（上接B134版）

单位:人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,261,337.88
银行间市场应付交易费用	–
合计	1,261,337.88

8.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	–
应付赎回费	3,440.05
预提费用	449,000.00
合计	452,440.05

8.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	502,676,901.92	502,676,901.92
本期申购	339,199,427.97	321,661,663.31
本期赎回(以"-"号填列)	-591,621,117.13	-579,818,628.03
本期末	250,255,212.76	244,519,937.20

注:1、原广发聚祥保本混合型证券投资基金于2014年3月20日的基金资产份额为人民币502,676,901.92元,已于2014年3月21日本基金转型后基金合同生效日全部转为本基金的基金资产份额。

2、本期申购含转换转入份(金)额,本期赎回含转换转出份(金)额。

8.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	10,397,639.63	583,169.77	10,980,809.40
本期利润	38,036,320.49	7,136,791.52	45,173,112.01
本期基金份额交易产生的变动数	-14,179,995.73	-17,637,350.12	-31,817,345.85
其中:基金申购款	8,068,627.55	224,367.63	8,292,995.18
基金赎回款	-22,248,623.28	-17,861,717.75	-40,110,341.03
本期已分配利润	–	–	–
本期末	34,253,964.39	-9,917,388.83	24,336,575.56

8.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
活期存款利息收入	469,588.67
定期存款利息收入	–
其他存款利息收入	2,474.51
结算备付金利息收入	138,360.57
其他	2,427.81
合计	612,851.56

8.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	1,153,333,000.61
减:卖出股票成本总额	1,121,294,983.45
买卖股票差价收入	32,038,017.16

8.4.7.13债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	415,311,697.26
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	398,385,557.73
减:应收利息总额	7,290,951.75
买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	9,635,187.78

8.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

8.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	776,082.62
基金投资产生的股利收益	–
合计	776,082.62

8.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1.交易性金融资产	7,136,791.52
——股票投资	4,776,319.59
——债券投资	2,360,471.93
——资产支持证券投资	–
——基金投资	–
——贵金属投资	–
2.衍生工具	–
——权证投资	–
3.其他	–
合计	7,136,791.52

8.4.7.17 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	374,142.85
手续费返还	–
基金转换费收入	7,728.46
其他	–
合计	381,871.31

8.4.7.18 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
交易所市场交易费用	3,508,156.58
银行间市场交易费用	775.00
合计	3,508,931.58

8.4.7.19 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
审计费用	62,684.78
信息披露费	235,068.32
银行汇划费	13,574.33
账户维护费	28,100.00
其他	400.00
合计	339,827.43

8.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

8.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的或有事项。

8.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日,本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

8.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司(注)	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:广发证券股份有限公司于2014年7月31日对广发基金管理有限公司进行增资,并对其实施控制,广发基金管理有限公司由此成为广发证券股份有限公司的子公司。

除此之外,本报告期内不存在其他控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

8.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

8.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	29,265,503.38	1.22%

8.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

8.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

8.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	4,619,800,000.00	37.77%

8.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	26,642.95	1.31%	–	–

注:1.股票交易佣金的计提标准:支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易);

2.本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立;

3.本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

8.4.10.2 关联方报酬

8.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,834,884.69
其中:支付销售机构的客户维护费	2,169,433.63

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5 %的年费率计提。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3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。

8.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	972,480.79

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。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3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

8.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	–	80,502,850.28	–	–	–	–

8.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

8.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

8.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	70,936,143.39	469,588.67

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

8.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

8.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

8.4.12 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

8.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

8.4.12.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110030	格力转债	2014-12-30	2015-01-13	新发流通受限	100.00	100.00	850.00	85,000.00	85,000.00	–

