# 广发聚安混合型证券投资基金

## 【2015】年度报告摘要

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
报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年3月25日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 广发聚安混合 | |
| 基金主代码 | 001115 | |
| 交易代码 | 001115 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年3月25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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,964,628,524.91份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发聚安混合A类 | 广发聚安混合C类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 001115 | 001116 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 160,660,731.30份 | 1,803,967,793.61份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。 |
| 投资策略 | （一）大类资产配置本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后回报率。（二）债券投资策略本基金通过对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进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。（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）金融衍生品投资策略 |
| 业绩比较基准 | 30%×沪深300指数收益率＋70%×中证全债指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 广发基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 段西军 | 洪渊 |
| | 联系电话 | 020-83936666 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | dxj@gfjunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105828，020-83936999 | 95588 |
| 传真 | | 020-88891918 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址 | http://www.gfjunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1期间数据和指标 | 2015年3月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 广发聚安混合A类 | 广发聚安混合C类 |
| 本期已实现收益 | 163,117,567.70 | 6,611,950.00 |
| 本期利润 | 200,417,405.95 | 11,023,740.01 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1179 | 0.0393 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.14% | 3.54% |
| 本期基金份额净值增长率 | 16.40% | 11.70% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 2015年末 | |
| | 广发聚安混合A类 | 广发聚安混合C类 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1649 | 0.1167 |
| 期末基金资产净值 | 187,001,177.21 | 2,014,483,801.72 |
| 期末基金份额净值 | 1.164 | 1.117 |

注：1. 本基金合同生效日为2015年3月25日，至披露时点不满一年。

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. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4. 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1. 广发聚安混合A类：

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 8.48% | 0.74% | 6.87% | 0.50% | 1.61% | 0.24% |
| 过去六个月 | 8.89% | 1.16% | －1.20% | 0.80% | 10.09% | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.40% | 0.94% | 3.10% | 0.79% | 13.30% | 0.15% |

2. 广发聚安混合C类：

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 8.45% | 0.73% | 6.87% | 0.50% | 1.58% | 0.23% |
| 过去六个月 | 4.69% | 1.03% | －1.20% | 0.80% | 5.89% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.70% | 0.84% | 3.10% | 0.79% | 8.60% | 0.05% |

1、业绩比较基准：30%×沪深300指数收益率＋70%×中证全债指数收益率。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

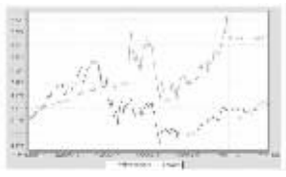
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发聚安混合型证券投资基金

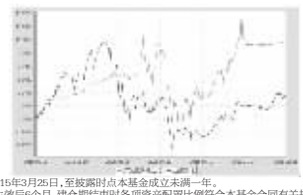
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年3月25日至2016年12月31日)

1、广发聚安混合A类



2、广发聚安混合C类



注：1、本基金合同生效日为2015年3月25日，至披露时点本基金成立未满一年。

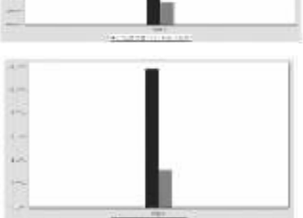
2、本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

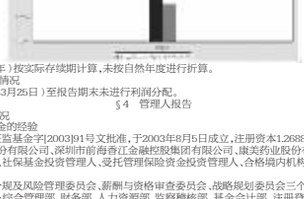
广发聚安混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、广发聚安混合A类



2、广发聚安混合C类



注：基金合同生效当年（2015年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2015年3月25日）至报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.26889亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、珠海格力电器股份有限公司、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技金融创新投资控股有限公司，公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和24个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司、参股了正通股份有限公司。

