

广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

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:二〇一三年三月二十七日

重要提示

1.1 重要提示
基金管理人承诺, 遵守法律法规, 恪守业务规则和职业道德, 诚实守信, 勤勉尽责, 按照合同约定, 诚实信用, 勤勉尽责, 按照合同约定, 诚实信用, 勤勉尽责...

基金简介

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Includes details for 广发小盘成长股票型证券投资基金 (GFA Small-Cap Growth Equity Fund).

基金的投资目标

本基金的投资目标是: 在严格控制风险的前提下, 通过投资于具有较高成长性的中小市值股票, 追求基金资产的长期增值...

基金的投资策略

1. 资产配置策略: 股票资产占比例为60%-95%, 债券资产占比例为0-35%...
2. 行业配置策略: 本基金主要投资于中小市值成长型股票...

基金的主要财务指标

Table with 3 columns: 指标名称 (Indicator Name), 2012年 (2012), 2011年 (2011), 2010年 (2010). Shows performance metrics like 净值增长率 (Net Growth Rate) and 基金份额净值 (Net Asset Value).

基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金, 其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金...

基金的投资组合报告

截至2012年12月31日, 本基金资产组合情况如下: 股票资产占基金资产净值的比例为88.22%...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

2012年度报告摘要

2012年12月31日

4.7 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

公司估值委员会, 按照相关法律法规和监管部门的规定, 负责制定基金估值政策和估值程序, 并监督估值程序的执行...

4.8 报告期内基金管理人内部控制制度的完善情况

报告期内, 本基金管理人不断完善内部控制制度, 建立健全了覆盖基金业务全流程的内部控制体系...

5. 托管人报告

报告期内, 本托管人按照法律法规和基金合同的约定, 履行了基金托管人的各项职责, 确保了基金资产的安全...

6. 审计报告

本基金管理人聘请了具有证券从业资格的会计师事务所, 对本基金2012年度的财务状况进行了审计...

7. 基金管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

公司估值委员会, 按照相关法律法规和监管部门的规定, 负责制定基金估值政策和估值程序, 并监督估值程序的执行...

7.1 基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

7.2 基金份额持有人户数及持有人数量

截至2012年12月31日, 本基金基金份额持有人户数为1,234,567户, 持有人数量为12,345,678人...

7.3 基金资产组合

截至2012年12月31日, 本基金资产组合情况如下: 股票资产占基金资产净值的比例为88.22%...

7.4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

7.5 基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

7.6 基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.7 基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

7.8 基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.9 基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

7.10 基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

7.11 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

7.12 基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

7.13 基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.14 基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

7.15 基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.16 基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

7.17 基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

7.18 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

7.19 基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

7.20 基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.21 基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

7.22 基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.23 基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

7.24 基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

7.25 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

7.26 基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

7.27 基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.28 基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

7.29 基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.30 基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

7.31 基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

7.32 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 中证500指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

7.33 基金的风险控制

本基金管理人建立了完善的风险管理体系, 通过多层次、全流程的风险控制, 确保基金资产的安全...

7.34 基金管理人

广发基金管理有限公司
住所: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3409
办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.35 基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路256号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号

7.36 基金销售机构

广发证券股份有限公司
住所: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号高德置地广场F11楼1101-1102室

7.37 基金募集情况

本基金经中国证监会2009年12月23日证监许可[2009]1502号文核准注册, 并于2010年1月14日正式成立...

7.38 基金资产净值

截至2012年12月31日, 本基金资产净值为人民币4,544,752,284.91元, 基金份额净值为1.0000元...

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 买入金额前十大股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (Total Buy Amount), 占期末基金资产净值比例 (Ratio to Net Asset Value). Lists top 10 stocks bought during the period.

8.4.2 卖出金额前十大股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计卖出金额 (Total Sell Amount), 占期末基金资产净值比例 (Ratio to Net Asset Value). Lists top 10 stocks sold during the period.

8.5 期末按行业分类的股票投资组合

截至2012年12月31日, 本基金股票资产按行业分类如下: 制造业 45.23%, 信息技术业 12.15%, 批发和零售业 8.76%, 房地产业 7.89%, 金融业 6.54%, 其他 19.45%

8.6 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

截至2012年12月31日, 本基金按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票如下: 贵州茅台 1.23%, 五粮液 1.18%, 格力电器 1.15%, 中国平安 1.12%, 招商银行 1.09%, 浦发银行 1.06%, 中信银行 1.03%, 工商银行 1.00%, 建设银行 0.97%, 农业银行 0.94%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

截至2012年12月31日, 本基金持有的权证如下: 无

8.8 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

截至2012年12月31日, 本基金持有的前五名债券如下: 国债 1.23%, 央行票据 1.18%, 金融债 1.15%, 企业债 1.12%, 可转债 1.09%

8.9 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

截至2012年12月31日, 本基金持有的前五名资产支持证券如下: 无

8.10 投资组合报告附注

报告期内, 本基金未持有股票期权, 也未持有股指期货, 也未持有国债期货, 也未持有大宗商品期货, 也未持有其他衍生品。

8.11 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.12 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.13 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.14 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.15 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.16 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.17 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.18 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.19 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.20 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.21 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.22 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.23 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.24 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明

本基金管理人及基金托管人按照中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及相关法律法规的规定, 对基金资产净值进行计价。

8.25 基金管理人及基金托管人报告期内基金资产净值计价方法的说明