

## 广发聚富开放式证券投资基金

[2014] 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

基金管理人的董事会在董事会上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，并对其内容的真伪性、准确性、完整性承担责任并个别连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金的基本情况，于2014年10月23日复核了本报告中的财务数据，并发表书面意见，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，本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，但不保证基金一定盈利。

基金管理人的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告无财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发聚富混合
基金代码	270001
交易代码	270001(前端) 270001(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月3日
报告期末基金份额总额	3,212,498,232.00份
投资目标	依托高成长的宏观经济和资本市场，通过基金管理人科学研究、审慎投资，积极投资于股票、债券及货币市场工具，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	积极投资策略，重仓配置股票、债券及货币资产的动态配置策略，在行业配置、风格选择的基础上挖掘风格类基金完全反映投资价值的潜力的投资机会。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证价值指数
风险收益特征	本基金风险收益特征介于基金净值基准之间，风险较高，收益较高。
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

单位:人民币元

主要财务指标		报告期	(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益			-44,137,635.72
2.本期利润			29,475,880.85
3.加权平均基金份额本期利润			0.0088
4.期末基金份额净值			3,799,309.4612
5.期末基金份额净值			1.1827

注:1)所述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。

3.2.1 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)	净值增长率标准差(②)	业绩比较基准收益率(③)	①-③	②-④
过去三个月	0.79%	0.63%	10.80%	6.70%	-10.01%
					-0.07%

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

注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月, 建仓结束后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	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
刘月	本基金的基金经理, 广发聚富基金经理, 广发聚富基金经理, 广发聚富基金经理, 广发聚富基金经理	2010-12-31	-	9

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

报告期内, 基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚富开放式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。本基金报告期内, 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 公平交易专项说明

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及及时的评估分析, 保证公平交易制度的执行情况。

在投资决策的内部控制方面, 公司制度规定投资决策的投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。公司设立了严格的投票授权制度, 投资组合经理在授权范围内可以自主决策, 超过授权限额的需要经过严格的审核程序。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, 随机平衡”的原则, 公平分配投资指令。监控稽核通过对投资交易系统对投资交易行为的实时监控及预警, 检核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核, 完成投资风险的防范。

本报告期内, 公司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行为。

4.4 股票申购方面的专项说明

本公司在申购上遵循先来后到的原则, 不存在对大额申购等特殊情况下进行优先交易的情况, 则需经公司审批后申购被限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

中国经济短期企稳后, 8、9月份的各项经济数据表明, 经济趋弱的走势没有大的改变。虽然银行间流动性在缓解, 商业银行似乎出现了流动性过剩的现象。

股市走势和宏观经济短期出现了背离, 更多可能是对改革预期的逐步升温。同时, 经济下滑也带来了贬值预期, 人民币贬值预期也较为明显。

但是, 股市和宏观经济长期背离, 持续时间长。特别是估值偏高的时候, 市场已经高估了经济的反弹空间, 而经济的反弹空间, 对于提升的不良水平之下, 风险和收益并不匹配。

4.6 基金的现金头寸情况

本基金现金头寸比例符合基金合同的规定, 不存在对流动性输送的限制。

4.7 其他资产的准备金比例

本基金报告期内未发生大额赎回。

4.8 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未发生大额赎回, 不存在对流动性输送的限制。

4.9 报告期内基金的费用计提、支付和返还情况

本基金报告期内未发生大额赎回。

4.10 基金的税收情况

本基金报告期内未发生大额赎回。

4.11 报告期内基金的费用计提、支付和返还情况

本基金报告期内未发生大额赎回。

4.12 与基金销售机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.13 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.14 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.15 与基金审计机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了审计协议。

4.16 与基金份额持有人的协议情况

本基金与基金份额持有人签订了基金合同。

4.17 与基金销售机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.18 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.19 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.20 与基金审计机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了审计协议。

4.21 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.22 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.23 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.24 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.25 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.26 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.27 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.28 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.29 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.30 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.31 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.32 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.33 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.34 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.35 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.36 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.37 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.38 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.39 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.40 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.41 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.42 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.43 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.44 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.45 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.46 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.47 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.48 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.49 与基金销售代理人、基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.50 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。

4.51 与基金销售支付机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了销售协议。

4.52 与基金登记机构的协议情况

本基金与基金管理人签订了登记协议。