

# 广发聚鑫债券型证券投资基金

## 2014 年半年度报告摘要

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

## 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称            | 广发聚鑫债券           |                 |
| 基金主代码           | 000118           |                 |
| 交易代码            | 000118           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2013 年 6 月 5 日   |                 |
| 基金管理人           | 广发基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 241,152,880.69 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 广发聚鑫债券 A         | 广发聚鑫债券 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 000118           | 000119          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 188,623,578.41 份 | 52,529,302.28 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，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略 | <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。</p> <p>本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。</p> <p>（二）债券投资策略</p> <p>本基金通过综合分析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，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>（四）权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的；同时，充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会，实现基金资产的增值。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | 易制度等多种因素，对权证进行定价。                              |
| 业绩比较基准 | 中债总全价指数收益率                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

### 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            | 中国银行股份有限公司               |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 段西军                   | 唐州徽                      |
|             | 联系电话 | 020-83936666          | 010-66594855             |
|             | 电子邮箱 | dxj@gffunds.com.cn    | tgxxpl@bank-of-china.com |
| 客户服务电话      |      | 95105828,020-83936999 | 95566                    |
| 传真          |      | 020-89899158          | 010-66594942             |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 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 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日） |               |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
|               | 广发聚鑫债券 A                             | 广发聚鑫债券 C      |
| 本期已实现收益       | -11,313,888.28                       | -2,998,667.21 |
| 本期利润          | 24,264,264.66                        | 5,589,054.46  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0788                               | 0.0719        |
| 本期基金份额净值增长率   | 8.93%                                | 8.75%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014 年 6 月 30 日)                |               |
|               | 广发聚鑫债券 A                             | 广发聚鑫债券 C      |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0207                              | -0.0252       |
| 期末基金资产净值      | 195,645,089.74                       | 54,227,965.94 |
| 期末基金份额净值      | 1.037                                | 1.032         |

注：1、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。

2、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）。

3、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

广发聚鑫债券 A

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 2.27%    | 0.30%       | 0.32%      | 0.10%         | 1.95% | 0.20% |
| 过去三个月      | 6.80%    | 0.30%       | 2.60%      | 0.12%         | 4.20% | 0.18% |
| 过去六个月      | 8.93%    | 0.41%       | 4.25%      | 0.11%         | 4.68% | 0.30% |
| 过去一年       | 3.60%    | 0.38%       | -1.72%     | 0.12%         | 5.32% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.70%    | 0.37%       | -2.36%     | 0.13%         | 6.06% | 0.24% |

广发聚鑫债券 C

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 2.28%    | 0.32%       | 0.32%      | 0.10%         | 1.96% | 0.22% |
| 过去三个月      | 6.61%    | 0.31%       | 2.60%      | 0.12%         | 4.01% | 0.19% |
| 过去六个月      | 8.75%    | 0.40%       | 4.25%      | 0.11%         | 4.50% | 0.29% |
| 过去一年       | 3.10%    | 0.38%       | -1.72%     | 0.12%         | 4.82% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.20%    | 0.37%       | -2.36%     | 0.13%         | 5.56% | 0.24% |

注：本基金业绩比较基准：中债总全价指数收益率

#### 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

广发聚鑫债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 6 月 5 日至 2014 年 6 月 30 日)

广发聚鑫债券 A



### 广发聚鑫债券 C



## 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 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、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技风险投资有限公司。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 22 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、金融工程部、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、国际业务部、营销服务部、互联网金融部（下辖深圳理财中心、杭州理财中心）、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。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。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人管理五十一只开放式基金---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、广发聚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、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、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、广发理财 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、广发理财 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、广发中债金融债指数证券投资基金、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和广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为 1271.27 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 |        |  |
| 代宇 | 本基金的基金经理；广发聚利债券基金的基金经理；广发聚财信用债券基金的基金经理；广发集利一年定期开放债券基金的基金经理 | 2013-06-05      | -    | 9      | 女，中国籍，金融学硕士，持有基金业执业资格证书，2005 年 7 月至 2011 年 6 月先后任广发基金管理有限公司固定收益部研究员及交易员、国际业务部研究员、机构投资部专户投资经理，2011 年 7 月调入固定收益部任投资人员，2011 年 8 月 5 日起任广发聚利债券基金的基金经理，2012 年 3 月 13 日起任广发聚财信用债券基金的基金经理，2013 年 6 月 5 日起任广发聚鑫债券基金的基金经理，2013 年 8 月 21 日起任广发集利一年定期开放债券基金的基金经理。 |
| 张芊 | 本基金的基金经理；广发纯债基金的基金经理；固定收益部总经理                              | 2013-07-12      | -    | 13     | 女，中国籍，金融学硕士、MBA，持有基金业执业资格证书，2001 年 6 月至 2012 年 2 月曾在中国银河证券研究中心、中国人保资产管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司从事固定收益类投研工作，2012 年 2 月起任广发基金管理有限公司固定收益部总经理，2012 年 12 月 14 日起任广发纯债债券基金的基金经理，2013 年 7 月 12 日起任广发聚鑫债券基金的基金经理。  |