注:截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的股票、权证。

8.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002675	东诚药业	2014-10-10	重大事项	23.11	–	–	606,240.00	11,956,005.53	14,010,206.40	–
600767	运盛实业	2014-10-27	重大事项	16.38	2015-02-09	12.30	650,000.00	6,544,011.35	10,647,000.00	–
002152	广电运通	2014-12-17	重大事项	20.80	2015-03-11	24.37	299,920.00	5,826,900.37	6,238,336.00	–
600222	太龙药业	2014-12-31	重大事项	7.13	2015-01-12	7.30	500,000.00	3,487,892.99	3,565,000.00	–

8.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

8.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

8.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

8.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念,在董事会下设立合规及风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

8.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息,或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降,将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险,本基金主要投资于信用等级较高的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。但是,随着短期资金市场的发展,本基金的投资范围扩大以后,可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司,违约风险较小;银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

8.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

8.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

股票代码	本期末 2014年12月31日
AAA	19,454,840.00
AAA以下	4,860,310.00
未评级	–
合计	24,315,150.00

注:债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

8.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求,在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足,导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险,或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则,在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,除8.4.12披露的流通受限不能自由转让的基金资产外,本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约约定到期日均为无固定期限且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上,由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法,由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标,从而对流动性风险进行监控。

8.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响,导致基金收益水平变化而产生的风险,反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲,市场风险是开放式基金面临的最大风险,也往往是众多风险中最基本和最常见的,也是最难防范的风险,其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

8.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

8.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	70,936,143.39	–	–	–	70,936,143.39
结算备付金	1,672,099.51	–	–	–	1,672,099.51
存出保证金	418,313.00	–	–	–	418,313.00
交易性金融资产	24,315,150.00	–	–	183,427,710.20	207,742,860.20
应收利息	–	–	–	62,568.58	62,568.58
应收申购款	–	–	–	105,313.27	105,313.27
资产总计	97,341,705.90	–	–	183,595,592.05	280,937,297.95
负债					
应付证券清算款	–	–	–	8,206,583.06	8,206,583.06
应付赎回款	–	–	–	1,732,592.39	1,732,592.39
应付管理人报酬	–	–	–	366,712.98	366,712.98
应付托管费	–	–	–	61,118.83	61,118.83
应付交易费用	–	–	–	1,261,337.88	1,261,337.88
其他负债	–	–	–	452,440.05	452,440.05
负债总计	–	–	–	12,080,785.19	12,080,785.19
利率敏感度缺口	97,341,705.90	–	–	171,514,806.86	268,856,512.76

注:上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

8.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例较小,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

8.4.13.4.2外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

8.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量,所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用Barra风险管理系统,通过标准差、跟踪误差、beta值、风险价值模型(VAR)等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

8.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

本期末 2014年12月31日	本期末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	183,427,710.20	68.23
交易性金融资产—基金投资	–	–
交易性金融资产-债券投资	24,315,150.00	9.04
交易性金融资产-贵金属投资	–	–
衍生金融资产-权证投资	–	–
其他	–	–
合计	207,742,860.20	77.27

8.4.13.4.3.2其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化且其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		上年度末 2014年12月31日
	业绩比较基准上升5%	9,150,740.54
	业绩比较基准下降5%	-9,150,740.54

8.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注8.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为173,197,317.80元,属于第二层级的余额为34,460,542.40元,属于第三层级的余额为85,000.00元。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

9 投资组合报告

原广发聚祥保本混合型证券投资基金

9.1 期末(2014年3月20日)基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	208,460,891.50	23.75
	其中:债券	208,460,891.50	23.75
	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	350,000,000.00	39.87
	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	205,747,690.14	23.44
7	其他各项资产	113,706,308.76	12.95
8	合计	877,914,890.40	100.00

9.2 期末(2014年3月20日)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

9.3 期末(2014年3月20日)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002717	岭南园林	4,464,000.00	0.28
2				
3				
4				
5				
6				
7				
8				
9				
10				
11				
12				
13				
14				
15				
16				
17				
18				
19				
20				

注:本项及下项9.4.2、9.4.3的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,此外,"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

9.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002717	岭南园林	9,412,000.00	0.59
2				
3				
4				
5				
6				
7				
8				
9				
10				
11				

