

## 广发聚祥保本混合型证券投资基金

### 2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十三日

**1.1 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。  
基金管理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10月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者自行承担投资风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告所载资料截止至2013年9月30日止。

5.2 基金产品概况	
基金简称	广发聚祥
基金代码	270027
交易场所	深交所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月15日
报告期末基金份额总额	1,718,327,773.67份
投资目标	在力争保本的前提下,严格控制风险,谋求基金资产的稳定增值。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金主要根据宏观经济周期和估值水平动态调整资产配置和风险控制的高低。 2. 债券投资策略 本基金的债券投资根据投资策略的不同分为两个部分,以避险策略(Dedicated Strategy)为主,通过自上而下和行业自下而上的方式,在严格控制风险和久期的基础上,积极寻找具有较高性价比的个券进行配置。 3. 股票投资策略 本基金主要以上市公司基本面、估值水平、市场情绪三方面选择参与标的,参与挖掘和选股,并通过对行业研究和上市公司基本面研究,积极寻找具有较高性价比的个股进行配置。 4. 衍生品投资策略 本基金通过 CARR 投资策略选择具备长期下行波动性、低风险、具有中长期上涨潜力的个股进行配置,控制衍生品风险和波动率风险,追求投资组合收益的长期稳定增值。 5. 权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于组合基金风险控制,有利于基金资产增值。 6. 股指期货投资策略 本基金为保本混合基金,属于证券投资基金中的低风险品种。 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 基金销售人:中国工商银行股份有限公司

**5.3 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7月1日-2013年9月30日)		
1.本期已实现收益	1,209,856.03		
2.本期利润	-38,839,292.31		
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0214		
4.期末基金份额净值	1.72,164,108.40		
本期利润/基金份额净值	1.00		
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。 注: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 本报告期末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			

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。

**5.4 管理人报告**

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏军	本基金基金经理	2011-3-15	10	男,中国籍,金融学硕士,持有证券业执业资格证书和证券投资基金从业资格(CFA),2003年9月至2006年9月担任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2006年9月至2008年4月担任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2008年4月17日至2010年11月担任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2010年11月18日起任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司资产管理部副经理。
李晖	本基金基金经理	2012-10-23	13	男,中国籍,经济学学士,持有证券业执业资格证书,2006年8月至2008年4月担任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2008年4月17日至2010年11月担任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2010年11月18日起任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司资产管理部副经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司资产管理部副经理。

注:1.“任职日期”和“离任日期”指公告聘任或解聘日期。  
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。  
3.2 基金净值表现  
3.2.1 本报告期末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

3.2.2 本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

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(2011年3月15日至2013年9月30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。

**5.5 投资组合报告**

5.5.1 报告期末基金资产组合情况

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	120006	12国债08	1,500,000	142,170,000.00	8.07
2	122224	12电气02	1,300,000	130,533,000.00	7.52
3	110311	11进出11	1,000,000	99,120,000.00	5.59
4	120410	12国债10	1,000,000	94,460,000.00	5.33
5	120009	12国债09	1,000,000	93,930,000.00	5.30

5.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,463,788.10	0.42
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,484,000.00	0.65
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	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	教育、培训和综合服务业	-	-
O	医药、医疗器械和保健服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		18,947,788.10	1.07

5.5.3 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	601117	中国化学	1,450,000	11,484,000.00	0.65
2	600662	华闻集团	357,200	7,463,788.10	0.42
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.5.4 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	120006	12国债08	1,500,000	142,170,000.00	8.07
2	122224	12电气02	1,300,000	130,533,000.00	7.52
3	110311	11进出11	1,000,000	99,120,000.00	5.59
4	120410	12国债10	1,000,000	94,460,000.00	5.33
5	120009	12国债09	1,000,000	93,930,000.00	5.30

5.5.5 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资产支持证券投资明细

5.5.6 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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110001	中信转债	10,003,000.00	0.56	
2	110035	石钢转债	4,894,500.00	0.28	
3	110017	中南转债	4,619,000.00	0.26	

5.5.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.6 开放式基金份额变动

本报告期初基金份额总额	1,891,062,270.40
本报告期基金总申购金额	-
减:本报告期基金总赎回金额	172,737,496.81
本报告期末基金份额总额	1,718,327,773.67

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理资产情况

5.8 基金资产投资

5.8.1 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.2 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.3 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.4 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.5 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.6 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.7 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.8 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.9 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.10 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.11 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.12 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.13 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.14 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.15 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.16 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.17 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.18 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.19 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.20 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.21 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.22 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.23 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.24 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.25 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.26 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.27 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.28 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.29 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.30 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.31 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.32 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.33 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.34 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.35 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.36 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.37 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.38 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.39 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.40 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.41 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.42 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.43 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.44 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.45 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.46 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.47 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.48 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.49 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.50 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.51 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.52 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.53 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.54 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.55 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.56 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.57 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.58 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.59 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.60 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.61 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.62 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.63 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.64 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.65 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.66 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.67 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.68 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.69 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.70 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.71 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.72 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.73 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.74 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.75 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.76 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.77 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.78 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.79 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.80 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.81 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.82 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.83 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.84 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.85 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.86 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.87 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.88 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.89 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.90 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.91 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.92 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.93 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.94 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.95 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.96 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.97 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.98 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.99 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.100 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.101 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.102 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.103 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.104 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.105 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.106 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.107 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.108 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.109 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.110 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.111 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.112 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.113 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.114 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.115 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.116 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.117 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.118 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资

5.8.119 中国证券投资基金业协会备案的基金资产投资