广发聚祥保本混合型证券投资基金招募说明书【更新】摘要

［2011年第1号］

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

时间：二〇一一年十月

【重要提示】

本基金于2011年1月21日经中国证监会证监基金字［2011］131号文核准。本基金的基金合同于2011年3月15日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不预示本基金业绩表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证基金一定盈利，也不保证最低收益，但为认购并持有到期的基金份额提供保本，并由担保人为本基金保本提供不可撤销的连带责任保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，认购并持有到期，投资者购买的基金份额存在仅能收回本金的可能性。认购未持有到期，投资者将不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，如果发生《基金合同》约定的不适用保本条款的情形，投资者认购并持有到期的基金份额亦存在着无法收回本金的可能性。

在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，根据自身的风险承受能力和预期收益，权衡选择适合自己的产品。在做出投资决策后，投资人需自行承担投资风险。

本摘要根据本基金合同和本基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金合同。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年9月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日（财务数据未经审计）。

一、 基金管理人

（一）、概况

1、名称：广发基金管理有限公司
2、住所：广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
3、办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
4、法定代表人：王志伟
5、设立时间：2003年8月5日
6、电话：020-83936666
全国统一客服热线：95105828
7、联系人：段西军
8、注册资本：1.2亿元人民币
9、股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司，分别持有本基金管理人48.33%、16.67%、16.67%、10%和8.33%的股权。

（二）、主要人员情况

1、董事会成员

王志伟：董事长，男，经济学硕士，高级经济师。兼任广东省第十届政协委员，广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员，广东金融学会常务理事，江西财经大学客座教授。历任广发证券股份有限公司董事长兼党委书记、广东发展银行党组成员兼副行长，广东发展银行行长助理，广东发展银行信托投资部总经理，广东发展银行人事教育部经理，广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉：副董事长，男，大学本科学历，现任广发基金管理有限公司总经理。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

孙晓燕：董事，女，硕士，现任广发证券副总经理、财务总监兼财务部总经理。曾任广东广发证券公司投资银行部经理，广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理、广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俊：董事，男，管理学硕士，高级经济师，现任烽火通信科技股份有限公司副总经理、财务总监兼董事会秘书。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿：董事，女，企业管理硕士，现任香江集团总裁、金海马集团董事长、香江投资有限公司董事长、深圳香江控股股份有限公司董事长。兼任广发证券监事、全国妇联常委、中国产业发展促进会副会长、香江社会救助基金会主席、广东省妇联副主席、广东省政协常委。曾任广州棠涌家具厂、北京丰台美满家具厂厂长。

许冬瑾：董事，女，工商管理硕士，主管药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云：独立董事，男，法学博士，教授，博士生导师，现任复旦大学教授。曾任复旦大学法律系副主任，复旦大学法学院副院长。

姚海鑫：独立董事，男，经济学博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学发展规划处处长。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、辽宁大学工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、辽宁大学计财处处长、学科建设处处长。

罗海平：独立董事，男，经济学博士，现任阳光财产保险股份有限公司总裁。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理，太平保险湖北分公司总经理，太平保险公司总经理助理，太平保险公司副总经理兼纪委书记，民安保险（中国）有限公司副总裁。

2、监事会成员

余利平：监事会主席，女，经济学博士，曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理，董事长。

匡丽军：监事，女，大学本科学历，高级涉外秘书，现任广州科技风险投资有限公司办公室主任。曾任广州实达实业发展公司办公室主任、广州屈臣氏公司行政主管。

刘文红：监事，女，经济学硕士，现任广发基金管理有限公司市场拓展部副总经理。曾任广发证券研究发展中心研究员。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉：总经理，男，大学本科学历，曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

