

广发聚瑞股票型证券投资基金
2011 年半年度报告
2011 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	34

7.9 投资组合报告附注.....	34
8 基金份额持有人信息.....	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	35
9 开放式基金份额变动.....	35
10 重大事件揭示.....	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
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.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	36
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	40
11 备查文件目录.....	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	42

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发聚瑞股票型证券投资基金
基金简称	广发聚瑞股票
基金主代码	270021
交易代码	270021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月16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	2,149,613,676.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律，把握主题投资机会，通过精选个股和有效的风险控制，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1.资产配置策略</p> <p>本基金为股票型基金，基金的资产配置比例范围为：股票资产占基金资产的60%-95%；现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>2. “主题投资分析框架”策略</p> <p>在股票投资方面，本基金主要采用自上而下的“主题投资分析框架”（Thematic Investing Analysis Frame），通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤，挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票，通过定量和定性相结合的方法，筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。</p>

业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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	赵会军
	联系电话	020-89899117	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市拱北情侣南路 255号4层	北京市西城区复兴门内大街 55号
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	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		王志伟	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	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（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	52,091,135.11
本期利润	-206,789,132.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0892
本期加权平均净值利润率	-7.93%
本期基金份额净值增长率	-6.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	274,172,097.26
期末可供分配基金份额利润	0.1275
期末基金资产净值	2,423,785,773.36
期末基金份额净值	1.128
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.79%

注：（1）所述基金财务指标不包括持有人认购和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。

（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）。

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

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	7.33%	1.10%	1.05%	1.35%	6.28%	-0.25%
过去三个月	2.36%	1.13%	-4.27%	3.89%	6.63%	-2.76%
过去六个月	-6.78%	1.34%	-1.89%	3.52%	-4.89%	-2.18%
过去一年	29.06%	1.54%	15.06%	2.78%	14.00%	-1.24%
自基金成立起至今	12.79%	1.71%	2.90%	2.28%	9.89%	-0.57%

注：业绩比较基准：80%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数。

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

广发聚瑞股票型证券投资基金

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

(2009 年 6 月 16 日至 2011 年 6 月 30 日)



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1.2亿元人民币。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、香江投资有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司具有企业年金投资管理人、QDII、特定资产管理业务资格和社保基金投资管理人资格。

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17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、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、机

构理财部、市场拓展部、国际业务部。此外，还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人管理十九只开放式基金——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、广发亚太（除日本）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、广发聚祥保本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和广发标普全球农业指数证券投资基金，管理资产规模为 1022.81 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

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		
刘明月	本基金的基 金经理	2009-06-16	-	7	男，中国籍，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2004 年 7 月至 2007 年 2 月任广发基金管理有限公司研究发展部研究员，2007 年 2 月至 2009 年 5 月先后任广发基金管理有限公司研究发展部副总经理、机构投资部总经理，2009 年 6 月 16 日起任广发聚瑞股票基金的基金经理。

注：1. 基金经理的“任职日期”和“离职日期”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《证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚瑞股票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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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（指数型基金除外）；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，确保交易的公平。

监察稽核部风险控制管理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；监察稽核部稽核岗通过对投资、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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发小盘股票、广发聚丰股票、广发核心精选股票、广发行业领先股票。报告期内，本投资组合与广发小盘股票、广发核心精选股票、广发行业领先股票的净值增长率差异均未超过 5%。报告期内，本投资组合与广发聚丰股票的净值增长率差异为 5.17%，主要原因是本投资组合与上述投资组合在行业配置方面存在一定差异所致。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、市场回顾：

2011 年上半年市场整体表现为振荡行情，1 季度银行、保险、有色、钢铁、煤炭等行业表现较好，而 2 季度医药、食品饮料、新能源、新材料等稳定类行业表现比较好。主要原因是经济形势比较复杂，通胀高，房地产调控效果不好，投资者比较迷茫，所以呈现出振荡行情。

2、操作回顾：

广发聚瑞上半年的配置方向为稳定增长类行业，重点配置了食品饮料、医药、纺织服装、能源设备、节能减排等行业，对强周期类股票配置比较少，所以 2 季度表现相对好些。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

