广发聚瑞股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6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:二〇一三年七月十八日

§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2013年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚瑞股票
基金主代码	270021
交易代码	270021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月16日
报告期末基金份额总额	2,591,484,078.13份
投资目标	深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律,把握主题投资机会,通过精选个股和有效的风险控制,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金为股票型基金,基金的资产配置比例范围为:股票资产占基金资产的60%—95%;现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%。基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 2."主题投资分析框架"策略 在股票投资方面,本基金主要采用自上而下的"主题投资分析框架"(Thematic Investing Analysis Frame),通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤,挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票,通过定量和定性相结合的方法,筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%×沪深300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货币市场基金和债券型基金。
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 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4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	522,888,414.27
2.本期利润	355,131,316.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.1200
4.期末基金资产净值	3,405,469,625.45
5.期末基金份额净值	1.314

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

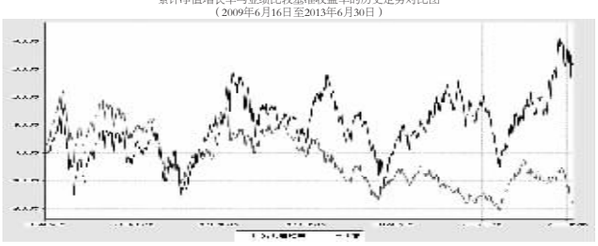
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.68%	2.26%	-9.24%	1.16%	18.92%	1.10%

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

广发聚瑞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

(2009年6月16日至2013年6月30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		
刘明月	本基金的基金经理;广发新经济股票基金的基金经理	2009-6-16	-	9	男,中国籍,金融学硕士,持有证券业执业资格证书,2004年7月至2007年2月任广发基金管理有限公司研究发展部研究员,2007年2月至2009年5月先后任广发基金管理有限公司研究发展部副总经理、机构投资部总经理,2009年6月16日起任广发聚瑞股票基金的基金经理,2013年2月6日起任广发新经济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、《广发聚瑞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。

本报告期内,本基金组合与主动型开放式基金。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

市场回顾:

第2季度市场整体表现为先略微向上再大幅向下,大幅收低。各行业表现不一,相对来说银行、券商、保险、地产、食品饮料、煤炭、有色等行业表现比较差,医药、TMT等行业表现较好。大盘下跌的主要原因是宏观经济增速兑现下降、房地产调控仍然坚决和效果仍然不佳、流动性在有限收缩。受益经济结构调整的部分行业仍然在延续之前的好的市场表现。

操作回顾:

广发聚瑞第2季度配置方向仍为稳定增长类行业,重点配置了医药、TMT、传媒、建筑工程、节能减排、偏国内消费的行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

聚瑞第2季报收益率为9.68%,而基准收益率为2.26%,跑赢基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内宏观政策仍为调结构、稳增长,新的环境变化是改革趋势比以前更确定、力度比以前更大。通胀压力目前还不大,国内商品房市场调控政策仍维持,支持刚需,流动性相关政策呈有限收缩状态。国内经济基调是调结构、稳增长、加强市场化改革,目前来看我国宏观经济基本稳定向下,结构调整将会有一定成效。

国内房地产调控和外围经济不佳对未来国内经济的影响还是长期的,尽管大多投资者对未来经济走势比较悲观,但是改革力度在加大、结构调整在加强、防经济过度下滑的后手还比较多,所以个人观点,中长期来看没必要太悲观。

预期低估值的价值股存在一定的机会,但长期还是看好大内需、经济结构调整受益的行业,看好中下游行业。

§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	3,226,416,543.65	92.94
	其中:股票	3,226,416,543.65	92.94
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	224,115,284.69	6.46
6	其他各项资产	21,003,607.43	0.61
7	合计	3,471,535,435.77	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	535,170.47	0.02
B	采矿业	124,023,210.22	3.64
C	制造业	2,137,757,602.89	62.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	142,650,024.33	4.19
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	586,379,843.48	17.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,121,942.54	0.03
L	租赁和商务服务业	24,345,521.10	0.71
M	科学研究和技术服务业	5,969,048.10	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	51,141,330.72	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,473,418.70	0.10
R	文化、体育和娱乐业	148,871,946.30	4.37
S	综合	147,484.80	0.00
	合计	3,226,416,543.65	94.74

