广发增强债券型证券投资基金

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	广发增强债券
基金主代码	270009
交易代码	270009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年3月27日
报告期末基金份额总额	1,012,980,907.84份
投资目标	在保持投资组合低风险和较高流动性的前提下,追求基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债券、可转换公司债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购,持有因可转债转股所形成的股票及该股票派发的权证或可分离交易可转债分离交易的权证等资产,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券品种。因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。本基金不通过二级市场买入股票或权证。本基金债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%,非债券类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 本基金通过利率预测、收益曲线预测、债券类属配置、信用策略和套利机会挖掘构建固定收益类资产投资组合;本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购参与标的、参与规模和退出时机。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,具有低风险,低预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,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	5,821,989.07
2.本期利润	2,358,979.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0019
4.期末基金资产净值	1,135,345,223.70
5.期末基金份额净值	1.121

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。

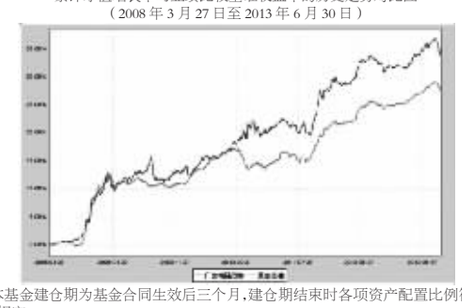
3.2 基金净值表现

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	0.18%	0.18%	0.98%	0.10%	-0.80%	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

广发增强债券型证券投资基金
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
(2008年3月27日至2013年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后三个月,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		
谢军	本基金的基金经理;广发聚源保本混合基金的基金经理;广发聚源定期债券基金的基金经理;固定收益部副总经理	2008-3-27	-	10	男,中国籍,金融学硕士,持有证券业执业资格证书和特许金融分析师状(CFA),2003年7月至2006年9月先后任广发基金管理有限公司研究发展部产品设计人员、企业年金和债券研究员,2006年9月12日至2010年4月28日任广发货币基金的基金经理,2008年3月27日起任广发增强债券基金基金经理,2008年4月17日至2012年2月14日先后任广发基金管理有限公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理,2011年3月15日起任广发聚泽保本混合基金的基金经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2013年5月8日起任广发聚源定期债券基金的基金经理。

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、《广发增强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

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

二季度市场的焦点转移,弱复苏被证伪,市场整体收益率一度下行。但二季度,一些结构性问题暴露,一是银行间债券市场监管加强,二是过去一段时间,社会融资总量增长偏快,资金空转显现明显,央行在6月份出手整顿,导致银行间利率突飚。整体来看,市场收益率先扬后抑。

权益市场也走出先扬后抑的走势,特别是在5月底后,大幅下跌。转债市场也是如此。

我们在4月中旬后已经清仓转债,躲过了大跌。但在6月中旬市场利率大幅飚升的那几天时候,有较大赎回,杠杆被迫提升,导致净值超跌。之后,基金调整完组合后,加仓了部分转债,提高到中性仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本季度收益为0.18%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期的事件,基金经理经过思考认为,不一定是偶然。国内信用市场发展所建立的基础已经脱离现金流、脱离抵押品,纯粹依赖于刚性兑付基础上。所以发生了结构性矛盾和短周期矛盾的冲突。所以整体上,组合调整未来将全方位考虑债市收益率的驱动因素。大的方向是未来会逐步降低整体杠杆和信用风险暴露,波段配置转债。

基于上述判断,我们接下来策略倾向为:对利率和高等级品种久期保持相对高位,均衡配置信用债,转债维持中性偏高配置,降低整体组合杠杆。

具体而言,基金管理人将紧密跟踪市场数据,判断经济周期阶段,把握好大类资产配置,优化本基金的风险收益特征,为投资者带来较低风险的稳健收益。

§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	1,793,768,946.67	82.45
	其中:债券	1,793,768,946.67	82.45
	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	183,818,673.44	8.45
6	其他各项资产	198,023,097.47	9.10
7	合计	2,175,610,717.58	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投资。

