

广发聚宝混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

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

【重要提示】
本基金于2015年3月26日经中国证监会证监许可[2015]449号文准予募集注册。
本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。
本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值或收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。
基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。
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。
本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、市场环境等因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金仓位连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金资产管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。
本基金可投资中小企业私募债券,其发行人是非上市中小微企业,发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下跌等,可能造成基金财产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大,从而增加了本基金整体的债券投资风险。
投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。
本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年10月9日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日。

第一部分 基金管理人

一、概况
1.名称:广发基金管理有限公司
2.住所:广东省珠海市横琴新区宝中3路3号4004-56室
3.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
4.法定代表人:王志伟
5.设立时间:2003年8月5日
6.电话:020-83936666
全国统一客服热线:96108628
7.联系人:段段西
8.注册资本:1.2688亿元人民币
9.股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”),烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科达金融控股投资有限公司,分别持有本基金管理人51.13%、15.763%、15.763%、9.468%和7.861%的股权。
二、主要人员情况
1.董事会成员
王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师,兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省第十届政协委员,广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广发证券董事长兼党委书记,广发发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政研处人事科科长等职务。
林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理(香港)有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与跨境发展专业委员会委员,资产管理专业委员会委员,深圳证券交易所第三上市公司审议复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务部总经理,投资银行总部副经理,投资银行上海业务部副总经理,投资银行华南业务部总经理。
孙晓松:董事,女,硕士,现任广发证券副经理、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事,证通股份有限公司监事,监事长。曾任广东广发证券分公司总经理,广东证券有限责任公司证券管理部经理、财务部副总经理,投资自营部副总经理,广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。
戈俊:董事,男,管理学学士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火网络技术服务有限公司、南京烽火烽火光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火滕光光电科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、西安烽火光通信有限公司、武汉烽火中天信息技术有限公司、成都烽巢网络科技有限公司、武汉烽火威视技术有限公司、武汉烽火机电科技有限公司、成都大康通信有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事,兼任武汉烽火网络有限公司董事,武汉烽火信息集成技术有限公司董事,烽火光电光技术服务有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事,曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理。
崔蒙明:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人,广汇集团控股有限公司总裁。兼任全国政协常委、全国妇联常委、香港社会救助会会长,深圳前海控股股份有限公司董事长,广东前海发展银行、深圳前海农商行董事。

许冬雄:董事,女,工商管理硕士,主管药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、副总裁,兼任中国中医药学会中药炮制专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会委员、全国中药炮制技术(技术委员会)中药炮制技术专业委员会副主任委员、国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中心炮制组与配置工专业专家委员会副主任委员,广东省中标准化技术委员会副主任委员等。曾任广东康美药业股份有限公司副总经理、广东省中标准化技术委员会副主任委员。
董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海维维乐律师事务所兼职律师,绍兴银行独立董事,海尔康生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系副主任,复旦大学法学院副教授。
姚海鑫:独立董事,男,经济学博士、教授、博士生导师,现任辽宁大学新华国际商学院教授,兼任东北制药(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、计财处处长、发展规划处处长、发展规划处处长、新华国际商学院教授。
郑南:独立董事,男,经济学博士,现任中联合国际证券股份有限公司董事长、总裁,兼任中联合国际控股有限公司常务副总经理。曾任中国人民保险公司荆州分公司经理,中国人民保险(中国)湖北省分公司业务处处长,中国人民保险(中国)湖北省国际部总经理,中国人民保险(中国)分公司总经理,太平保险(中国)分公司总经理,太平保险(中国)分公司总经理兼党委书记,平安保险(中国)有限公司副总裁,阳光财产保险股份有限公司总裁,阳光保险集团执行委员会成员。
2.监事会成员
余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。
匡丽军:监事,女,工商管理硕士,高级涉外秘书,现任广州科技金融控股投资有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技风险投资公司办公室主任,广州巨田公司行政主管,广州利科达实业发展公司办公室主任、总经理,广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。
吴晓辉:监事,男,工学硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分公司董事。曾任广发证券电脑中心员工,副经理,经理。
3.总经理及其他高级管理人员
林传辉:总经理,男,大学本科学历,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与跨境发展专业委员会委员,资产管理专业委员会委员,深圳证券交易所第三上市公司审议复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务部总经理、投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部副总经理、投资银行华南业务部总经理。
朱平:副总经理,男,硕士、经济师,中国证券监督管理委员会广东局创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海恒信集团市场部经理,广发证券投资银行部华南业务部总经理,兼兼弘基基金经理,易方达基金管理有限公司投资部研究负责人,广发基金管理有限公司总经理助理。
易阳方:副总经理,男,经济学硕士、经济师。兼任广发基金管理有限公司财务总监、广发聚兴股票型证券投资基金经理,广发聚兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事,瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资银行部副经理,中国证监会上市公司并购重组审核委员会发行审核委员,广发基金管理有限公司资产管理部总经理、广发基金管理有限公司总经理助理,广发制造业精选股票基金基金经

