广发沪深300指数证券投资基金

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 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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300指数
基金主代码	270010
交易代码	270010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月30日
报告期末基金份额总额	2,178,941,498.84份
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。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,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-83,605,279.93
2.本期利润	216,719,854.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0920
4.期末基金资产净值	2,336,652,693.33
5.期末基金份额净值	1.072

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。

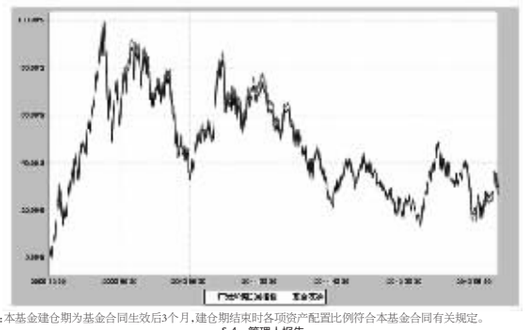
3.2 基金净值表现

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	9.50%	1.38%	9.01%	1.36%	0.49%	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

广发沪深300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
(2008年12月30日至2013年9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		
陈盛业	本基金的基金经理;广发中证500指数(of)的基金经理;广发中证500ETF基金的基金经理;广发深证100指数分级基金的基金经理	2010-12-1	-	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(of)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,2013年9月9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 管理人对投资组合合规性的说明

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、《广发沪深300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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。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

(1)报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.06%,符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要有两个:一是基金成份股调整因素,本基金季度末的成份股调整策略合理,较好地控制了该因素带来的误差;二是申购和赎回因素,本基金成立以来规模稳步增长,目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2)简要展望

作为指数基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

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9.50%,业绩比较基准收益率为9.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度以来,整个中国宏观经济数据逐步好转,经济周期有触底反弹的迹象,在此背景下,我们预计四季度以沪深300指数为代表的蓝筹可能迎来上涨的行情。

§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	2,213,387,299.54	94.29
	其中:股票	2,213,387,299.54	94.29
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	124,258,269.82	5.29
6	其他各项资产	9,827,507.64	0.42
7	合计	2,347,473,077.00	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	16,666,031.40	0.71
B	采矿业	156,720,202.82	6.71
C	制造业	785,006,865.50	33.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,437,711.39	2.84
E	建筑业	78,708,780.48	3.37
F	批发和零售业	53,451,848.11	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	50,506,528.11	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,457,778.64	2.42
J	金融业	764,840,436.15	32.73
K	房地产业	121,795,092.15	5.21
L	租赁和商务服务业	16,868,867.64	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,471,788.50	0.70
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	8,711,586.94	0.37
S	综合	20,743,781.71	0.89
	合计	2,213,387,299.54	94.72

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	600016	民生银行	9,823,414	93,911,837.84	4.02
2	600036	招商银行	7,243,041	79,094,007.72	3.38
3	600030	中信证券	5,624,027	69,119,291.83	2.96
4	601328	交通银行	13,629,447	58,606,622.10	2.51
5	601166	兴业银行	4,971,595	55,532,716.15	2.38
6	601318	中国平安	1,457,051	52,016,720.70	2.23
7	000002	万 科A	5,503,917	50,250,762.21	2.15
8	600000	浦发银行	4,867,776	49,115,859.84	2.10
9	600837	海通证券	3,519,361	44,027,206.11	1.88
10	000651	格力电器	1,538,314	40,857,619.84	1.75

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
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金投资国债期货以套期保值为主要目的,在构建债券投资组合时,可通过国债期货对冲利率风险。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期内未进行国债期货交易。
5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期内未进行国债期货交易。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 根据中国平安保险(集团)股份有限公司(601318.SH)2013年5月22日发布的《关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》显示,中国平安集团的控股子公司平安证券收到证监会的处罚通知书。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。
本基金今年以来对中国平安(601318.SH)小幅减仓,截至2013年三季末仍持有1,457,051股。投资逻辑是:中国平安是沪深300指数前五大权重股之一,同时也是保险股龙头品种;本基金为保证对指数的良好追踪,故进行适度配置。
除上述证券外,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,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。
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(元)
1	存出保证金	1,417,004.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	227,800.08
4	应收利息	24,853.40
5	应收申购款	8,157,849.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,827,507.64