肖雯：副总经理，女，企业管理硕士，高级经济师。曾任珠海国际信托投资公司助理总经理、广发证券电子商务部副总经理、广发证券经纪业务总部副总经理。

朱平：副总经理，男，硕士，经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理有限公司总经理助理。

易阳方：副总经理，男，经济学硕士，经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发聚丰股票型证券投资基金基金经理。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理，广发基金管理有限公司总经理助理。

段西军：督察长，男，博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

4、基金经理

谢军，男，中国籍，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，特许金融分析师（CFA），2003年7月至2006年9月先后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日任广发货币基金的基金经理，2008年3月27日起任广发增强债券基金的基金经理，2008年4月17日至2009年2月9日任广发基金管理有限公司固定收益部总经理助理，2009年2月10日至2010年8月8日任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理，2010年8月9日起任广发基金管理有限公司固定收益部总经理。2011年3月15日起任广发聚祥保本混合基金的基金经理。

朱纪刚，男，中国籍，理学硕士，持有证券业执业资格证书，2006年7月至2006年12月任职于招商证券股份有限公司，2006年12月至2009年7月先后任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究小组组长、研究发展部副总经理，2008年10月9日至2009年7月16日任广发大盘成长混合基金的基金经理助理，2009年7月17日起在公司投资管理部工作，2009年9月10日起任广发核心精选股票基金的基金经理。2011年3月15日起任广发聚祥保本混合基金的基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

主席：公司总经理林传辉；成员：公司副总经理朱平，公司副总经理易阳方，研究发展部总经理傅友兴，固定收益部总经理谢军。

二、 基金托管人

（一）、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349，018，545，827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军

（二）、主要人员情况

截至2011年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年6月，中国工商银行共托管证券投资基金219只，其中封闭式7只，开放式212只。自2003年以来，本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的23项最佳托管银行大奖；2010年，本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、 相关服务和保证机构

（一）、基金份额发售机构

1、直销机构

本基金管理人通过在广州、北京、上海设立的分公司和网上交易为投资者办理开放式基金开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务：

（1）广州分公司
地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔32楼
直销中心电话：020-89899073 020-89899042
传真：020-89899069 020-89899070

（2）北京分公司
地址：北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层
电话：010-68083368
传真：010-68083078

（3）上海分公司
地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室
电话：021-68885310
传真：021-68885200

（4）网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购、赎回、基金转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。
本公司网上交易系统公司网站：www.gffunds.com.cn。
本公司网站：www.gffunds.com.cn
客服电话：95105828（免长途费）或020-83936999
客服传真：020-34281105

2、代销机构

（1）名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：赵会军
电话：010-66107900
传真：010-66107914
客服电话：95588
公司网站：www.icbc.com.cn

（2）名称：广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：林治海
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87557985
客服电话：95575或致电各地营业网点
公司网站：www.gf.com.cn

（3）名称：中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（长安兴融中心）
法定代表人：郭树清
客服电话：95533
公司网站：www.ccb.com

（4）名称：中国农业银行股份有限公司
住所：北京市建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
客服电话：95599
公司网站：www.abchina.com

（5）名称：交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408483
客服电话：95559
公司网站：www.bankcomm.com

（6）名称：招商银行股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
客服电话：95555
公司网站：www.cmbchina.com

（7）名称：广发银行股份有限公司
住所：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：董建岳
联系人：詹全鑫、张大奕
电话：020-38322222、0571-96000888
传真：020-87311780
客服电话：400-830-8003
公司网站：www.gdb.com.cn

（8）名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：倪苏云、虞谷云
客服电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

（9）名称：兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号兴业大厦9楼
法定代表人：高建平
联系人：刘玲
电话：021-52629999
客服电话：95561，或拨打当地咨询电话
公司网站：www.cib.com.cn

（10）名称：上海银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路168号
法定代表人：宁黎明
联系人：张萍
电话：021-68475888
传真：021-68476111
客服电话：021-962888
公司网站：www.bankofshanghai.com

（11）名称：深圳发展银行股份有限公司
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遂宁
联系人：张青
联系电话：0755-82088888
传真电话：0755-82080714
客服电话：95501
公司网站：www.sdb.com.cn