理。
陈西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。
邱春格:副总经理,男,经济学博士,瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人,广发基金管理有限公司机构管理部副总经理、金融工程部经理、产品总监,金融工程部副经理。
4.基金经理
曹晖:男,中国籍,经济学硕士,7年基金从业经历,曾任基金业协会资格证券,2008年7月至2012年4月在广发基金管理有限公司固定收益部担任研究员,2012年7月19日起任广发基金红棉保本基金的基金经理,2012年9月20日至2015年5月26日任广发双债添利债券基金的基金经理,2015年10月22日起任广发天发灵活配置证券投资基金的基金经理,2014年11月10日至2015年7月23日任广发双债添利货币市场基金的基金经理,2014年11月27日至2015年5月26日任广发集惠债券型证券投资基金,2014年11月27日至2015年7月23日任广发天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日至2015年4月9日任广发季利债券基金,2015年11月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理,2015年3月25日起任广发聚宝混合基金的基金经理,2015年4月9日起任广发聚宝混合基金的基金经理,2015年6月1日起任广发聚惠混合基金的基金经理。
5.本基金投资决策采取集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:
主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平,公司副总经理易阳方,权益投资一部总经理刘晓龙,研究发展部副总经理孙涛,固定收益部总经理张睿。上述人员之间不存在近亲属关系。
三、基金管理人的职责
1.依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2.办理基金备案手续;
3.对所管理的不同基金财产分别管理,分别记账,进行证券投资;
4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6.编制季度、半年度和年度基金报告;
7.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9.召集基金份额持有人大会;
10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。
四、基金管理人承诺
1.基金管理人承诺:
(1)严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《基金法》及其他相关法律法规的行为发生;
(2)根据基金合同的约定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资;
2.基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定,基金资产不得用于下列投资或者活动:
(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金管理人以外的第三人谋取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)法律法规及中国证监会规定禁止的其他行为。
3.基金管理人承诺:
(1)依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益;
(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等秘密;
(4)不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。
五、基金管理人的内部控制制度
基金管理人内部控制制度包括内部控制大纲、内部控制细则、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内部控制原则的细化和展开,对各项基本管理制度的总揽和指引。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织结构、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制制度、基金管理人控制包括风险控制制度、基金投资决策制度、基金会计核算制度、集中交易制度、基金估值制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等各项的具体说明。
根据基金业务的特点,公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线:
1.建立以岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的权利、职责,各业务部门制定详细的操作流程,各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守,在授权范围内承担各自职责。
2.建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理环节信息和沟通制度,后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督的责任。
3.建立以监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第二道监控防线。监察稽核部属于内部部门,直接接受总经理的领导,独立于其他部门和业务活动,对内部控制制度的执行情况进行严格的检查和监督。
4.建立以合规审核委员会及督察长为内核的第三道监控防线。
六、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系电话:010-61606799
联系人:洪捷
(二)主要人员情况
截至2015年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工2203人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
(三)基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、完善的信息系统和专业的服务团队,严格履行托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心保险金、OPF资产、ODF资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券投资基金定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展跨境评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年3月31日,中国工商银行托管证券投资基金428只,自2003年以来,本行连续十一年获得香港(亚洲货币)、英国(全球货币)、香港(财资)、美国(环球金融)、内地《证券时报》的“上海证券报”等境内外权威财经媒体评选的45项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。