注：1.基金经理的“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
3. 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合规守信情况的说明

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、《广发聚鑫债券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。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

#### 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

2014 年上半年，受房地产销售和出口下行的影响，经济基本面超预期回落，大宗商品和各类物价增速放缓。央行货币政策操作更加前瞻性，使用各种定向宽松工具，配合灵活的公开市场操作，较好地平滑了春节、缴税和半年度等关键节点的流动性冲击。春节后回购利率超预期下行，中长期存款利率稳步下行。

在政策面回暖的推动下，债券品种春节后开始稳中上升。但是行情并非一帆风顺，3 月初到 4 月非信用品种大幅度调整波动。但是受基本支撑，5 月后收益率加速下行。信用品种在超日债违约后，一般企业债和城投债走势明显分化，城投债收益率稳中有降，中低评级周期行业实体债利差有所扩大。可转债方面，随大盘震荡。

基于宏观经济下行环境中货币政策紧缩空间有限的判断，本基金维持了较高的久期和杠杆。信用风险不断积累，基金重点减持中低评级品种。基金对前期涨幅较大的权益类品种进行止盈操作，适当对行业和品种进行分散化。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发聚鑫 A 类本报告期净值增长率为 8.93%，同期业绩比较基准收益率为 4.25%

广发聚鑫 C 类本报告期净值增长率为 8.75%，同期业绩比较基准收益率为 4.25%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从最新央行货币政策精神看，货币政策层面未看到放松的迹象。近期宏观经济加速下滑情况有所改变，货币政策可能保持稳定，市场利率波动相对平稳。利率和高评价品种在前期经历一定调整后，风险得到一定释放。未来宏观基本将引导市场。

基于上半年利率市场上行幅度较高的情况，未来将更加注重管理利率风险，继续积极防范个券的信用风险，继续减持高风险品种。权益类积极选股，维持对非周期成长股的配置。

#### 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、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工

程部负责人、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、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，并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。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。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签署服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的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“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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发聚鑫债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融

工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发聚鑫债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      | -                              | -                                |
| 银行存款            | 2,799,266.58                   | 3,334,640.35                     |
| 结算备付金           | 8,080,310.53                   | 15,311,548.47                    |
| 存出保证金           | 87,834.62                      | 162,705.45                       |
| 交易性金融资产         | 606,604,750.74                 | 1,008,237,190.05                 |
| 其中：股票投资         | 56,773,454.98                  | 102,452,993.25                   |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 549,831,295.76                 | 905,784,196.80                   |
| 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        | -                              | 2,200,001.10                     |
| 应收证券清算款         | -                              | 2,913,877.81                     |
| 应收利息            | 15,478,310.27                  | 17,699,557.73                    |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 15,618,582.16                  | 9,296.83                         |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 648,669,054.90                 | 1,049,868,817.79                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2014 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2013 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      | -                              | -                                |
| 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       | 393,091,301.86                 | 520,378,337.48                   |
| 应付证券清算款         | -                              | 2,200,001.10                     |
| 应付赎回款           | 4,370,261.91                   | 2,181,188.19                     |
| 应付管理人报酬         | 155,089.99                     | 346,006.57                       |
| 应付托管费           | 44,311.44                      | 98,859.05                        |
| 应付销售服务费         | 17,953.32                      | 49,104.84                        |

|               |                |                  |
|---------------|----------------|------------------|
| 应付交易费用        | 87,100.58      | 123,691.13       |
| 应交税费          | -              | -                |
| 应付利息          | 794,698.48     | 564,224.13       |
| 应付利润          | -              | -                |
| 递延所得税负债       | -              | -                |
| 其他负债          | 235,281.64     | 150,323.17       |
| 负债合计          | 398,795,999.22 | 526,091,735.66   |
| <b>所有者权益：</b> | -              | -                |
| 实收基金          | 241,152,880.69 | 550,719,298.74   |
| 未分配利润         | 8,720,174.99   | -26,942,216.61   |
| 所有者权益合计       | 249,873,055.68 | 523,777,082.13   |
| 负债和所有者权益总计    | 648,669,054.90 | 1,049,868,817.79 |