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换期的可转换债券。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末持有处于转换期的可转换债券。

§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	3,037,411,547.18
本报告期基金总申购份额	421,286,481.32
减:本报告期基金总赎回份额	1,279,756,529.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,178,941,498.84

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会批准广发沪深300指数证券投资基金募集的文件;
2.《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》;
3.《广发沪深300指数证券投资基金托管协议》;
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.《广发沪深300指数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。
8.2 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
8.3 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
二〇一三年十月二十三日

广发聚富开放式证券投资基金

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 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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚富混合	
基金主代码	270001	
交易代码	270001	270011
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年12月3日	
报告期末基金份额总额	4,068,050,917.91份	
投资目标	依托高速发展的宏观经济和资本市场,通过基金管理人科学研究,审慎投资,在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	积极投资策略,在资产配置层面,重视股票资产和债券资产的动态平衡配置;在行业配置层面,根据不同行业的发展前景进行行业优化配置;在个股选择层面,在深入把握上市公司基本面的基础上挖掘价格尚未完全反映投资价值的潜力股的投资机会。	
业绩比较基准	80%*中信标普300指数收益+20%*中信标普全债指数收益	
风险收益特征	本基金风险收益特征介于成长基金与价值基金之间;适度风险、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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	241,603,914.81
2.本期利润	289,722,700.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0703
4.期末基金资产净值	4,980,270,504.14
5.期末基金份额净值	1.2242

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。

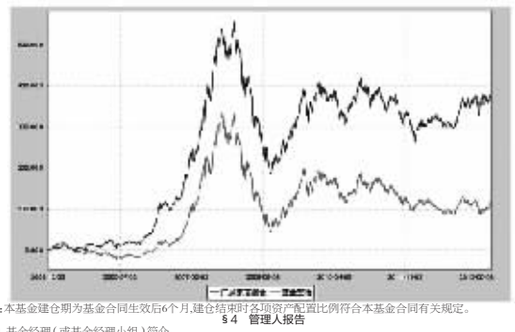
3.2 基金净值表现

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	6.09%	1.00%	8.63%	1.12%	-2.54%	-0.12%

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

广发聚富开放式证券投资基金
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
(2003年12月3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		
祝捷	本基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理	2010-12-31	-	8	男,经济学硕士,持有证券业执业证书,2005年7月至2007年7月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员,2008年8月至2010年5月任农银汇理基金管理有限公司研究部行业研究员,2010年5月至今任职于广发基金管理有限公司,2010年12月31日起任广发聚富混合基金的基金经理;2013年9月11日起任广发趋势优选灵活配置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、《广发聚富开放式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。

本投资组合为主动型开放式基金。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

三季度,市场延续了上半年的特征,成长股行情超出了本基金的预期,成长股继续大幅跑赢市场,地产、家电等低估值板块继续跑输,两极分化严重。

由于流动性环境已经开始发生改变,经济虽然短期企稳,中期内继续下滑的概率仍然很大。在经济下滑过程中,市场对部分行业和个股过度乐观。估值偏贵、盈利不达预期板块回调的可能性很大。

基于以上考虑,本基金将继续坚定持有基本面扎实、估值相对合理的个股,继续回避高估值、基本面缺乏支撑的股票。本基金力争通过对基本面的持续跟踪,配置上坚持行业集中、方向均衡的策略,获取超额收益。

风险提示:

IPO重启对高估值板块较为不利。

§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	3,267,817,942.22	65.36
	其中:股票	3,267,817,942.22	65.36
2	固定收益投资	1,021,144,000.00	20.42
	其中:债券	1,021,144,000.00	20.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	398,501,048.15	7.97
	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	285,087,271.30	5.70
6	其他各项资产	27,471,474.36	0.55
7	合计	5,000,021,736.03	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,649,113,389.24	33.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	249,135,573.00	5.00
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	-	-
J	金融业	239,407,000.00	4.81
K	房地产业	1,101,675,358.08	22.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	28,486,621.90	0.57
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,267,817,942.22	65.62