(四)基金托管人的内部控制制度
中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些优势的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展、一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视合规和加强内部控制管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制措施作为核心工作。精心培育内控文化,完善风险管理体系,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来抓。经2007、2009、2010、2011、2012、2013年七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否有效的权威ISAS701(审计标准第70号)审阅后,2014年中国工商银行资产托管部第八次通过ISAE3402(原ISAS70)审阅获得无保留意见的控制及有效性评价,表明独立第三方对工行托管服务的风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。
(五)内部控制组织架构
中国工商银行资产托管部遵守国家有关法律法规和行业监管规定,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解操作风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。
2.内部风险控制组织结构
中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部门、内部稽查)和资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律、法规,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室均设有专门负责内部风险控制的岗位。
3.内部风险控制措施
(1)合法性原则。内部控制应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。
(2)完整性原则。托管部的各项经营管理活动都必须有相应的规范和程序,并监督制约;监督制约渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。
(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须优先建立相关的规章制度。
(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须审慎规范,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。
(5)有效性原则。内部控制制度应根据国家法规、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证落实各项内部控制制度,不得有任何时间、时滞及人员的例外。
(6)独立性原则。设立专行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内部控制制度的制定和执行部门。
4.内部风险控制措施实施
(1)严格的流程控制。资产托管业务与系统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保业务独立、环境独立、人员独立、业务操作和管理独立、网络独立。
(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为资产托管业务政策和战略的制定者和监督者,要求一级部门及时报告经营管理和控制情况,以检查资产托管部在实现内部目标的过程中,是否根据具体情况提出内部风险管理,督促内部控制部门改进。
(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“内控防线”,“互相制约”,“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的不间断的职业道德培训,使员工树立风险意识与合规理念。
(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方式开展各种业务营销活动,处理各项事务,从而有效控制和平衡投资损益,达到资源利用和效益最大化目的。
(5)内部风险控制措施。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部流程控制,定期或不定期地业务状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,防范风险。
(6)数据灾备控制。我们通过业务操作环境相对独立、数据和传输真实、数据传输线路的冗余备份、异地四个节点的完备的数据备份方式,并组织员工定期演练。为使数据更加接近现实,资产托管部不断提高数据准确率,从最初的按预订时间流程发现到现在的“随时演练”。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。
5.资产托管部内部风险控制情况
(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律法规,全面贯彻落实合规控制思想,确保资产托管业务合规、稳定地发展。
(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制约的组织结构。
(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内部制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念与方式融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作规程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各业务环节之间相互制约的有机整体。
(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部自成立以来之日起就特别强调规范运作,一直将建立一系统、高效、内控制度作为工作重心。随着市场环境与业务发展的需要和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。
(五)基金托管人对基金管理人运用基金资产进行监督的方法和程序
根据《基金法》、基金合同、基金托管人与基金管理人签署的《广发聚宝股票型证券投资基金托管协议》和有关基金法规的规定,基金托管人对基金管理人的投资运作、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的收益条件等进行合法、合规性监督,并根据法律法规、基金合同和基金托管人职责,对基金资产的投资行为进行监督,发现违规行为及时报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。
使托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

