（上接B65版）

电话:025-83367888-4201
传真:022-83320066
客户服务热线:4008285888
公司网站:www.njzq.com.cn
（96）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:宋德清
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
（97）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:谢琼辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客服电话:0571-967777
公司网站:www.stocke.com.cn
（98）名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:4008-096-096
公司网站:www.swsc.com.cn
（99）名称:财达证券有限责任公司
注册地址:河北省石家庄市自强路35号
办公地址:石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
法定代表人:翟建强
联系人:刘亚静
电话:0311-66006393
传真:0311-66006249
客服电话:400-612-8888
公司网站:www.s10000.com
（100）名称:红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
客服电话:400-871-8880
传真:0871-3578827
公司网站:www.hongtastock.com
（101）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:刘一宏
电话:028-86690070
传真:028-86690126
客服电话:4006600109
公司网站:www.gjzq.com.cn
（102）名称:中天证券有限责任公司
注册地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马功勋
联系人:袁劲松
联系电话为:024-86268007
传真为:024-86268016
客服电话:400-6180-315
公司网站:www.stockren.com
（103）名称:联讯证券有限责任公司
注册地址:广东省惠州市下埔路14号
法定代表人:徐刚
客服电话:400-8888-929
联系人:丁宁
电话:010-64408820
传真:010-64408252
公司网站:www.lxzq.com.cn
（104）名称:新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法人代表:刘汝军联络人:孙恺
联系电话:010-83561149
客服电话:400-698-9898
传真:010-83561094
网址:www.xdzq.cn
（105）名称:日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈彬彬
联系电话:010-88086830-730 010-88086830-737
传真:010-66412537
客服电话:010-88086830
公司网址:www.rxzq.com.cn
（106）名称:天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座
法人代表:余磊
联系人:崔翠
联系电话:027-87618882
客服电话 028-86712334
传真:027-87618863
公司网址: www.tfzq.com
（107）名称:东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼
法人代表:张运勇
联系人:乔芳
联系电话:0769-22100155
客服电话:0769-961130
传真:0769-22119426
公司网址:www.dgzq.com.cn
（108）名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:殷莎
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.enchfund.com
（109）名称:华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
联系人 ;陈威
联系电话:021-64316642
业务传真:021-54653529
客服热线:021-32109999;029-68918888;4001099918
公司网址:www.cfsc.com.cn
（110）名称:中山证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
联系人:刘军
联系电话:0755-82943755
业务传真:0755-82940511
客服热线:400022011
公司网址:www.zszq.com
（111）名称:中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:李剑阳
联系电话:010-65051166
业务传真:010-65051166
公司网址:www.cicc.com.cn
（112）名称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
联系电话:021-58870011
业务传真:021-68596916
客服热线:4007009665
公司网址:www.ehowbuy.com
（113）名称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
联系电话:0571-88911818-8565
业务传真:0571-86800423
客服热线:0571-88920897,4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
（114）名称:深圳腾元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F（07）
办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F（07）
法定代表人:卓战晶
联系人:主冀萍
联系电话:0755-33376853
业务传真:0755-33065516
客服热线:4006877899
公司网址:www.tenyuanfund.com
（115）名称:中期时代基金销售（北京）有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
联系电话:010-65808756
业务传真:010-65807864
客服热线:95162、4008888160
公司网址:www.CIFCOFUND.com
（116）公司名称:万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:高晓芳
联系电话:010-59393923
业务传真:010 -59393074
客服热线:400-8088-0069
公司网址:www.wy-fund.com
（117）名称:太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元
法定代表人:李长伟
联系人:陈征
联系电话:010-88321882
业务传真:010-88321763
客服热线:0871-68898130
公司网址:www.tpyzq.com
（118）名称:上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998
业务传真:021-64385308
客服热线:4001818188
公司网址:www.1234567.com.cn
（119）名称:杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
联系电话:021-60897840
业务传真:0571-26697013
客服热线:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn
（120）名称:渣打银行（中国）有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心23楼
法定代表人:林清锋
联系人:郑毓栋
联系电话:021-50163988
业务传真:021-58205487
客服热线:800-820-8088
公司网址:www.standardchartered.com.cn
（121）名称:和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:吴阿娟
联系电话:0755-82721106-8642
业务传真:0755-82029055
客服热线:4009200022
公司网址:www.hexun.com
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
（二）注册登记机构
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
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
法定代表人:王志伟
联系人:李尔华
电话:020-89899170
传真:020-89899175
（三）律师事务所和经办律师
名称:国浩律师（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:程秉、陈桂华
联系人:程秉
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称:德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
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
联系人:黄晓霞
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:黄晓霞、余志亮