9.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	4,464,000.00
卖出股票的收入(成交)总额	9,412,000.00

9.5 报告期末(2014年3月20日)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	69,958,000.00	13.62
	其中:政策性金融债	69,958,000.00	13.62
4	企业债券	8,265,891.50	1.61
5	企业短期融资券	130,237,000.00	25.35
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	208,460,891.50	40.58

9.6 报告期末(2014年3月20日)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	130218	13国开18	700,000	69,958,000.00	13.62
2	011361008	13五矿股SCP008	500,000	50,250,000.00	9.78
3	011446002	14南车SCP002	500,000	49,990,000.00	9.73
4	011442001	14中航空SCP001	300,000	29,997,000.00	5.84
5	122190	12王府02	86,690	8,265,891.50	1.61

9.7 报告期末(2014年3月20日)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。

9.8 报告期末(2014年3月20日)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。

9.9 报告期末(2014年3月20日)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。

9.10 报告期末(2014年3月20日)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。

9.11 报告期末(2014年3月20日)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。

9.12 投资组合报告附注

9.12.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

9.12.2本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

9.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	136,926.61
2	应收证券清算款	110,036,551.41
3	应收股利	–
4	应收利息	3,532,830.74
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	113,706,308.76

9.12.4报告期末(2014年3月20日)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。

9.12.5报告期末(2014年3月20日)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。

§10 投资组合报告

10.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	183,427,710.20	65.29
	其中:股票	183,427,710.20	65.29
2	固定收益投资	24,315,150.00	8.66
	其中:债券	24,315,150.00	8.66
	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	72,608,242.90	25.84
7	其他各项资产	586,194.85	0.21
8	合计	280,937,297.95	100.00

10.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	15,930.00	0.01
C	制造业	87,414,874.12	32.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,780,849.32	6.24
E	建筑业	2,316,796.20	0.86
F	批发和零售业	10,334,150.74	3.84
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	20,945,823.37	7.79
J	金融业	31,393,226.45	11.68
K	房地产业	13,003,000.00	4.84
L	租赁和商务服务业	1,204,500.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	18,560.00	0.01
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	183,427,710.20	68.23

10.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	279,995	20,918,426.45	7.78
2	002675	东诚药业	606,240	14,010,206.40	5.21
3	300226	上海钢联	189,901	11,464,323.37	4.26
4	600271	航天信息	350,000	10,678,500.00	3.97
5	600767	运盛实业	650,000	10,647,000.00	3.96
6	000516	开元投资	554,394	6,769,150.74	2.52
7	601166	兴业银行	410,000	6,765,000.00	2.52
8	002169	智光电气	650,000	6,695,000.00	2.49
9	002250	联化科技	450,961	6,674,222.80	2.48
10	000601	韶能股份	1,100,000	6,479,000.00	2.41
11	300335	迪森股份	500,068	6,245,849.32	2.32
12	002152	广电运通	299,920	6,238,336.00	2.32
13	002465	海格通信	300,000	5,796,000.00	2.16
14	600118	中国卫星	200,000	5,696,000.00	2.12
15	300005	探路者	250,000	4,640,000.00	1.73
16	600168	武汉控股	300,000	4,056,000.00	1.51
17	600222	太龙药业	500,000	3,565,000.00	1.33
18	300303	聚飞光电	200,077	3,417,315.16	1.27
19	601818	光大银行	700,000	3,416,000.00	1.27
20	300295	三六五网	45,000	3,411,000.00	1.27
21	300034	钢研高纳	149,986	3,227,698.72	1.20
22	002063	远光软件	150,000	3,007,500.00	1.12
23	000876	新希望	200,000	2,800,000.00	1.04
24	600855	航天长峰	100,000	2,776,000.00	1.03
25	000901	航天科技	80,000	2,700,000.00	1.00
26	300072	三聚环保	100,128	2,421,095.04	0.90
27	000540	中天城投	200,000	2,356,000.00	0.88
28	600104	上汽集团	100,000	2,147,000.00	0.80
29	600217	秦岭水泥	200,000	1,748,000.00	0.65
30	300002	神州泰岳	100,000	1,660,000.00	0.62
31	002325	洪涛股份	150,000	1,627,500.00	0.61
32	300166	东方国信	50,000	1,403,000.00	0.52
33	000887	中鼎股份	100,000	1,380,000.00	0.51
34	300079	数码视讯	100,000	1,245,000.00	0.46
35	000861	海印股份	150,000	1,204,500.00	0.45
36	600775	南京熊猫	100,000	1,037,000.00	0.39
37	000729	燕京啤酒	100,000	799,000.00	0.30
38	000090	天健集团	49,949	689,296.20	0.26
39	300238	冠昊生物	10,000	467,700.00	0.17
40	000731	四川美丰	50,000	439,500.00	0.16
41	002271	东方雨虹	10,000	333,400.00	0.12
42	600816	安信信托	10,000	293,800.00	0.11
43	300408	三环集团	1,000	47,900.00	0.02
44	601226	华电重工	1,000	18,560.00	0.01
45	601969	海南矿业	1,000	15,930.00	0.01