聚瑞上半年收益率为-6.78%，而基准收益率为-1.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内方面，房价和物价居高不下，政府调控房地产将是一场持久战，目前金融政策的态势还将维持。政府在没有看到调控效果时不可能放松紧缩政策，预期第 3 季度开始我国的投资增速和总体经济增速将有所回落。

国外方面，各国经济恢复程度不一，经济增速有高有低，一些较发达国家因担忧通胀开始加息，复苏速度缓慢，而新兴发展中国家因通胀比较严重仍将实施紧缩的货币政策，不断收缩流动性，经济增速预期也会回落。

基于前述判断和市场走势，我们对强周期类股票和大金融类股票仍比较谨慎。重点投资方向为大消费行业和经济结构调整、优化受益的行业，总体布局在中下游行业。

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

本报告期内本基金未进行利润分配，期末可供分配利润为 274,172,097.26 元。

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

2011 年上半年，本基金托管人在对广发聚瑞股票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

2011 年上半年，广发聚瑞股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在

广发聚瑞股票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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发聚瑞股票型证券投资基金未进行利润分配。

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瑞股票型证券投资基金 2011 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	132,578,583.80	350,968,770.19
结算备付金		1,968,675.00	5,298,553.81
存出保证金		2,436,420.12	6,032,917.74
交易性金融资产	6.4.7.2	2,283,135,186.50	2,802,690,960.69
其中：股票投资		2,283,135,186.50	2,802,690,960.69
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,712,195.42	-
应收利息	6.4.7.5	22,796.19	34,439.23
应收股利		-	-
应收申购款		4,424,906.32	15,921,055.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,434,278,763.35	3,180,946,697.42

负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	98,904,337.00
应付赎回款		5,094,737.25	4,148,624.88
应付管理人报酬		2,843,872.43	3,596,285.97
应付托管费		473,978.74	599,381.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	1,875,481.03	3,130,116.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	204,920.54	96,273.67
负债合计		10,492,989.99	110,475,018.81
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	2,149,613,676.10	2,536,837,724.02
未分配利润	6.4.7.9	274,172,097.26	533,633,954.59
所有者权益合计		2,423,785,773.36	3,070,471,678.61
负债和所有者权益总计		2,434,278,763.35	3,180,946,697.42

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.128 元，基金份额总额 2,149,613,676.10 份。

6.2 利润表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-178,357,186.46	-646,103,597.73
1.利息收入		701,728.05	1,079,157.62
其中：存款利息收入	6.4.7.10	701,728.05	1,079,157.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收		-	-

入			
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		78,944,156.54	139,984,300.52
其中：股票投资收益	6.4.7.11	69,448,034.74	129,252,267.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	9,496,121.80	10,732,032.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-258,880,267.50	-788,916,211.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	877,196.45	1,749,156.00
减：二、费用		28,431,945.93	42,938,218.62
1. 管理人报酬		19,449,191.92	26,972,094.78
2. 托管费		3,241,531.96	4,495,349.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.15	5,533,387.28	11,257,943.60
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.16	207,834.77	212,831.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-206,789,132.39	-689,041,816.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-206,789,132.39	-689,041,816.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	2,536,837,724.02	533,633,954.59	3,070,471,678.61

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-206,789,132.39	-206,789,132.39
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）	-387,224,047.92	-52,672,724.94	-439,896,772.86
其中：1. 基金申购款	338,543,943.26	41,686,512.46	380,230,455.72
2. 基金赎回款	-725,767,991.18	-94,359,237.40	-820,127,228.58
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）	2,149,613,676.10	274,172,097.26	2,423,785,773.36
项目	上年度可比期间		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	4,204,802,094.46	313,139,488.82	4,517,941,583.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-689,041,816.35	-689,041,816.35
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）	-759,172,982.46	-59,753,878.78	-818,926,861.24
其中：1. 基金申购款	600,686,934.23	-20,804.52	600,666,129.71
2. 基金赎回款	-1,359,859,916.69	-59,733,074.26	-1,419,592,990.95
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）	3,445,629,112.00	-435,656,206.31	3,009,972,905.69

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王志伟，主管会计工作负责人：林传辉，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

广发聚瑞股票型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2009]348 号文《关于同意广发聚瑞股票型证券投资基金募集的批复》的批准,由基金发起人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《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2009 年 6 月 16 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。本基金已向中国证券监督管理委员会备案,并获基金部函[2009]407 号《广发聚瑞股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期间为 2009 年 5 月 13 日至 2009 年 6 月 12 日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币 7,070,893,298.01 元,有效认购户数为 101,082 户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 997,938.74 元,折合基金份额 997,938.74 份,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。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2009 年 6 月 16 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,070,893,298.01 份。