四、基金的名称

广发聚瑞股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律,把握主题投资机会,通过精选个股和有效的风险控制,追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略
本基金为股票型基金,基金的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,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。
（二）股票投资策略
在股票投资方面,本基金主要采用目上而下的“主题投资分析框架”（Thematic Investing Analysis Frame),通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤,挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票,通过定量和定性相结合的方法,筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。
1、主题挖掘
本基金将通过自上而下的方式,从宏观经济运行、经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发,在深入研究的基础上,有效分析影响经济发展和企业盈利的关键性、趋势性因素,从而前瞻性地挖掘出中国经济发展过程中不断涌现出的投资主题。
2、主题配置
在主题挖掘的基础上,基金管理人定期召开投研联席会议,由研究员（宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员）和基金经理对主题因子进行分析、评估,最终确定各大主题资产在股票资产中的配置。
3、主题投资
（1）主题行业配置
在确定了主题配置后,本基金将明确各个主题所涵盖的主题行业,通过行业投资评级的方式,确定各个主题行业的配置比例,本基金将重点投资于那些主题特征明显、成长价值高的行业。
（2）个股精选
在个股投资方面,本基金采用备选库制度,本基金的备选库包括一级股票库和二级股票库。
一级股票库:主要根据本基金管理人开发的广发企业价值评估系统,通过考察企业的基本面状况,筛选出基本面良好的股票组成一级股票库。
二级股票库:在一级股票库的基础上,根据主题行业配置阶段所确定的各个主题所覆盖的主题行业,从一级股票库中挑选出所有属于主题行业的股票,通过定性、定量分析,精选增长潜力大、盈利能力好的优质上市公司,构成本基金的二级股票库。二级股票库是本基金的风格股票库。
（三）债券投资策略
在债券投资上,坚持稳健投资的原则,通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现和确认市场失衡,把握投资机会;在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下,为投资者获得稳定的收益。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。
利率预测:本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险。尤其是在预期利率上升的时候,严格控制,保持债券投资组合较短的久期,降低债券投资风险。
收益率曲线策略:首先确定收益曲线变动的类型以及各种变动对组合收益率变动的影响,具体包括子弹策略、杠铃策略和梯子策略,在此基础上以对收益率曲线形状变动的预期为依据建立或改变组合头寸。
债券配置:本基金将依照收益率及风险特征对债券类资产进行配置,确定投资组合,并随着投资环境的变化调整投资组合。
债券分析:本基金将根据不同债券品种的特点进行分析。
（1）国债:重点关注利率水平以及国债的供求关系等;
（2）企业债:重点关注发债企业的信用等级、收益率、债券的流动性以及债券的发行期限等指标;
（3）可转债:本基金将在评估其债券能力的同时兼顾公司的成长性,以期通过转换条款分享股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。
（四）权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具,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。
根据有关规定,本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制:
1、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
2、本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之三。
3、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。
若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。
如果中证指数有限公司停止计算编制这些指数或更改指数名称,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、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,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2014年1月6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2013年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
（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	3,237,073,967.51	92.81
	其中:股票	3,237,073,967.51	92.81
2	固定收益投资	5,172,697.13	0.15
	其中:债券	5,172,697.13	0.15
	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	218,568,364.53	6.27
6	其他各项资产	26,888,257.42	0.77
7	合计	3,487,703,286.59	100.00

（二）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	436,086.00	0.01
B	采矿业	225,078,329.14	6.54
C	制造业	1,409,554,760.79	40.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,821,245.20	0.90
E	建筑业	1,372,741.20	0.04
F	批发和零售业	199,344,897.10	5.80
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	1,036,839,934.69	30.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	770,483.25	0.02
L	租赁和商务服务业	58,872,708.48	1.71
M	科学研究和技术服务业	9,346,323.75	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	25,377,158.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,973,805.46	0.67
R	文化、体育和娱乐业	216,198,108.37	6.29
S	综合	87,386.08	0.00
	合计	3,237,073,967.51	94.13

（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

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	300273	和佳股份	9,896,511	237,318,333.78	6.90
2	300157	恒泰艾普	11,864,962	225,078,329.14	6.54
3	002450	康得新	8,628,049	206,900,615.02	6.02
4	300147	香雪制药	8,885,959	196,290,834.31	5.71
5	300104	乐视网	5,331,434	182,654,928.84	5.31
6	300212	易华录	3,906,145	106,051,836.75	3.08
7	002241	歌尔声学	2,472,963	104,556,875.64	3.04
8	300014	亿纬锂能	2,743,490	102,853,440.10	2.99
9	002024	苏宁云商	7,999,889	102,798,573.65	2.99
10	300027	华谊兄弟	1,287,950	100,305,546.00	2.92

（四）按券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	5,172,697.13	0.15
8	其他	-	-
9	合计	5,172,697.13	0.15

（五）债券投资前五名组合

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	41,625	5,172,697.13	0.15
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

（六）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股票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	2,110,211.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	47,316.03
5	应收申购款	24,730,730.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,888,257.42

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	(1) 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	300104	乐视网	182,654,928.84	5.31	重大事项
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

6. 本报告期内本基金未主动或被动持有权证投资。
7. 本报告期末本基金未持有资产支持证券投资。
8. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
（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。
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金投资国债期货以套期保值为主要目的,在构建债券投资组合时,可通过国债期货对冲利率风险。
9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
（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。
9.3 本基金投资国债期货的投资评价
（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。