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投资。

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	334,368,337.80	29.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	520,188,000.00	45.82
	其中:政策性金融债	520,188,000.00	45.82
4	企业债券	649,000,927.17	57.16
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	182,511,000.00	16.08
7	可转债	107,700,681.70	9.49
8	其他	-	-
9	合计	1,793,768,946.67	157.99

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	010107	21国债(7)	1,355,000	142,329,200.00	12.54
2	019116	11国债16	950,000	101,460,000.00	8.94
3	130402	13农发02	1,000,000	99,780,000.00	8.79
4	130406	13农发06	1,000,000	99,090,000.00	8.73
5	110311	11进出11	800,000	81,744,000.00	7.20

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	356,665.08
2	应收证券清算款	19,230,868.41
3	应收股利	-
4	应收利息	35,622,236.70
5	应收申购款	142,813,327.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,023,097.47

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	110015	石化转债	33,402,766.60	2.94
2	110020	南山转债	32,808,445.80	2.89
3	113001	中行转债	31,817,961.30	2.80

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

本报告期期初基金份额总额	1,302,942,104.55
本报告期基金总申购份额	500,332,953.94
减:本报告期基金总赎回份额	790,294,150.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,012,980,907.84

§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增强债券型证券投资基金募集的文件;

2.《广发增强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.《广发增强债券型证券投资基金托管协议》;

5.《广发增强债券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

广发深证100指数分级证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	广发深证100指数分级		
基金主代码	162714		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年5月7日		
报告期末基金份额总额	163,947,688.80份		
投资目标	本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对深证100指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金为指数型基金,主要采用完全复制法,即按照标的指数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。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,广发深证100A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;广发深证100B份额具有高风险、高预期收益的特征。		
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		
下属三级基金的基金简称	广发深证100指数分级A	广发深证100指数分级B	广发深证100指数分级
下属三级基金的交易代码	150083	150084	162714
报告期末下属三级基金的份额总额	51,966,670.00份	51,966,671.00份	60,014,347.80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4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-2,104,953.05
2.本期利润	-11,060,009.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0589
4.期末基金资产净值	132,361,081.08
5.期末基金份额净值	0.8073

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。

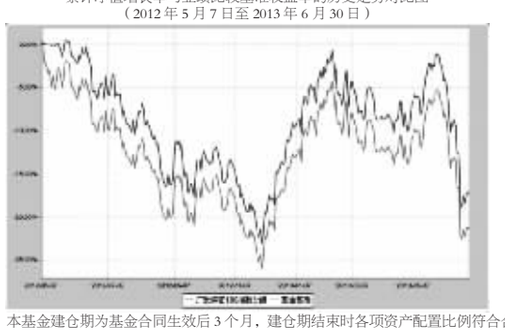
3.2 基金净值表现

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	-9.18%	1.50%	-10.13%	1.51%	0.95%	-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

广发深证100指数分级证券投资基金
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5月7日至2013年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理;数量投资部总经理	2012-5-7	-	14	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年8月9日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理,2011年6月3日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金的基金经理。

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、《广发深证100指数分级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

本季度内,本基金的申购赎回及本基金的分级份额的交易、分拆、合并运作正常,运作过程中未发生风险事件。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资,除2只法规限制投资的指数样本证券采用样本替代投资方法之外,其余指数样本采用完全复制方法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-9.18%,基金业绩基准为-10.13%。由于样本替代股票的贡献因素影响,跑赢同期业绩基准0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

深证100指数由深市规模大、成交活跃的100只样本证券构成,包含了大量成长性好的股票,行业分布较为均匀。深证100指数是分享经济结构转型和恢复性增长的良好工具,也是进行长期投资的优秀标的。

