及期权投资明细

3.2.19报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名期货投资明细

3.2.20报告期期末基金资产净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

3.2.21报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

3.2.22报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名其他投资明细

3.3.1主要财务指标

主要财务指标		报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	301,792,441.36	2.本期利润	70,129,118.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0125	4.期末基金份额净值	7,383,216,094.24
5.期末基金份额净值	1.3436		

注:(1)本基金财务指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金期初的收入,投资人收益,其他收入(不包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的公允价值变动收益。

3.3.2报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

3.3.3报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.3.4报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

3.3.5报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品及期权投资明细

3.3.6报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名期货投资明细

3.3.7报告期期末基金资产净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

3.3.8报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

3.3.9报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名其他投资明细

3.4 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
1.本期已实现收益	301,792,441.36	2.本期利润	70,129,118.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0125	4.期末基金份额净值	7,383,216,094.24
5.期末基金份额净值	1.3436		

注:(1)本基金财务指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金期初的收入,投资人收益,其他收入(不包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的公允价值变动收益。

3.4.1报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

3.4.2报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.4.3报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

3.4.4报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品及期权投资明细

3.4.5报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名期货投资明细

3.4.6报告期期末基金资产净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

3.4.7报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

3.4.8报告期期末基金资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名其他投资明细

3.5 报告期期末基金资产组合情况

项目		金额(元)	占基金总资产的比例(%)</th
----	--	-------	------------------