广发聚利债券型证券投资基金招募说明书【更新】摘要

[2012年第2号]

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

日期:二〇一二年九月

重要提示

本基金于2011年5月6日经中国证监会证监许可[2011]668号文核准。本基金基金合同于2011年8月5日正式生效。

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。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本基金的基金合同已经根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

本招募说明书所载内容截止日为2012年8月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

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、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、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,兼任广发国际资产管理有限公司董事长。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,现任广发证券副总裁、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裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏征信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司等公司董事,兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。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,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长,香江集团有限公司董事长兼总裁,深圳市金海马实业股份有限公司董事长,南方香江集团有限公司董事长,香江控股股份有限公司董事长。兼任广发证券监事,广发银行股份有限公司董事,全国妇联常委,中国产业发展促进会副会长,广东省政协常委,广东省工商联副主席,广东省妇联副主席,广东省女企业家协会会长,深圳市政协常委,香江社会救助基金会主席。

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,兼任广发国际资产管理有限公司董事。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。

刘志军:监事,男,管理学硕士,现任广州科技风险投资有限公司董事长,兼任广州生产力促进中心副主任、广州市科达实业发展公司总经理。曾任广州市统计局投资处处长、工业处处长、社会科技处处长。

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,兼任广发国际资产管理有限公司董事长。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及广发制造业精选股票型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事。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

代宇,女,中国籍,金融学硕士,7年基金从业经历,持有证券业执业资格证书,2005年7月至2011年6月先后任广发基金管理有限公司固定收益部研究员及交易员、国际业务部研究员、机构投资部专户投资经理,2011年7月调入固定收益部任投资人员,2011年8月5起任广发聚利债券基金的基金经理,2012年3月13日起任广发聚财信用债券基金的基金经理。

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,投资总监、投资管理部总经理陈仕德,研究发展部总经理傅友兴,固定收益部总经理张芊。

二、基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所: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
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:尹 东
联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2011年9月30日,中国建设银行资产总额117,723.30亿元,较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月,中国建设银行实现净利润1,392.07亿元,较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%,年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元,较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%,净利息收益率为2.68%,分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元,较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科、台北设有代表处,海外机构已覆盖到全球13个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年,中国建设银行主要国际排名位次持续上升,先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年"世界银行品牌500强"中位列第10,较去年上升3位;在美国《财富》世界500强中排名第108位,较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的"亚洲企业管治年度大奖",先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的"中国最佳银行"、"中国国内最佳银行"与"中国最佳私人银行"等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

三、相关服务机构

(一)场外发售机构

1.直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司、深圳理财中心、杭州理财中心及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务:

(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)深圳理财中心
地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦24楼05室
电话:0755-82701982
传真:0755-82572169

(5)杭州理财中心
地址:杭州市西湖区华星路2-2号
电话:0571-81903158
传真:0571-81903158

(6)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、认购等业务,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网址:www.gffunds.com.cn
本公司网址: www.gffunds.com.cn
客服电话:95105828(免长途费)或020-83936999
客服传真:020-34281105

(7)投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2.场外代销机构

(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、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
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:王洪章
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:蒋超良
客服电话:95599
公司网站:www.abchina.com

(5)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

(6)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

(7)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

(8)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

(9)名称:平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号
办公地址:深圳市深南中路1099号
法定代表人:孙建一
联系人:蔡宇洲
电话:0755-22197874 25879591
传真:0755-22197701
客服电话:40066-99999
公司网站:http://bank.pingan.com

(10)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:谢小华
电话:010-66223587
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

(11)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

(12)名称:浙商银行股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号
办公地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号
法定代表人:张达洋
联系人:毛真海
联系电话:0571-87659546
传真:0571-87659188
客服电话:95527
公司网站:www.czbank.com

(13)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

(14)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)

(15)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

(16)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

(17)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:010-66568990
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

(18)名称:中信建投证券股份有限公司
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:王常青
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

(19)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:010-66045527
天相投顾网址:http://www.txsec.com
天相基金网网址:www.jjm.com.cn

(20)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

(21)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

(22)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:万鸣
客服电话:95597
公司网站:www.htsc.com.cn

(23)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200号中银大厦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

(24)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

(25)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:安岩岩
联系电话:0431-85096517
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

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)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

(32)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、95525
公司网站:www.ebscn.com

(33)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:梁旭
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
公司网站:www.longone.com.cn

(34)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:陈明
电话:0791-86282293
传真:0791-86282293
客服电话:见各营业部客户电话
公司网站:www.gsstock.com

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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:无锡市滨湖区太湖新城金融一街8号
法定代表人:雷建辉
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客服电话: 95570
公司网站:www.glsc.com.cn

