

广发聚源定期开放债券型证券投资基金

【2013】第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
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。
基金托管人中国农业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。
基金的投资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。
本报告中期财务资料未经审计。
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

基金名称	广发聚源定期债券
基金简称	广发聚源
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2013年5月8日
报告期末基金份额总额	1,298,477,225.42份
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人获取高于市场基准水平的投资收益。

本基金主要投资于固定收益类品种，不直接从事一级市场企业股权投资，权证和可转债等，但不直接一级市场股权投资，新股发行申购等，本基金对国内外宏观经济形势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，并结合各种固定收益品种在不同经济周期下的估值水平、期限结构、流动性特征、信用等级和流动性特征等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，采取组合久期、期限结构、期限结构和资产配置，并在此基础上构建和调整债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。

本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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告期自2013年7月1日至9月30日止。

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	广发聚源定期债券A	广发聚源定期债券C
1.本期已实现收益	5,613,860.16	3,205,246.57
2.本期利润	-16,211,550.72	-11,309,818.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0207	-0.0219
4.期末基金份额净值	772.740,478.80	497,683,986.07
5.期末基金份额净值	0.979	0.977

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。
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率水平要低于所列数字。

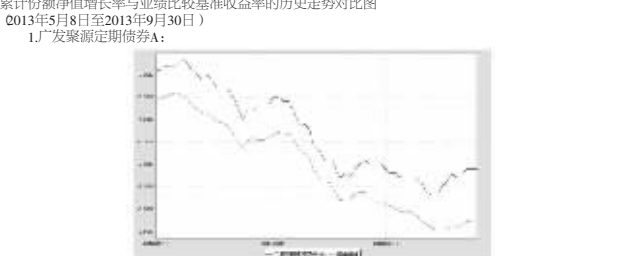
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①		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
	净值增长率	标准差				
过去三个月	-2.10%	0.13%	-2.68%	0.09%	0.58%	0.04%

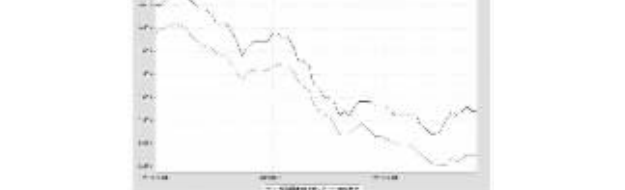
2.广发聚源定期债券C:

阶段	净值增长率①		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
	净值增长率	标准差				
过去三个月	-2.20%	0.13%	-2.68%	0.09%	0.48%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来本基金累计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
广发聚源定期开放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
2013年5月8日至2013年9月30日



注：本基金合同生效日为2013年5月8日，建仓期为6个月。至披露时点，本基金仍处于建仓期，且基金成立未满一年。



注：本基金合同生效日为2013年5月8日，建仓期为6个月。至披露时点，本基金仍处于建仓期，且基金成立未满一年。

姓名	职务	在本基金的基金任期		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢军	本基金的基金经理、广发聚源定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部副经理	2013-5-8	-	10	男，中国籍，金融硕士，持有证券投资基金从业资格和证券从业资格，曾任广发基金管理有限公司研究发展部产品设计人员、企业年金和债券研究员，2006年9月12日至2010年4月28日任广发基金管理有限公司基金经理，2008年9月17日至2012年2月14日先后任广发基金管理有限公司固定收益部总经理助理、副经理、总经理，2015年3月15日起任广发基金管理有限公司固定收益部副经理，2013年5月8日起任广发聚源定期债券基金的基金经理。

注：1. 任职日期和 离任日期”指公司公聘任或解聘日期。
2. 基金经理助理的 任职日期”和 离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
3. 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。
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、《广发聚源定期开放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，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约定。

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价，保证公平交易原则的实现。
在投资流程的内部控制方面，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。公司建立了严格的股票授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过授权范围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监督，实现投资流程的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资流程的事后控制。

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
本基金报告期内未出现异常交易行为。

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业绩表现说明
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 同一投资组合在每一交易日内进行反向交易。如果出现对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导层审核并批准后方可。

本报告期内，本基金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。

4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.57 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.59 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.61 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.63 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.65 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.67 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.69 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.71 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.73 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.75 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.77 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.79 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.81 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.83 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.84 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.85 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.86 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.87 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.88 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.89 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.90 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.91 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.92 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.93 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.94 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.95 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.96 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.97 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.98 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.99 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.100 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.101 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.102 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.103 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.104 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.105 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.106 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.107 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.108 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.109 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.110 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.111 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.112 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.113 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.114 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.115 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.116 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.117 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.118 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.119 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.120 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.121 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.122 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.123 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.124 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.125 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.126 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.127 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.128 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.129 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.130 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.131 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.132 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.133 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.134 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.135 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.136 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.137 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.138 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.139 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.140 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.141 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.142 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.143 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.144 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.145 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.146 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.147 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.148 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.149 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.150 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.151 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.152 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.153 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.154 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.155 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.156 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.157 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.158 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.159 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.160 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

广发理财30天债券型证券投资基金

【2013】第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
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。
基金托管人中国农业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。
本报告中期财务资料未经审计。
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

基金名称	广发理财30天债券
基金简称	广发理财30天
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2013年1月14日
报告期末基金份额总额	255,993,071.88份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于货币市场基金的投资收益。

本基金特在境内研究国内外宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，合理判断利率走势和收益率曲线变化趋势，并综合考量各类资产的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。

本基金主要投资于固定收益类品种，不直接从事一级市场企业股权投资，权证和可转债等，但不直接一级市场股权投资，新股发行申购等，本基金对国内外宏观经济形势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，并结合各种固定收益品种在不同经济周期下的估值水平、期限结构、流动性特征、信用等级和流动性特征等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，采取组合久期、期限结构、期限结构和资产配置，并在此基础上构建和调整债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。

本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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告期自2013年7月1日至9月30日止。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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

3.2.2 自基金合同生效以来本基金累计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

广发理财30天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
2013年1月14日至2013年9月30日

注：1. 任职日期和 离任日期”指公司公聘任或解聘日期。
2. 基金经理助理的 任职日期”和 离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
3. 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。

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、《广发理财30天