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日,广发聚鑫债券 A 基金份额净值人民币 1.037 元，基金份额总额 188,623,578.41 份；广发聚鑫债券 C 基金份额净值人民币 1.032 元，基金份额总额 52,529,302.28 份；总份额总额 241,152,880.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发聚鑫债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>40,126,581.10</b>                  |
| 1.利息收入                | 16,258,763.48                         |
| 其中：存款利息收入             | 99,273.46                             |
| 债券利息收入                | 16,125,004.52                         |
| 资产支持证券利息收入            | -                                     |
| 买入返售金融资产收入            | 34,485.50                             |
| 其他利息收入                | -                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -20,369,655.45                        |
| 其中：股票投资收益             | 5,325,984.10                          |
| 基金投资收益                | -                                     |
| 债券投资收益                | -25,852,902.19                        |
| 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                  | 157,262.64                            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 44,165,874.61                         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 71,598.46                             |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| <b>减：二、费用</b>              | <b>10,273,261.98</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 1,321,079.60         |
| 2. 托管费                     | 377,451.30           |
| 3. 销售服务费                   | 152,156.85           |
| 4. 交易费用                    | 327,805.92           |
| 5. 利息支出                    | 7,896,526.69         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 7,896,526.69         |
| 6. 其他费用                    | 198,241.62           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>29,853,319.12</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>29,853,319.12</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发聚鑫债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）                        | 550,719,298.74                                      | -26,942,216.61 | 523,777,082.13   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 29,853,319.12  | 29,853,319.12    |
| 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）      | -309,566,418.05                                     | 5,809,072.48   | -303,757,345.57  |
| 其中：1.基金申购款                             | 68,673,043.94                                       | 850,835.51     | 69,523,879.45    |
| 2.基金赎回款                                | -378,239,461.99                                     | 4,958,236.97   | -373,281,225.02  |
| 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）                        | 241,152,880.69                                      | 8,720,174.99   | 249,873,055.68   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2013 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 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）                        | 2,708,497,991.22                                    | -              | 2,708,497,991.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利                 | -   | 2,091,073.37   | 2,091,073.37     |

|  |                  |              |                  |
|--|------------------|--------------|------------------|
| 润)                                     |                  |              |                  |
| 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）      | -                | -            | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -                | -            | -                |
| 2.基金赎回款                                | -                | -            | -                |
| 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）                        | 2,708,497,991.22 | 2,091,073.37 | 2,710,589,064.59 |

报表附注为财务报表的组成部分。

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发聚鑫债券型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可证监许可[2013]293号《关于核准广发聚鑫债券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《广发聚鑫债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于2013年6月5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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2013年5月6日至2013年5月31日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，根据认购费用收取方式不同将基金份额分为不同类别。本基金募集资金总额为人民币2,708,497,991.22元，有效认购户数为10,279户。其中广发聚鑫债券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1,172,282,824.58元，认购资金在募集期间的利息为人民币211,457.77元；广发聚鑫债券C类基金(“C类基金”)的募集资金净额1,535,880,514.12元，认购资金在募集期间的利息为人民币123,194.75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)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律

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的相关规定）。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于集合债券、定向债务融资工具等，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，也可直接从二级市场上买入股票和权证。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为：中债总全价指数收益率。

本基金的财务报表于 2014 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金执行企业会计准则、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### **6.4.3 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3、2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，上市公司在代扣代缴时，减按 50% 计算应纳税所得额。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- 4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5、对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。
- 6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在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。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称      | 与本基金的关系                    |
|------------|----------------------------|
| 中国银行股份有限公司 | 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 | 基金管理人股东、代销机构               |

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）<br>至2013年6月30日 |              |
|------------|----------------------------|--------------|--|--------------|
|            | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 | 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 | 191,196,566.94             | 100.00%      | -  | -            |

