

## 广发核心精选股票型证券投资基金

## [2012]第四季度报告

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:二〇一二年一月十九日

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2013年1月15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，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。

基金投资于证券市场，涉及证券投资风险。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。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 广发核心精选股票

基金主代码 270008

交易代码 270008

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2008年7月16日

报告期末基金份额总额 1,652,901,117.54份

投资目标 通过认真、细致的宏观研究，合理配置股票、债券、现金等资产，应用“核心—卫星”投资策略，投资于具有较高投资价值的股票，在控制合理的预期的基础上，进行长期管理，稳健地投资于债券市场。在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略 1.资产配置策略

本基金资产配置比例范围为：股票资产占基金资产的60%~95%，现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%~40%。其中，基金持有的权证的市值不得超过基金资产净值的3%，现金持有的权证的市值不得超过当年一月以内持有的权证的5%。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行相关程序后，可以将其纳入投资品种。

2.“核心—卫星”投资策略

本基金采取“核心—卫星”的投资策略，在沪深300指数成分股及沪深300指数成分股中精选成长型股票，通过挑选具有成长性的股票，直面股票市场价格波动的风险。一般情况下，本基金持有的“核心股票”的市值不低于本基金股票市值的80%。

本基金投资于沪深300指数成分股（包括备选成分股）的A股市值不低于本基金股票市值的20%。本基金投资的这部分股票为“卫星股票”，“卫星股票”采用主动投资方法，力图通过适度把握股票市场的热点，精选个股，提高基金“卫星股票”的投资收益率。

业绩比较基准 80%×沪深300指数+20%×上证国债指数。

风险收益特征 本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 3,428,495.93

2.本期利润 99,245,552.08

3.加权平均基金份额本期利润 0.0635

4.期末基金份额净值 2,605,050,175.88

5.期末基金份额净值 1.576

注:①所述基金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要低于所列数字。

②本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(①) 净值增长率标准差(②) 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

过去三个月 4.23% 8.17% 1.02% -3.94% 0.04%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发核心精选股票型证券投资基金

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

2008年7月16日至2012年12月31日

注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月，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

朱纪刚 本基金的基金经理 2009-9-10 - 6

注:任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期，否则指基金合同生效日或终止日。

2.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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，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、《广发核心精选股票型证券投资基金合同》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，为基金份额持有人的利益服务，不存在损害基金份额持有人利益的行为，基金的投资组合符合法律法规和基金合同的有关规定。

4.3 公平交易制度的执行情况

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.4 投资组合的特征分析

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.5 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.6 投资组合的特征分析

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.7 公平交易制度的执行情况

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.8 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.9 公平交易制度的执行情况

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.10 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.11 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.12 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.13 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.14 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.15 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.16 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.17 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.18 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.19 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.20 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.21 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.22 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.23 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.24 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.25 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.26 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.27 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.28 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.29 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.30 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.31 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.32 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.33 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.34 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.35 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.36 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.37 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.38 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.39 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.40 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.41 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.42 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.43 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.44 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.45 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.46 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.47 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。

4.48 管理人对报告期内本基金运作的专项说明

公司制定了公平交易制度和决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控及定期的评估评价，确保公平交易制度的执行效果。