广发聚瑞混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:二〇一五年十月二十六日

§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10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚瑞混合
基金主代码	270021
交易代码	270021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月16日
报告期末基金份额总额	668,647,937.47份
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。
投资策略	1.资产配置策略 本基金为混合型基金,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。 2. 主题投资分析框架"策略 在股票投资方面,本基金主要采用自上而下的 "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。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-123,728,220.32
2.本期利润	-518,294,272.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.7574
4.期末基金资产净值	1,179,839,485.29
5.期末基金份额净值	1.765

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	-28.34%	3.85%	-22.20%	2.67%	-6.14%	1.18%

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

广发聚瑞混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年6月16日至2015年9月30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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王颂	本基金的基金经理;权益投资二部总经理	2014-12-24	-	17年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,1998年3月至2012年4月先后任平安证券投资管理部投资经理、平安资产基金投资部总经理,2012年5月起加入广发基金管理有限公司,2012年6月至2014年1月任机构投资部总经理,2014年1月21日起任权益投资二部总经理,2014年12月24日起任广发聚瑞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、《广发聚瑞混合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

市场回顾

2015年三季度内,股票市场呈现下跌趋势,6月到8月间经历了两次较大幅度的调整。其后,政府采取了积极措施,在8月中旬后市场基本平稳震荡。8月中下旬市场又一次快速下探。9月市场在经历了前期出清的震荡后,指数缓步上行,而个股涨幅较大,部分个股9月份涨幅超过50%。

操作回顾

本季度面临的最大压力来自于3个方面。1、上半年股票市场泡沫破裂带来的估值急速回归的压力。2、经济层面上,加速去产能带来的经济增速加速下滑的压力。3、人民币811贬值后,带来的资金外流的压力。由于这三方面的压力在本季度集中体现,因此,市场表现为快速大幅下滑。为应对这些压力,组合应对策略为:(1)、在资产配置层面上采取了降低权益头寸(从上半年的95%以上的头寸到本季度的75%左右的头寸)。广发聚瑞资产配置范围60%以上,我们考虑到季度本市场面临的各种问题巨大,但由于市场快速大幅下滑,而且在7月市场快速下滑阶段基本上并没有降低头寸的机会,因此,我们在降低了组合的风险头寸到75%左右后,基本上维持在这一位置。(2)、在行业结构上,我们大幅降低牛市中由于市场预期非常乐观,而使估值处于高位的成长型公司的头寸,同时,对于稳定类的公司加大了配置。另外,我们考虑到,由于政府在应对经济加速下滑时,将采取宽松的货币政策以及较为积极的财政政策,同时,中国发展到今天,大力发展军工业已是国家战略的必然选择。因此,我们对这些未来需求仍将保持较高和较稳定的行业公司,也加大了配置力度。除了以上2个方面的组合结构考虑以外,由于国企改革是对上市公司基本面带来的根本性变化,我们从中选择那些具有长期竞争优势,该给使其基本面发生了根本性变化的公司进行投资。

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-28.34%,同期业绩比较基准收益率为-22.20%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下季度,市场泡沫破裂带来的急速估值回归压力应该已经消除,但是经济加速下滑以及全球竞争加剧带来的压力仍然存在,特别是资本外流带来的压力可能将在较长时间一直保持,因此,从整体层面来说,市场虽然度过了急速下跌的阶段,但仍将面临较大压力。为此,我们保持较谨慎的态度。同时,考虑到政府对冲经济下滑的刺激政策,以及中国作为一个大国的必然战略选择,我们认为这条资产配置思路仍将可以维持。同时,在经济下滑过程中,稳定性行业公司由于其固有的特性,以及本身的估值优势仍将具有较好的吸引力。因此,下季度,我们仍将沿着整体上控制权益头寸的大类资产配置策略,结构上,倾向于稳定性资产。同时,以及始终坚持的估值优势下的稳定增长的公司投资策略进行公司选择。

§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	895,332,486.94	74.81
	其中:股票	895,332,486.94	74.81
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	298,083,711.57	24.91
7	其他各项资产	3,441,101.50	0.29
8	合计	1,196,857,300.01	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	84,037,305.24	7.12
C	制造业	679,524,318.61	57.59
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	25,061,060.88	2.12
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	70,199,183.60	5.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,980,618.61	0.76
L	租赁和商务服务业	6,830,000.00	0.58
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	20,700,000.00	1.75
S	综合	-	-
	合计	895,332,486.94	75.89