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

代码	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	46,650,154.95	9.08
2	600703	三安光电	34,766,602.54	6.77
3	002185	华天科技	30,619,936.86	5.96
4	000516	开元投资	28,856,941.14	5.62
5	000043	中航地产	28,336,592.82	5.52
6	002385	大北农	26,905,173.52	5.24
7	002422	科伦药业	23,344,842.80	4.54
8	600684	珠江实业	21,275,072.44	4.14
9	002063	远光软件	21,222,516.45	4.13
10	300072	三聚环保	20,169,808.09	3.93
11	300335	迪森股份	19,854,396.37	3.87
12	600837	海通证券	19,598,755.80	3.82
13	600196	复星医药	19,091,464.20	3.72
14	600521	华海药业	18,783,703.54	3.66
15	600594	益佰制药	18,674,291.65	3.64
16	600079	人福医药	18,433,994.51	3.59
17	002299	圣农发展	18,404,045.89	3.58
18	300303	聚飞光电	17,734,030.55	3.45
19	002250	联化科技	16,633,924.95	3.24
20	000538	云南白药	16,044,691.64	3.12
21	300058	蓝色光标	15,877,857.64	3.09
22	002400	省广股份	15,614,132.45	3.04
23	002236	大华股份	15,383,041.40	2.99
24	300226	上海钢联	15,093,584.44	2.94
25	000513	丽珠集团	14,618,399.33	2.85
26	002415	海康威视	14,502,459.24	2.82
27	000035	中国天楹	14,409,461.64	2.81
28	300281	金明精机	14,258,819.37	2.78
29	002456	欧菲光	13,804,124.30	2.69
30	001696	宗申动力	12,964,568.34	2.52
31	002626	金达威	12,553,430.37	2.44
32	000024	招商地产	12,487,350.95	2.43
33	600266	北京城建	12,179,407.29	2.37
34	002675	东诚药业	11,956,005.53	2.33
35	603456	九洲药业	11,723,916.57	2.28
36	601901	方正证券	11,610,647.29	2.26
37	300079	数码视讯	11,235,169.16	2.19
38	002038	双鹭药业	11,107,231.37	2.16
39	000001	平安银行	11,039,922.83	2.15
40	002151	北斗星通	10,814,815.74	2.11
41	300166	东方国信	10,642,697.96	2.07
42	300171	东富龙	10,412,681.61	2.03
43	600271	航天信息	10,321,033.95	2.01

