广发纳斯达克100指数证券投资基金

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

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。

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发纳斯达克100指数(QDII)
基金主代码	270042
交易代码	270042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月15日
报告期末基金份额总额	137,940,175.43份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。 本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。 本基金对纳斯达克100指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%,对纳斯达克100指数备选成份股及以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金(ETF)的投资比例不高于基金资产净值的10%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。
业绩比较基准	人民币计价的纳斯达克100总收益指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China(Hong Kong)
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,651,189.79
2.本期利润	6,951,801.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0500
4.期末基金资产净值	138,746,538.88
5.期末基金份额净值	1.006

注:1、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。

2、上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。

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

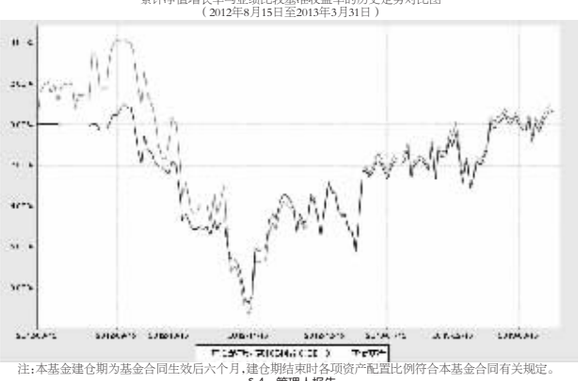
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.34%	0.71%	5.58%	0.74%	-0.24%	-0.03%

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

广发纳斯达克100指数证券投资基金

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

(2012年8月15日至2013年3月31日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,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		
邱炜	本基金的基金经理;广发全球农业指数基金的基金经理	2012-8-15	-	6	男,中国籍,统计学博士,持有证券业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。

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、《广发纳斯达克100指数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

2013年1季度美国三大股指均是小步上扬的走势,在年初财政悬崖有惊无险之后市场风险偏好明显上升,加上美国经济数据的持续走稳,使得市场基本未能展开有效调整,仅仅在美联储一月份公开市场会议记录披露之后市场对提前退出QE的担忧导致了短暂的调整。

本季度纳斯达克100指数上涨5.58%,本基金以达到基金合同说规定的仓位,并严格按照指数复制操作,严格按照基金合同允许的范围对日常申购赎回进行操作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值上涨5.34%,跟踪指数上涨5.58%,日均偏离度为0.054%,报告期间跟踪误差0.158%,年化跟踪误差为2.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年二季度美国市场将会延续一季度的慢牛升势,市场也有可能会出现因某个事件而导致获利回吐,但下半年仍然看好。我们判断的依据就是美国经济确实开始走向复苏,而且迹象较为明显,但是市场目去年开始的涨幅已经使得一部分投资者累积了较大幅度的盈利,而我们预计将会有更多的场外资金会在借市场调整之际进入,故预计如果出现调整幅度将会非常有限。同时,经济复苏带来的美联储QE何时退出之讨论也将在一定程度上反复影响投资者的情绪,我们要抓住问题的核心就是如果提早退出其实代表着美联储对经济的乐观程度已经超出他们原本的预期,其实对市场的中长期走势肯定是个利好因素。我们预计若经济数据持续向好的话,美联储有可能在年底开始逐步缩减QE的力度,但这个时候市场的重点应该已经转到美国经济复苏上来了,而不是货币政策上。

二季度前期将是季报的高峰期,所以整个科技板块的波动性要大于一季度,预计整体季报将进一步加强市场对经济和企业盈利复苏的信心。从宏观方面看,美国科技板块将再次崛起引领美国经济走上路实的复苏之路。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	126,175,426.91	88.92
	其中:普通股	124,017,158.10	87.40
	存托凭证	2,158,268.81	1.52
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	7,782,588.59	5.48
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,710,316.03	5.43
8	其他各项资产	226,229.65	0.16
9	合计	141,894,561.18	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	126,175,426.91	90.94
合计	126,175,426.91	90.94

注:1.国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括注册地为开曼群岛、泽西岛和英国在美国上市的ADR。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	530,888.57	0.38
工业	2,668,544.03	1.92
非必须消费品	22,026,680.95	15.88
必须消费品	5,960,190.72	4.30
保健	16,715,764.57	12.05
金融	-	-
信息技术	76,859,299.60	55.40
电信服务	1,414,058.47	1.02
公共事业	-	-
合计	126,175,426.91	90.94

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	5,752	15,960,668.05	11.50
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	51,545	9,244,762.19	6.66
3	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,621	8,068,843.06	5.82
4	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纳斯达克证券交易所	美国	29,480	5,976,663.94	4.31
5	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,771	4,629,230.28	3.34
6	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	10,424	4,374,982.56	3.15
7	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	32,509	4,261,367.46	3.07
8	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	30,440	4,169,533.15	3.01
9	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	12,962	3,413,626.81	2.46
10	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,695	3,017,124.09	2.17