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	000697	炼石有色	4,700,073	84,037,305.24	7.12
2	000917	电广传媒	2,599,884	50,177,761.20	4.25
3	600703	三安光电	2,499,807	49,321,192.11	4.18
4	600391	成发科技	1,235,320	44,607,405.20	3.78
5	600765	中航重机	2,799,838	44,349,433.92	3.76
6	601989	中国重工	3,984,778	39,887,627.78	3.38
7	600893	中航动力	957,415	39,119,976.90	3.32
8	000901	航天科技	999,950	39,118,044.00	3.32
9	300285	国瓷材料	1,099,844	34,095,164.00	2.89
10	600416	湘电股份	2,299,945	30,428,272.35	2.58

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	1,986,401.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	59,944.98
5	应收申购款	1,394,754.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,441,101.50

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	000917	电广传媒	50,177,761.20	4.25	重大事项
2	000901	航天科技	39,118,044.00	3.32	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	753,001,403.70
本报告期基金总申购份额	161,637,663.05
减:本报告期基金总赎回份额	245,991,129.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	668,647,937.47

§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	17,922,689.74
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	17,922,689.74
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.68

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影响投资者决策的其他重要信息

按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》的最新规定,股票基金的股票资产投资比例下限由60%上调至80%。上述调整使广发基金管理有限公司管理的十只股票基金,包括广发聚丰股票型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金和广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF),不再符合股票基金的相关定义。经与该十只基金的基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,广发基金管理有限公司将该十只基金变更为混合型证券投资基金,基金合同中的相关条款亦做相应修订。

详情可见本基金管理人于2015年8月7日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司官方网站发布的《广发基金管理有限公司关于旗下十只基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚瑞混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚瑞混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发聚瑞混合型证券投资基金托管协议》;

5.《广发聚瑞混合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。

9.2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

9.3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
二〇一五年十月二十六日

广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:二〇一五年十月二十六日

§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10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚祥灵活配置
基金主代码	000567
交易代码	000567
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月21日
报告期末基金份额总额	355,875,455.67份
投资目标	通过对权益类资产及固定收益类资产的合理配置和积极管理,谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金根据宏观及市场分析结果,并综合考虑基金投资目标、风险控制要求等因素,确定本基金各类资产的比例。 2、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。 3、债券投资策略 本基金将采取主动投资的策略,通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现价值低估的品种,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,力争为投资者获得稳定的收益。 4、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。
业绩比较基准	55%×沪深300指数+45%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-127,612,685.80
2.本期利润	-121,646,495.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4241
4.期末基金资产净值	526,395,077.84
5.期末基金份额净值	1.479

注:(1)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。

(2)上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。

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

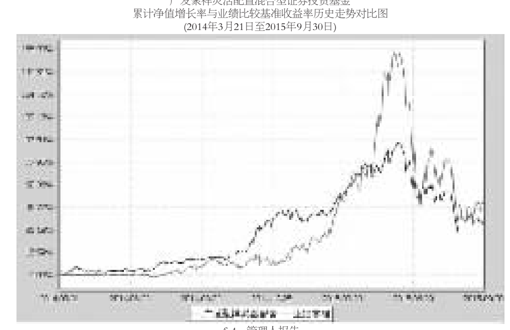
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-22.16%	3.42%	-14.46%	1.84%	-7.70%	1.58%

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

广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年3月21日至2015年9月30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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易阳方	本基金的基金经理;广发聚丰混合基金的基金经理;公司副总经理、投资总监	2014-03-21	-	18年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,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日起任广发聚丰混合基金的基金经理,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混合基金的基金经理,2014年3月21日起任广发聚祥灵活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、《广发聚祥灵活配置混合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

6月中下旬以来,监管层意识到在不断加大的杠杆推动了市场泡沫的膨胀,开始严厉收缩杠杆,釜底抽薪,市场快速去杠杆,引发市场恐慌,产生了流动性危机。股指断崖式下跌,在短短两个月内,上证综合指数从5200点跌至2850点,创业板指数下跌幅度超过了50%。