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》等有关规定和基金合同的有关规定,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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准:80%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数。

本基金的财务报表于 2011 年 8 月 26 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、基金合同、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 上半年度

的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

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》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、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。
- 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，对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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	132,578,583.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	132,578,583.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,968,450,402.36	2,283,135,186.50	314,684,784.14
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,968,450,402.36	2,283,135,186.50	314,684,784.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有买入返售证券金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有买断式回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	21,998.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	797.31
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	22,796.19

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,875,481.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,875,481.03

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,981.44
预提费用	192,939.10
合计	204,920.54

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	2,536,837,724.02
本期申购	-	338,543,943.26
本期赎回（以“-”号填列）	-	-725,767,991.18
本期末	-	2,149,613,676.10

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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
上年度末	280,248,906.17	253,385,048.42	533,633,954.59
本期利润	52,091,135.11	-258,880,267.50	-206,789,132.39
本期基金份额交易产生的变动数	-45,632,140.76	-7,040,584.18	-52,672,724.94
其中：基金申购款	39,557,079.91	2,129,432.55	41,686,512.46
基金赎回款	-85,189,220.67	-9,170,016.73	-94,359,237.40

本期已分配利润	-	-	-
本期末	286,707,900.52	-12,535,803.26	274,172,097.26

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
活期存款利息收入		649,364.75
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		32,444.50
其他		19,918.80
合计		701,728.05

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
卖出股票成交总额		2,015,227,382.65
减：卖出股票成本总额		1,945,779,347.91
买卖股票差价收入		69,448,034.74

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
股票投资产生的股利收益		9,496,121.80
基金投资产生的股利收益		-
合计		9,496,121.80

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
1. 交易性金融资产		-258,880,267.50
——股票投资		-258,880,267.50
——债券投资		-
——资产支持证券投资		-
——基金投资		-
2. 衍生工具		-
——权证投资		-
3. 其他		-
合计		-258,880,267.50

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	663,328.31
转换费	213,868.14
合计	877,196.45

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	5,533,387.28
银行间市场交易费用	-
合计	5,533,387.28

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	10,395.67
账户维护费	9,000.00
合计	207,834.77

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期新增关联方广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)，为基金管理人的全资子公司。

6.4.9.2 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
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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	136,456,033.52	3.69%	2,184,812,424.85	30.48%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期末通过关联方席位进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期末通过关联方席位进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期末通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	115,986.59	4.08%	1,875,481.03	6.18%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1,791,289.37	30.04%	934,475.68	28.70%

注：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）。

上述佣金按市场佣金率计算，佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,449,191.92	26,972,094.78
其中：支付销售机构的客户维护费	3,315,409.15	4,690,205.94

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,241,531.96	4,495,349.16

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期本基金未与关联方进行银行间同业市场的证券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
----	--------------------------------	---------------------------------

期初持有的基金份额	48,262,548.26	-
期间申购/买入总份额	25,795,356.84	48,262,548.26
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	74,057,905.10	48,262,548.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.45%	1.40%

注：基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国工商银行股份有限公司	132,578,583.80	649,386.75	209,065,289.25	1,035,976.05

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。
上年度可比期内本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600199	金种子酒	2010-12-14	2011-12-08	非公开发行流通受限	16.02	16.30	800,000	12,816,000.00	13,040,000.00	-

注：截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有流通受限的债券及其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金未进行交易所市场债券正回购交易。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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体系的建设，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。

6.4.13.2 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，本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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。

截止 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 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，其余亦可银行间同业市场交易，除前文所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)的合同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。

对流动性风险的监控和管理,本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断,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。

6.4.13.4 市场风险

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的风险,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、外汇风险和市场价格风险。

