广发聚丰股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9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:二〇一二年十月二十五日

§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2012年10月22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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚丰股票	
基金主代码	270005	
交易代码	270005	270015
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年12月23日	
报告期末基金份额总额	30,173,299,886.45份	
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。	
投资策略	本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票,同时保持两类资产的适度均衡配置,构建股票投资组合。	
业绩比较基准	80%*新华富时A600指数+20%*新华巴克莱资本中国全债指数	
风险收益特征	较高风险、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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-538,257,032.34
2.本期利润	-370,244,198.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0123
4.期末基金资产净值	19,243,794,822.30
5.期末基金份额净值	0.6378

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

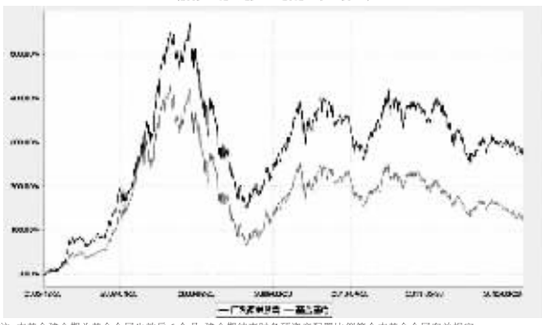
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.86%	0.98%	-5.72%	0.97%	3.86%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发聚丰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的历史走势对比图

(2005年12月23日至2012年9月30日)



注: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		
易阳方	本基金的基金经理;广发制造业精选股票基金的基金经理;公司副总经理、投资总监	2005-12-23	-	15	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,1997年1月至2002年11月任职于广发证券股份有限公司,2002年11月至2003年11月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员,2003年12月3日至2007年3月28日任广发聚富混合基金的基金经理,2005年5月13日至2011年1月5日任广发基金管理有限公司投资管理部总经理,2005年12月23日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2006年9月4日至2008年4月16日任广发基金管理有限公司总经理助理,2008年4月17日起任广发基金管理有限公司投资总监,2011年8月11日起任广发基金管理有限公司副总经理,2011年9月20日起任广发制造业精选股票基金的基金经理。

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、《广发聚丰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

本季度,欧洲主权债务危机依然没有缓解迹象,西班牙危机还似乎有所加剧,数据显示美国经济在本季度明显改善,其股指创五年来新高,已经回到2008年金融危机前的高位,国内经济依旧处在去库存和去产能阶段,同时市场对于货币政策放松和房地产调控政策松绑的憧憬本季度破灭,房地产板块以及与投资相关的行业股价持续调整,股指跌到2000点才暂时企稳。

本基金本季度继续坚守积极防御策略,权益类仓位降低了4个百分点,在行业配置上继续增加了医药等稳定增长行业配置,减持煤炭和化工配置。遗憾的是本基金没有参与苹果iphone5推出带来相关电子板块的主题投资机会,错失了一些投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期,本基金净值增长-1.86%,比较基准增长-5.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度,由于去年第四季度经济数据较差,受此低基数影响,今年第四季度经济数据同比会有所好转,另外国内政治经济在重大会议开幕时期有维稳的传统,加之指数持续调整,无论幅度和时间都在全球不出其二,因此本基金预计本季度市场将会企稳,呈现震荡向上格局,当然高度不宜乐观。投资机会可能体现在周期性行业超跌反弹和稳定增长行业估值切换两方面。

§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	13,033,716,931.38	67.42
	其中:股票	13,033,716,931.38	67.42
2	固定收益投资	1,008,057,000.00	5.21
	其中:债券	1,008,057,000.00	5.21
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	3,484,658,186.98	18.02
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,768,322,684.21	9.15
6	其他各项资产	37,701,648.11	0.20
7	合计	19,332,456,450.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	70,271,581.71	0.37
B	采掘业	841,280,000.00	4.37
C	制造业	9,821,889,109.24	51.04
C0	食品、饮料	4,195,935,681.88	21.80
C1	纺织、服装、皮毛	248,001,311.33	1.29
C2	木材、家具	5,115,317.79	0.03
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,081,328,791.88	5.62
C5	电子	281,123,063.32	1.46
C6	金属、非金属	99,620,000.00	0.52
C7	机械、设备、仪表	747,173,129.51	3.88
C8	医药、生物制品	3,152,566,758.73	16.38
C99	其他制造业	11,025,054.80	0.06
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	720,502,822.41	3.74
F	交通运输、仓储业	122,176,915.00	0.63
G	信息技术业	333,209,618.84	1.73
H	批发和零售贸易	728,910,868.83	3.79
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	281,860,891.65	1.46
K	社会服务业	6,946,000.00	0.04
L	传播与文化产业	95,644,123.70	0.50
M	综合类	11,025,000.00	0.06
	合计	13,033,716,931.38	67.73

