

### 广发聚利债券型证券投资基金

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  
报告送出日期：二〇一四年七月十八日

1.1 重要提示  
基金管理人及基金托管人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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年7月16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、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人保证以诚实信用、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者收益不受损失。  
基金的投资有风险，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。  
本报告中所列财务数据未经审计。  
本报告日期为2014年4月1日起至6月30日止。

1.2 基金基本情况  
基金简称：广发聚利债券  
基金代码：162712  
交易代码：162712  
基金运作方式：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)。  
基金合同生效日：2011年8月5日  
报告期末基金份额总额：335,745,621.79份  
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，力争为基金份额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。  
投资策略：通过自上而下的宏观研究指导资产配置，在主动研判利率变动趋势的基础上进行利率品种投资，在深入评估信用债投资风险状况的前提下进行信用债投资，在深入挖掘可转债投资价值的过程中参与可转债投资，并通过新股申购、股票增发和定向增发股票类投资提高基金资产的收益水平。  
业绩比较基准：中证全债指数收益率。  
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。  
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

3.1 主要财务指标  
3.2 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
3.3 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 广发聚利债券型证券投资基金 2014 第二季度报告

2.1 基金投资组合报告  
2.2 本报告期末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  
2.3 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细  
2.4 本报告期末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  
2.5 本报告期末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  
2.6 本报告期末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  
2.7 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产投资明细

3.1 主要财务指标  
3.2 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
3.3 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 广发聚瑞股票型证券投资基金

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  
报告送出日期：二〇一四年七月十八日

1.1 重要提示  
基金管理人及基金托管人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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年7月16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、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人保证以诚实信用、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者收益不受损失。  
基金的投资有风险，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。  
本报告中所列财务数据未经审计。  
本报告日期为2014年4月1日起至6月30日止。

1.2 基金基本情况  
基金简称：广发聚瑞股票  
基金代码：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7月16日  
报告期末基金份额总额：2,785,270,051.195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：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%，债券、货币、权证以及中国证监会允许基金投资的其它品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有的现金或者投资于债券资产净值占基金资产净值的5%。  
业绩比较基准：中证全指指数收益率。  
风险收益特征：本基金属于股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和债券型基金，为证券投资基金中的较高风险品种。  
基金管理人：广发基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标  
3.2 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
3.3 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 广发聚瑞股票型证券投资基金 2014 第二季度报告

2.1 基金投资组合报告  
2.2 本报告期末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  
2.3 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细  
2.4 本报告期末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  
2.5 本报告期末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  
2.6 本报告期末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  
2.7 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产投资明细

3.1 主要财务指标  
3.2 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
3.3 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金

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  
报告送出日期：二〇一四年七月十八日

1.1 重要提示  
基金管理人及基金托管人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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年7月16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、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人保证以诚实信用、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者收益不受损失。  
基金的投资有风险，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。  
本报告中所列财务数据未经审计。  
本报告日期为2014年4月1日起至6月30日止。

1.2 基金基本情况  
基金简称：广发聚祥灵活配置  
基金代码：090027  
交易代码：090027  
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：608,252,712.21份  
投资目标：通过积极配置股票及固定收益类资产的合理配置和积极管理，追求基金资产的稳健增值。  
投资策略：1.资产配置策略：本基金为灵活配置型基金，本基金资产配置比例范围为：股票资产占基金资产的0%-95%，债券、货币、权证以及中国证监会允许基金投资的其它品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有的现金或者投资于债券资产净值占基金资产净值的5%。  
业绩比较基准：沪深300指数收益率+45%\*中证全债指数收益率。  
风险收益特征：本基金为灵活配置型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，债券型基金，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：中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标  
3.2 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
3.3 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金 2014 第二季度报告

2.1 基金投资组合报告  
2.2 本报告期末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  
2.3 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细  
2.4 本报告期末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  
2.5 本报告期末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  
2.6 本报告期末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  
2.7 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产投资明细

3.1 主要财务指标  
3.2 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
3.3 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

6.8 报告期末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。  
6.9 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) 本基金本报告期末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；  
(2) 本基金本报告期末未进行国债期货交易。  
11.1 投资组合报告附注  
6.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体在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、处罚的情况。  
6.11.2 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,098.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,567,873.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.17
8	其他	-
9	合计	17,618,218.62

6.11.3 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。  
6.11.4 报告期末本基金持有的公允价值大于成本的交易资产明细  
本基金本报告期末未持有公允价值大于成本的交易资产。  
6.11.5 报告期末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。  
6.11.6 报告期末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。  
6.11.7 报告期末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。  
6.11.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产投资明细  
本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