截至2015年12月31日，本基金管理人管理八十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发集丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发聚财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发聚财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发迎向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对中套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指新材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫成灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安丽回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宗回报灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为3300.24亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 谭昌杰 | 本基金的基金经理；广发刚好年年红债券基金的基金经理；广发天天红货币基金的基金经理；广发稳势优选灵活配置混合基金的基金经理；广发聚宝混合基金的基金经理；广发聚鑫混合基金的基金经理 | 2015-03-25 | － | 7年 | 男，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员，2012年7月19日起任广发刚好年年红债券基金的基金经理，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，2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理，2014年1月10日至2015年7月31日任广发纯债子货币市场基金的基金经理，2014年1月27日至2015年7月23日任广发集鑫债券型证券投资基金，2014年1月27日至2015年7月23日任广发天天利货币市场基金的基金经理，2014年9月29日至2015年4月29日任广发季季利债券基金的基金经理，2015年1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26日起任广发聚安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日起任广发聚鑫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、《广发聚安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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保公交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项统计分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期主要经济指标持续恶化，多项经济指标出现了台阶式下滑，部分指标跌入负增长区域，整体经济形势较为严峻，导致大宗商品价格不断下跌。货币政策继续宽松，在反腐带来的地方政府不作为的影响下，积极的财政政策对经济的带动作用大幅弱化。相对于基本面不断恶化的实体经济，除大宗商品之外的资产价格整体上扬：股市呈现过山车行情，上半年系统性收益显著，下半年亦有结构性和主题性机会；债券市场继续上年牛市全年走牛，市场收益率、信用利差和期限利差均大幅下降，但在那分过剩行业以及公司治理问题的发债主体中也出现了较多的违约事件；以深圳为代表的一线地产价格继续上扬，但大部分二三线城市房价回温一般，仍处于缓慢去库存阶段。

本基金以获取低风险的绝对回报作为投资目标，一直维持较低的股票仓位，并主要通过新股和转债的网下申购增厚组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发聚安A净值增长率为16.4%，广发聚安C净值增长率为11.7%；同期业绩比较基准收益率为3.1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年我国经济预计将面临更大的不确定性：国际方面，发达经济体逐步企稳，但受到大宗商品下跌的影响，新兴经济体以及资源国将面临较大的经济下行压力，人民币汇率转面临考验。国内方面，供给侧改革的推动有望对传统行业带来变革，但受制于稳增长、保就业的政策要求，实际的执行效果有待观察。

我们认为，基于推持汇率稳定、限制僧户企业再融资以及防范流动性陡降风险的需要，去年下半年以来极度宽松的资金面有望得以修正，逐步恢复到中性偏宽松的资金面。财政政策在2015年发力不大，预计今年会有所表现。考虑到2016年是十三五的开局之年，经济改革政策无其是产业政策和区域发展政策有望加速推出，对资产价格的影响会有所加大。

受制于资金面进一步宽松的空间有限的判断，目前已经较低的收益率曲线继续下行的空间将非常有限，虽然短期内看不到对债券市场的冲击，但中长期来看，通胀仍有小幅回升的风险，应降低债券资产的预期回报。如果供给侧改革进入实质推进阶段，信用利差仍有继续扩大的风险；期权、利率债以及高等级信用债仍属于相对安全的品种，中低等级信用债整体处于左侧区域，需要耐心等待机会。

权益市场方面，受制于经济结构转型缓慢、经济增速下滑的影响，系统性上涨空间有限，预计指数将呈现宽幅震荡的表现。在经济结构改革期，少数的主题性和结构性机会明显，但注册制下股票的供给会加大，这将降低股市的估值中枢，尤其不利于业绩确定性不强的高估值股票。因此，后续将主要以低估值的价值股以及优质成长股为主。

本基金将继续致力于为投资者获取绝对回报，考虑到债券市场方面的预期回报一般，本基金后续将以短期债券作为配置主体，积极参与新股和转债的网下申购。二级股票方面，会维持相对较低的仓位，重点配置具有业绩和股价（定增、大股东增值、员工持股）支持，符合新经济发展方向的股票。严格控制市盈率，并注重分散股票的行业分布。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，开确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化，证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发聚安混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发聚安混合型证券投资基金的管理人---广发基金管理有限公司在广发聚安混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各里要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发聚安混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第P0777号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发聚安混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2015年12月31日 |
|---|---|
| 资 产： | – |
| 银行存款 | 1,107,152,940.03 |
| 结算备付金 | 463,424.70 |
| 存出保证金 | 68,750.69 |
| 交易性金融资产 | 196,587,365.14 |
| 其中：股票投资 | 66,961,693.14 |
| 基金投资 | – |
| 债券投资 | 128,635,772.00 |
| 资产支持证券投资 | – |
| 贵金属投资 | – |
| 衍生金融资产 | – |
| 买入返售金融资产 | 896,002,225.00 |
| 应收证券清算款 | 1,564,576.20 |
| 应收利息 | 4,226,308.87 |
| 应收股利 | – |
| 应收申购款 | – |
| 递延所得税资产 | – |
| 其他资产 | – |
| 资产总计 | 2,204,065,589.53 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015年12月31日 |
| 负 债： | – |
| 短期借款 | – |
| 交易性金融负债 | – |
| 衍生金融负债 | – |
| 卖出回购金融资产款 | – |
| 应付证券清算款 | – |
| 应付赎回款 | 106,015.69 |
| 应付管理人报酬 | 1,491,665.98 |
| 应付托管费 | 372,916.50 |
| 应付销售服务费 | 170,620.71 |
| 应付交易费用 | 185,011.94 |
| 应交税费 | – |
| 应付利息 | – |
| 应付利润 | – |
| 递延所得税负债 | – |
| 其他负债 | 284,379.78 |
| 负债合计 | 2,580,610.60 |
| 所有者权益： | – |
| 实收基金 | 1,964,628,524.91 |
| 未分配利润 | 236,856,454.02 |
| 所有者权益合计 | 2,201,484,978.93 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,204,065,589.53 |

