广发聚丰股票型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚丰股票	
基金主代码	270005	
交易代码	270005(前端)	270015(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年12月23日	
报告期末基金份额总额	17,933,064,211.05份	
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。	
投资策略	本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票,同时保持两类资产的适度均衡配置,构建股票投资组合。	
业绩比较基准	本基金自2013年1月17日起,将基金业绩比较基准由"80%*新华富时A600指数+20%*新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"80%*沪深300指数+20%*中证全债指数"。	
风险收益特征	较高风险,较高收益。	
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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	2,576,246,005.46
2.本期利润	6,088,739,950.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.3155
4.期末基金资产净值	18,492,459,432.95
5.期末基金份额净值	1.0312

注:(1)所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 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

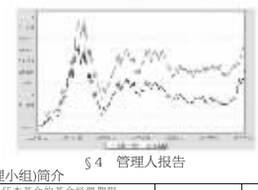
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	45.14%	1.68%	11.90%	1.46%	33.24%	0.22%

3.2.2自基金合同生效以来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

广发聚丰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历史走势对比图

(2005年12月23日至2015年3月31日)



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
傅友兴	本基金的基金经理;广发稳健增长混合基金的基金经理	2013-02-05	-	13年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金执业资格证书,2002年2月至2006年3月先后任天同基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投委会秘书,2006年4月至2013年2月先后任广发基金管理有限公司研究员、基金经理助理、研究发展部副总经理、研究发展部总经理,2013年2月5日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2014年12月8日起任广发稳健增长混合基金的基金经理。
易阳方	本基金的基金经理;广发聚伟灵活配置基金的基金经理;公司副总经理、投资总监	2005-12-23	-	18年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金执业资格证书,1997年1月至2002年11月任职于广发证券股份有限公司,2002年11月至2003年11月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员,2003年12月3日至2007年3月28日任广发聚富混合基金的基金经理,2005年5月13日至2011年1月5日任广发基金管理有限公司投资管理部总经理,2005年12月23日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2006年9月4日至2008年4月16日任广发基金管理有限公司总经理助理,2008年4月17日起任广发基金管理有限公司投资总监,2011年8月11日起任广发基金管理有限公司副总经理,2011年9月20日至2013年2月4日任广发制造业精选股票基金的基金经理,2014年3月21日起任广发聚祥灵活配置基金的基金经理。
白金	本基金的基金经理	2015-01-06	-	4年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2011年7月至2015年1月先后任广发基金管理有限公司研究发展部和权益投资一部任研究员,2015年1月6日起任广发聚丰股票基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

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、《广发聚丰股票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

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估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,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。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限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预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

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)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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运作分析

一季度,PMI环比呈现上行态势,经济处于库存向上周期,但实体经济总需求相当疲弱,企业盈利趋势表现并不强。估值层面,降息、场外资金加速入场、互联网+等因素综合驱动A股表现抢眼。一季度,沪深300指数涨14.64%,中证500涨36.27%,创业板指涨58.66%。分行业看,1季度计算机、传媒、通信等行业涨幅超过58%。

本基金在年初就重点关注高分红股票、稳定成长类股票以及与互联网密切相关的几类投资机会,并结合市场变化顺势加大了科技类板块的配置比例,因此在一季度较好地实现了基金净值的较快增长。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为45.14%,同期业绩比较基准收益率为11.9%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

移动互联网的发展正在对各行各业发生深刻的影响。科技传媒板块经历一季度的快速上涨,预计未来个股的表现将会趋于分化,但市场仍存在不少结构性的投资机会。与此同时,场外资金加速入场的态势较为明确,市场氛围仍较正面。本基金将继续积极顺势而为,竭力为持有人谋求收益的快速增长。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	16,790,802,017.59	88.94
	其中:股票	16,790,802,017.59	88.94
2	固定收益投资	1,856,711.12	0.01
	其中:债券	1,856,711.12	0.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	294,200,787.10	1.56
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,528,422,679.63	8.10
7	其他各项资产	263,956,175.91	1.40
8	合计	18,879,238,371.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	174,508,479.60	0.94
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,384,414,335.83	39.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	215,519,245.62	1.17
E	建筑业	120,823,800.70	0.65
F	批发和零售业	863,530,726.67	4.67
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,307,325,972.59	34.11
J	金融业	11,325,000.00	0.06
K	房地产业	538,764,014.73	2.91
L	租赁和商务服务业	848,067,613.63	4.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,803,962.64	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,872.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业	179,122,061.60	0.97
S	综合	140,593,931.88	0.76
	合计	16,790,802,017.59	90.80

