

广发聚丰股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:二〇一四年十月二十七日

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2014年10月23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2014年7月1日起至9月30日止。

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	303,804,281.64	1.91
B	采矿业	113,213,859.99	0.71
C	制造业	10,499,532,985.08	66.12
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	100,655,076.12	0.63
E	建筑业	117,428,138.97	0.74
F	批发和零售业	154,448,073.67	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	40,361,037.26	0.25
H	住宿和餐饮业	97,396,530.24	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	890,474,950.06	5.61
J	金融业	187,023,000.00	1.18
K	房地产业	396,568,599.20	2.50
L	租赁和商务服务业	104,689,559.04	0.66
M	科学研究和技术服务业	142,598,000.00	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	39,733,980.81	0.25
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,773,792.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	628,225,507.76	3.96
S	综合	7,740,000.00	0.05
合计		13,842,027,372.50	87.16

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	600252	广中集团	47,905,710	674,991,453.90	4.25
2	600994	招商医药	17,706,960	663,032,082.00	4.18
3	002422	科伦药业	18,501,110	585,673,500.20	3.71
4	400309	万润化学	31,480,000	543,534,000.00	3.42
5	600373	中信特钢	31,099,988	489,202,496.64	3.08
6	600703	三安光电	31,027,084	474,696,660.40	2.99
7	002236	大乐股份	16,945,575	467,189,502.75	2.94
8	300003	东方医疗	18,400,000	432,402,115.00	2.72
9	000245	三钢环保	12,739,960	345,633,648.00	2.18
10	300173	海南橡胶	15,659,193	301,752,619.11	1.90

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	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

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	110027	东方债01	63,900	7,080,144.00	0.05
2	113007	中信转债	19,230	2,322,407.10	0.01
3	128008	三钢转债	12,500	1,250,000.00	0.01
4	128007	通钢转债	9,960	1,244,163.36	0.01

5.6 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					
序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	110027	东方债01	63,900	7,080,144.00	0.05
2	113007	中信转债	19,230	2,322,407.10	0.01
3	128008	三钢转债	12,500	1,250,000.00	0.01
4	128007	通钢转债	9,960	1,244,163.36	0.01

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 (1)本基金本报告期末未持有股指期货。
 (2)本基金本报告期未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 (1)本基金本报告期末未持有国债期货。
 (2)本基金本报告期未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注		
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名股票中超出基金合同规定的备选股票情况	说明	
1	存出保证金	2,589,926.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	303,133.58
6	其他应收款	1,625,160.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,608,230.52

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名债券中超出基金合同规定的备选债券情况					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300072	三安转债	349,653,114.80	2.18	重大限售
2	600703	三安光电	1,683,666.40	1.22	非公开发行股票限售
3	600994	招商医药	18,757,332.00	0.12	非公开发行股票限售

5.11.3 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
股指期货	IF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.4 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
国债期货	TF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.5 本报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
权证	-	-	-	-	-

5.11.6 投资组合报告附注		
5.11.6.1 报告期内本基金投资的前十名股票中超出基金合同规定的备选股票情况	说明	
1	存出保证金	2,589,926.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	303,133.58
6	其他应收款	1,625,160.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,608,230.52

5.11.6.2 报告期内本基金投资的前十名债券中超出基金合同规定的备选债券情况					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300072	三安转债	349,653,114.80	2.18	重大限售
2	600703	三安光电	1,683,666.40	1.22	非公开发行股票限售
3	600994	招商医药	18,757,332.00	0.12	非公开发行股票限售

5.11.6.3 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
股指期货	IF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.4 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
国债期货	TF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.5 本报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
权证	-	-	-	-	-

5.11.6.6 投资组合报告附注		
5.11.6.6.1 报告期内本基金投资的前十名股票中超出基金合同规定的备选股票情况	说明	
1	存出保证金	2,589,926.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	303,133.58
6	其他应收款	1,625,160.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,608,230.52

5.11.6.6.2 报告期内本基金投资的前十名债券中超出基金合同规定的备选债券情况					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300072	三安转债	349,653,114.80	2.18	重大限售
2	600703	三安光电	1,683,666.40	1.22	非公开发行股票限售
3	600994	招商医药	18,757,332.00	0.12	非公开发行股票限售

5.11.6.6.3 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
股指期货	IF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.6.4 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
国债期货	TF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.6.5 本报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
权证	-	-	-	-	-

5.11.6.6.6 投资组合报告附注		
5.11.6.6.6.1 报告期内本基金投资的前十名股票中超出基金合同规定的备选股票情况	说明	
1	存出保证金	2,589,926.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	303,133.58
6	其他应收款	1,625,160.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,608,230.52

5.11.6.6.6.2 报告期内本基金投资的前十名债券中超出基金合同规定的备选债券情况					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300072	三安转债	349,653,114.80	2.18	重大限售
2	600703	三安光电	1,683,666.40	1.22	非公开发行股票限售
3	600994	招商医药	18,757,332.00	0.12	非公开发行股票限售

5.11.6.6.6.3 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
股指期货	IF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.6.6.4 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
国债期货	TF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.6.6.5 本报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
权证	-	-	-	-	-

5.11.6.6.6.6 投资组合报告附注		
5.11.6.6.6.6.1 报告期内本基金投资的前十名股票中超出基金合同规定的备选股票情况	说明	
1	存出保证金	2,589,926.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	303,133.58
6	其他应收款	1,625,160.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,608,230.52

5.11.6.6.6.6.2 报告期内本基金投资的前十名债券中超出基金合同规定的备选债券情况					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300072	三安转债	349,653,114.80	2.18	重大限售
2	600703	三安光电	1,683,666.40	1.22	非公开发行股票限售
3	600994	招商医药	18,757,332.00	0.12	非公开发行股票限售

5.11.6.6.6.6.3 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
股指期货	IF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.6.6.6.4 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
国债期货	TF1409	10	1,425,088.31	0.01	94.10

5.11.6.6.6.6.5 本报告期末本基金投资的权证持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动
权证	-	-	-	-	-

5.11.6.6.6.6.6 投资组合报告附注		
5.11.6.6.6.6.6.1 报告期内本基金投资的前十名股票中超出基金合同规定的备选股票情况	说明	
1	存出保证金	2,589,926.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	303,133.58
6	其他应收款	1,625,160.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,608,230.52

5.11.6.6.6.6.6.2 报告期内本基金投资的前十名债券中超出基金合同规定的备选债券情况					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300072	三安转债	349,653,114.80	2.18	重大限售
2	600703	三安光电	1,683,666.40	1.22	非公开发行股票限售
3	600994	招商医药	18,757,332.00	0.12	非公开发行股票限售

5.11.6.6.6.6.6.3 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细					
品种	合约名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动