（12）名称：中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：董云巍
电话：010-57092615
传真：010-57092611
客服电话：95568
公司网站：www.cmbc.com.cn

（13）名称：中国光大银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
联系人：薛军丽
电话：010-68098777
客服电话：95595（全国）
公司网站：www.cebbank.com

（14）名称：中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
联系人：丰靖
电话：010-65550828
客服电话：95558
公司网站：bank.ecitic.com

（15）名称：北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
传真：010-66226045
客服电话：95526
公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（16）名称：宁波银行股份有限公司
住所：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勋
联系方式：0574-89068340
传真：0574-87050024
客服电话：96528，上海、北京地区962528
公司网站：www.nbcb.com.cn

（17）名称：青岛银行股份有限公司
注册地址：山东省青岛市市南区香港中路68号
法定代表人：郭少泉
联系人：滕克
联系电话：0532-85709787
传真：0532-85709799
客服电话：（青岛）96588，（全国）400-66-96588
公司网站：www.qdccb.com

（18）名称：徽商银行股份有限公司
住所：安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座
法定代表人：王晓昕
联系人：王祎
电话：0551-2667819
传真：0551-2667857
客服电话：4008896588（安徽省外）、96588（安徽省内）
公司网站：www.hsbank.com.cn

（19）名称：渤海银行股份有限公司
住所：天津市河西区马场道201-205号
法定代表人：刘宝凤
联系人：王宏
电话：022-58316666
传真：022-58316569
客户服务热线：4008888811
公司网站：www.cbhb.com.cn

（20）名称：东莞银行股份有限公司
注册地址：东莞市运河东一路193号
办公地址：东莞市运河东一路193号
法定代表人：廖玉林
联系人：巫渝峰
电话：0769-22100193
传真：0769-22117730
客服电话：0769-96228
公司网站：www.dongguanbank.cn

（21）名称：哈尔滨银行股份有限公司
注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号
办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号
法定代表人：郭志文
联系人：王超
电话：0451-86779007
传真：0451-86779218
客服电话：95537
公司网站：www.hrbb.com.cn

（22）名称：华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
公司网站：www.hfzq.com.cn
客服电话：96326（福建省外请先拨0591）

（23）名称：申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：曹晔
电话：021-54033888
传真：021-54038844
客服电话：95523或4008895523
电话委托电话：021-962505
公司网站：www.sywg.com

（24）名称：国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服电话：400-8888-666
公司网站：www.gtja.com

（25）名称：中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
联系人：田薇
电话：010-66568430
传真：010-66568536
客服电话：4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。
公司网站：www.chinastock.com.cn

（26）名称：中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
电话：400-8888-108
传真：010-65182261
客服电话：400-8888-108
公司网站：www.csc108.com

（27）名称：天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
电话：010-66045608
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
公司网站：http://www.txsec.com或http://jijin.txsec.com

（28）名称：国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客服电话：95536
公司网站：www.guosen.com.cn

（29）名称：招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
客服电话：95565、4008888111
公司网站：www.newone.com.cn

（30）名称：华泰证券股份有限公司
住所：南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-83290834
传真：025-51863323
联系人：程高峰
客服电话：95597
公司网站：www.htsc.com.cn

（31）名称：华泰联合证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌、庞晓芸
电话：0755-82492000
传真：0755-82492962
客服电话：95513
公司网站：www.lhzq.com

（32）名称：中银国际证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区银城中路中银大厦39层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
电话：021-20328216
传真：021-50372474
客服电话：4006208888
公司网站：www.bocichina.com

（33）名称：长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：李春芳
电话：0755-83516089
传真：0755-83515567
客户服务热线：0755-33680000；400-6666-888
公司网站：www.cgws.com