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁软件	4,640,615	756,884,306.50	4.09
2	002063	远光软件	18,520,700	741,568,828.00	4.01
3	002280	联络互动	3,490,953	495,366,230.70	2.68
4	600271	航天信息	9,500,083	471,109,115.97	2.55
5	300271	华宇软件	6,159,936	443,576,991.36	2.40
6	300058	蓝色光标	10,506,691	382,968,886.95	2.07
7	002422	科伦药业	9,007,418	358,585,310.58	1.94
8	300072	三聚环保	8,018,050	303,082,290.00	1.64
9	002551	尚荣医疗	8,447,601	295,581,558.99	1.60
10	300085	银之杰	2,081,254	280,740,352.06	1.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,856,711.12	0.01
8	其他	-	-
9	合计	1,856,711.12	0.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128002	东华转债	6,502	1,856,711.12	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1根据四川科伦药业股份有限公司(002422.SZ)2014年6月5日发布的《四川科伦药业股份有限公司关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告》显示,科伦药业于2013年5月20日收到中国证监会《调查通知书》(稽查总队调查通字13139号),因公司涉嫌信息披露违法违规,中国证监会对其进行了处罚。

本基金对科伦药业(002422.SZ)的持仓主要是在2010年四季度买入的,投资逻辑如下:

当时股价平均对应2010年28PE的估值水平,在当时医药股平均35倍较为合理。同时公司基本面正在产生积极变化:第一,管理层调整经营战略,开始进入抗生素领域,筹建川宁项目;第二,主导产品可立袋还有近10省市的招标还未进入,且产能也有释放空间;第三,公司聘请很多优秀的研究专家,积极向高端专科药转型。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,606,959.87
2	应收证券清算款	226,642,086.83
3	应收股利	-
4	应收利息	354,735.05
5	应收申购款	31,352,394.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	263,956,175.91

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	128002	东华转债	1,856,711.12	0.01

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002280	联络互动	495,366,230.70	2.68	重大事项
2	600271	航天信息	471,109,115.97	2.55	重大事项
3	300271	华宇软件	443,576,991.36	2.40	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额	20,284,227,342.66
本报告期基金总申购份额	345,810,310.84
减:本报告期基金总赎回份额	2,696,973,442.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,933,064,211.05

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,316,088.52
本报告期买入/申购总份额	0.00
本报告期卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,316,088.52
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.01

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚丰股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》;

3.《广发聚丰股票型证券投资基金托管协议》;

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《广发聚丰股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年四月二十日

广发聚富开放式证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚富混合	
基金主代码	270001	
交易代码	270001(前端)	270011(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	2,482,321,514.52份	
投资目标	依托高速发展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,在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	根据投资策略,在资产配置层面,重视股票资产和债券资产的动态平衡配置;在行业配置层面,根据不同行业的发展前景进行行业优化配置;在个股选择层面,在深入把握上市公司基本面的基础上挖掘价格尚未完全反映投资价值的潜力股的投资机会。	
业绩比较基准	80%*中信标普300指数收益+20%*中信标普全债指数收益	
风险收益特征	本基金风险收益特征介于成长基金与价值基金之间;适度风险、较高收益。	
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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	677,457,657.91
2.本期利润	1,123,874,688.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.4177
4.期末基金资产净值	3,861,621,683.53
5.期末基金份额净值	1.5556

注:(1)所述基金财务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 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

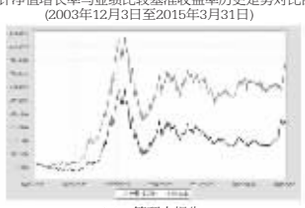
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	37.02%	1.87%	11.75%	1.46%	25.27%	0.41%

3.2.2自基金合同生效以来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历史走势对比图

(2003年12月3日至2015年3月31日)



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
祝俊	本基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理	2010-12-31	2015-02-17	10年	男,经济学硕士,持有基金业执业证书,2005年7月至2007年7月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员,2008年8月至2010年5月任农银汇理基金管理有限公司研究部行业研究员,2010年5月至2015年2月16日任职于广发基金管理有限公司,2010年12月31日至2015年2月16日任广发聚富混合基金的基金经理,2013年9月11日至2015年2月16日任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理。
苗宇	本基金的基金经理;广发竞争优势混合基金的基金经理	2015-02-12	-	7年	男,中国籍,理学博士,持有基金业执业资格,2008年7月1日至2010年5月9日任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员,2010年5月10日至2015年1月5日任广发小盘成长股票(LOF)基金的基金经理助理,2015年2月12日起任广发聚富混合基金的基金经理,2015年2月17日起任广发竞争优势混合基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

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。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,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

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估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,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。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限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预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

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)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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运作分析