注:本项及下项10.4.2、10.4.3的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,此外,"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。10.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	36,069,327.42	7.02
2	000043	中航地产	33,848,058.00	6.59
3	002185	华天科技	33,193,566.05	6.46
4	601318	中国平安	30,453,375.16	5.93
5	002422	科伦药业	27,352,691.64	5.33
6	000516	开元投资	26,081,149.03	5.08
7	002385	大北农	25,294,268.04	4.92
8	600684	珠江实业	21,558,752.16	4.20
9	300072	三聚环保	20,141,495.55	3.92
10	600837	海通证券	20,083,182.84	3.91
11	600521	华海药业	19,623,592.93	3.82
12	002299	圣农发展	19,073,755.46	3.71
13	600079	人福医药	18,141,227.65	3.53
14	600594	益佰制药	17,922,110.30	3.49
15	600196	复星医药	17,654,119.22	3.44
16	002063	远光软件	17,076,148.57	3.32
17	000538	云南白药	15,946,045.66	3.10
18	000035	中国天楹	15,894,183.10	3.09
19	300303	聚飞光电	15,855,318.20	3.09
20	000513	丽珠集团	15,602,274.75	3.04
21	002400	省广股份	15,364,059.98	2.99
22	300058	蓝色光标	14,819,979.44	2.89
23	002236	大华股份	14,648,531.12	2.85
24	300335	迪森股份	14,114,549.92	2.75
25	300281	金明精机	13,921,029.03	2.71
26	600266	北京城建	13,907,440.42	2.71
27	002415	海康威视	13,675,938.29	2.66
28	002456	欧菲光	13,452,835.89	2.62
29	002626	金达威	12,291,252.46	2.39
30	300166	东方国信	12,183,697.75	2.37
31	601901	方正证券	11,600,750.48	2.26
32	001696	宗申动力	11,590,778.59	2.26
33	002219	恒康医疗	11,535,007.42	2.25
34	603456	九洲药业	11,228,750.59	2.19
35	000024	招商地产	11,219,346.70	2.18
36	300171	东富龙	10,841,129.50	2.11
37	002038	双鹭药业	10,648,159.66	2.07
38	000001	平安银行	10,561,392.80	2.06
39	002250	联化科技	10,540,063.13	2.05
40	300059	东方财富	10,399,085.92	2.02
41	002151	北斗星通	10,375,094.22	2.02

10.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

序号	1,299,946,374.06
卖出股票的收入(成交)总额	1,153,333,000.61

10.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	24,315,150.00	9.04
8	其他	–	–
9	合计	24,315,150.00	9.04

10.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	60,000	10,825,200.00	4.03
2	113001	中行转债	30,000	4,697,700.00	1.75
3	110023	民生转债	25,000	3,456,750.00	1.29
4	125089	深机转债	20,000	2,532,340.00	0.94
5	110029	浙能转债	10,000	1,399,600.00	0.52

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

10.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

10.9 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。

10.10 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。

10.11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。

10.12 投资组合报告附注

10.12.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.12.2本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

10.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	418,313.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	62,568.58
5	应收申购款	105,313.27
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	586,194.85

10.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	10,825,200.00	4.03
2	113001	中行转债	4,697,700.00	1.75
3	110023	民生转债	3,456,750.00	1.29
4	125089	深机转债	2,532,340.00	0.94

10.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002675	东诚药业	14,010,206.40	5.21	重大事项
2	600767	运盛实业	10,647,000.00	3.96	重大事项

11 基金份额持有人信息

11.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,567	44,953.33	2,312,147.19	0.92%	247,943,065.57	99.08%

11.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,742,942.93	1.8952%

11.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

12 开放式基金份额变动

单位:份

基金转型前基金份额总额	502,676,901.92
基金转型日至报告期末基金总申购份额	329,217,140.15
基金转型日至报告期末基金总赎回份额	591,621,117.13
基金转型日至报告期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	9,982,287.82
报告期期末基金份额总额	250,255,212.76

注:基金转型前基金份额总额为2014年3月20日的数据。

13 重大事件揭示

13.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

13.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014年8月8日,陈伯军因工作调动不再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日,本基金管理人聘任包林生为公司副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