（34）名称：东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
电话：0431-85096709
开放式基金咨询电话：4006000686；0431-85096733
开放式基金业务传真：0431-85096795
公司网站：www.nesc.cn

（35）名称：东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63326173
客服电话：95503
公司网站：www.dfzq.com.cn

（36）名称：平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：0755-22626319
开放式基金业务传真：0755-82400862
全国免费业务咨询电话：95511—8
公司网站：www.pingan.com

（37）名称：渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客服电话：400-6515-988
公司网站：www.bhzq.com

（38）名称：海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
电话：021-23219000
传真：021-23219100
客户服务热线：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站：www.htsec.com

（39）名称：东吴证券股份有限公司
住所：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
公司网站：www.dwzq.com.cn

（40）名称：金元证券股份有限公司
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
电话：0755-83025022
传真：0755-83025625
客服电话：4008-888-228
公司网站：www.jyzq.cn

（41）名称：光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客服电话：4008888788，10108998
公司网站：www.ebscn.com

（42）名称：东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
客服电话：4008888588
联系人：李涛
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
公司网站：www.longone.com.cn

（43）名称：国盛证券有限责任公司
注册地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
办公地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
法定代表人：曾小普
联系人：吴祖平
电话：07916281061
客服电话：见各营业部客户电话
传真：07916289395
公司网站：www.gsstock.com

（44）名称：山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
客服电话：400-666-1618
公司网站：www.i618.com.cn

（45）名称：湘财证券有限责任公司
注册地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莺
电话：021-68634518
传真：021-68865680
开放式基金客服电话：400-888-1551
公司网站：www.xcsc.com

（46）名称：国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市县前东街168号
办公地址：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
联系人：徐欣
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
客服电话：400-888-5288，0510-82588168
公司网站：www.glsc.com.cn

（47）名称：国海证券有限责任公司
住所：广西桂林市育才路55号
法定代表人：蒋文胜
联系人：牛孟宇
电话：0755-83709350
传真：0755-83700205
客服电话：95563
公司网站：www.ghzq.com.cn

（48）名称：广州证券有限责任公司
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人：刘东
联系人：林洁茹
电话：020-87322668
传真：020-87325036
客服电话：020-961303
公司网站：www.gzs.com.cn

（49）名称：德邦证券有限责任公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人：姚文平
联系人：罗芳
电话：021-68761616
传真：021-68767981
客服电话：400-8888-128
公司网站：www.tebon.com.cn

（50）名称：国元证券股份有限公司
住所：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系人：陈琳琳
联系电话：0551-2246273
开放式基金咨询电话：安徽地区：95578
开放式基金业务传真：0551-2272100
公司网站：www.gyzq.com.cn

（51）名称：华安证券有限责任公司
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦
法定代表人：李工
联络人：甘霖
电话：0551-5161666
传真：0551-5161600
客服电话：96518，4008096518
公司网站：www.hazq.com

（52）名称：中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层（266061）
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客服电话：0532-96577
公司网站：www.zxwt.com.cn

（53）名称：中信金通证券有限责任公司
浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
电话：0571-87112510
客服电话：0571-96598
公司网站：www.bigsun.com.cn

（54）名称：财通证券有限责任公司
注册地址：杭州市解放路111号
法定代表人：沈继宁
联系人：乔骏
电话：0571-87925129
传真：0571-87828042
客服电话：0571-96336，（上海地区：962336）
公司网站：www.ctsec.com

（55）名称：中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：石保上
联系人：程月艳、耿铭
电话：0371-65585670
传真：0371-65585665
客服电话：0371-967218或4008139666
公司网站：www.ccnew.com

（56）名称：国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183333
传真：010-84183311-3389
客服电话：400-818-8118
公司网站：www.guodu.com

（57）名称：万联证券有限责任公司
注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层
办公地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层
法定代表人：张建军
开放式基金咨询电话：400-8888-133
开放式基金接收传真：020-22373718-1013
联系人：罗创斌
联系电话：020-37865070
公司网站：www.wlzq.com.cn