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2013年9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	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)
2009.6.16-2009.12.31	7.40%	2.03%	16.35%	1.65%	-8.95%	0.38%
2010.1.1-2010.12.31	12.66%	1.68%	-9.39%	1.27%	22.05%	0.41%
2011.1.1-2011.12.31	-18.43%	1.31%	-18.83%	1.04%	0.40%	0.27%
2012.1.1-2012.12.31	11.75%	1.49%	6.75%	1.02%	5.00%	0.47%
2013.1.1-2013.9.30	37.99%	1.97%	-3.36%	1.18%	41.35%	0.79%
自基金合同生效至今	52.20%	1.66%	-12.24%	1.21%	64.44%	0.45%

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
（2009年6月16日至2013年9月30日）

注:本基金建仓期为六个月,本基金建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.5%÷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前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。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%÷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前2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
上述一、基金费用的种类中第3—7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、基金销售费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,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和基金管理人网站上公告。

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《广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书更新》（2013年2号）的内容进行了更新,主要更新的内容如下:
1. 在“第二部分 基金管理人”部分,根据基金管理人人员变动进行了相应更新。
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,相关事宜均已公告。
4. 在“第九部分 基金的投资”部分,更新了截至2013年9月30日的基金投资组合报告。
5. 在“第十部分 基金的业绩”部分,更新了截至2013年9月30日的基金业绩。
6. 根据最新公告,对“第二十二部分 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○一四年一月二十八日

（上接B66版）

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	2,647,225,497.99	71.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,260,070.24	0.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	83,746,347.20	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	21,812,151.00	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,713,475.24	1.34
J	金融业	30,270,000.00	0.81
K	房地产业	72,180,187.00	1.94
L	租赁和商务服务业	151,589,959.80	4.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	83,061,903.10	2.23
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	30,546,565.01	0.82
S	综合	-	-
	合计	3,194,406,156.58	85.82

3、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	002415	海康威视	10,183,532	268,845,244.80	7.22
2	600315	上海家化	5,326,218	231,211,123.38	6.21
3	002570	贝因美	4,575,775	190,352,240.00	5.11
4	600887	伊利股份	3,982,272	177,927,912.96	4.78
5	600585	海螺水泥	10,075,279	150,524,668.26	4.04
6	000538	云南白药	1,223,709	143,247,375.54	3.85
7	600352	浙江龙盛	9,905,381	121,340,917.25	3.26
8	600535	天士力	2,679,740	120,641,894.80	3.24
9	002344	海宁皮城	4,975,944	107,977,984.80	2.90
10	000625	长安汽车	9,764,574	100,575,112.20	2.70

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	49,875,000.00	1.34
	其中:政策性金融债	49,875,000.00	1.34
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	49,875,000.00	1.34

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	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	1.34

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、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
10、投资组合报告附注
（1）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）本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,336,943.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,363,576.47
5	应收申购款	238,259.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,938,779.38

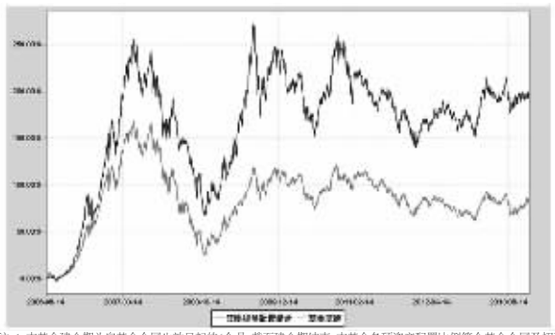
（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2013年9月30日,所载财务数据未经审计师审计。
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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
下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。
1、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	6.42%	0.99%	7.39%	0.90%	-0.97%	0.09%
2013年度上半年	-4.30%	1.10%	-6.39%	0.95%	2.09%	0.15%
2012年度	15.29%	1.11%	6.18%	0.84%	9.11%	0.27%
2011年度	-22.91%	1.09%	-17.00%	0.86%	-5.91%	0.23%
2010年度	-3.73%	1.54%	-4.17%	1.02%	0.44%	0.52%
2009年度	85.46%	1.96%	57.17%	1.31%	28.29%	0.65%
2008年度	-42.93%	2.16%	-46.18%	1.95%	3.25%	0.21%
2007年度	106.33%	2.01%	86.60%	1.50%	19.73%	0.51%
2006年度（2006年6月14日-2006年12月31日）	57.11%	0.96%	35.63%	0.89%	21.48%	0.07%

注:本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数”。详情见本基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。
2、自基金合同生效以来基金份额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
交银施罗德稳健配置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的历史走势对比图
（2006年6月14日至2013年9月30日）



注:1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。
2、本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“65%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数”。详情见本基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

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相关的会计师费和律师费;
7、基金的证券交易费用;
8、在有关规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,销售服务费的具体计提方法、计提标准在有关公告中载明。
9、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金基金合同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. 与基金运作有关的费用
（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年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%
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,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