

2013年4月22日 星期一

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:二〇一三年四月二十二日  
§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事会对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的法律责任。  
本基金托管人中国建设银行股份有限公司承诺对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告及其摘要等内容的真实性、准确性和完整性负有复核责任，但不对报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息发表复核意见。  
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基金的招募说明书。

报告书中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发聚利债券
基金主代码	162712
交易代码	162712
基金运作方式	契约型，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购赎回本基金份额，但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；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。

通过自上而下的宏观研究指导债券配置，在主动研判收益率变动趋势的基础上进行利率产品投资，在深市根据可转债正股基本面的基础上参与可转债投资，并通过新股申购、股票增发和要约收购等方式提高基金资产的收益水平。

业绩比较基准 中证全债指数收益率。

风险收益特征 本基金属于债券型基金，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较低风险品种。

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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	16,518,460.42
2.本期利润	17,503,219.69
3.期末平均基金份额本期利润	0.0521
4.期末基金份额净值	370,830,017.97
5.期末基金份额净值	1.104

注：①所述本基金业绩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千所列数字。

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期末平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总数。

④期末基金份额净值=期末总资产/期末总份额。

⑤过去三个月 4.84% \* 0.20% = 1.42%，0.03% \* 3.42% = 0.17%。

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

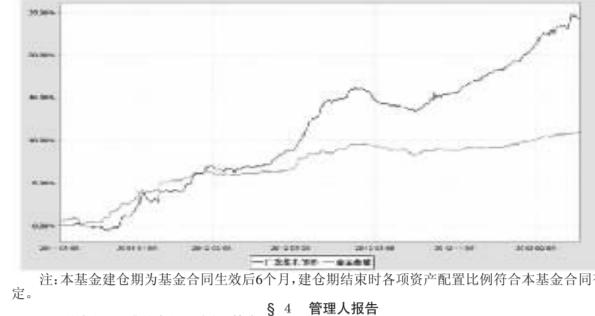
广发聚利债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年8月5日至2013年3月31日

## 广发聚利债券型证券投资基金

## 2013 第一季度报告



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	任职日期	离任日期
牛志刚	本基金的基金经理	
代宇	2011-8-5	-

牛志刚，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2005年7月至2007年7月就职于广发基金管理有限公司研究发展部，2007年7月至今就职于广发基金管理有限公司客户服务部，2011年8月5日起任广发聚利债券基金基金经理，2012年3月13日起任广发聚利债券基金基金经理。

代宇，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2011年8月5日起任广发聚利债券基金基金经理。

注：由于公司内部组织架构调整，原公司公告牛志刚担任基金经理的日期变更为2011年8月5日。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他配套法规、《广发聚利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，诚实信用，勤勉尽责的财产管理及运用基金资产，严格控制风险，保护基金份额持有人利益，未出现损害基金份额持有人利益的行为，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基金的招募说明书。

本基金中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

## § 5 报告期内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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	16,518,460.42
2.本期利润	17,503,219.69
3.期末平均基金份额本期利润	0.0521
4.期末基金份额净值	370,830,017.97
5.期末基金份额净值	1.104

注：①所述本基金业绩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千所列数字。

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期末平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总数。

④期末基金份额净值=期末总资产/期末总份额。

⑤过去三个月 4.84% \* 0.20% = 1.42%，0.03% \* 3.42% = 0.17%。

3.2.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年8月5日至2013年3月31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	任职日期	离任日期
牛志刚	本基金的基金经理	
代宇	2010-12-31	-

牛志刚，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2005年7月至2007年7月就职于广发基金管理有限公司研究发展部，2007年7月至今就职于广发基金管理有限公司客户服务部，2011年8月5日起任广发聚利债券基金基金经理。

代宇，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2010年12月至今就职于广发基金管理有限公司客户服务部，2010年12月31日起任广发聚利债券基金基金经理。

注：①任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业人员的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.基金管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金在报告期内，基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他配套法规、《广发聚利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，诚实信用，勤勉尽责的财产管理及运用基金资产，严格控制风险，保护基金份额持有人利益，未出现损害基金份额持有人利益的行为，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基金的招募说明书。

本基金中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

## § 5 报告期内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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	103,182,287.13
2.本期利润	285,662,935.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0630
4.期末基金份额净值	5,326,729,27.96
5.期末基金份额净值	1.1955

注：①所述本基金业绩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千所列数字。

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期末平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总数。

④期末基金份额净值=期末总资产/期末总份额。

⑤过去三个月 1.10% \* -0.13% = -1.21%，0.03% \* 5.73% = -0.11%。

3.2.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率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31日至2013年3月31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	任职日期	离任日期
牛志刚	本基金的基金经理	
代宇	2010-12-31	-

牛志刚，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2005年7月至2007年7月就职于广发基金管理有限公司研究发展部，2007年7月至今就职于广发基金管理有限公司客户服务部，2011年8月5日起任广发聚利债券基金基金经理。

代宇，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2010年12月至今就职于广发基金管理有限公司客户服务部，2010年12月31日起任广发聚利债券基金基金经理。

注：①任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业人员的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.基金管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金在报告期内，基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他配套法规、《广发聚利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，诚实信用，勤勉尽责的财产管理及运用基金资产，严格控制风险，保护基金份额持有人利益，未出现损害基金份额持有人利益的行为，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基金的招募说明书。

本基金中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

## § 5 报告期内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(2013年1月1日-2013年3月31日)





</