（58）名称：世纪证券有限责任公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：卢长才
联系人：方文
电话：0755-83199599-8133
公司网站：www.csco.com.cn

（59）名称：财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
联系人：郭磊
电话：0731-84403319
公司网站：www.cfzq.com

（60）名称：安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
电话：0755-82825551
传真：0755-82558355
统一客服电话：4008001001
公司网站：www.essence.com.cn

（61）名称：中航证券有限公司
住所：江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
联系人：戴蕾
电话：0791-6768681
传真：0791-6770178
公司网站：www.avicsec.com

（62）名称：长江证券股份有限公司
地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客服电话：955679或4008888999
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客服网站：www.95579.com

（63）名称：瑞银证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：刘弘
联系人：邱培玲
电话：010-58328366
传真：010-58328748
客服电话：400-887-8827
公司网站：www.ubssecurities.com

（64）名称：宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：010-88085858
传真：010-88085195
客服电话：4008-000-562

（65）名称：中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
开放式基金咨询电话：400-600-8008
公司网站：www.cjis.cn

（66）名称：齐鲁证券有限公司
注册地址：济南市市中区经七路86号
办公地址：济南市经七路86号证券大厦
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538
公司网站：www.qlzq.com.cn

（67）名称：方正证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：彭博
电话：0731-85832343
传真：0731-85832214
客服电话：95571
公司网站：www.foundersc.com

（68）名称：江海证券有限公司
地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客服电话：4006662288
公司网站：www.jhzq.com.cn

（69）名称：华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：宋歌
电话：021-50122086
传真：021-50122200
客服电话：4008209898
公司网站：www.cnhbstock.com

（70）名称：英大证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：赵文安
联系人：王睿
电话：0755-83007069
传真：0755-83007167
客服电话：4008-698-698
公司网站：www.ydsc.com.cn

（71）名称：中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人：赵大建
联系人：李微
联系电话：010-59355941
客服电话：40088-95618
公司网站：www.e5618.com

（72）名称：华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
电话：0931-4890100
传真：0931-4890118
客服电话：400-6898888
公司网站：www.hlzqgs.com

（73）名称：信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：400-800-8899
公司网站：www.cindasc.com

（74）名称：厦门证券有限公司
注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：傅毅辉
联系人：卢金文
电话：0592-5161642
传真：0592-5161640
客服电话：0592-5163588
公司网站：www.xmzq.cn

（75）名称：南京证券有限责任公司
住所：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
电话：025-83367888-4201
传真：022-83320066
客户服务热线：4008285888
公司网站：www.njzq.com.cn

（76）名称：华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
法定代表人：丁之锁
联系人：陶颖
电话：010-58568040
传真：010-58568062
客服电话：010-58568118
公司网站：www.hrsec.com.cn

（77）名称：浙商证券有限责任公司
注册地址：杭州市杭大路1号
办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人：吴承
联系人：谢项辉
电话：0571-87901053
传真：0571-87901913
客服电话：0571-967777
公司网站：www.stocke.com.cn

（78）名称：西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：王珠林
联系人：陈诚
电话：023-63786464
传真：023-63786311
客服电话：4008-096-096
公司网站：www.swsc.com.cn

（79）名称：国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：金喆
电话：028-86690126
传真：028-86690126
客服电话：4006600109
公司网站：www.gjzq.com.cn（以上排名不分先后）

3、其他代销机构

本基金发售期间，若新增代销机构或代销机构新增营业网点，则另行公告。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）、注册登记人

名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
法定代表人：王志伟
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话：020-89899129
传真：020-89899175
联系人：李尔华