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF	契约性开放式	Invesco PowerShares Capital Mgmt LLC	7,782,588.59	5.61
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	79,000.01
4	应收利息	1,186.34
5	应收申购款	51,780.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	94,262.81
8	其他	-
9	合计	226,229.65

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存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	142,021,651.41
本报告期基金总申购份额	15,127,924.16
减:本报告期基金总赎回份额	19,209,400.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	137,940,175.43

§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纳斯达克100指数证券投资基金募集的文件

2.《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发纳斯达克100指数证券投资基金托管协议》

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

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
二〇一三年四月二十二日

广发双债添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

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。

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发双债添利债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月20日
报告期末基金份额总额	534,057,680.14份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,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高于业绩比较基准的收益。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金通过深入研究利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化情况,并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征,在符合相应投资比例规定的前提下,决定各类资产的配置比例。 2.固定收益类资产投资策略 本基金将采用"自上而下"的债券资产配置和"自下而上"的个券精选相结合的固定收益类资产投资策略。从整体上来看,固定收益类资产的投资策略主要可以分为以下三个层次:确定组合的久期和组合的利率期限结构;进行组合资产的类属配置和个券选择;根据相关影响因素的变化情况,对投资组合进行及时动态的调整。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×45%+中信标普可转债指数收益率×45%+中债国债总指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,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,高于货币市场基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	广发双债添利债券A类 / 广发双债添利债券C类
下属两级基金的交易代码	270044 / 270045
报告期末下属两级基金的份额总额	137,345,846.38份 / 396,711,833.76份

§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(2013年1月1日-2013年3月31日)	
	广发双债添利债券A类	广发双债添利债券C类
1.本期已实现收益	4,617,044.12	12,341,388.04
2.本期利润	6,951,655.77	18,204,729.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0351	0.0328
4.期末基金资产净值	143,306,830.05	412,818,489.58
5.期末基金份额净值	1.043	1.041

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

1.广发双债添利债券A类:

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	2.86%	0.26%	3.08%	0.32%	-0.22%	-0.06%

2.广发双债添利债券C类:

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	2.87%	0.25%	3.08%	0.32%	-0.21%	-0.07%

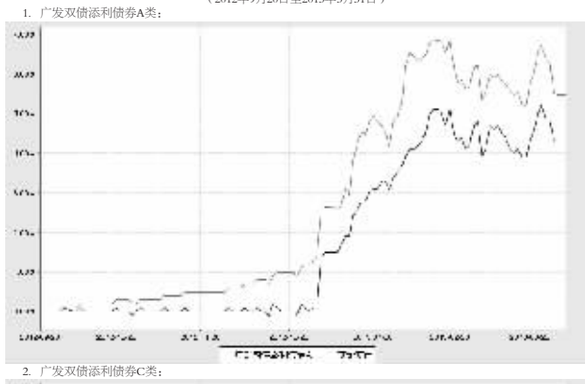
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发双债添利债券型证券投资基金

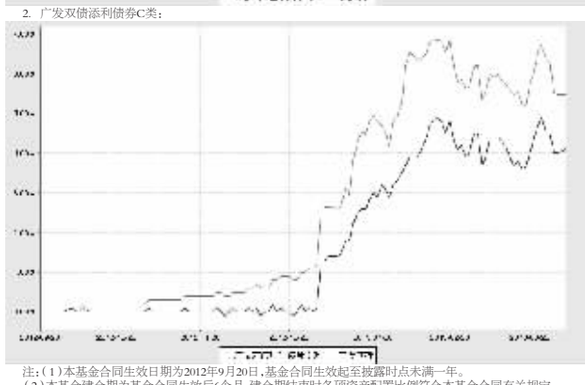
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月20日至2013年3月31日)

1. 广发双债添利债券A类:



2. 广发双债添利债券C类:



注:(1)本基金合同生效日期为2012年9月20日,基金合同生效起至披露时点未满一年。

(2)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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红基金的基金经理	2012-9-20	-	5	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部任债券研究员,2012年7月19日起任广发年年红债券基金基金经理,2012年9月20日起任广发双债添利债券型证券投资基金的基金经理。

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、《广发双债添利债券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

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

2013年1季度美国三大股指均是小步上扬的走势,在年初财政悬崖有惊无险之后市场风险偏好明显上升,加上美国经济数据的持续走稳,使得市场基本未能展开有效调整,仅仅在美联储一月份公开市场会议记录披露之后市场对提前退出QE的担忧导致了短暂的调整。