(39)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:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人:刘东
联系人:林洁茹
电话:020-88836999
传真:020-88836654
客服电话:020-961303
公司网站:www.gzs.com.cn

(40)名称:第一创业证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
联系人:崔国良
电话:0755-25832852
传真:0755-25831718
客服电话:4008881888
公司网站:www.fcsc.cn

(41)名称:中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-60833722
传真:010-60833739
客服电话:95558
公司网站:www.citics.com

(42)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

(43)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

(44)名称:华安证券股份有限公司
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(安徽)、4008096518(全国)
公司网站:www.hazq.com

(45)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

(46)名称:中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
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:周妍
电话:0571-86078823
客服电话:0571-96598

(47)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:徐轶青
电话:0571-87822359
传真:0571-87818329
客服电话:96336(浙江)、40086-96336(全国)
公司网站:www.ctsec.com

(48)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

(49)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

(50)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

(51)名称:世纪证券有限责任公司
注册地址: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
传真:0755-83199545
客服电话:0755-83199511
公司网站:www.csco.com.cn

(52)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

(53)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

(54)名称:中航证券有限公司
住所:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
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

(55)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

(56)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:牟冲
电话:010-58328112
传真:010-58328748
客服电话:400-887-8827
公司网站:www.ubssecurities.com

(57)名称:恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
联系人:常向东 孙伟
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
客服电话:0471-4961259
公司网站:www.cnht.com.cn

(58)名称:中国中投证券有限责任公司
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-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
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04、18层至21层
法定代表人:龙增来
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.china-invs.cn

(59)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

(60)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

(61)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

(62)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

(63)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

(64)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

(65)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

(66)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:赵钦
电话:0592-5161642
传真:0592-5161640
客服电话:0592-5163588
公司网站:www.xmzq.cn

(67)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

(68)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

(69)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

(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)场内发售机构
具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。

(三)注册登记人
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
联系电话:0755-25938095
传真:0755-25987538
联系人:任瑞新

(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)会计师事务所和经办注册会计师
名称:天健会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:杭州市西溪路128号新湖商务大厦9层
法人代表: 胡少先
电话:0571-88216888
传真:0571-88216999
经办注册会计师:杨克晶、禤文欣
联系人:禤文欣

四、基金的名称

广发聚利债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型、契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,封闭期间投资人不能申购赎回本基金份额,但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额;封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%;权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;基金转为上市开放式基金(LOF)后,本基金将保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

(一)大类资产配置策略

本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险等因素,从经济周期的角度判断经济形势,并根据各类资产在特定经济形势下的预期收益和预期风险特征,在本基金的投资范围内,确定各类资产的配置比例。

本基金主要投资的金融资产包括:利率产品、信用产品和可转换债券等固定收益类资产,以及新股申购、股票增发和要约收购类股票投资等权益类资产。其中,利率产品包括国债、央行票据、政策性金融债等政府债券;信用产品包括企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、分离交易可转债等非由国家信用担保的固定收益类产品;本基金视可转换债券为一种内嵌转股权的特殊债券,不属于信用产品。

结合投资时钟理论,本基金认为,在经济衰退阶段,央行通常会降息刺激经济,进而引导收益率曲线急剧下行,利率产品是最佳选择;在经济复苏阶段,经济刺激政策发挥作用,GDP增长加速,企业盈利上升,信用产品和可转债能获得较高收益;而到了经济过热阶段,央行加息以控制通胀并紧缩经济,短期的高收益信用产品依然能锁定较高的投资回报。因此,本基金将通过对宏观形势的积极研判并灵活调整组合配置,获得长期稳健的收益。

(二)固定收益类资产投资策略

1、利率预测及久期配置策略

积极的债券投资策略的关键是对未来利率走向进行预测,并及时调整债券组合的期限分布使其符合收益率变化的趋势。

具体而言,本基金将通过对影响债券投资的宏观经济形势进行分析判断,形成对未来市场利率变动方向的预期,结合市场的流动性情况确定固定收益类资产的久期配置和期限结构配置。

本基金主要关注的宏观经济因素有GDP、通货膨胀、信贷增长、固定资产投资、对外贸易情况等。同时,这些宏观经济指标所反映的经济运行情况将影响政府货币政策和财政政策的选择,进而影响市场利率的调整,因此本基金在关注宏观经济因素的基础上,会进一步跟踪政府推行的相关政策的市场影响。

