

(0)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

(1)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国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华国际大厦22-24层
法定代表人:雷波
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

(2)名称:江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张萍北
电话:0451-85863696
传真:0451-822872
客户服务热线:400-666-2288
网站:www.jhzq.com.cn

(3)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:陈琳
联系人:宋歌
电话:021-50122086
传真:021-50122200
客服电话:4008092989
公司网站:www.cnhtstock.com

(4)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:甘肃省城关区东南路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:4001-689888
公司网站:www.hlzq.com

(5)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:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63801000
传真:010-63809778
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

(6)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:赵秋
电话:0592-5161642
传真:0592-5161640
客服电话:0592-51653588
公司网站:www.xmzq.com

(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:张华荣
联系人:徐朋
电话:025-83367888-4201
传真:022-83320066
客户服务专线:4008285888
公司网站:www.njzq.com.cn

(68)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9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

(69)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市北区较场口
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

(70)名称:国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街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

(71)名称:中天证券有限责任公司
注册地址:武汉市武昌区中北路23甲
办公地址:武汉市和平区南五马路121号 万丽城晶座4楼 中天证券
法定代表人:余维佳
联系人:袁劲松
电话:024-23280842
客服电话:4006180315
公司网站:www.stockren.com

(72)名称:联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市下埔路14号
法定代表人:徐勇
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

(73)名称:新时代证券股份有限公司
注册地址: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:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:李汝军
联系人:肖彬
联系电话:010-83561149
客服电话:400-698-9898
传真:010-83561094
公司网站:www.xsdzq.com

(74)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:陈永彬
联系电话:010-88086830-730 010-88086830-737
传真:010-66412537
客服电话:010-88086830
公司网站:www.rxzq.com.cn

(75)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:湖北省武汉市汉阳区唐家湾路32号国贸大厦B座16层
法人代表:余磊
联系人:余磊
联系电话:027-87618882
客服电话:028-86712334
传真:027-87618863
公司网站:www.tfzq.com

(76)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:张永勇
联系人:王芳
联系电话:0769-22100155
客服电话:0769-961130
传真:0769-22119426
公司网站:www.dgzq.com.cn

(77)名称:上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路555号裕国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:秦臻
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

(78)名称:深圳弘亿基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
法定代表人:薛峰
联系人:李海疆
电话:0755-33227950
传真:0755-82008078
网站:www.szfund.cn及www.jimwm.com
客服电话:4006-788-887

(79)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A1、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:陈敏
联系电话:021-64316642
业务传真:021-54563529
客服热线:021-32109994/029-68918888/401099918
公司网站:www.cfsc.com.cn

(80)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层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层27层及28层
法定代表人:李利国
联系电话:010-65051166
业务传真:010-65051166
公司网站:www.cic.com.cn

(81)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号等大楼国际大厦903-9
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹

客服电话:021-58870011
业务传真:021-68596916
客服热线:4007096665
公司网址:www.chowbay.com
(82)名称:浙江同恒基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区西溪路二一零号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市滨江区浦沿路7号杭州电子商务产业园2号楼
法定代表人:凌波平
联系人:杨爽
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.5fund.com
(83)名称:深圳鹏华基金销售有限公司
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:卓卓晶
联系人:王妮娜
联系电话:0755-33376853
业务传真:0755-33065116
客服热线:4006877899
公司网址:www.tonyuanfund.com
(84)名称:上海时代基金销售有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内光华路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12层
法定代表人:路璐
联系人:侯建强
联系电话:010-65808756
业务传真:010-65807644
客服热线:95162、400888160
公司网址:www.CIFCOFUND.COM
(85)名称:广州财富基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路27号盘古大观A座3201
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座3201
法定代表人:李相智
联系人:高晓芳
联系电话:010-59393923
业务传真:010-59393074
客服热线:400-808-0069
公司网址:www.sxyfunds.com
(86)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:北京市西城区北大街九华世纪企业中心D座三单元
法定代表人:李永怀
联系人:陈征
联系电话:010-88321863
业务传真:010-88321762
客服热线:0871-68898130
公司网址:www.tpyzq.com
(88)名称:上海大智慧基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区杨高南路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C南楼7楼
法定代表人:汪友
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.cn
(89)名称:广州市欧基基金销售有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江新城华夏路2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区长江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈伟青
联系人:张洁
联系电话:021-60897840
业务传真:0571-26690713
客服热线:4000-766-123
公司网址:www.1234567.cn
(90)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:王朔
联系人:吴阿婷
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
(91)名称:北京汇成基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)801室
办公地址:浙江省杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)801室
法定代表人:林彬彬
联系人:刘秀男
联系电话:0571-56028610
业务传真:0571-56099710
客服热线:400-068-0058
公司网址:www.jincheng-fund.com
(92)公司名称:东方证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道155号盛大国际B座12、15层(详细地址)
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)
法定代表人:魏庆华
联系人:汤漫川
联系电话:010-66555316
业务传真:010-66555246
客服热线:4008888993
公司网址:www.dzqj.net.cn
(93)公司名称:北京证赢财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街66号1008-1012
办公地址:北京市丰台区月坛南街6号1008-1012
法定代表人:赵冠春
联系人:魏善
联系电话:010-57418829
业务传真:010-57569671
客服热线:400-678-5095
公司网址:www.mnjj.net
(94)公司名称:上海广财资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区美兰路2819号1幢109室
办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人:惠惠君
联系人:徐彦华
联系电话:021-68685825
业务传真:021-68682927
客服热线:400-021-9898
公司网址:www.jfcta.com
(95)公司名称:深圳前海开源证券投资有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10楼1006G
办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人:孙荣杰
联系人:刘宝文
联系电话:010-58325395
业务传真:010-58325282
客服热线:4008507771
公司网址:dps99.rjy.com
(96)公司名称:大同证券经纪有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人:董祥升
联系人:薛萍
联系电话:0351-4130322
业务传真:0351-4137986
客服热线:4007121212
公司网址:www.vdsbc.com.cn
(97)公司名称:中国中期期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京亚光里17号光大银行1幢1层
办公地址:北京市朝阳区朝花庄西路3号新恒基大厦15层
法定代表人:王兵
联系人:赵磊
联系电话:010-59539864
业务传真:010-59539806
客服热线:95162、400-8888-160
公司网址:www.cifco.net
(98)名称:上海天天基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路20号乐成中心A座23层
法定代表人:赵越
联系人:梁蓉
联系电话:010-57760191
业务传真:010-57761919
客服热线:400-786-8868-5
公司网址:www.fund123.com