13.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

13.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

13.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

13.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

13.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

13.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

转型前

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	4					–
招商证券	3					–
中信证券	4					–
光大证券	3					–
联讯证券	2					–
广发证券	7	9,412,000.00	100%	8,568.69	100%	–
东北证券	2					–
海通证券	2					–
英大证券	2					新增一个
东兴证券	3					–
国泰君安	4	–	–	–	–	–
中天证券	1	–	–	–	–	–
中原证券	2	–	–	–	–	–
国联证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	4	–	–	–	–	–
齐鲁证券	3	–	–	–	–	–
长江证券	3	–	–	–	–	–
首创证券	1	–	–	–	–	–
新时代证券	1	–	–	–	–	–
东海证券	1	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
华福证券	2	–	–	–	–	–
国盛证券	1	–	–	–	–	–
华鑫证券	2	–	–	–	–	–
万联证券	2	–	–	–	–	–
湘财证券	1	–	–	–	–	–
华安证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	3	–	–	–	–	–
信达证券	2	–	–	–	–	–
银河证券	3	–	–	–	–	–
国海证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	4	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
北京高华	1	–	–	–	–	–
安信证券	5	–	–	–	–	–
第一创业证券	1	–	–	–	–	–
中航证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
东莞证券	1	–	–	–	–	–
宏源证券	3	–	–	–	–	–
中银国际	2	–	–	–	–	–
国元证券	2	–	–	–	–	–
国信证券	4	–	–	–	–	–
方正证券	4	–	–	–	–	–
财富证券	2	–	–	–	–	–
财富里昂	1	–	–	–	–	–
广州证券	2	–	–	–	–	–
川财证券	2	–	–	–	–	–
上海证券	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	2	–	–	–	–	–
中金公司	2	–	–	–	–	–
中信建投	4	–	–	–	–	–
国都证券	1	–	–	–	–	–
江海证券	1	–	–	–	–	–
申银万国	3	–	–	–	–	–
东方证券	2	–	–	–	–	–
华融证券	1	–	–	–	–	–
中信证券(浙江)	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
民族证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	2	–	–	–	–	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–
德邦证券	1	–	–	–	–	–
渤海证券	1	–	–	–	–	–
长城证券	1	–	–	–	–	新增1个
民生证券	2	–	–	–	–	–
南京证券	1	–	–	–	–	–
山西证券	1	–	–	–	–	–
世纪证券	1	–	–	–	–	–
厦门证券	1	–	–	–	–	–

转型后

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	2	80,892,290.46	3.30%	57,465.89	2.77%	增加1席位
海通证券	2	77,310,765.44	3.15%	70,383.63	3.39%	
平安证券	4	7,376,641.18	0.30%	6,715.66	0.32%	
招商证券	3	6,532,500.00	0.27%	5,947.19	0.29%	
中信证券	3	6,254,930.23	0.26%	5,694.48	0.27%	
中天证券	1	61,694,452.71	2.52%	56,166.48	2.71%	
中金公司	2	57,168,085.40	2.33%	52,046.07	2.51%	
齐鲁证券	3	56,026,598.69	2.28%	39,801.61	1.92%	
国泰君安	4	54,111,125.10	2.21%	49,263.03	2.37%	
川财证券	2	5,285,000.00	0.22%	3,754.44	0.18%	
中信证券(浙江)	1	52,073,521.65	2.12%	47,407.81	2.28%	
光大证券	3	501,331,565.49	20.44%	456,412.18	21.99%	
兴业证券	4	37,501,518.66	1.53%	34,141.62	1.65%	
东兴证券	2	356,967,133.49	14.55%	253,591.06	12.22%	减少1席位
国信证券	4	324,071,223.51	13.21%	295,034.96	14.22%	
联讯证券	2	30,652,500.94	1.25%	27,906.16	1.34%	
广发证券	7	82,070,543.28	3.35%	74,716.87	3.60%	
东北证券	2	27,247,056.35	1.11%	24,805.67	1.20%	
广州证券	2	20,058,748.05	0.82%	14,249.44	0.69%	
瑞银证券	1	173,648,392.49	7.08%	158,088.25	7.62%	
英大证券	2	15,993,052.47	0.65%	11,361.61	0.55%	增加1席位
万联证券	2	154,838,820.09	6.31%	140,965.13	6.79%	
中银国际	2	128,544,001.77	5.24%	91,318.40	4.40%	
宏源证券	3	12,590,912.51	0.51%	8,944.58	0.43%	
信达证券	2	111,534,926.27	4.55%	79,234.59	3.82%	
长江证券	3	10,782,364.00	0.44%	9,816.16	0.47%	
中原证券	2					
国联证券	1					
浙商证券	1					
首创证券	1					
新时代证券	1					
东海证券	1					
华福证券	2					
国盛证券	1					
华鑫证券	2					
湘财证券	1					
华安证券	1					
中投证券	3					
银河证券	3					
国海证券	1					
西部证券	1					
华泰证券	4					
国金证券	1					
北京高华	1					
安信证券	5					
第一创业证券	1					
中航证券	0					减少1席位
华创证券	1					
东莞证券	1					
国元证券	2					
方正证券	4					
财富证券	2					
财富里昂	1					
上海证券	1					
太平洋证券	2					
中信建投	4					
国都证券	1					
江海证券	1					
申银万国	3					
东方证券	2					
华融证券	1					
西南证券	1					
民族证券	1					
东吴证券	1					减少1席位
华宝证券	1					
德邦证券	1					