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	002450	康得新	9,606,814	268,798,655.72	7.89
2	002241	歌尔声学	5,106,407	185,311,510.03	5.44
3	300027	华谊兄弟	5,072,298	148,871,946.30	4.37
4	300147	香雪制药	8,508,434	142,771,522.52	4.19
5	300228	富瑞特装	1,737,399	138,991,920.00	4.08
6	002236	大华股份	3,427,504	128,568,477.92	3.78
7	300212	易华录	4,224,197	126,725,910.00	3.72
8	300157	恒泰艾普	3,586,559	124,023,210.22	3.64
9	300115	长盈精密	3,664,444	117,775,230.16	3.46
10	600637	百视通	3,836,511	107,422,308.00	3.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 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股票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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,303,509.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	92,951.90
5	应收申购款	18,607,146.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,003,607.43

5.9.4 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。

5.9.5 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	300027	华谊兄弟	148,871,946.30	4.37	重大事项
2	-	-	-	-	-
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	3,629,248,740.96
本报告期基金总申购份额	657,713,166.74
减:本报告期基金总赎回份额	1,695,477,829.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,591,484,078.13

§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瑞股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚瑞股票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.《广发聚瑞股票型证券投资基金托管协议》;

5.《广发聚瑞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;

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
二〇一三年七月十八日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6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:二〇一三年七月十八日

§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2013年7月15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4月11日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证500ETF
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月11日
报告期末基金份额总额	173,038,319份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	中证500指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数中证500指数的表现,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(2013年4月11日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	22,150,482.55
2.本期利润	1,762,630.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	158,818,777.23
5.期末基金份额净值	0.9178

注:(1)本基金合同于2013年4月11日生效。

(2)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。

(3)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

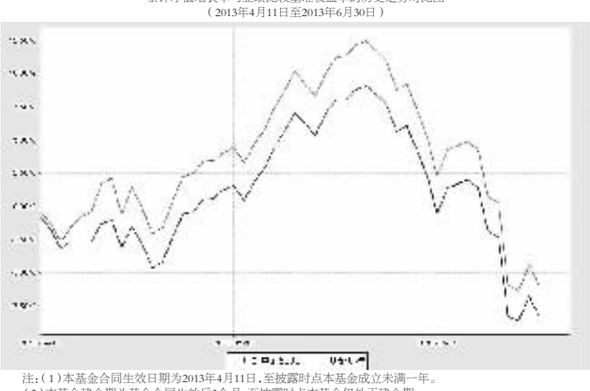
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.22%	1.52%	-5.86%	1.60%	-2.36%	-0.08%

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

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

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

(2013年4月11日至2013年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日期为2013年4月11日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后3个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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		
陈盛业	本基金的基金经理;广发中证500指数(lof)基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理	2013-4-11	-	6	男,中国籍,经济学博士,持有证券业执业证书,2007年3月至2009年9月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管,2009年9月至2010年8月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理,2010年8月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作,2010年12月1日起任广发沪深300指数基金及广发中证500指数(lof)基金的基金经理,2013年4月11日起任广发中证500ETF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、《广发中证500交易型开放式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,本基金组合与主动型开放式基金。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

按照指数结构复制指数进行运作。本季度内,基金交易和申购赎回正常,运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-8.22%,基金资产的日均跟踪误差为0.05%,日均跟踪偏离度为0.01%,符合控制在0.2%以内的要求。报告期内本基金较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政府已经意识未来中国经济可持续发展必须要走转型的道路,中证500成份股大多数是有转型前景的公司,因此我们看好指数的长期走势。

§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	156,306,182.11	97.61
	其中:股票	156,306,182.11	97.61
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	3,327,688.00	2.08
6	其他各项资产	506,892.31	0.32
7	合计	160,140,762.42	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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	3,471,000.72	2.19
B	采矿业	2,883,894.16	1.82
C	制造业	92,308,593.96	58.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,474,787.70	4.71
E	建筑业	4,445,667.11	2.80
F	批发和零售业	8,411,540.80	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	4,674,320.83	2.94
H	住宿和餐饮业	129,546.35	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,328,233.97	5.87
J	金融业	1,289,779.10	0.81
K	房地产业	13,523,023.46	8.51
L	租赁和商务服务业	1,788,848.64	1.13
M	科学研究和技术服务业	679,223.16	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	1,514,791.26	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,748,174.09	2.36
S	综合	636,436.80	0.40
	合计	156,307,862.11	98.42