（三）、担保人

名称：中国投资担保有限公司
住所：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层
办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层
法定代表人：刘新来
成立日期：1993年12月4日
组织形式：有限责任公司
注册资本：3，521，459，934元人民币
经营范围：投资担保；投资及担保的评审、策划、咨询服务；投资及投资相关的策划、咨询；资产受托管理；经济信息咨询；人员培训；新技术、新产品的开发、生产和产品销售；仓储服务；组织、主办会议及交流活动；上述范围涉及国家专项规定管理的按有关规定办理。

（四）、出具法律意见书的律师事务所

名称：国浩律师集团（广州）事务所
住所：广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人：程秉
电话：020-38799345
传真：020-38799335
经办律师：黄贞、王志宏
联系人：程秉

（五）、审计基金资产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所有限公司
办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表：卢伯卿
电话：021-61418888
传真：021-63350003
经办注册会计师：胡小骏 洪锐明
联系人：胡小骏

四、基金的名称

广发聚祥保本混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在力争保本周期到期时本金安全的前提下，严格控制风险，谋求基金资产的稳定增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的债券、A股股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金将按照恒定比例组合保险（Constant-Proportion Portfolio Insurance，CPPI）机制将资产配置于安全资产与风险资产。恒定比例组合保险机制的基本思想为：将扣除一般费用和开支的基金资产分为两个部分。一部分是将较大比例的资金投入到债券和货币市场工具上，以期获得稳定的回报，称为安全资产，另一部分是将少部分资金投入到股票等风险较高的投资工具上，以期取得潜在的超额回报，称为风险资产。通过动态的调整资产配置比例，将可能的风险资产损失锁定在一定范围内，同时追求其上涨时所带来的收益。

本基金的安全资产指固定收益类资产，包括国债、央行票据、企业债、公司债、金融债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券等债券，以及货币市场工具等；风险资产指股票、权证等权益类资产。基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的0%-30%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的70%-100%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

在资产配置上，本基金主要根据恒定比例组合保险机制来动态调整安全资产和风险资产的配比。

恒定比例组合保险机制的原理可以用下面的模型加以说明：

其中，E_t表示t时刻投资于风险资产的额度，M表示放大乘数（Multiplier），A_t表示t时刻投资组合的净资产，F_t表示t时刻的最低保险额度，称为底线（Floor），而（A_t-F_t）称为安全垫（Cushion）。

该策略的具体实施方案如下：

（1）确定初始底线F_0：通过预期的无风险收益水平计算期末目标价值（在本基金中该值为认购并持有到期的基金份额的投资金额）的现值，使得这部分资产到期后本利之和等于期末目标价值；此现值即为初始的底线F_0；

（2）确定放大乘数M：放大乘数主要通过考察以下几方面因素进行选取并进行定期的重新评估与调整：

a.证券市场的运行情况；
b.基金资产的风险情况；
c.通过对历史行情的蒙特卡洛模拟得到的参考最优放大乘数。

（3）确定初始风险资产投资额度E0：底线与基金初始资产的差为初始安全垫；将初始安全垫放大一定的倍数后投资于风险资产，其余部分投资于安全资产；

（4）期间调整：根据本基金的投资情况计算新的安全垫，重新分配风险资产和安全资产比例。

基金管理人从两个方面对恒定比例组合保险机制进行了改进：

首先，本基金强调在股票市值上涨的时候，不过度追涨的策略。通过实时跟踪各类资产净值的变化情况计算各类资产的理论配比，当风险资产价值下跌时及时减仓，而当风险资产价值上升时，需要达到一定的幅度才开始增持，这样在保证执行保本策略的情况下，提高了安全性，降低了交易费用。

同时，本基金还将严密关注风险资产的风险敞口暴露情况。通过计算风险资产的VaR等风险指标值，将可能发生的损失控制在现有资产与底线的差值以内，从而能够避免由于风险资产仓位过重可能引起的潜在损失。