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。
本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。投资者可在下列网站查询本基金的申购赎回情况:

一、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三路3号4004-56室
法定代表人:王传武
电话:020-86363533
传真:020-89989120
二、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师(广州)事务所
住所:广东省广州市市桥西区环市东路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真:020-38799335
三、会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安路222号22层外滩中心3楼
法人代表:姚树明
联系人:洪晓明
电话:021-61418888
传真:021-63500503
经办注册会计师:郭新华、洪晓明

第四部分 基金的名称

第五部分 基金的类型

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,
期限匹配,力争实现基金资产的长期稳健增值。

第七部分 基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上
市股票及经中国证监会核准上市交易的股票、债券、货币市场工具、权证、
股指期货和中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的有
关基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类资产,包括但不限于:国债、
央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持
证券、企业债、可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款(包括协议存款和
定期存款等)、货币市场基金及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它固定收
入类金融工具等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资了集合资产管理计
划,本基金管理人将在适当时候增加,以将其纳入基金投资范围。

本基金投资于一级市场资产的价格,可通过可转债转股所得的股票、因可转债转股所派发的现金或因投资可分离债券而产生的权证,也可直接在二级市场上买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

第八部分 投资策略

(一)大类资产配置策略

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。

本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场的运行状况和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的动态收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的变化进行及时调整。

(二)债券投资策略

本基金在债券组合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化和信用风险变化等因素,并结合对固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征,符合本基金相关投资比例规定的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,并在此基础上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资回报。

1.利率预期策略

本基金通过对GDP、CPI、国际收支等国民经济运行指标进行深入的研究,分析宏观经济运行可能情景,并在此基础上判断包括财政政策、货币政策的未来对宏观经济政策取向,对利率和收益率曲线未来可能的变化趋势做出预测和判断,结合债券市场资金供求状况变化,确定固定收益类资产久期策略。

(三)利率预期策略

债券预期利率走势的关键是对未来利率走向的预测。通过对利率的科学预测和对债券投资组合久期的正确调整,可明显提高投资收益。

久期越长,利率变动所引起价格变化越大,久期越短,利率变动所引起价格变化越小。如果预期利率上涨,债券价格上涨,则应该加大中长期债券的投资比例,以实现收益的最小化。相反,如果预期利率下降,债券价格下跌,则应该增加组合中久期较短债券的投资,以尽可能减少利率上涨带来的损失。

(四)收益率曲线配置策略

收益率曲线配置策略是根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变投资组合期限结构。要运用收益率曲线配置策略,必须首先预期收益率曲线变动的方向,然后根据收益率曲线组合期限结构的变化,构造相应的期限结构。

(五)骑乘策略

骑乘策略是一种基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的债券投资管理策略。该策略是指当收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平相对较高的债券,随着持有期限的延长,债券的到期收益率将缩短,此时债券收益率水平会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下降来获得资本利得收益。