5.6 开放式基金份额变动

项目	金额(元)
本报告期初基金份额总额	335,745,621.79
本报告期间基金总申购份额	-
减:本报告期间基金总赎回份额	-
本报告期间基金净申购/赎回份额	-
本报告期末基金份额总额	335,745,621.79

5.7 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(1)申购、赎回或买卖本基金的情况。  
5.8 备查文件目录  
2.《中国证监会批准广发聚利债券型证券投资基金募集的文件》；  
2.1《广发聚利债券型证券投资基金基金合同》；  
2.2《广发聚利债券型证券投资基金托管协议》；  
2.3《广发聚利债券型证券投资基金招募说明书》及其更新；  
2.4《广发聚利债券型证券投资基金法律意见书》；  
2.5《广发聚利债券型证券投资基金备案公告》；  
2.6《广发聚利债券型证券投资基金成立公告》。  
2.7 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32楼3201-3202室  
2.8 报告编制日期  
2014年7月18日  
2.9 报告披露日期  
2014年7月18日  
2.10 报告披露方式  
投资者对本报告有任何疑问，可向本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话：020-66223000或020-66223009，或发送邮件至：service@gf-fund.com.cn。  
广发基金管理有限公司  
二〇一四年七月十八日

6.8 报告期末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。  
6.9 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) 本基金本报告期末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；  
(2) 本基金本报告期末未进行国债期货交易。  
11.1 投资组合报告附注  
6.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体在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、处罚的情况。  
6.11.2 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,011,320.83
2	应收证券清算款	295,362.45
3	应收股利	-
4	应收利息	55,763.55
5	应收申购款	7,366,385.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,728,833.78

6.11.3 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。  
6.11.4 报告期末本基金持有的公允价值大于成本的交易资产明细  
本基金本报告期末未持有公允价值大于成本的交易资产。  
6.11.5 报告期末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。  
6.11.6 报告期末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。  
6.11.7 报告期末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。  
6.11.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产投资明细  
本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

5.6 开放式基金份额变动

项目	金额(元)
本报告期初基金份额总额	2,659,197,435.67
本报告期间基金总申购份额	486,643,093.33
减:本报告期间基金总赎回份额	364,570,477.81
本报告期间基金净申购/赎回份额	122,062,615.52
本报告期末基金份额总额	2,785,270,051.19

5.7 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  
7.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

6.1 备查文件目录  
2.《中国证监会批准广发聚瑞股票型证券投资基金募集的文件》；  
2.1《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》；  
2.2《广发聚瑞股票型证券投资基金托管协议》；  
2.3《广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书》及其更新；  
2.4《广发聚瑞股票型证券投资基金法律意见书》；  
2.5《广发聚瑞股票型证券投资基金备案公告》；  
2.6《广发聚瑞股票型证券投资基金成立公告》。  
2.7 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32楼3201-3202室  
2.8 报告编制日期  
2014年7月18日  
2.9 报告披露日期  
2014年7月18日  
2.10 报告披露方式  
投资者对本报告有任何疑问，可向本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话：020-66223000或020-66223009，或发送邮件至：service@gf-fund.com.cn。  
广发基金管理有限公司  
二〇一四年七月十八日

6.8 报告期末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。  
6.9 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) 本基金本报告期末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；  
(2) 本基金本报告期末未进行国债期货交易。  
11.1 投资组合报告附注  
6.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体在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、处罚的情况。  
6.11.2 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	33,086.80
2	应收证券清算款	14,370,326.03
3	应收股利	-
4	应收利息	48,725.21
5	应收申购款	42,351.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,494,489.76

6.11.3 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。  
6.11.4 报告期末本基金持有的公允价值大于成本的交易资产明细  
本基金本报告期末未持有公允价值大于成本的交易资产。  
6.11.5 报告期末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。  
6.11.6 报告期末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。  
6.11.7 报告期末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。  
6.11.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产投资明细  
本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

5.6 开放式基金份额变动

项目	金额(元)
本报告期初基金份额总额	428,841,582.21
本报告期间基金总申购份额	310,375,954.71
减:本报告期间基金总赎回份额	140,973,112.53
本报告期间基金净申购/赎回份额	9,822,287.82
本报告期末基金份额总额	608,252,712.21

5.7 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  
7.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

6.1 备查文件目录  
2.《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》；  
2.1《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；  
2.2《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；  
2.3《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；  
2.4《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金法律意见书》；  
2.5《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金备案公告》；  
2.6《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金成立公告》。  
2.7 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32楼3201-3202室  
2.8 报告编制日期  
2014年7月18日  
2.9 报告披露日期  
2014年7月18日  
2.10 报告披露方式  
投资者对本报告有任何疑问，可向本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话：020-66223000或020-66223009，或发送邮件至：service@gf-fund.com.cn。  
广发基金管理有限公司  
二〇一四年七月十八日