第三部分 相关服务机构

一、基金销售机构
1.名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
联系人:赵会军
电话:010-61607900
传真:010-61606799
客户服务热线:96388
公司网址:www.icbc.com.cn
2.名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:罗剑斌
联系电话:020-37865070
公司网站:www.gfzq.com.cn
本基金的销售机构具有代销资格。基金管理人有权根据有关法律、法规和规定,选择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3路3号4004-56室
法定代表人:王志伟
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
电话:020-89188970
传真:020-89899175
联系人:李华芳
三、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:广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层
负责人:程捷
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:黄晨、程捷
联系人:程捷
四、审计基金资产的会计师事务所
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号外滩中心30楼
法人代表:卢伯坤
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:王明静、吴迪

第四部分 基金的名称

广发聚宝混合型证券投资基金
基金类型 基金的基本类型
本基金通过股票、固定收益类资产和现金等大类资产的积极灵活配置,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,充分挖掘市场潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。
本基金的投资范围具有良好流动性的资产,包括国内依法发行和上市交易的股票(包括中小创、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)占基金资产的比例不低于70%,其中每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规及监管机构的规定执行。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
本基金为混合型基金,基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例不超过30%,债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)占基金资产的比例不低于70%,其中每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规及监管机构的规定执行。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

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。
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11月28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2015年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
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 17,942,379.75 1.30

其中:股票 17,942,379.75 1.30

2 固定收益投资 1,332,693,400.00 96.72

其中:债券 1,332,693,400.00 96.72

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 2,342,100.44 0.17

7 其他各项资产 24,980,656.62 1.81

8 合计 1,377,968,536.81 100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业名称 股票数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 采矿业 - -

3 制造业 8,713,631.91 0.87

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 6,349,000.00 0.63

5 建筑业 - -

6 批发和零售业 804,062.00 0.08

7 交通运输、仓储和邮政业 1,107,020.26 0.11

8 信息、软件和信息技术服务业 - -

9 金融业 - -

10 房地产业 - -

11 租赁和商务服务业 968,675.58 0.10

12 科学研究和技术服务业 - -

13 水利、环境和公共设施管理业 - -

14 居民服务、修理和其他服务业 - -

15 教育 - -

16 卫生和社会工作 - -

17 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 17,942,379.75 1.79

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 601985 中国核电 700,000 6,349,000.00 0.63

2 600707 航天电子 260,000 4,139,200.00 0.41

3 300405 华邦制药 17,722 1,304,289.76 0.13

4 603869 艾华集团 27,977 1,105,371.27 0.11

5 603300 华铁科技 36,734 968,675.58 0.10

6 603108 润达医疗 11,800 804,062.00 0.08

7 603808 鹏化股份 31,366 693,002.88 0.07

8 602223 恒通股份 18,626 602,620.26 0.06

9 603885 吉祥航空 10,000 504,400.00 0.05

10 300462 华信智能 20,598 495,999.84 0.05

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 债券数量 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 1,121,610,400.00 111.77

其中:政策性金融债 1,121,610,400.00 111.77

4 企业债 - -

5 中期票据 211,083,000.00 21.03

6 短期融资券 - -

7 可转债 - -

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 1,332,693,400.00 132.80

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 150403 15农收03 2,900,000 291,218,000.00 29.02

2 150411 15农收11 2,700,000 270,864,000.00 26.99

3 150311 15通出11 2,000,000 199,840,000.00 19.91

4 150206 15通开06 1,500,000 151,005,000.00 15.05

5 150202 15通开02 900,000 90,342,000.00 9.06

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序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金报告期末未持有权证投资。