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）<br>至2013年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|--|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券成交总额的比例 |

|            |                |              |   |              |
|------------|----------------|--------------|---|--------------|
|            |                | 券成交总<br>额的比例 |   | 券成交总<br>额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 377,333,235.35 | 100.00%      | - | -            |

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）<br>至2013年6月30日 |                    |
|------------|----------------------------|--------------------|--|--------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的<br>比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的<br>比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 9,576,370,000.00           | 100.00%            | -  | -                  |

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30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 | 174,064.42                               | 100.00%    | -        | -            |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）至2013年6月30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 | 96,945.27                                | 100.00%    | -        | -            |

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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,321,079.60               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 459,734.84                 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 377,451.30                 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
|                |                            |

|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                         |            |            |
|----------------|--|------------|------------|
|                | 广发聚鑫债券 A                                 | 广发聚鑫债券 C   | 合计         |
| 广发基金管理有限公司     | -  | 13,169.09  | 13,169.09  |
| 中国银行股份有限公司     | -  | 64,619.09  | 64,619.09  |
| 广发证券股份有限公司     | -  | 23,374.52  | 23,374.52  |
| 合计             | -  | 101,162.70 | 101,162.70 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）至2013年6月30日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                         |            |            |
|                | 广发聚鑫债券A                                  | 广发聚鑫债券C    | 合计         |
| 广发基金管理有限公司     | -  | 164,739.81 | 164,739.81 |
| 中国银行股份有限公司     | -  | 105,165.59 | 105,165.59 |
| 广发证券股份有限公司     | -  | 13,200.13  | 13,200.13  |
| 合计             | -  | 283,105.53 | 283,105.53 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.8.3 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

| 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |        |       |       |
|----------------------------|--------|-------|-------|
| 银行间市场                      | 债券交易金额 | 基金逆回购 | 基金正回购 |
|                            |        |       |       |

|  |        |      |       |      |               |            |
|--|--------|------|-------|------|---------------|------------|
| 交易的各关联方名称                                | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出       |
| 中国银行股份有限公司                               | -      | -    | -     | -    | 92,000,000.00 | 115,937.45 |
| 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）至2013年6月30日 |        |      |       |      |               |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称                           | 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       |
| 中国银行股份有限公司                               | -      | -    | -     | -    | -             | -          |

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.8.4.2 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

广发聚鑫债券 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况（一级）。、

广发聚鑫债券 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况（二级）。

#### 6.4.8.5 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2013年6月5日（基金合同生效日）<br>至2013年6月30日 |            |
|            | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额   | 当期利息收入     |
| 中国银行股份有限公司 | 2,799,266.58               | 17,626.35 | 8,218,698.74                                 | 109,229.86 |

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

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.9 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.9.1 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

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |           |       |        |            |               |               |   |
|---------------------|------|------------|------------|-----------|-------|--------|------------|---------------|---------------|---|
| 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  |
| 600705              | 中航投资 | 2014-03-20 | 2015-03-19 | 非公开发行流通受限 | 14.54 | 14.97  | 700,000.00 | 10,178,000.00 | 10,479,000.00 | 2014 年 7 月 23 日除权除息，比例：每 10 股派现金红利 0.70 元（含税） |

注：截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截止本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 92,091,301.86 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）      | 期末估值总额        |
|--------|----------|------------|--------|------------|---------------|
| 130231 | 13 国开 31 | 2014-07-07 | 94.45  | 200,000.00 | 18,890,000.00 |
| 140205 | 14 国开 05 | 2014-07-04 | 107.06 | 50,000.00  | 5,353,000.00  |
| 130231 | 13 国开 31 | 2014-07-07 | 94.45  | 220,000.00 | 20,779,000.00 |
| 130231 | 13 国开 31 | 2014-07-10 | 94.45  | 213,000.00 | 20,117,850.00 |
| 138001 | 13 铁道 01 | 2014-07-14 | 99.58  | 311,000.00 | 30,969,380.00 |

|    |  |  |  |            |               |
|----|--|--|--|------------|---------------|
| 合计 |  |  |  | 994,000.00 | 96,109,230.00 |
|----|--|--|--|------------|---------------|