2. 类属配置策略

类属配置策略是根据对利率预期,选择、调整债券的适当组合以及获得资产组合的管理。本基金将在利率预期及其久期配置策略确定的基础上,通过债券分析和历史规律相结合的方式,自上而下地在国债、金融债和二级信用债、银行间市场和交易所市场、银行存单、信用债、政府债券等资产类别之间进行资产配置,从而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

3. 信用债投资策略

信用债市场包括国债、金融债和信用债,信用债发行主体自身信用状况、行业景气度和信用债市场的估值水平非常重要。因此,一方面,本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和市场估值水平等因素对信用债市场估值水平进行综合分析,另一方面,本基金还将通过内部信用评级及外部信用评级等多种方式,对信用债的信用风险和评级调整,研究债券发行主体企业的基本面,以决定主客观的实际情况和信用。具体而言,本基金的信用债投资主要基于信用债债券违约率、信用等级、持有期限、信用评级和信用债债券违约率四个因素。本基金信用债投资遵循以下流程:

(1)信用债债券违约率

本基金将通过着重于经济走势、资金利率、信用债供求等影响信用债市场违约的因素来对未来一段期间内信用债市场不同品种、不同信用等级债券的违约率变化情况进行预测。

(2)信用利差分析

在信用债债券违约率的基础上,本基金将进一步分析和判断信用债未来可能发生的变化及其基本原因,是历史利率经验数据所致,还是上述影响因素产生,并对当前状况与历史情况进行对比,分析信用利差的趋势以及合理位置,最终分析结果用于利率差变动,则积极主动进行资产调整,动态调整投资组合。

4. 持有期收益策略

持有期收益策略是指根据信用利差和基准利率的预测,假设组合可能发生的情景并赋予不同情景不同的收益率曲线组合和收益率变化,得出在不同情景下各信用债的持有期收益,根据预期结果选择最优的组合配置方案,为投资决策提供依据。

(三)信用债配置策略

本基金借助公司内部的专业研究能力,并综合参考外部权威、专业研究机构的研究成果,采用定量分析与定性分析相结合的方法对发债主体企业基本面进行的基本分析,并结合债券的发行条款、信用评级和实际的信用状况及信用质量,提前提示风险,风险外溢收益和流动性特征等,对信用债投资的因素进行评价,并编制采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型评价信用债资产的投资价值并做出相应的投资决策。

(二)股票投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下,本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资,以增加基金收益。

1. 新股申购策略

本产品主要参与上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面因素参与标的,参与规模和退出时机,并结合申购中签率、中签率、中签率估值水平等因素,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高的申购收益。

2. 二级市场股票投资策略

本基金通过CARP 投资选择具备良好、流动性好、低风险、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常性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。

CARP 投资注重股票投资与成长能力的平衡,一方面利用价值投资标准筛选低价股票,避免市场波动时投资风险投资价格高企的风险,另一方面利用价值投资分享高成长收益的机会。

(四)权证投资策略

权证作为本基金辅助性投资工具,本基金将以主动投资权证,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,充分发挥权证与标的证券之间可能的套期保值、实现基金增值的作用。在权证投资中,本基金将对权证的投资价值的基本面进行分析,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,对权证进行投资。

5. 投资决策依据和投资程序

(一)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。

(二)投资决策程序

1. 投资决策委员会制定整体投资策略。

2. 固定收益部研究员根据自身或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,为投资决策委员会提供决策依据。

3. 固定收益部基金经理根据投资决策委员会的投资战略,结合研究员的研究报告,拟订所管理基金的投资计划,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部基金经理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,固定收益部基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易部执行。

6. 中央交易部按执行交易规则执行,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评估报告和改进方案。

8. 中债总收益指数收益率、中债总收益指数是中央国债登记结算公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的债券市场指数,该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债,能够较好地反映债券市场的整体收益情况。

第十部分 风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

第十一部分 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。

本报告中基金投资组合数据截至2014年7月31日。

本报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,789,393.68	8.58
	其中:股票	69,789,393.68	8.58
2	固定收益投资	665,085,066.28	81.78
	其中:债券投资	665,085,066.28	81.78
3	货币资金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	15,000,000.00	1.84
	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	12,101,634.24	1.49
7	其他各项资产	51,297,976.84	6.31
8	合计	813,254,071.04	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	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	42,488,728.68	11.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,248,000.00	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	6,975,225.00	1.86
J	金融业	17,047,400.00	4.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商业服务业	30,040.00	0.01
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	-	-
S	合计	69,789,393.68	18.59

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	60705	中航证券	1,154,000	17,047,400.00	4.54
2	60893	航发动力	675,051	10,068,082.84	2.75
3	300280	中航光电	859,894	14,628,289.84	3.83
4	60499	科达股份	380,000	7,592,400.00	2.02
5	002230	科大讯飞	155,055	6,975,225.00	1.86
6	60085	海天瑞声	298,200	4,228,476.00	1.13
7	600783	南京港	320,000	3,248,000.00	0.86
8	600703	三安光电	78,000	1,774,500.00	0.47
9	002202	金风科技	150,000	1,408,500.00	0.38
10	000416	渤海能源	150,000	1,291,500.00	0.34

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	国债	30,079,040.	