本基金将在短期利率预测和中长期利率预测的基础上,结合收益率曲线策略来确定目标久期并进行动态调整。同时,本基金将进一步预测收益率曲线可能发生的形变,在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略,获取收益率曲线变动带来的收益。即使预测收益率曲线未来将维持稳定,本基金也可以利用收益率曲线的陡峭特征,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券并等待其收益率下滑进而获得骑乘收益。

2、债券类属资产配置策略

债券类属资产配置是在确定目标久期的前提下,根据市场流动性、信用风险利差等市场因素,在国债、金融债、短期融资券、企业债等债券类别间进行配置。

(1)利率产品投资策略

利率产品是指具有国家信用担保的债券,包括国债、央行票据、政策性金融债等。这类债券在信用资质层面没有差异,但在流动性和税收安排方面有一定差别。本基金在收益率曲线策略的指导下,根据个券的流动性情况对这类产品进行配置。

利率产品的流动性在所有的债券品种中最好,因而也最具有波段操作机会,本基金将密切跟踪影响收益率预期的各类因素,力求抓住短期的交易性机会。

(2)信用产品投资策略

本基金将建立内部信用评级制度,根据国民经济运行的周期阶段,分析企业的市场地位、管理水平、发展趋势和财务状况等,作为支持信用产品投资的研究基础。同时,本基金还将重点研究信用市场环境的变化,掌握并预测信用利差波动的规律,以此作为信用品种配置时机的重要依据。

信用利差是信用产品波动的重要影响因素,鉴于我国信用债市场发展时间较短,本基金主要借鉴国外成熟债券市场的信用利差规律,并结合我国信用债市场的结构和经济形势研判国内信用产品的利差波动趋势。通过这种自上而下的分析方法把握信用产品运行的基本规律,从而指导本基金的信用产品投资策略。

发债主体的信用基本面分析是信用债投资的基础性工作,本基金将根据国民经济运行的周期阶段,分析发债主体的市场地位、管理水平、发展趋势和财务状况等,对债券发行人的信用风险进行综合评价。

本基金将在对宏观经济、企业状况深入研究的基础上,对债券的信用风险进行度量和定价,把握信用利差波动趋势,选择溢价率较高的信用产品进行投资。

(3)可转债投资策略

可转债是普通信用债与一系列期权的结合体,既有债券的保护性又有像股票那样的波动性。本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该转债的债底保护,防范信用风险,另一方面,还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定转债中长期的上涨空间。

考虑到转债内含的权利,尤其是转股价的修正权,本基金在借助Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值模型对转债进行定价的同时,将密切跟踪上市公司的经营状况,从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。通过上述方式,基金管理人对可转债的价值进行综合评估,从中选择具有较高投资价值的可转债进行投资。

(4)回购放大策略

回购放大是一种杠杆投资策略,通过质押组合中的持仓债券进行正回购,将融得资金购买债券,获取回购利率和债券利率的利差,从而提高组合收益水平。

影响回购放大策略的关键因素有两个:一是回购资金成本与债券收益率的关系,只有当债券收益率高于回购资金成本时,放大策略才能取得正的回报;其次,该策略的运用一般需要一个相对宽松的资金面。本基金将密切跟踪资金面的情况,动态调整回购放大的比例,并配置流动性较好的债券,在防范流动性风险的基础上,为基金持有人争取更多收益。

(三)权益类资产投资策略

本基金可参与一级市场新股申购、股票增发和要约收购类股票投资,还可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票、因投资分离交易可转债所形成的权证等权益类资产。

新股申购方面,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。本基金还综合考虑新股中签率、上市首日涨幅、股价长期表现和锁定期限等因素,选择网上申购或网下申购,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高的申购收益。

要约收购类股票投资方面,因上市公司吸收合并、要约收购等因素,市场上存在具有现金选择权的要约收购类投资机会,本基金将从固定收益证券投资角度判断要约收购类股票的投资价值。自收购人在证监会指定信息披露媒体上公告要约收购报告书后,本基金在充分研究和判断要约收购人的资金实力和收购意愿的前提下,综合考虑收购时间、波动性和流动性等因素,确定是否参与要约收购类股票投资。

本基金除了可以参与新股首次发行(IPO)外,还可以参与新股增发,所配新股在可上市交易后,结合宏观形势和公司基本面的判断择机出售。

对于因投资分离交易可转债所形成的权证,在权证上市后,本基金将根据权证估值模型的分析结果,在权证价值高估时,选择适当的时机卖出。

(四)、投资决策依据和决策程序

1.投资决策依据
(1)、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
(2)、宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。

