

## 广发聚利债券型证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

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:二〇一二年七月二十日

§ 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。

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。

基金管理人的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称: 广发聚利债券

基金代码: 162712

交易代码: 162712

契约型基金，本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期，封闭期间投资人不能申赎购买的基金份额，但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让给基金份额持有人，封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。

基金合同生效日: 2011年8月5日

报告期末基金份额总额 335,745,621.79份

在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳健增值。

通过上述的系统研究和深度剖析，在主动研究和审慎的仓位配置的基础上，力争实现资产的保值增值，从而获得较高的投资回报。

本基金属于货币市场基金，其预期风险和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，为证券投资基金中的最低风险品种。

基金管理人: 广发基金管理有限公司

基金托管人: 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位: 人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 9,548,275.76

2.本期利润 25,851,959.89

3.加权平均基金份额本期利润 0.0770

4.期末基金份额净值 381,180,584.53

5.期末基金份额净值 1.135

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 0.15% 2.41% 0.10% 4.87% 0.05%

过去三个月 7.28% -2.41% 0.10% 4.87% 0.05%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较 广发聚利债券型证券投资基金 累计净值增长率为业 绩比较基准收益率的历史走势对比如图 2011年8月5日至2012年6月30日)

注: 1. 本基金合同生效日期为2011年8月5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。

§ 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 任职日期 离任日期 说明

李文娟 固定收益组 基金经理,金融学硕士,持有证券从业资格证书,2005年7月至2011年6月先后任广发基金管理有限公司机构理财部高级客户经理、机构理财部客户经理,2011年6月起任广发聚利债券型证券投资基金基金经理,2013年3月13日起任广发聚利债券型证券投资基金基金经理。

注: 1. 任职日期 和 离任日期 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从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 本基金报告期内基金管理人根据法律法规的规定，遵守诚实信用、勤勉尽责的原则管理运

行基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，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，通过实时的行为监控

及定期的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制定并实施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，但须遵循授权比例限制、止损限额、授权期限、授权范围等规定。严格执行授权制度，做到授权优先、比例分配、按时轮换、定期报告、监控预警、风险控制和报告过投资交易系统对投资交

流过程进行监控、实时监控及调整、实现投资风险管理、核销风险通过对投资、研究及交易等全流程的独立监测核销，实现投资风险管理的手段控制。

本报告期内，上市公司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，未发生任何不公平对待客户的情况。

4.3.2 竞争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。如果因对冲策略等特殊情况下进行反向交易的，则需经公司领导层审批并报备。

5.8 根据公开披露信息，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

或在报告编制日前一个月内受到监管部门公开谴责或处罚。

5.9 请用定期报告格式披露的前十名股票市值占基金总资产的比例是否符合基金合同的规定。

5.8.3 其他各投资品种构成

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 120292 11大秦01 391,190 39,901,380.00 10.47

2 122065 11上港01 342,640 34,736,843.20 9.11

3 126011 08石化债 324,910 30,934,681.10 8.12

4 122770 11国电01 300,000 30,750,000.00 8.07

5 122140 12宁港01 281,950 28,476,950.00 7.47

5.8.4 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 113002 工行转债 7,535,568.60 1.98

2 113001 中行转债 6,863,470.40 1.80

3 110018 国电转债 4,495,425.90 1.18

4 110015 石化转债 3,916,472.00 1.03

5 125709 唐钢转债 3,270,900.00 0.86

5.8.5 报告期末前十名股东中存在限售股情况的说明

本基金本报告期末前十名股东中不存在限售股情况。

§ 6 开放式基金份额变动

本报告期内期初基金份额总额 335,745,621.79

本期基金份额净增加额 0

期末基金份额净额 0

本期基金份额拆分变动份额 -

本报告期末基金份额总额 335,745,621.79

7 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金募集的文件；

2. 《公开发售证券投资基金份额的公告》；

3. 《基金合同》；

4. 《招募说明书》；

5. 法律意见书；

6. 广发基金管理有限公司批准备案批件、营业执照、公司章程；

7. 基金销售代理人业务资格批件、营业执照；

8. 基金监察稽核部门出具的基金监察稽核报告；

9. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

10. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

11. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

12. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

13. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

14. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

15. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

16. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

17. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

18. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

19. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

20. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

21. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

22. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

23. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

24. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

25. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

26. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

27. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

28. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

29. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

30. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

31. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

32. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

33. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

34. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

35. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

36. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

37. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

38. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

39. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

40. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

41. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

42. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

43. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

44. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

45. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

46. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

47. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

48. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

49. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

50. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

51. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

52. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

53. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

54. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

55. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

56. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

57. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

58. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

59. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

60. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

61. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

62. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

63. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

64. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

65. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

66. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

67. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

68. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

69. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

70. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

71. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；

72. 基金销售机构的基金销售业务资格批件；