注:1、交易席位选择标准:

(1)财务状况良好,在最近一年内无重大违规行为;

(2)经营行为规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(3)具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源,满足投资组合进行证券交易的需要;

(4)具有较强的研究和行业分析能力,能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;

(5)能积极为公司投资业务的开展,提供良好的信息交流和客户服务;

(6)能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程:

(1)对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。

(2)协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

12.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	28,478,340.40	6.94%	3,446,000,000.00	28.17%	–	–
招商证券	–	–	326,000,000.00	2.66%	–	–
中信证券	–	–	3,813,000,000.00	31.17%	–	–
中天证券	1,305,509.29	0.32%	–	–	–	–
中金公司	46,370,713.40	11.30%	–	–	–	–
中信证券(浙江)	1,160,836.96	0.28%	–	–	–	–
光大证券	94,251,796.79	22.97%	–	–	–	–
国信证券	2,494,417.00	0.61%	–	–	–	–
广发证券	–	–	4,619,800,000.00	37.77%	–	–
广州证券	2,075,900.00	0.51%	–	–	–	–
瑞银证券	146,858,767.70	35.79%	28,200,000.00	0.23%	–	–
万联证券	10,215,413.40	2.49%	–	–	–	–
中银国际	52,599,939.30	12.82%	–	–	–	–
宏源证券	24,484,316.30	5.97%	–	–	–	–

14 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定,我司决定以验资日2014年4月18日作为本基金基金份额折算日,对基金份额持有人持有的原广发聚祥保本基金份额进行折算,折算后原广发聚祥保本基金份额将变更登记为本基金基金份额。经我司计算并经基金托管人复核的折算前单位基金份额净值为1.023元,我司按照1.023317174的折算比例(精确到小数点后第9位,第10位舍去)对原广发聚祥保本基金进行了基金份额折算,折算后当日的基金份额净值为1.000元,折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例,基金份额的份数计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。折算前原广发聚祥保本基金基金份额总额为428,108,804.50份,折算后基金份额总额为438,091,092.32份。原广发聚祥保本基金份额折算后,基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

2、根据广发基金管理有限公司2014年度股东会第四次会议决议,公司的注册资本由人民币12000万元增加至人民币12688万元,公司股东广发证券股份有限公司认购全部新增注册资本688万元。自此,广发证券股份有限公司的持股比例由原来的48.33%增加至51.13%,其他股东的持股比例相应调整。详见2014年8月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和广发基金管理有限公司网站(http://www.gffunds.com.cn)上刊登的《广发基金管理有限公司关于注册资本及股东出资比例变更的公告》。

广发基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日