

广发聚利债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

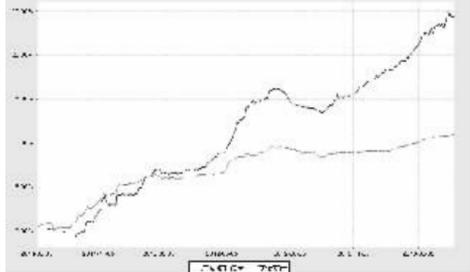
基金管理人:广发基金管理有限公司	
基金托管人:中国工商银行股份有限公司	
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日	
1 重要提示	
<p>基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。</p> <p>基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。</p> <p>本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。</p> <p>本报告中财务数据未经审计。</p> <p>本报告日期为2013年1月1日起至3月31日止。</p>	
2 基金产品概况	
基金简称	广发聚利债券
基金代码	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,封闭期投资者不能申购赎回基金份额,封闭期结束后本基金上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2011年8月5日
报告期期末基金份额总额	135,745,621.79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,力争为基金份额持有人提供持续稳定的增值回报并实现资产的长期稳健增值。
投资策略	通过对自上而下的宏观经济研究和管理资产配置,重点选择利率债等固定收益品种进行利率资产配置,在严格控制风险的前提下进行信用产品投资,在深入挖掘并修正基本面的基础上参与可转债投资,并通过新股发行、债券置换和定向增发等方式参与权益类资产的投资。
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型基金,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	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	16,518,460.42
2.本期利润	17,503,218.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0521
4.期末基金资产净值	370,830,017.97
5.期末基金份额净值	1.104

注:4.期末基金份额净值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。
Q.期末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	4.84%	0.20%	1.42%	0.03%	3.42%	0.17%

3.2.2 本基金合同生效以来(以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比较)“广发聚利债券型证券投资基金”资产配置比例与基金合同约定的资产配置比例对比图
 2011年8月5日至2013年3月31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。

4.1 基金经理 魏基经 简介	
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间

注:1. 魏基经自2011年11月1日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2011年11月1日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2011年11月1日起担任公司公募基金经理职务。

注:1. 魏基经自2011年11月1日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2011年11月1日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2011年11月1日起担任公司公募基金经理职务。

5.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	20,294,532.06
2.本期利润	20,294,532.06
3.期末基金资产净值	950,776,982.91

注:1. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。

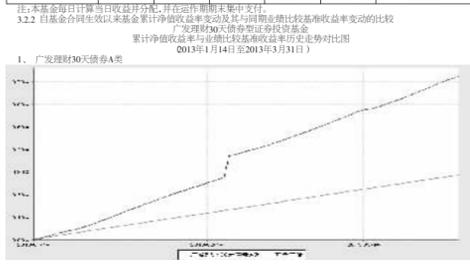
5.2 基金产品概况	
基金简称	广发理财30天债券
基金代码	162706
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月14日
报告期期末基金份额总额	1,041,141,387.27份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的当期收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外宏观经济形势,合理配置资产,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人提供持续稳定的增值回报并实现资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于货币型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。
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

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年1月14日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	20,294,532.06
2.本期利润	20,294,532.06
3.期末基金资产净值	950,776,982.91

注:1. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。

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	0.726%	0.0102%	0.288%	0.0009%	0.4374%	0.0102%

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。
3.2.2 本基金合同生效以来(以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比较)“广发理财30天债券型证券投资基金”资产配置比例与基金合同约定的资产配置比例对比图
 2013年1月14日至2013年3月31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。

广发聚财信用债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

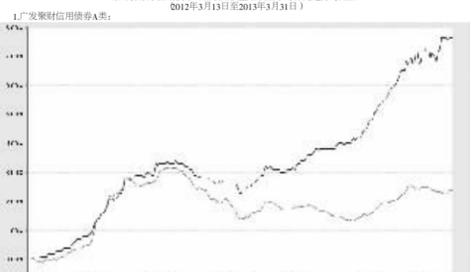
基金管理人:广发基金管理有限公司	
基金托管人:中国工商银行股份有限公司	
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日	
1 重要提示	
<p>基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。</p> <p>基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。</p> <p>本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示其未来表现。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。</p> <p>本报告中财务数据未经审计。</p> <p>本报告日期为2013年1月1日起至3月31日止。</p>	
2 基金产品概况	
基金名称	广发聚财信用债券
基金代码	162706
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月13日
报告期期末基金份额总额	958,040,163.55份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期稳健增值,力争为基金份额持有人提供持续稳定的增值回报并实现资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过深入的宏观研究和信用研究,对利率走势、债券收益率曲线变化和信用风险变化情况进行前瞻,并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征,在符合资产配置比例的前提下,通过各大类资产的配置比例,本基金采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的方式进行资产配置。从整体上看,固定收益类资产的投资策略主要可以分为以下三个层次:确定符合久期和信用风险的利率债配置;进行组合资产的久期配置和个券选择;根据利率走势调整仓位,对投资组合进行动态调整。
业绩比较基准	中债企业债总指数收益率*80%+中国国债总指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其平均风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币型基金。
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

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	10,807,112.62
2.本期利润	14,682,200.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0340
4.期末基金资产净值	414,503,493.28
5.期末基金份额净值	1.067

注:1. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。

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	3.29%	0.13%	0.97%	0.04%	2.32%	0.09%

3.2.2 本基金合同生效以来(以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比较)“广发聚财信用债券型证券投资基金”资产配置比例与基金合同约定的资产配置比例对比图
 2012年3月13日至2013年3月31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。

4.1 基金经理 魏基经 简介	
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间

注:1. 魏基经自2012年3月13日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2012年3月13日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2012年3月13日起担任公司公募基金经理职务。

注:1. 魏基经自2012年3月13日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2012年3月13日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2012年3月13日起担任公司公募基金经理职务。

5.1 主要财务指标	
单位:份	
主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	520,762,596.33
2.本期利润	520,762,596.33
3.期末基金资产净值	520,762,596.33

注:1. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	520,762,596.33
2.本期利润	520,762,596.33
3.期末基金资产净值	520,762,596.33

注:1. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月1日起担任公司公募基金经理职务。

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	0.726%	0.0102%	0.288%	0.0009%	0.4374%	0.0102%

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。
3.2.2 本基金合同生效以来(以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比较)“广发理财30天债券型证券投资基金”资产配置比例与基金合同约定的资产配置比例对比图
 2013年1月14日至2013年3月31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。

4.1 基金经理 魏基经 简介	
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间
姓名	魏基经
职务	任本基金基金经理期间

注:1. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。

注:1. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。

5.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年1月14日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	20,294,532.06
2.本期利润	20,294,532.06
3.期末基金资产净值	950,776,982.91

注:1. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
2. 证监会的基金从业人员管理办法规定,基金从业人员在任职期间,应当遵守法律法规及中国证监会的相关规定。
3. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。
4. 魏基经自2013年1月14日起担任公司公募基金经理职务。

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决策流程,投资决策必须在授权范围内进行,超过授权范围的申购需要通过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照 时间优先、价格优先、比例公平、综合平衡”的原则,公平分配投资指令,监察稽核部按照投资指令交易记录与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、研究及交易等各个环节的稽核,实现投资风险的事后风险控制。

本报告期,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
本报告期,未发现异常交易行为。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期,未发现异常交易行为。

本报告期,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
本报告期,未发现异常交易行为。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期,未发现异常交易行为。