§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	121,598,410.57	90.06
	其中:股票	121,598,410.57	90.06
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	8,343,240.02	6.18
6	其他各项资产	5,079,295.25	3.76
7	合计	135,020,945.84	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	658,876.94	0.50
B	采矿业	5,318,940.31	4.02
C	制造业	73,444,631.48	55.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	766,782.15	0.58
E	建筑业	2,199,168.18	1.66
F	批发和零售业	1,163,322.00	0.88
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	3,084,210.55	2.33
J	金融业	10,717,679.35	8.10
K	房地产业	16,722,064.29	12.63
L	租赁和商务服务业	677,375.08	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,741,751.86	3.58
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	968,122.38	0.73
S	综合	1,135,486.00	0.86
	合计	121,598,410.57	91.87

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	1,114,740	10,980,189.00	8.30
2	000651	格力电器	289,523	7,255,446.38	5.48
3	000527	美的电器	397,211	4,933,360.62	3.73
4	000001	平安银行	450,681	4,493,289.57	3.39
5	000858	五 粮 液	192,171	3,851,106.84	2.91
6	000538	云南白药	32,537	2,733,433.37	2.07
7	000895	双汇发展	67,395	2,590,663.80	1.96
8	000063	中兴通讯	200,242	2,553,085.50	1.93
9	000423	东阿阿胶	63,048	2,438,696.64	1.84
10	000157	中联重科	400,326	2,173,770.18	1.64

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	28,003.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,767.45
5	应收申购款	5,049,524.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,079,295.25

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发深证100指数分级A	广发深证100指数分级B	广发深证100指数分级
本报告期期初基金份额总额	52,577,161.00	52,577,162.00	95,881,164.20
本报告期基金总申购份额	-	-	26,139,830.44
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	63,227,628.84
本报告期基金拆分变动份额	-610,491.00	-610,491.00	1,220,982.00
本报告期期末基金份额总额	51,966,670.00	51,966,671.00	60,014,347.80

注:拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额及份额折算所得份额。

§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深证100指数分级证券投资基金募集的文件

2.《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》

3.《广发深证100指数分级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

广发理财年年红债券型证券投资基金

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	广发理财年年红债券
基金主代码	270043
交易代码	270043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月19日
报告期末基金份额总额	543,111,437.13份
投资目标	本基金主要投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求为投资者获取稳健的收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,具体包括企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、短期融资券、高收益债券、中期票据、资产支持证券、债券回购及银行存款等。在封闭期内,本基金采用买入并持有策略,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配,主要投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。在开放期,本基金原则上将使基金资产保持现金状态。基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排、防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的银行一年期定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与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。
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	8,195,128.91
2.本期利润	8,195,128.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0151
4.期末基金资产净值	566,062,086.51
5.期末基金份额净值	1.042

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。

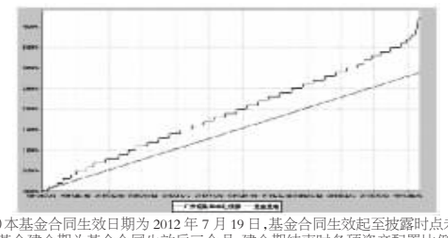
3.2 基金净值表现

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	1.46%	0.05%	0.76%	0.00%	0.70%	0.05%

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

广发理财年年红债券型证券投资基金
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7月19日至2013年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日期为2012年7月19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三个月,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;广发双债添利债券基金的基金经理	2012-7-19	-	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 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、《广发理财年年红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2季度,经济数据重回弱势,债市具备经济基本面支持,但2季度以来针对债券市场监管升级不断干扰债市表现。在4,5月份资金面相对宽松的条件下,纯债部分整体获得了较好的收益。5月中下旬之后,资金利率逐步提升,并且在6月中下旬达到历史高点,股票和债券等资产均出现明显回调。

从5月份开始,持仓债券逐步到期,本基金对于这类到期偿付的现金,通过银行间逆回购和定存进行流动性