（二）债券投资策略

本基金的债券投资根据投资策略不同分为两个部分，以免疫策略（Immunization Strategy）为主，通过构造投资组合，尽可能使债券组合避免市场利率波动带来的影响，保持收益的稳定性；以积极投资策略为辅，通过对经济周期和利率长期走势分析主动调整组合获取超额收益率；并且，由于债券仓位因投资组合整体策略而动态调整，本基金将选择流动性相对较好的债券作为投资品种，以期在买入和卖出时尽量降低冲击成本。

（1）免疫策略

所谓免疫策略，是指构造这样一种投资组合，使得投资组合的久期与投资期限相匹配，从而使得任何由利率变化引起的债券市场价格的波动能被再投资的回报（或损失）所弥补。免疫策略主要通过配置于久期与保本周期相匹配的债券来实现的。本基金将根据保本周期的剩余期限动态调整债券组合久期，有效地控制组合的利率风险，从而保证投资组合收益的稳定性。

（2）积极投资策略

在免疫策略的基础上，我们采用积极投资的策略对债券组合进行调整，以获取超额收益，其中的积极投资策略包括：

a.类属配置策略

由于不同类型的债券在经济周期内的表现差异很大，本基金以经济周期理论为基础，重点研究不同类别债券资产在经济周期内的变动规律，并根据对当前经济所在经济周期的判断，动态调整对不同类别债券资产的配置比例，并控制整体的风险水平。

b.利率投资策略

本基金通过对GDP、CPI、固定资产投资、国际收支等国民经济运行指标进行深入研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向，结合债券市场资金供求状况变化趋势及结构，对利率水平和收益率曲线形态在未来的变化趋势做出预测和判断。结合收益率曲线变化的预测，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合，并动态调整。

c.个券选择策略

1）信用债

本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法，研究信用产品的信用基本面。债券研究员根据对当前国民经济所处的经济周期阶段的判断，分析发债主体的行业地位、发展趋势、财务状况以及债券的增信方式等情况，并参考外部信用评级机构的评级结果，对该债券的信用级别进行综合评价，并以此作为信用债券投资的重要依据。

本基金还将紧密捕捉银行间市场和交易所市场的分割带来的套利机会、一二级债券市场的收益率利差带来的投资机会等，同时密切跟踪国外信用债券的最新发展规律和重要研究成果，深化对国内信用利差变动的认识，通过调整本基金组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布，获取最大化的风险加权回报。

2）可转债

可转债兼顾固定收益债券的稳定收益特点，以及标的权益可能的上升空间，在某些市场阶段可以有效的抵御债券市场系统性风险，提高组合收益。

本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性，以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益。本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。

3）资产支持证券

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、支持证券的构成及质量等多种因素的影响。目前资产支持证券的流动性及市场对其认可度还有待提高，本基金将密切关注资产支持证券市场的发展，通过定量与定性相结合的研究方法，确定其投资价值。

（三）股票投资策略

（1）新股投资策略

本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择参与标的、参与规模和退出时机，并通过深入分析新股上市公司的基本面情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高收益。

（2）二级市场股票投资策略

本基金通过GARP投资法选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

本基金股票投资采用备选库制度，本基金的备选库包括一级库和二级库。

1） 一级库的构建

一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围，入选条件主要是根据广发企业价值评估体系，通过研究，筛选出基本面良好的股票进入一级库。广发企业价值评估系统对企业价值的考察重点包括：企业财务状况、经营管理状况、竞争力优势及所处行业环境。

2）二级库的构建

二级股票库为本基金的风格库。本基金通过GARP投资法从一级股票库中选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

GARP投资法重视投资价值与成长潜力的平衡，一方面利用价值投资标准筛选低价股票，避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险；另一方面，利用成长性投资可分享高成长收益的机会。

二级库的股票主要选择标准包括：（1）成长性，通过对宏观经济、产业政策、行业景气和公司经营管理等方面的综合分析，结合净资产收益率、收入和利润的增长速度等指标，筛选出具有预期高成长性的公司；（2）PEG指标，在成长性分析的基础上，采用PEG指标做进一步的筛选分析，并结合PE、PB等其它指标，以及公司和行业等因素进行综合考虑，以准确把握公司的增长潜力；（3）其它因素，包括公司治理、外部环境、竞争优势、创新能力等。