本季度前两个月,本基金和所有基金一样,为尽可能回避系统性风险,同时也为了防范流动性风险,大幅降低仓位,最低降到了五成仓位附近。九月份,市场逐步走稳,仓位才逐步回升到七成以上。本季度,本基金持仓结构也进行了大幅调整,减持、清仓了一批估值过高的股票,逐步增加了一些行业成长好、估值合理的公司的配置,主要集中在传媒、计算机软件、化肥、医药服务等领域。也参与了军工、国企改革等主题性机会。

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-22.16%,同期业绩比较基准收益率为-14.46%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面,全球经济依然乏善可陈,以中国为首的新兴国家经济减速明显。美国经济恢复相对较好,但也存在反复。四季度全球还面临美国加息可能,加息会对新兴市场带来较大冲击。国内方面,政策不断托底,流动性宽松溢出效应明显,给证券市场企稳带来曙光。在证券市场方面,6月底7月初的流动性危机已经解除;投资者的信心也适度修复;经过前期大幅调整,市场整体估值已近合理,许多股票具备了很好的投资价值。预计未来一个季度,市场呈现震荡格局,存在一些结构性的机会,个股分化加剧。代表经济转型的发展方向如计算机、医疗、环保、传媒、互联网等行业的投资机会相对会大一些。

§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	364,931,107.60	68.83
	其中:股票	364,931,107.60	68.83
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	148,441,856.41	28.00
7	其他各项资产	16,854,269.66	3.18
8	合计	530,227,233.67	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	2,179,800.00	0.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	177,245,880.75	33.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,710,838.40	1.65
E	建筑业	15,297,000.00	2.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,064,000.00	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	145,447,088.45	27.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,986,500.00	1.52
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	综合	-	-
	合计	364,931,107.60	69.33

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	300238	冠昊生物	900,000	33,120,000.00	6.29
2	300043	互动娱乐	2,050,000	28,679,500.00	5.45
3	300339	润和软件	800,000	24,520,000.00	4.66
4	002354	天神娱乐	300,000	22,515,000.00	4.28
5	300297	蓝盾股份	930,920	22,202,442.00	4.22
6	600271	航天信息	350,000	18,791,500.00	3.57
7	300271	华宇软件	450,000	15,862,500.00	3.01
8	000902	新洋丰	700,000	15,575,000.00	2.96
9	300146	汤臣倍健	570,000	15,447,000.00	2.93
10	002550	千红制药	1,100,000	14,465,000.00	2.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	486,691.73
2	应收证券清算款	14,826,048.06
3	应收股利	-
4	应收利息	26,770.87
5	应收申购款	1,514,759.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,854,269.66

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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	259,534,630.82
本报告期基金总申购份额	247,357,848.72
减:本报告期基金总赎回份额	151,017,023.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	355,875,455.67

§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	-
本报告期买入/申购总份额	16,267,568.66
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	16,267,568.66
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.57

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	2015-07-30	16,267,568.66	27,980,218.09	-
合计			16,267,568.66	27,980,218.09	

§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祥灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2. 《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4. 《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

5. 《关于广发基金管理有限公司申请修改广发聚祥保本混合型证券投资基金名称及基金合同的法律意见》

6. 基金管理人业务资格批件、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
二〇一五年十月二十六日

广发聚鑫债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚鑫债券	
基金主代码	000118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月5日	
报告期末基金份额总额	563,516,847.92份	
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,追求较高的当期收益和长期回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
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,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。 (二)债券投资策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种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,在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,并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资收益。 (三)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。 (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。	
业绩比较基准	中债总全价指数收益率	
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。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发聚鑫债券A	广发聚鑫债券C
下属分级基金的交易代码	000118	000119
报告期末下属分级基金的份额总额	391,409,142.73份	172,107,705.19份

§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7月1日-2015年9月30日)	
	广发聚鑫债券A	广发聚鑫债券C
1.本期已实现收益	-13,223,813.07	-5,809,479.10
2.本期利润	-26,705,083.10	-15,041,855.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0756	-0.0931
4.期末基金资产净值	504,018,027.61	220,790,308.93
5.期末基金份额净值	1.288	1.283

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

1、广发聚鑫债券A:

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	-4.30%	1.14%	1.31%	0.08%	-5.61%	1.06%

2、广发聚鑫债券C:

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	-4.25%	1.14%	1.31%	0.08%	-5.56%	1.06%

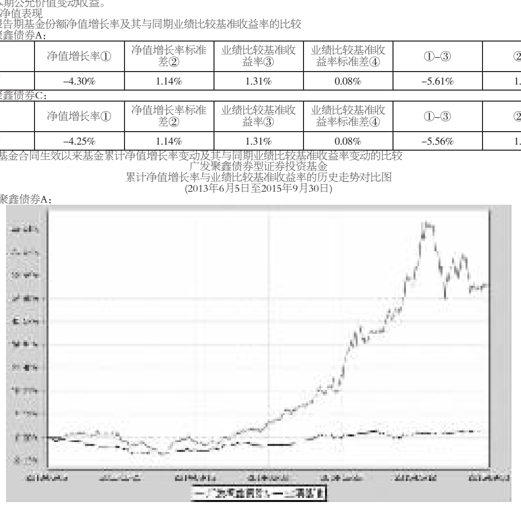
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发聚鑫债券型证券投资基金

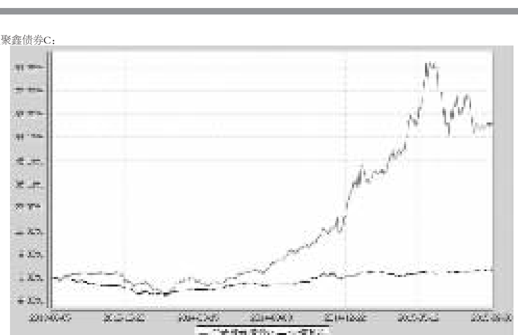
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年6月5日至2015年9月30日)

1. 广发聚鑫债券A:



2. 广发聚鑫债券C:



§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
代宇	本基金的基金经理;广发聚利债券基金的基金经理;广发聚财信用债券基金的基金经理;广发集利一年定期开放债券基金的基金经理;广发成长优选混合基金的基金经理;广发聚惠混合基金的基金经理;广发安泰回报混合基金的基金经理;广发安心回报混合基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理	2013-06-05	2015-07-24	10年	女,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书,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日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,2013年6月5日至2015年7月23日任广发聚鑫债券基金的基金经理,2013年8月21日起任广发集利一年定期开放债券基金的基金经理,2015年2月17日起任广发成长优选混合基金的基金经理,2015年4月15日起任广发聚惠混合基金的基金经理,2015年5月14日起任广发安泰回报混合基金和广发安心回报混合基金的基金经理,2015年5月27日起任广发双债添利债券基金的基金经理。
张芊	本基金的基金经理;广发纯债基金的基金经理;固定收益部总经理	2013-07-12	-	14年	女,中国籍,金融学硕士、MBA,持有基金业执业资格证书,2001年6月至2012年2月曾在中国银河证券研究中心、中国人保资产管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司从事固定收益类投研工作,2012年2月起任广发基金管理有限公司固定收益部总经理,2012年12月14日起任广发纯债债券基金的基金经理,2013年7月12日起任广发聚鑫债券基金的基金经理。

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、《广发聚鑫债券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

三季度,债市整体表现平稳,短端收益率与二季度相比有所上行;中长端收益率方面7、8两月持续下探,9月企稳震荡,整体收益率表现为 "7、8月下行,9月震荡" 的局面。

利率债方面,"三季度魔咒" 再次被打破,7、8两月收益率震荡下行,9月呈现震荡行情。7月份利率债表现为震荡下行走势,经济基本面虽有趋稳向好的迹象,但7月中采PMI数据的回落仍带来复苏的不确定性,同时通胀回升预期升温或制约宽松政策的施展空间,资本市场风险偏好的下降带来理财和打新资金的回流仍是利好债市的主要因素,债市延续震荡行情。8月份,债市配置力量悄然转向利率债,金融债与国债中长端收益率震荡下行。全月,虽然汇率、专项债、地方债等负面因素冲击不断,但经济数据显示复苏动力依然不足,央行中下旬持续放量宽松的举措推动债市走出大涨行情,收益率重回下行轨道。9月份,债市虽然整体处于窄幅震荡行情,但月末利率债中长端收益率出现大幅下行走势。经济基本面每况愈下,机构在较低的绝对收益背景之下,虽然处于纠结与矛盾之中,但迫于配置压力,仍进行有防御性质的买券操作。