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	600594	益佰制药	13,250,000	445,200,000.00	8.94
2	600048	保利地产	44,000,016	434,720,158.08	8.73
3	000002	万 科A	41,500,000	378,895,000.00	7.61
4	000651	格力电器	12,000,000	318,720,000.00	6.40
5	000024	招商地产	12,000,000	288,000,000.00	5.78
6	000963	华东医药	5,675,070	249,135,573.00	5.00
7	002415	海康威视	9,400,000	248,160,000.00	4.98
8	600030	中信证券	11,300,000	138,877,000.00	2.79
9	600422	昆明制药	5,000,000	134,900,000.00	2.71
10	600066	宇通客车	6,120,990	112,626,216.00	2.26

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	160,288,000.00	3.22
3	金融债券	860,856,000.00	17.29
	其中:政策性金融债	860,856,000.00	17.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,021,144,000.00	20.50

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	120419	12农发19	3,200,000	319,392,000.00	6.41
2	120318	12进出18	2,200,000	219,802,000.00	4.41
3	130229	13国开29	1,800,000	174,222,000.00	3.50
4	1101081	11央行票据81	1,600,000	160,288,000.00	3.22
5	130218	13国开18	500,000	49,665,000.00	1.00

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
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金投资国债期货以套期保值为主要目的,在构建债券投资组合时,可通过国债期货对冲利率风险。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期内未进行国债期货交易。
5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期内未进行国债期货交易。
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不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(元)
1	存出保证金	2,105,630.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,817,487.15
5	应收申购款	548,356.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,471,474.36

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

§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	4,172,399,101.61
本报告期基金总申购份额	265,637,252.21
减:本报告期基金总赎回份额	369,985,435.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,068,050,917.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会批准广发聚富开放式证券投资基金募集的文件;
2.《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》;
3.《广发聚富开放式证券投资基金托管协议》;
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.《广发聚富开放式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。
8.2 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
8.3 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
二〇一三年十月二十三日

广发聚丰股票型证券投资基金

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 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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚丰股票	
基金主代码	270005	
交易代码	270005	270015
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年12月23日	
报告期末基金份额总额	27,385,485,681.55份	
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。	
投资策略	本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票,同时保持两类资产的适度均衡配置,构建股票投资组合。	
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"80%*新华富时A600指数+20%*新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"80%*沪深300指数+20%*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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-220,037,264.41
2.本期利润	1,326,459,454.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0473
4.期末基金资产净值	18,768,896,806.25
5.期末基金份额净值	0.6854

注:(1)所述基金财务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。

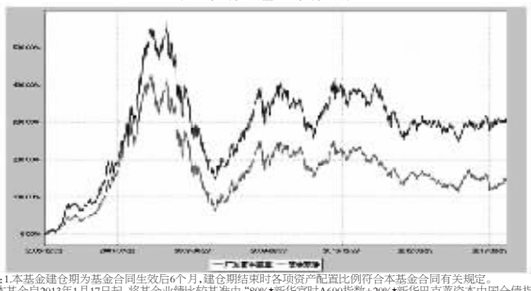
3.2 基金净值表现

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	7.36%	1.17%	7.35%	1.15%	0.01%	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

广发聚丰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
(2005年12月23日至2013年9月30日)



注:1.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。
2.本基金自2013年1月17日起,将基金业绩比较基准由"80%*新华富时A600指数+20%*新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"80%*沪深300指数+20%*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		
傅友兴	本基金的基金经理	2013-2-5	-	11	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,2002年2月至2006年3月先后任天同基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投委会秘书,2006年4月至2013年2月先后任广发基金管理有限公司研究员、基金经理助理、研究发展部副总经理、研究发展部总经理,2013年2月5日起任广发聚丰股票基金的基金经理。
易阳方	本基金的基金经理;公司副总经理、投资总监	2005-12-23	-	16	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,1997年1月至2002年11月任职于广发证券股份有限公司,2002年11月至2003年11月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员,2003年12月3日至2007年3月28日任广发聚富混合基金的基金经理,2005年5月13日至2011年1月5日任广发基金管理有限公司投资管理部总经理,2005年12月23日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2006年9月4日至2008年4月16日任广发基金管理有限公司总经理助理,2008年4月