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持有国债期货。
(3)本基金本报告期末未持有国债期货。
(4)本基金本报告期末未持有国债期货。
(5)本基金本报告期末未持有国债期货。
(6)本基金本报告期末未持有国债期货。
(7)本基金本报告期末未持有国债期货。
(8)本基金本报告期末未持有国债期货。
(9)本基金本报告期末未持有国债期货。
(10)本基金本报告期末未持有国债期货。
(11)本基金本报告期末未持有国债期货。
(12)本基金本报告期末未持有国债期货。
(13)本基金本报告期末未持有国债期货。
(14)本基金本报告期末未持有国债期货。
(15)本基金本报告期末未持有国债期货。
(16)本基金本报告期末未持有国债期货。
(17)本基金本报告期末未持有国债期货。
(18)本基金本报告期末未持有国债期货。
(19)本基金本报告期末未持有国债期货。
(20)本基金本报告期末未持有国债期货。
(21)本基金本报告期末未持有国债期货。
(22)本基金本报告期末未持有国债期货。
(23)本基金本报告期末未持有国债期货。
(24)本基金本报告期末未持有国债期货。
(25)本基金本报告期末未持有国债期货。
(26)本基金本报告期末未持有国债期货。
(27)本基金本报告期末未持有国债期货。
(28)本基金本报告期末未持有国债期货。
(29)本基金本报告期末未持有国债期货。
(30)本基金本报告期末未持有国债期货。
(31)本基金本报告期末未持有国债期货。
(32)本基金本报告期末未持有国债期货。
(33)本基金本报告期末未持有国债期货。
(34)本基金本报告期末未持有国债期货。
(35)本基金本报告期末未持有国债期货。
(36)本基金本报告期末未持有国债期货。
(37)本基金本报告期末未持有国债期货。
(38)本基金本报告期末未持有国债期货。
(39)本基金本报告期末未持有国债期货。
(40)本基金本报告期末未持有国债期货。
(41)本基金本报告期末未持有国债期货。
(42)本基金本报告期末未持有国债期货。
(43)本基金本报告期末未持有国债期货。
(44)本基金本报告期末未持有国债期货。
(45)本基金本报告期末未持有国债期货。
(46)本基金本报告期末未持有国债期货。
(47)本基金本报告期末未持有国债期货。
(48)本基金本报告期末未持有国债期货。
(49)本基金本报告期末未持有国债期货。
(50)本基金本报告期末未持有国债期货。
(51)本基金本报告期末未持有国债期货。
(52)本基金本报告期末未持有国债期货。
(53)本基金本报告期末未持有国债期货。
(54)本基金本报告期末未持有国债期货。
(55)本基金本报告期末未持有国债期货。
(56)本基金本报告期末未持有国债期货。
(57)本基金本报告期末未持有国债期货。
(58)本基金本报告期末未持有国债期货。
(59)本基金本报告期末未持有国债期货。
(60)本基金本报告期末未持有国债期货。
(61)本基金本报告期末未持有国债期货。
(62)本基金本报告期末未持有国债期货。
(63)本基金本报告期末未持有国债期货。
(64)本基金本报告期末未持有国债期货。
(65)本基金本报告期末未持有国债期货。
(66)本基金本报告期末未持有国债期货。
(67)本基金本报告期末未持有国债期货。
(68)本基金本报告期末未持有国债期货。
(69)本基金本报告期末未持有国债期货。
(70)本基金本报告期末未持有国债期货。
(71)本基金本报告期末未持有国债期货。
(72)本基金本报告期末未持有国债期货。
(73)本基金本报告期末未持有国债期货。
(74)本基金本报告期末未持有国债期货。
(75)本基金本报告期末未持有国债期货。
(76)本基金本报告期末未持有国债期货。
(77)本基金本报告期末未持有国债期货。
(78)本基金本报告期末未持有国债期货。
(79)本基金本报告期末未持有国债期货。
(80)本基金本报告期末未持有国债期货。
(81)本基金本报告期末未持有国债期货。
(82)本基金本报告期末未持有国债期货。
(83)本基金本报告期末未持有国债期货。
(84)本基金本报告期末未持有国债期货。
(85)本基金本报告期末未持有国债期货。
(86)本基金本报告期末未持有国债期货。
(87)本基金本报告期末未持有国债期货。
(88)本基金本报告期末未持有国债期货。
(89)本基金本报告期末未持有国债期货。
(90)本基金本报告期末未持有国债期货。
(91)本基金本报告期末未持有国债期货。
(92)本基金本报告期末未持有国债期货。
(93)本基金本报告期末未持有国债期货。
(94)本基金本报告期末未持有国债期货。
(95)本基金本报告期末未持有国债期货。
(96)本基金本报告期末未持有国债期货。
(97)本基金本报告期末未持有国债期货。
(98)本基金本报告期末未持有国债期货。
(99)本基金本报告期末未持有国债期货。
(100)本基金本报告期末未持有国债期货。
(101)本基金本报告期末未持有国债期货。
(102)本基金本报告期末未持有国债期货。
(10