6.4.13.4.1 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、VAR 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	132,578,583.80	-	-	-	132,578,583.80
结算备付金	1,968,675.00	-	-	-	1,968,675.00
存出保证金	-	-	-	2,436,420.12	2,436,420.12
交易性金融资产	-	-	-	2,283,135,186.50	2,283,135,186.50
应收证券清算款	-	-	-	9,712,195.42	9,712,195.42
应收利息	-	-	-	22,796.19	22,796.19
应收申购款	4,424,906.32	-	-	-	4,424,906.32
资产总计	138,972,165.12	-	-	2,295,306,598.23	2,434,278,763.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,094,737.25	5,094,737.25
应付管理人报酬	-	-	-	2,843,872.43	2,843,872.43
应付托管费	-	-	-	473,978.74	473,978.74
应付交易费用	-	-	-	1,875,481.03	1,875,481.03
其他负债	-	-	-	204,920.54	204,920.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	10,492,989.99	10,492,989.99
利率敏感度缺口	138,972,165.12	-	-	2,284,813,608.24	2,423,785,773.36
上年度末2010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	350,968,770.19	-	-	-	350,968,770.19
结算备付金	5,298,553.81	-	-	-	5,298,553.81
存出保证金	6,032,917.74	-	-	-	6,032,917.74
交易性金融资产	-	-	-	2,802,690,960.69	2,802,690,960.69
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	34,439.23	34,439.23
应收申购款	15,921,055.76	-	-	-	15,921,055.76
资产总计	378,221,297.50	-	-	2,802,725,399.92	3,180,946,697.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,148,624.88	4,148,624.88
应付管理人报酬	-	-	-	3,596,285.97	3,596,285.97
应付托管费	-	-	-	599,381.01	599,381.01
应付交易费用	-	-	-	3,130,116.28	3,130,116.28
其他负债	-	-	-	96,273.67	96,273.67
应付证券清算款	-	-	-	98,904,337.00	98,904,337.00
负债总计	-	-	-	110,475,018.81	110,475,018.81
利率敏感度缺口	378,221,297.50	-	-	2,692,250,381.11	3,070,471,678.61

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指以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、VAR 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,283,135,186.50	94.20	2,802,690,960.69	91.28
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,283,135,186.50	94.20	2,802,690,960.69	91.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准（80%×沪深300指数+20%×中证全债指数）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）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	101,156,699.25	124,457,615.03
	业绩比较基准下降5%	-101,156,699.25	-124,457,615.03

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明的会计事项。

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	2,283,135,186.50	93.79
	其中：股票	2,283,135,186.50	93.79
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	134,547,258.80	5.53
6	其他各项资产	16,596,318.05	0.68
7	合计	2,434,278,763.35	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	24,588,615.84	1.01
B	采掘业	1,952,000.00	0.08
C	制造业	1,160,800,462.94	47.89
C0	食品、饮料	572,870,284.25	23.64
C1	纺织、服装、皮毛	121,907,173.58	5.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,735,859.50	0.53
C5	电子	90,315,778.14	3.73
C6	金属、非金属	4,026,373.00	0.17
C7	机械、设备、仪表	20,048,316.95	0.83
C8	医药、生物制品	338,896,677.52	13.98
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	303,002,862.43	12.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	253,410,122.10	10.46
H	批发和零售贸易	181,872,813.20	7.50
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	357,508,309.99	14.75
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,283,135,186.50	94.20

