

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
报告送达日期:二〇一五年八月二十八日

1 重要提示

基金管理人的声明:董事会、监事会在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、完整性承担责任;财务会计报告、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。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年8月21日复核了本报告中的财务报表、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及基金合同。

本年度报告摘要摘要半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期2015年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称: 广发聚源债券型证券投资基金(LOF)
场内简称: 广发聚源
基金代码: 162715
交易代码: 162715
上市交易型开放式
基金合同生效日: 2013年9月1日
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
报告期起止日期: 2015年1月1日至2015年6月30日

2.2 基金产品说明

投资目标: 在严控投资风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人获取商业绩比较基准的稳定回报。

投资策略: 本基金主要投资于经严格挑选的品种,不直接从二级市场买入股票、权证和可转债等,也不参与一级市场的新股申购。本基金将通过深入研究,精选具有较好投资价值的债券品种,并结合各投资品种的资产在定价机制、收益率、风险特征和波动率等方面进行综合分析,选择投资品种的集中度和投资比例,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准: 中债全价指数收益率

风险收益特征: 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人
名称 广发基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司
姓名 赵克军 林蕙
信息披露负责人 联系电话 020-83036066 010-66006069
电子邮箱 dxfy@funds.com.cn tpxqj@abcchina.com
客户服务电话 95105828,020-83096999 965599
传真 020-86909158 010-63201816

2.4 信息披露

登载基金半年度报告的管理人互联网网址: http://www.gffunds.com
基金半年度报告备置地点: 广州市海珠区珠江大道1号保利国际广场南座31-33楼

3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1 期间利润和净利润

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 广发聚源债券(LOF) 广发聚源债券C
本期已实现收益 3,534,394.27 3,026,701.67
本期利润 4,263,338.46 3,503,744.48

加权平均基金份额本期利润 0.0896 0.0716
本期基金份额变动率 7.63% 7.66%

3.2 期末未分配利润指标

报告期(2015年6月30日) 广发聚源债券(LOF) 广发聚源债券C
期末可供分配利润 0.0693 0.0608
期末可供分配利润总额 11,492,738.01 43,631,763.47

期末可供分配利润净额 10.968 1.061

3.3 期末可供分配利润用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不包括当期损益)。

3.4 基金净值表现

3.4.1 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

广发聚源债券A(LOF) 基金份额净值增长率

阶段 份额净值增长 红利再投金额 业绩比较基准 收益率差额(%) ①-③ ②-④
率(%) 增长率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去一个月 0.09% 0.06% -0.06% 0.08% 0.15% -0.03%
过去二个月 4.03% 0.12% 1.26% 0.14% 2.69% -0.02%
过去三个月 7.63% 0.14% 0.77% 0.13% 6.86% 0.01%
过去一年 10.79% 0.17% 3.89% 0.16% 6.90% 0.02%
自基金合同生效以来 5.00% 0.16% 1.47% 0.14% 4.33% 0.02%

注:本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水平将低于指标。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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,本期利润即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不包括当期损益)。

3.2.1 基金净值表现

3.2.1.1 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

广发聚源债券A(LOF) 基金份额净值增长率

阶段 份额净值增长 红利再投金额 业绩比较基准 收益率差额(%) ①-③ ②-④
率(%) 增长率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去一个月 0.10% 0.07% -0.06% 0.08% 0.15% -0.03%
过去二个月 3.95% 0.12% 1.35% 0.14% 2.50% -0.02%
过去三个月 7.46% 0.14% 0.77% 0.13% 6.69% 0.01%
过去一年 10.40% 0.17% 3.88% 0.16% 6.51% 0.02%
自基金合同生效以来 5.10% 0.16% 1.47% 0.14% 4.33% 0.02%

注:本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水平将低于指标。

3.2.2 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年5月8日至2015年6月30日)

广发聚源债券C 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年5月8日至2015年6月30日)</p