本报告期内,市场热点众多,以计算机板块为首的成长股表现优异,创业板指数创出新高,主板市场部分板块日趋活跃,市场赚钱效应明显,政策和资金面都支持股市上涨。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为37.02%,同期业绩比较基准收益率为11.75%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本报告期内,我们增持了计算机、传媒等新兴产业的配置,减持了医药等行业,从结果上来看,调整是比较及时和成功的。一季度表现较好的行业或多或少都与互联网相关,但是直到现在,市场上仍然有较多不同的声音,认为估值过高,市值过大。如果从成长的角度来看,目前这些股票市值并不大,在目前国家鼓励创新的背景下,这些股票是良好的投资标的。

展望二季度行情,我们认为市场依然机会很多,资金面和政策面会成为决定行情纵深的关键性因素,在可以预期的时间内,这些因素还都是正面的。所以二季度积极把握市场节奏比较重要,我们相对看好互联网相关、新能源和环保,在操作上加强灵活性,争取为持有人带来满意回报。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,873,594,629.11	73.35
	其中:股票	2,873,594,629.11	73.35
2	固定收益投资	818,542,000.00	20.89
	其中:债券	818,542,000.00	20.89
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	164,222,160.83	4.19
7	其他各项资产	61,192,791.60	1.56
8	合计	3,917,551,581.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	461,638,952.14	11.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	51,358,493.44	1.33
F	批发和零售业	331,458,489.49	8.58
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	43,221,550.41	1.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,673,484,351.77	43.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	134,281,495.70	3.48
L	租赁和商务服务业	56,768,446.40	1.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	121,382,849.76	3.14
S	综合	-	-
	合计	2,873,594,629.11	74.41

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600804	鹏博士	10,300,287	336,304,370.55	8.71
2	300226	上海钢联	2,379,269	276,471,057.80	7.16
3	300253	卫宁软件	1,536,750	250,643,925.00	6.49
4	600180	瑞茂通	7,599,679	210,663,101.88	5.46
5	300367	东方网力	1,133,370	170,651,520.90	4.42
6	300028	金亚科技	3,642,402	139,613,268.66	3.62
7	000732	泰禾集团	5,194,642	134,281,495.70	3.48
8	300170	汉得信息	3,191,976	121,327,007.76	3.14
9	600153	建发股份	8,573,129	120,795,387.61	3.13
10	002405	四维图新	2,699,836	110,153,308.80	2.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	818,542,000.00	21.20
	其中:政策性金融债	818,542,000.00	21.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	818,542,000.00	21.20

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130229	13国开29	1,800,000	178,830,000.00	4.63
2	140430	14农发30	1,500,000	150,045,000.00	3.89
3	140443	14农发43	1,000,000	100,060,000.00	2.59
4	150202	15国开02	700,000	69,818,000.00	1.81
5	130238	13国开38	500,000	50,340,000.00	1.30

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.本基金本报告期末未持有股指期货。

2.本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.本基金本报告期末未持有国债期货。

2.本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 鹏博士电信传媒集团股份有限公司(股票代码:600804)于2014年10月24日收到中国证券监督管理委员会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司出具警示函措施的决定》,就公司在过去2011-2014年三个年度对现金流量表的部分项目归类出现错误被进行警示并责令整改。

本基金投资该公司的主要原因是:1.公司是中国第四大固网通信运营商,这几年业务发展呈现高速增长状况。2.运营商具备向互联网业务发展的天然潜质,公司在家庭互联网、云计算等方向做出了诸多努力。3.因为智能家居的发展以及涉及家庭重大开支决策的教育、医疗业务出现互联网的发展趋势,我们认为家庭这一场景将会成为互联网公司的重要战略点,另一家上市公司乐视网发展智能电视证明了这一趋势。总的老说,鹏博士具备良好发展的基本面、庞大用户资源的禀赋、处于互联网下一战略要地,所以进入了较好的投资时点。证监局出具的警示函,与公司基本面无关,也非公司主观意愿,因此并不过多影响投资决策。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,507,537.67
2	应收证券清算款	32,295,511.75
3	应收股利	-
4	应收利息	25,226,537.00
5	应收申购款	2,163,205.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,192,791.60

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300367	东方网力	170,651,520.90	4.42	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,825,499,117.53
本报告期基金总申购份额	104,525,883.20
减:本报告期基金总赎回份额	447,703,486.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,482,321,514.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
本报告期买入/申购总份额	26,566,032.25
本报告期卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	26,566,032.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.07

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	基金转入	2015-01-22	18,941,581.00	22,868,170.74	-
2	基金转入	2015-01-22	7,624,451.25	9,205,000.00	-
合计			26,566,032.25	32,073,170.74	

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚富开放式证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》;

3.《广发聚富开放式证券投资基金托管协议》;

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《广发聚富开放式证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年四月二