中票、企业债成交集中在中高评级券种,7月和8月份,在配置盘情绪带动下,收益率持续下行;进入9月份,收益率呈现窄幅震荡,略有下行的局面。城投债方面,7、8月份收益率同样持续下探,机构一方面积极配置AAA短端可质押品种,另一方面追求中低评级高收益券种。AA评级4-7年期城投受到券商、券商资管等关注,资质较好的地级市城投已寻觅无踪,县级市、经开区和高新区等大部分成交区间已经下移至5.00%-5.50%附近。9月份,城投债整体表现相对平稳,成交量有所缩减,收益率同样小幅下行。

基于宏观经济下行环境中货币政策仍保持宽松的判断,本基金维持较高的久期,重点增持利率债和高资质信用债。信用风险不断积累,基金重点减持中低评级品种。权益和转债方面,保持较低的转债仓位,增加了重点行业和品种持仓。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发聚鑫A类的净值增长率为-4.3%,广发聚鑫C类的净值增长率为-4.25%,同期业绩比较基准收益率为1.31%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期宏观经济加速下滑,稳增长的任务很重,货币政策仍处于宽松期。市场利率波动相对平稳。利率和高评级品种,风险收益均衡。未来宏观基本面将引导市场。基于债券市场长期向好的判断,本基金将维持一定的杠杆和久期,同时精选品种提高持仓收益。权益类在控制风险的前提下优选品种,加大波段操作力度。

§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	141,678,318.64	11.45
	其中:股票	141,678,318.64	11.45
2	固定收益投资	1,061,820,296.84	85.83
	其中:债券	1,061,820,296.84	85.83
	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	11,575,096.04	0.94
7	其他各项资产	22,046,609.38	1.78
8	合计	1,237,120,320.90	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	62,594,378.45	8.64
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,604,636.44	10.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	3,479,303.75	0.48
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	141,678,318.64	19.55

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	600406	国电南瑞	3,546,276	50,321,656.44	6.94
2	600893	中航动力	897,834	36,685,497.24	5.06
3	002268	卫士通	223,000	10,721,840.00	1.48
4	002121	科陆电子	639,000	10,434,870.00	1.44
5	600271	航天信息	186,209	9,997,561.21	1.38
6	002439	启明星辰	393,800	9,963,140.00	1.37
7	600312	平高电气	365,000	4,843,550.00	0.67
8	600037	歌华有线	200,000	3,592,000.00	0.50
9	600763	通策医疗	47,177	3,479,303.75	0.48
10	002405	四维图新	40,000	1,006,000.00	0.14

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	81,185,000.00	11.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,892,000.00	13.92
	其中:政策性金融债	100,892,000.00	13.92
4	企业债券	745,995,892.84	102.92
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	132,369,000.00	18.26
7	可转债	1,378,404.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,061,820,296.84	146.50

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	122266	13中信03	844,950	86,201,799.00	11.89
2	101456077	14德泰MTN001	600,000	62,820,000.00	8.67
3	1480152	14济城投债	500,000	54,340,000.00	7.50
4	124805	14穗铁02	500,000	53,850,000.00	7.43
5	101461005	14长沙轨交MTN001	500,000	53,655,000.00	7.40

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本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	52,871.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,423,403.04
5	应收申购款	2,570,334.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,046,609.38

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	002121	科陆电子	10,434,870.00	1.44	重大事项
2	600312	平高电气	4,843,550.00	0.67	重大事项
3	600763	通策医疗	3,479,303.75	0.48	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发聚鑫债券A	广发聚鑫债券C
本报告期期初基金份额总额	219,879,892.28	161,238,334.74
本报告期基金总申购份额	235,112,871.58	112,119,763.25
减:本报告期基金总赎回份额	63,583,621.13	101,250,392.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	391,409,142.73	172,107,705.19

§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鑫债券型证券投资基金募集的文件

2.《广发聚鑫债券型证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发聚鑫债券型证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、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
二〇一五年十月二十六日