注：1、报告截止日2015年12月31日，广发聚安混合A基金份额净值人民币1.164元，基金份额总额160,660,731.30份；广发聚安混合C基金份额净值人民币1.117元，基金份额总额1,803,967,793.61份；总份额总额1,964,628,524.91份。

2、本会计期间为2015年3月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：广发聚安混合型证券投资基金

本报告期：2015年3月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年3月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日 |
|---|---|
| 一、收入 | 230,937,660.29 |
| 1.利息收入 | 35,327,307.14 |
| 其中：存款利息收入 | 17,490,112.68 |
| 债券利息收入 | 10,844,304.65 |
| 资产支持证券利息收入 | – |
| 买入返售金融资产收入 | 7,032,889.91 |
| 其他利息收入 | – |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 129,236,518.25 |
| 其中：股票投资收益 | 125,002,989.12 |
| 基金投资收益 | – |
| 债券投资收益 | 4,187,569.20 |
| 资产支持证券投资收益 | – |
| 贵金属投资收益 | – |
| 衍生工具收益 | – |
| 股利收益 | 45,959.93 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 41,711,628.26 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | – |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 24,662,206.74 |
| 减:二、费用 | 19,496,514.43 |
| 1. 管理人报酬 | 12,801,409.24 |
| 2. 托管费 | 3,200,352.29 |
| 3. 销售服务费 | 243,492.45 |
| 4. 交易费用 | 874,740.52 |
| 5. 利息支出 | 2,055,663.04 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 2,055,663.04 |
| 6. 其他费用 | 320,856.90 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 211,441,145.86 |
| 减:所得税费用 | – |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 211,441,145.86 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发聚安混合型证券投资基金

本报告期：2015年3月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年3月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 204,326,901.96 | – | 204,326,901.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | – | 211,441,145.96 | 211,441,145.96 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 1,760,301,622.96 | 25,415,308.06 | 1,785,716,931.02 |
| 其中：1.基金申购款 | 8,269,141,388.00 | 454,819,062.80 | 8,723,960,450.80 |
| 2.基金赎回款 | -6,498,839,765.04 | -429,403,754.74 | -6,928,243,519.78 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | – | – | – |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,964,628,524.91 | 236,856,454.02 | 2,201,484,978.93 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王志伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发聚安混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2015]277号《关于同意广发聚安混合型证券投资基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发聚安混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于2015年3月25日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为2015年3月16日至2015年3月20日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币204,326,901.96元，有效认购户数为470户。其中广发聚安混合A类基金（“A类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币200,379,324.13元，认购资金在募集期间的利息为人民币4,028.58元；广发聚安混合基金C类基金（“C类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额3,943,221.12元，认购资金在募集期间的利息为人民币328.12元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，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的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、公司债、次级债、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）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准：30%×沪深300指数收益率＋70%×中证全债指数收益率。

本基金的财务报表于2016年3月23日经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年3月25日(基金合同生效日)起至2015年12月31日期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为2015年3月25日（基金合同生效日）起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资;主要为权证投资等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利仅括还红股和公积金转增股本以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1.对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2.对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3.当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

4. 对于交易市场活跃程度下降的证券投资品种(可转换债券、资产支持证券和