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 301,000,000.00 元，于 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 7 月 16 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他重大事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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              | 56,773,454.98  | 8.75          |
|    | 其中：股票             | 56,773,454.98  | 8.75          |
| 2  | 固定收益投资            | 549,831,295.76 | 84.76         |
|    | 其中：债券             | 549,831,295.76 | 84.76         |
|    | 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      | 10,879,577.11  | 1.68          |
| 7  | 其他各项资产            | 31,184,727.05  | 4.81          |
| 8  | 合计                | 648,669,054.90 | 100.00        |

7.2 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              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 42,760,199.73 | 17.11         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| 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  | 1,330,212.80  | 0.53          |
| J  | 金融业              | 10,479,000.00 | 4.19          |
| K  | 房地产业             | -             | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 2,204,042.45  | 0.88          |
| 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               | 56,773,454.98 | 22.72         |

7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 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  | 600887 | 伊利股份 | 427,000 | 14,142,240.00 | 5.66         |
| 2  | 600705 | 中航投资 | 700,000 | 10,479,000.00 | 4.19         |
| 3  | 600893 | 航空动力 | 310,051 | 7,990,014.27  | 3.20         |
| 4  | 002080 | 中材科技 | 629,894 | 6,576,093.36  | 2.63         |
| 5  | 600315 | 上海家化 | 149,914 | 5,494,348.10  | 2.20         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 6  | 002312 | 三泰电子 | 167,000 | 3,401,790.00 | 1.36 |
| 7  | 600855 | 航天长峰 | 130,200 | 2,229,024.00 | 0.89 |
| 8  | 000826 | 桑德环境 | 96,457  | 2,204,042.45 | 0.88 |
| 9  | 002230 | 科大讯飞 | 50,008  | 1,330,212.80 | 0.53 |
| 10 | 002202 | 金风科技 | 140,000 | 1,328,600.00 | 0.53 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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  | 600887 | 伊利股份 | 16,767,764.15 | 3.20            |
| 2  | 002080 | 中材科技 | 11,311,235.85 | 2.16            |
| 3  | 600705 | 中航投资 | 10,178,000.00 | 1.94            |
| 4  | 600085 | 同仁堂  | 5,569,061.26  | 1.06            |
| 5  | 600315 | 上海家化 | 4,892,967.02  | 0.93            |
| 6  | 002312 | 三泰电子 | 4,381,482.26  | 0.84            |
| 7  | 002181 | 粤传媒  | 3,633,105.80  | 0.69            |
| 8  | 600703 | 三安光电 | 3,597,583.18  | 0.69            |
| 9  | 600708 | 海博股份 | 3,065,768.85  | 0.59            |
| 10 | 000826 | 桑德环境 | 3,014,147.54  | 0.58            |
| 11 | 002318 | 久立特材 | 2,415,536.05  | 0.46            |
| 12 | 300090 | 盛运股份 | 2,264,541.61  | 0.43            |
| 13 | 002202 | 金风科技 | 1,521,233.06  | 0.29            |
| 14 | 600499 | 科达洁能 | 1,490,563.07  | 0.28            |
| 15 | 600416 | 湘电股份 | 1,475,198.30  | 0.28            |
| 16 | 600316 | 洪都航空 | 1,333,398.94  | 0.25            |
| 17 | 600855 | 航天长峰 | 710,997.76    | 0.14            |
| 18 | 002531 | 天顺风能 | 393,516.00    | 0.08            |
| 19 | 600066 | 宇通客车 | 393,400.00    | 0.08            |
| 20 | 000541 | 佛山照明 | 273,718.60    | 0.05            |

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 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。

##### 7.4.2 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  | 600893 | 航空动力 | 27,754,555.92 | 5.30            |
| 2  | 002230 | 科大讯飞 | 25,507,408.23 | 4.87            |
| 3  | 600705 | 中航投资 | 21,387,125.24 | 4.08            |
| 4  | 600499 | 科达洁能 | 8,630,144.21  | 1.65            |
| 5  | 600118 | 中国卫星 | 4,871,173.03  | 0.93            |
| 6  | 600085 | 同仁堂  | 4,780,141.43  | 0.91            |
| 7  | 600855 | 航天长峰 | 4,121,158.18  | 0.79            |
| 8  | 600703 | 三安光电 | 3,627,326.37  | 0.69            |
| 9  | 002181 | 粤传媒  | 3,119,291.27  | 0.60            |
| 10 | 600708 | 海博股份 | 2,776,812.00  | 0.53            |
| 11 | 002080 | 中材科技 | 2,602,190.19  | 0.50            |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 2,537,710.71  | 0.48            |
| 13 | 300090 | 盛运股份 | 2,307,960.47  | 0.44            |
| 14 | 002318 | 久立特材 | 2,119,454.49  | 0.40            |
| 15 | 000831 | 五矿稀土 | 1,407,655.40  | 0.27            |
| 16 | 600316 | 洪都航空 | 1,132,065.00  | 0.22            |
| 17 | 000538 | 云南白药 | 771,184.70    | 0.15            |
| 18 | 000826 | 桑德环境 | 768,491.59    | 0.15            |
| 19 | 600416 | 湘电股份 | 668,369.49    | 0.13            |
| 20 | 002229 | 鸿博股份 | 409,582.16    | 0.08            |