本季度纳斯达克100指数上涨5.58%,本基金以达到基金合同说规定的仓位,并严格按照指数复制操作,严格按照基金合同允许的范围对日常申购赎回进行操作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值上涨5.34%,跟踪指数上涨5.58%,日均偏离度为0.054%,报告期间跟踪误差0.158%,年化跟踪误差为2.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2季度,经济基本面的不确定性依然较大。本基金对经济的基本判断是:经济仍处于弱复苏阶段,但复苏的进程和力度仍不强,经济基本面对于外部环境的恶化和紧缩政策都会更加敏感。具体而言,在实体经济层面,主要的担心在于制造业投资未见起色、出口的持续性有待考验。除此之外,本基金还将重点关注房地产投资是否还能维持,并从非食品的角度关注通胀压力。

在具体的债券品种方面,考虑到信用利差已经持续处于历史低位,除非经济陷入通缩,纯债部分已经很难再获取超额收益。尽管对于2季度的资金面仍然乐观,但本基金仍然会陆续降低债券仓位,以中高等级信用债作为配置主体。对于利率品种,2季度末自通胀的压力较小,安全性较高,考虑到超额收益空间有限,维持较低的配置比例。对于可转债,目前持仓比例已经调整到中性水平,后续的配置主体仍会以盈利增长确定、估值较低的品种为主,适度参与转股意愿较强的高弹性个券。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	923,760,084.40	96.54
	其中:债券	923,760,084.40	96.54
	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	10,547,616.86	1.10
6	其他各项资产	22,593,904.34	2.36
7	合计	956,901,605.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	100,786,000.00	18.12
	其中:政策性金融债	100,786,000.00	18.12
4	企业债券	291,508,781.50	52.42
5	企业短期融资券	30,215,000.00	5.43
6	中期票据	304,715,000.00	54.79
7	可转债	196,535,302.90	35.34
8	其他	-	-
9	合计	923,760,084.40	166.11

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	1282356	12金隅MTN1	600,000	61,602,000.00	11.08
2	113002	工行转债	525,070	56,723,312.10	10.20
3	122747	12晋煤运	500,000	52,245,000.00	9.39
4	110015	石化转债	456,540	51,150,741.60	9.20
5	1282349	12中煤MTN1	500,000	50,465,000.00	9.07

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投资。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:(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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	92,404.17
2	应收证券清算款	5,255,406.91
3	应收股利	-
4	应收利息	15,446,368.19
5	应收申购款	1,799,725.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,593,904.34

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	56,723,312.10	10.20
2	110015	石化转债	51,150,741.60	9.20
3	110018	国电转债	49,090,600.00	8.83
4	110013	国投转债	28,570,531.80	5.14
5	113003	重工转债	10,415,439.00	1.87

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发双债添利债券A类	广发双债添利债券C类
本报告期期初基金份额总额	274,631,934.99	767,965,829.92
本报告期基金总申购份额	61,835,260.62	141,571,514.11
减:本报告期基金总赎回份额	199,121,349.23	512,825,510.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,345,846.38	396,711,833.76

§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双债添利债券型证券投资基金募集的文件

2.《广发双债添利债券型证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发双债添利债券型证券投资基金托管协议》

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

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
二〇一三年四月二十二日

广发消费品精选股票型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

§1 重要提示

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。

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发消费品精选股票
基金主代码	270041
交易代码	270041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月12日
报告期末基金份额总额	78,384,009.18份
投资目标	在深入研究的基础上,本基金精选消费品行业的优质上市公司进行投资,在严格控制风险的前提下,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合考虑基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例,并定期或不定期地进行调整。本基金将根据对消费品行业各细分子类行业的综合分析,确定各细分子类行业的资产配置比例。在细分子类行业配置的基础上,本基金将选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的消费品行业上市公司进行投资。
业绩比较基准	80%×申银万国消费品指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	7,880,372.10
2.本期利润	3,405,884.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0387
4.期末基金资产净值	82,460,050.55
5.期末基金份额净值	1.052

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

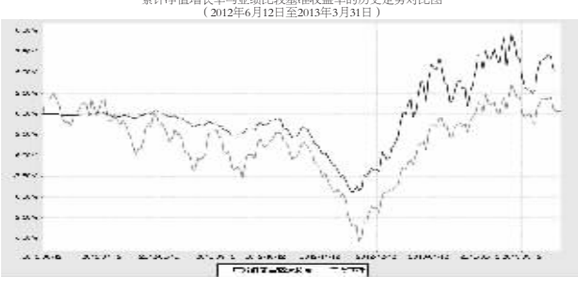
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.24%	1.39%	6.21%	0.97%	-2.97%	0.42%

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

广发消费品精选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

(2012年6月12日至2013年3月31日)



注:1.本基金合同生效日期为2012年6月12日,至披露时点,基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为六个月,建仓结束时各项资产