2.投资决策程序
(1)投资决策委员会制定整体投资战略。
(2)固定收益部研究员根据自身或者其他研究机构的研究成果,形成利率走势预测、券种配置建议等,为债券决策提供支持。
研究发展部的行业及公司研究员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,提供新股配置建议。
(3)固定收益基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,结合研究员的研究报告,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、目标久期、期限结构、个券选择等投资方案。
(4)投资决策委员会对固定收益基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。
(5)根据决策纪要,固定收益基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由交易部执行。
(6)交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈至基金经理小组。
(7)基金绩效评估与风险管理小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险,定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准是中证全债指数收益率。

十、风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,为证券投资基金中的较低风险品种。

十一、基金投资组合报告

广发基金管理有限公司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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行根据本基金基金合同规定,于2012年8月22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。

本投资组合报告所载数据截至2012年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	304,780.00	0.03
	其中:股票	304,780.00	0.03
2	固定收益投资	973,058,137.20	96.91
	其中:债券	973,058,137.20	96.91
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	13,342,706.16	1.33
6	其他各项资产	17,390,775.11	1.73
7	合计	1,004,096,398.47	100.00

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	采掘业	-	-
C	制造业	248,940.00	0.07
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	248,940.00	0.07
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	42,000.00	0.01
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	13,840.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	304,780.00	0.08

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	603001	奥康国际	9,000	242,190.00	0.06
2	002673	西部证券	2,500	42,000.00	0.01
3	603128	华贸物流	1,000	6,970.00	0.00
4	601965	中国汽研	1,000	6,870.00	0.00
5	603002	宏昌电子	1,000	6,750.00	0.00
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	3,205,105.00	0.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	849,652,915.30	222.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	93,471,000.00	24.52
7	可转债	26,729,116.90	7.01
8	其他	-	-
9	合计	973,058,137.20	255.27

5.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	122092	11大秦01	391,190	39,901,380.00	10.47
2	122065	11上港01	342,640	34,736,843.20	9.11
3	126011	08石化债	324,910	30,934,681.10	8.12
4	122770	11国网01	300,000	30,750,000.00	8.07
5	122140	12宁港01	281,950	28,476,950.00	7.47

6.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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.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
本基金本报告期末未持有权证。

8.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,或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)报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,250.32
2	应收证券清算款	45,142.60
3	应收股利	-
4	应收利息	17,339,382.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,390,775.11

(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	113002	工行转债	7,535,568.60	1.98
2	113001	中行转债	6,863,470.40	1.80
3	110018	国电转债	4,495,425.90	1.18
4	110015	石化转债	3,916,472.00	1.03
5	125709	唐钢转债	3,270,900.00	0.86

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

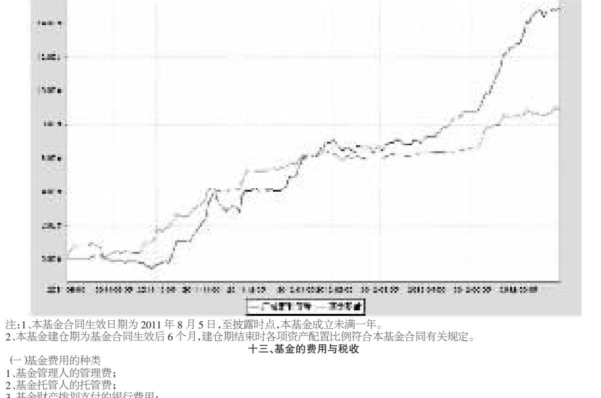
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2012年6月30日。

一、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
2012.1.1-2012.6.30	9.54%	0.16%	3.10%	0.09%	6.44%	0.07%
2011.8.5-2011.12.31	4.90%	0.19%	5.68%	0.13%	-0.78%	0.06%
自基金合同生效至今	14.91%	0.17%	8.95%	0.11%	5.96%	0.06%

二、自基金合同生效以来基金累计份额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

广发聚利债券型证券投资基金
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
(2011年8月5日至2012年6月30日)



注:1、本基金合同生效日期为2011年8月5日,至披露时点,本基金成立未满一年。
2、本基金建仓期为基金合同生效后6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。

十三、基金的费用与税收

(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、基金财产拨划支付的银行费用;
4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7、基金的证券交易费用;
8、基金上市初费和上市月费;
9、证券账户开户费用和银行账户维护费;
10、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)、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
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5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、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5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、休息日,支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)、不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

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《广发聚利债券型证券投资基金招募说明书更新》(2012年1号)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,增加了新代销机构,对原有销售机构的资料进行更新。
4.在"第十部分 基金的投资"部分,更新了截至2012年6月30日的基金投资组合报告。
5.在"第十一部分 基金的业绩"部分,更新了截至2012年6月30日的基金业绩。
6.根据最新公告,对"第二十四部分 其他应披露事项"内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一二年九月十七日