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	600519	贵州茅台	7,700,000	1,892,660,000.00	9.84
2	000568	泸州老窖	32,665,637	1,257,627,024.50	6.54
3	600123	兰花科创	38,000,000	749,360,000.00	3.89
4	002422	科伦药业	14,596,068	728,343,793.20	3.78
5	000651	格力电器	32,000,100	684,162,138.00	3.56
6	600309	烟台万华	47,102,766	651,902,281.44	3.39
7	600252	中恒集团	52,380,878	504,951,663.92	2.62
8	002375	亚厦股份	16,900,000	426,725,000.00	2.22
9	600594	益佰制药	17,306,639	362,401,020.66	1.88
10	600062	华润双鹤	15,067,480	343,990,568.40	1.79

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	1,008,057,000.00	5.24
	其中:政策性金融债	1,008,057,000.00	5.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,008,057,000.00	5.24

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110419	11农发19	3,500,000	345,975,000.00	1.80
2	110322	11进出22	3,300,000	325,776,000.00	1.69
3	110318	11进出18	1,300,000	131,209,000.00	0.68
4	110314	11进出14	900,000	92,403,000.00	0.48
5	110415	11农发15	800,000	82,160,000.00	0.43

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 2012年7月2日,上海证券交易所发布上证公字[2012]32号《关于给予广西梧州中恒集团股份有限公司和公司董事长姜总经理许淑清等有关责任人公开谴责的决定》,对中恒集团及有关责任人给予公开谴责。本基金投资该公司的逻辑是:该公司独家生产的主导产品血栓通冻干粉针目前主要应用在心脑血管领域,样本医院过去三年的年均增速超过50%,我国每年新增心脑血管疾病患者200万人,心脑血管用药未来的发展空间巨大,而中恒产品血栓通的技术优势优于同类竞品,前景值得看好。本基金投资该股票主要于2010年第三季度买入,之后一直持有,基金在这只股票上实现了浮盈。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,578,470.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,144,792.82
5	应收申购款	978,384.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,701,648.11

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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	30,151,959,287.80
本报告期基金总申购份额	841,453,581.17
减:本报告期基金总赎回份额	820,112,982.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,173,299,886.45

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚丰股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》;

3.《广发聚丰股票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.《广发聚丰股票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、公司章程;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 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

7.3 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
二〇一二年十月二十五日

广发聚富开放式证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9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:二〇一二年十月二十五日

§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2012年10月22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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚富混合	
基金主代码	270001	
交易代码	270001	270011
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年12月3日	
报告期末基金份额总额	4,607,323,311.72份	
投资目标	依托高速发展的宏观经济和资本市场,通过基金管理人科学研究,审慎投资,在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	积极投资策略,在资产配置层面,重视股票资产和债券资产的动态平衡配置;在行业配置层面,根据不同行业的发展前景进行行业优化配置;在个股选择层面,在深入把握上市公司基本面的基础上挖掘价格尚未完全反映投资价值的潜力股的投资机会。	
业绩比较基准	80%*中信标普300指数收益+20%*中信标普全债指数收益	
风险收益特征	本基金风险收益特征介于成长基金与价值基金之间;适度风险、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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-103,021,094.08
2.本期利润	-152,965,469.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0330
4.期末基金资产净值	4,920,570,651.43
5.期末基金份额净值	1.0680

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和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	-3.01%	0.69%	-5.29%	0.93%	2.28%	-0.24%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发聚富开放式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年12月3日至2012年9月30日)

注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓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		
祝位	本基金的基金经理	2010-12-31	-	7	男,经济学硕士,持有证券业执业证书,2005年7月至2007年7月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员,2008年8月至2010年5月任农银汇理基金管理有限公司研究部行业研究员,2010年5月至今任职于广发基金管理有限公司,2010年12月31日起任广发聚富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、《广发聚富开放式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同日反向交易的情况,但与本公司管理的其他被动型投资组合曾发生过同日反向交易的情况,其中成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共有1次。上述被动型投资组合属于完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合,发生反向交易的原因是公司其他被动型投资组合调仓,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

2012年三季度,市场整体下跌,前期强势的食品饮料、地产等行业大幅调整,银行、石化等行业表现较好。

本基金减持了部分后周期个股,增加了低估值品种,降低了仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本季度净值增长-3.01%,同期比较基准增长-5.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过了过去两年的大幅下跌,市场似乎能越来越接近中期底部。市场对长期结构性问题的讨论非常充分,对周期下滑问题也很担忧。在估值上,相当多的大盘蓝筹企业和香港市场接轨。

