

广发聚宝混合型证券投资基金

2015年度报告摘要

8.42 累计计入金额超过期末基金资产净值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	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例	
1	601166	兴业银行	36,039,000.00	4.54	
2	000001	平安银行	29,750,000.00	3.86	
3	600030	中信证券	28,056,624.57	3.64	
4	601028	中国人保	28,102,777.00	3.61	
5	000038	云南白药	23,242,777.00	2.99	
6	002024	苏宁云商	21,300,000.00	2.76	
7	000728	国元证券	18,000,729.96	2.35	
8	000002	万科 A	15,197,272.00	1.97	
9	000039	中钢国际	12,124,488.00	1.57	
10	000911	南宁糖业	11,748,852.01	1.52	
11	601085	中国铁建	10,683,263.20	1.39	
12	002309	中钨科技	10,396,251.00	1.35	
13	000709	国电核电	10,281,285.00	1.33	
14	000699	双汇发展	7,881,627.00	1.02	
15	000560	中国国贸	6,136,000.00	0.80	
16	000079	航天电子	5,244,741.00	0.68	
17	601318	中国平安	5,100,000.00	0.67	
18	002285	双钢新材	3,473,346.24	0.45	
19	002142	宁波银行	3,060,824.00	0.40	
20	000061	格力电器	2,708,007.00	0.35	

买入股票的成本(成交)总额		328,202,288.21
卖出股票的收入(成交)总额		340,282,098.57

8.5 期末按投资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	138,244,800.00	17.93		
4	企业债券	138,244,800.00	17.93		
5	企业短期融资券	190,519,000.00	24.70		
6	可转债(可交换债)	268,000.00	0.03		
7	中期票据	—	—		
8	同业存单	—	—		
9	其他	—	—		
10	合计	329,031,800.00	42.66		

8.6 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组合					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	150111	15国开11	700,000	70,070,000.00	9.09
2	160111	16国开11	600,000	60,174,000.00	7.80
3	011570003	15国债03	500,000	50,266,000.00	6.52
4	011590243	15央行国债0306	400,000	40,212,000.00	5.21
5	041510119	15央行国债0300	300,000	30,201,000.00	3.92

8.7 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					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		
6	国家开发银行2015年第六期资产支持证券	—	—		
7	国家开发银行2015年第七期资产支持证券	—	—		
8	国家开发银行2015年第八期资产支持证券	—	—		
9	国家开发银行2015年第九期资产支持证券	—	—		
10	国家开发银行2015年第十期资产支持证券	—	—		

8.8 报告期内买入及卖出资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		
6	国家开发银行2015年第六期资产支持证券	—	—		
7	国家开发银行2015年第七期资产支持证券	—	—		
8	国家开发银行2015年第八期资产支持证券	—	—		
9	国家开发银行2015年第九期资产支持证券	—	—		
10	国家开发银行2015年第十期资产支持证券	—	—		

8.9 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组合					金额单位:人民币元
序号	权证名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.10 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	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.11 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.12 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.13 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.14 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.15 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.16 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.17 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.18 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.19 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.20 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.21 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.22 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.23 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.24 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.25 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.26 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

8.27 期末持有的资产支持证券明细					金额单位:人民币元
序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家开发银行2015年第一期资产支持证券	—	—		
2	国家开发银行2015年第二期资产支持证券	—	—		
3	国家开发银行2015年第三期资产支持证券	—	—		
4	国家开发银行2015年第四期资产支持证券	—	—		
5	国家开发银行2015年第五期资产支持证券	—	—		

民生证券	2	—	—	—	—	新增2个
民族证券	1	—	—	—	—	新增1个
南京证券	1	—	—	—	—	新增1个
瑞银证券	1	—	—	—	—	新增1个