#### 7.4.3 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

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 78,839,974.30  |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 122,562,147.64 |

#### 7.5 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      | 20,044,000.00 | 8.02          |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 76,821,000.00 | 30.74         |
|    | 其中：政策性金融债 | 76,821,000.00 | 30.74         |

|   |         |                |        |
|---|---------|----------------|--------|
| 4 | 企业债券    | 418,708,782.10 | 167.57 |
| 5 | 企业短期融资券 | -              | -      |
| 6 | 中期票据    | -              | -      |
| 7 | 可转债     | 34,257,513.66  | 13.71  |
| 8 | 其他      | -              | -      |
| 9 | 合计      | 549,831,295.76 | 220.04 |

### 7.6 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  | 122266  | 13 中信 03 | 1,304,950 | 131,982,643.00 | 52.82        |
| 2  | 130231  | 13 国开 31 | 700,000   | 66,115,000.00  | 26.46        |
| 3  | 1380241 | 13 铁道 01 | 600,000   | 59,748,000.00  | 23.91        |
| 4  | 124241  | 13 烟开发   | 378,990   | 37,520,010.00  | 15.02        |
| 5  | 122826  | 11 北港债   | 320,000   | 32,320,000.00  | 12.93        |

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

- (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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

- (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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本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、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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   | 87,834.62     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 15,478,310.27 |
| 5  | 应收申购款   | 15,618,582.16 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 31,184,727.05 |

### 7.12.4 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 | 11,429,740.00 | 4.57         |
| 2  | 113002 | 工行转债 | 10,540,000.00 | 4.22         |
| 3  | 110022 | 同仁转债 | 6,634,040.00  | 2.65         |
| 4  | 113003 | 重工转债 | 5,450,880.00  | 2.18         |

### 7.12.5 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  | 600705 | 中航投资 | 10,479,000.00 | 4.19         | 非公开发行<br>流通受限 |

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 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 |
| 广发聚鑫债券 A | 1,325    | 142,357.42 | 14,519,845.11 | 7.70%  | 174,103,733.30 | 92.30% |
| 广发聚鑫债券 C | 1,300    | 40,407.16  | 12,138,219.92 | 23.11% | 40,391,082.36  | 76.89% |
| 合计       | 2,625    | 91,867.76  | 26,658,065.03 | 11.05% | 214,494,815.66 | 88.95% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 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 | 广发聚鑫债券 A | 3,167,487.43 | 1.6793%  |
|                  | 广发聚鑫债券 C | 24,038.80    | 0.0458%  |
|                  | 合计       | 3,191,526.23 | 1.3234%  |

### 8.3 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                             | 份额级别     | 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 | 广发聚鑫债券 A | >=100             |
|                                | 广发聚鑫债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | >=100             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 广发聚鑫债券 A | >=100             |
|                                | 广发聚鑫债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | >=100             |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 广发聚鑫债券 A         | 广发聚鑫债券 C         |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2013 年 6 月 5 日)基金份额总额 | 1,172,494,282.35 | 1,536,003,708.87 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 414,078,812.43 | 136,640,486.31 |
| 本报告期基金总申购份额   | 46,499,912.68  | 22,173,131.26  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 271,955,146.70 | 106,284,315.29 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 188,623,578.41 | 52,529,302.28  |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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

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 |    |
| 广发证券 | 2      | 191,196,566.94 | 100.00%      | 174,064.42 | 100.00%    | -  |
| 东莞证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 安信证券 | 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。

**10.7.2 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 |
| 广发证券 | 377,333,235.35 | 100.00%      | 9,576,370,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

广发基金管理有限公司

二〇一四年八月二十九日