如果市场因为对短期周问题的悲观而再次下跌,本基金将会逐渐由过去多个季度的防御转向进攻,逐步增加低估值、早周期的大盘蓝筹股票。

同时,对部分后周期成长股,本基金仍然会寻找时机继续减持。

在风险因素上,由于对政府的宽松政策已经非常悲观,政策很难继续低于预期,大概率符合预期。

比较大的不确定性在于,依赖于刚需的地产销售,已经走过多个季度,可持续性到底有多高,需要值得警惕。

另外,过去两年市场降估值的现象非常普遍,很多企业(包括消费股)的股价表现远差于业绩增长,应该说低于很多人的预期。未来哪些行业和企业会再次上演这一过程,越来越值得思考。

§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	2,464,152,591.78	49.64
	其中:股票	2,464,152,591.78	49.64
2	固定收益投资	1,876,338,000.00	37.80
	其中:债券	1,876,338,000.00	37.80
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	580,733,749.09	11.70
6	其他各项资产	42,774,141.33	0.86
7	合计	4,963,998,482.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	1,261,945,736.82	25.65
C0	食品、饮料	283,683,832.00	5.77
C1	纺织、服装、皮毛	197,054,998.40	4.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	26,146,737.80	0.53
C4	石油、化学、塑胶、塑料	466,500.00	0.01
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	123,165,073.87	2.50
C8	医药、生物制品	631,428,594.75	12.83
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	299,797,595.19	6.09
E	建筑业	105,360,000.00	2.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	287,779,766.54	5.85
I	金融、保险业	18,692,609.40	0.38
J	房地产业	490,576,883.83	9.97
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,464,152,591.78	50.08

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	000002	万科A	31,200,337	263,018,840.91	5.35
2	000963	华东医药	7,090,258	244,613,901.00	4.97
3	600048	保利地产	21,148,517	227,558,042.92	4.62
4	002029	七匹狼	9,473,798	197,054,998.40	4.00
5	600594	益佰制药	7,908,130	165,596,242.20	3.37
6	600011	华能国际	23,736,303	150,250,797.99	3.05
7	600027	华电国际	45,540,777	149,546,797.20	3.04
8	600276	恒瑞医药	4,312,305	130,705,964.55	2.66
9	002304	洋河股份	1,000,000	125,000,000.00	2.54
10	600535	天士力	2,380,000	122,427,200.00	2.49

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	433,354,000.00	8.81
3	金融债券	1,442,984,000.00	29.33
	其中:政策性金融债	1,442,984,000.00	29.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,876,338,000.00	38.13

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	120408	12农发08	2,800,000	280,056,000.00	5.69
2	120402	12农发02	2,000,000	200,060,000.00	4.07
3	1101088	11央行票据88	1,800,000	174,006,000.00	3.54
4	1101081	11央行票据81	1,600,000	162,768,000.00	3.31
5	120304	12进出04	1,500,000	149,805,000.00	3.04

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,998,401.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,369.12
4	应收利息	40,358,750.29
5	应收申购款	414,620.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,774,141.33

5.8.4 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可转换债券。

5.8.5 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	600027	华电国际	129,600,000.00	2.63	非公开发行流通受限
2	002029	七匹狼	29,120,000.00	0.59	非公开发行流通受限
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

§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	4,674,781,500.62
本报告期基金总申购份额	89,027,598.24
减:本报告期基金总赎回份额	156,485,787.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,607,323,311.72

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚富开放式证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》;

3.《广发聚富开放式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.《广发聚富开放式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、公司章程;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 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

7.3 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
二〇一二年十月二十五日

广发聚利债券型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚利债券
基金主代码	162712
交易代码	162712
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,封闭期间投资人不能申购赎回本基金份额,但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额;封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2011年8月5日
报告期末基金份额总额	335,745,621.79份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过自上而下的宏观研究指导债券配置,在主动研判收益率变动趋势的基础上进行利率产品投资,在严格评估个券信用风险状况的前提下进行信用产品投资,在深入挖掘可转债正股基本面的基础上参与可转债投资,并通过新股申购、股票增发和要约收购类股票投资提高基金资产的收益水平。
业绩比较基准	中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,为证券投资基金中的较低风险品种。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	12,777,308.77
2.本期利润	-2,082,725.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0062
4.期末基金资产净值	379,097,858.79
5.期末基金份额净值	1.129

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购和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