3）构建股票组合

在二级库的基础上，根据投资程序，基金经理小组通过对个股价格趋势和市场时机的判断，进行最终的股票组合构建。

（四）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的；同时，充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会，实现基金资产的增值。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：3年期银行定期存款税后收益率。

十、风险收益特征

本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

十一、基金基金的投资组合报告

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2011年10月12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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日。

（一）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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	3，234，628，962.70	81.19
	其中：债券	3，234，628，962.70	81.19
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	573，851，420.78	14.40
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	147，229，054.22	3.70
6	其他各项资产	28，119，874.59	0.71
7	合计	3，983，829，312.29	100.00

（二）、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

（三）、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

本基金报告期末未持有股票。

（四）、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	5，885，706.00	0.15
2	央行票据	893，960，000.00	22.53
3	金融债券	1，513，908，000.00	38.15
	其中：政策性金融债	1，513，908，000.00	38.15
4	企业债券	81，751，256.70	2.06
5	企业短期融资券	739，124，000.00	18.63
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3，234，628，962.70	81.52

（五）、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1101032	11央票32	8，500，000	845，665，000.00	21.31
2	110216	11国开16	2，500，000	246，250，000.00	6.21
3	1181165	11国电集CP01	2，200，000	219，780，000.00	5.54
4	1181153	11铁道CP01	2，000，000	199，380，000.00	5.02
5	110222	11国开22	2，000，000	199，280，000.00	5.02

（六）、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

（七）、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

（八）、投资组合报告附注

1. 根据公开市场信息，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

2.报告期内本基金持有的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	334，325.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27，785，549.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28，119，874.59

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转换期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中无流通受限股票情况。

十二、 基金的业绩

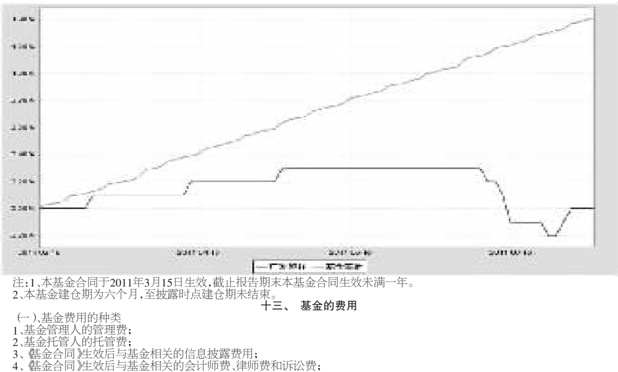
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2011年6月30日。

1. 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金成立起至今	0.00%	0.04%	1.41%	0.00%	-1.41%	0.04%

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

广发聚祥保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011年3月15日至2011年6月30日）



注：1、本基金合同于2011年3月15日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
2、本基金建仓期为六个月，至披露时点建仓期未结束。

十三、 基金的费用

（一）、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在保本周期内，本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

在保本周期内，本基金的保证费用从基金管理人的管理费收入中列支。

2、基金托管人的托管费

在保本周期内，本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为转型后的“广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

上述一、基金费用的种类中第3-8项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《广发聚祥保本混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。
2、在“第四部分 基金托管人”部分，根据基金托管人人员变动及业务经营情况对基金托管人信息进行了相应更新。
3、在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了相关的代销机构，对原有销售机构的资料进行更新。
4、在“第十一部分 基金的投资”部分，更新了截至2011年6月30日的基金投资组合报告。
5、在“第十二部分 基金的业绩”部分，更新了截至2011年6月30日的基金业绩。
6、根据最新公告，对“第二十五部分 其他应披露事项”内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一一年十月二十八日