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	120261	13国债03	1,513,740	150,117,595.80	20.98																																								
2	130044	13国债01	1,300,000	123,799,000.00	32.97																																								
3	130231	13国债31	1,000,000	99,490,000.00	23.83																																								
4	130318	13国债18	500,000	46,865,000.00	12.48																																								
5	122267	13华泰债	463,810	43,598,140.00	11.61																																								
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贵金属投资明细																																													
本基金本报告期末未持有贵金属。																																													
8、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。																																													
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合约。																																													
(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。																																													
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合约。																																													
(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。																																													
11、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)其他资产构成																																													
序号	项目	名称	金额(元)																																										
1	存出保证金			203,599.92																																									
2	应收证券清算款			31,999,992.30																																									
3	应收股利			-																																									
4	应收利息			18,976,238.20																																									
5	应收申购款			8,146.42																																									
6	其他应收款			-																																									
7	待摊费用			-																																									
8	其他			-																																									
9	合计			51,277,976.84																																									
14、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	113003	重工转债	5,023,680.00	1.34																																									
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	600705	中航投资	10,192,000.00	2.71	非公开发行受限																																								
2	600708	海博股份	3,248,000.00	0.86	重大事项																																								
第十二部分 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,投资人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2014年3月31日。 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 广发聚鑫债券A: <table border="1"> <thead> <tr> <th>阶段</th> <th>份额净值增值率①</th> <th>业绩比较基准收益率②</th> <th>①-③</th> <th>②-④</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2013.6.5~2013.12.31</td> <td>-4.80%</td> <td>0.32%</td> <td>-6.34%</td> <td>0.13%</td> <td>1.54%</td> <td>0.19%</td> </tr> <tr> <td>自基金合同生效至今</td> <td>-2.90%</td> <td>0.38%</td> <td>-4.84%</td> <td>0.13%</td> <td>1.94%</td> <td>0.25%</td> </tr> </tbody> </table> 广发聚鑫债券C: <table border="1"> <thead> <tr> <th>阶段</th> <th>份额净值增值率①</th> <th>业绩比较基准收益率②</th> <th>业绩比较基准收益率③</th> <th>①-③</th> <th>②-④</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2013.6.5~2013.12.31</td> <td>-5.10%</td> <td>0.32%</td> <td>-6.34%</td> <td>0.13%</td> <td>1.24%</td> <td>0.19%</td> </tr> <tr> <td>自基金合同生效至今</td> <td>-3.2%</td> <td>0.38%</td> <td>-4.64%</td> <td>0.13%</td> <td>1.64%</td> <td>0.25%</td> </tr> </tbody> </table> ②、自基金合同生效以来以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 广发聚鑫债券型证券投资基金 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2013年6月5日至2014年3月31日) (1) 广发聚鑫债券A类 (2) 广发聚鑫债券C类 注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同约定规定。							阶段	份额净值增值率①	业绩比较基准收益率②	①-③	②-④	2013.6.5~2013.12.31	-4.80%	0.32%	-6.34%	0.13%	1.54%	0.19%	自基金合同生效至今	-2.90%	0.38%	-4.84%	0.13%	1.94%	0.25%	阶段	份额净值增值率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④	2013.6.5~2013.12.31	-5.10%	0.32%	-6.34%	0.13%	1.24%	0.19%	自基金合同生效至今	-3.2%	0.38%	-4.64%	0.13%	1.64%	0.25%
阶段	份额净值增值率①	业绩比较基准收益率②	①-③	②-④																																									
2013.6.5~2013.12.31	-4.80%	0.32%	-6.34%	0.13%	1.54%	0.19%																																							
自基金合同生效至今	-2.90%	0.38%	-4.84%	0.13%	1.94%	0.25%																																							
阶段	份额净值增值率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④																																								
2013.6.5~2013.12.31	-5.10%	0.32%	-6.34%	0.13%	1.24%	0.19%																																							
自基金合同生效至今	-3.2%	0.38%	-4.64%	0.13%	1.64%	0.25%																																							
第十三部分 基金费用																																													
一、基金费用的种类																																													
1.基金基金管理人的管理费;																																													