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	000998	隆平高科	84,700	1,755,831.00	1.11
2	002230	科大讯飞	33,418	1,543,911.60	0.97
3	000400	许继电气	40,850	1,106,218.00	0.70
4	600436	片仔癀	7,880	1,078,141.60	0.68
5	000661	长春高新	10,709	1,048,518.19	0.66
6	000503	海虹控股	74,404	1,047,608.32	0.66
7	600867	通化东宝	68,400	1,018,476.00	0.64
8	600200	江苏吴中	64,361	1,006,606.04	0.63
9	000793	华闻传媒	98,843	990,406.86	0.62
10	000598	兴蓉投资	187,832	903,471.92	0.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值主要目的。在构建股票投资组合的同时,通过卖出股指期货对冲市场下行风险,降低系统风险损失,提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	149,989.14
2	应收证券清算款	345,376.63
3	应收股利	10,305.60
4	应收利息	1,220.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	506,892.31

5.9.4 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。

5.9.5 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	000998	隆平高科	1,755,831.00	1.11	重大事项
2	600436	片仔癀	1,078,141.60	0.68	重大事项
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	425,038,319
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	122,000,000
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	374,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	173,038,319

§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中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.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
二〇一三年七月十八日

广发策略优选混合型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6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:二〇一三年七月十八日

§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2013年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发策略优选混合	
基金主代码	270006	
交易代码	270006	270016
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年5月17日	
报告期末基金份额总额	6,044,044,436.72份	
投资目标	通过综合运用多种投资策略优选股票,分享中国经济和资本市场高速增长的成果,为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。	
投资策略	本基金将主要根据宏观经济政策、资金供求、市场波动周期因素的判断,确定资产配置策略;通过综合运用主题投资、买入持有、逆向投资等多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合;通过利率预测以及收益曲线策略进行债券投资;同时严格遵守有关权证投资的比例限制。	
业绩比较基准	本基金自2013年1月17日起,将基金业绩比较基准由"75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"75%*沪深300指数+25%*中证全债指数"。	
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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-38,334,670.23
2.本期利润	-615,787.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0001
4.期末基金资产净值	7,519,778,940.44
5.期末基金份额净值	1.2442

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

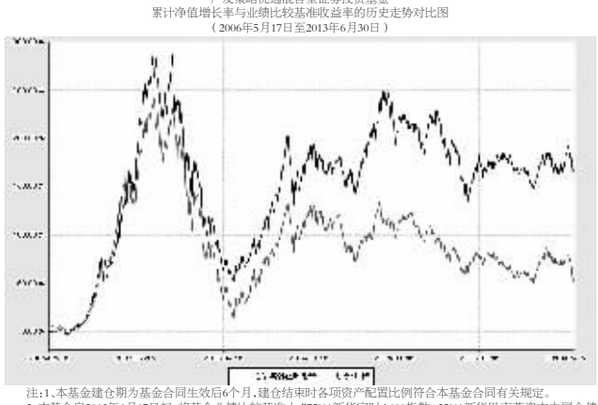
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.12%	1.11%	-8.60%	1.09%	8.48%	0.02%

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

广发策略优选混合型证券投资基金

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

(2006年5月17日至2013年6月30日)



注:1.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。

2.本基金自2013年1月17日起,将基金业绩比较基准由"75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"75%*沪深300指数+25%*中证全债指数"。

§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		
冯永欢	本基金的基金经理;广发消费品精选股票基金的基金经理;广发大盘成长混合基金的基金经理	2008-2-14	-	9	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,2004年2月28日至2007年3月28日先后任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究发展部总经理助理,广发稳健增长混合基金的基金经理助理,2007年3月29日至2010年12月30日任广发稳健增长混合基金的基金经理,2008年2月14日起任广发策略优选混合基金的基金经理,2012年6月12日起任广发消费品精选股票基金的基金经理,2013年2月5日起任广发大盘成长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、《广发策略优选混合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