7.3 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

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	600406	国电南瑞	6,295,896	228,541,024.80	9.43
2	600252	中恒集团	12,268,980	228,325,717.80	9.42
3	002081	金螳螂	4,789,361	192,532,312.20	7.94
4	002304	洋河股份	1,140,718	143,912,982.88	5.94
5	002051	中工国际	4,484,844	122,884,725.60	5.07
6	600199	金种子酒	7,236,414	120,881,570.36	4.99
7	002269	美邦服饰	3,686,928	110,497,232.16	4.56
8	601117	中国化学	12,089,879	107,116,327.94	4.42
9	002140	东华科技	3,652,418	100,258,874.10	4.14
10	002236	大华股份	1,994,166	90,315,778.14	3.73
11	000568	泸州老窖	1,829,777	82,559,538.24	3.41
12	002375	亚厦股份	2,578,990	76,080,205.00	3.14
13	002293	罗莱家纺	785,098	60,884,349.90	2.51
14	000858	五粮液	1,690,000	60,366,800.00	2.49
15	000596	古井贡酒	659,786	52,439,791.28	2.16
16	000869	张裕 A	500,507	49,450,091.60	2.04
17	002503	搜于特	1,237,172	40,727,702.24	1.68
18	600809	山西汾酒	500,528	35,061,986.40	1.45
19	000538	云南白药	592,675	33,829,889.00	1.40
20	002327	富安娜	781,768	32,802,985.28	1.35
21	600785	新华百货	1,099,970	29,347,199.60	1.21
22	600519	贵州茅台	129,981	27,637,860.03	1.14
23	600079	人福科技	1,161,777	25,628,800.62	1.06
24	002065	东华软件	1,049,329	24,869,097.30	1.03
25	600248	延长化建	2,359,752	24,588,615.84	1.01
26	000423	东阿阿胶	547,892	22,606,023.92	0.93
27	002325	洪涛股份	1,099,770	21,489,505.80	0.89
28	002154	报喜鸟	1,450,074	19,430,991.60	0.80
29	000650	仁和药业	1,349,852	19,208,393.96	0.79
30	002123	荣信股份	785,975	17,904,510.50	0.74
31	000826	合加资源	699,895	17,448,382.35	0.72
32	002250	联化科技	399,870	12,735,859.50	0.53
33	002310	东方园林	139,586	12,562,740.00	0.52
34	300070	碧水源	245,000	9,800,000.00	0.40
35	002485	希努尔	395,894	8,788,846.80	0.36
36	600276	恒瑞医药	200,000	5,994,000.00	0.25
37	002541	鸿路钢构	99,910	4,026,373.00	0.17
38	600976	武汉健民	150,198	2,942,378.82	0.12
39	002249	大洋电机	100,000	2,125,000.00	0.09
40	300157	恒泰艾普	61,000	1,952,000.00	0.08

41	300005	探路者	57,024	900,979.20	0.04
42	600537	海通集团	15,283	559,663.46	0.02
43	600859	王府井	10,000	399,700.00	0.02
44	600535	天士力	8,680	357,008.40	0.01
45	600970	中材国际	12,371	338,099.43	0.01
46	002073	软控股份	899	18,519.40	0.00
47	000661	长春高新	94	4,465.00	0.00
48	002006	精工科技	5	287.05	0.00

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	000012	南玻A	105,588,209.98	3.44
2	601117	中国化学	103,054,659.23	3.36
3	600199	金种子酒	67,019,200.13	2.18
4	600750	江中药业	60,737,694.44	1.98
5	000858	五粮液	58,376,235.00	1.90
6	600770	综艺股份	56,247,799.59	1.83
7	000568	泸州老窖	52,221,295.66	1.70
8	002051	中工国际	48,716,376.16	1.59
9	000869	张裕A	47,742,068.72	1.55
10	000423	东阿阿胶	42,209,621.31	1.37
11	002310	东方园林	41,763,901.10	1.36
12	600000	浦发银行	40,831,473.29	1.33
13	000669	领先科技	37,304,764.49	1.21
14	002249	大洋电机	34,584,081.19	1.13
15	002140	东华科技	33,793,275.09	1.10
16	600785	新华百货	33,495,600.10	1.09
17	002062	宏润建设	33,236,572.40	1.08
18	600869	三普药业	32,566,888.67	1.06
19	600809	山西汾酒	32,130,699.73	1.05
20	601328	交通银行	30,293,102.39	0.99

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	600970	中材国际	181,410,971.10	5.91
2	600976	武汉健民	103,202,188.68	3.36
3	000012	南玻A	94,899,885.45	3.09
4	600750	江中药业	89,339,473.54	2.91
5	600537	海通集团	86,522,327.05	2.82
6	002006	精功科技	83,230,489.12	2.71
7	000568	泸州老窖	72,410,614.05	2.36
8	600535	天士力	66,182,801.55	2.16
9	002232	启明信息	63,006,817.31	2.05
10	002063	远光软件	54,108,164.54	1.76
11	002073	软控股份	53,588,532.72	1.75
12	600770	综艺股份	48,966,402.77	1.59
13	000538	云南白药	47,989,785.71	1.56
14	600000	浦发银行	40,374,254.37	1.31
15	600809	山西汾酒	37,665,476.59	1.23
16	600079	人福医药	37,039,243.40	1.21
17	300086	康芝药业	36,621,191.07	1.19
18	300082	奥克股份	36,288,509.46	1.18
19	600594	益佰制药	35,550,362.63	1.16
20	000826	桑德环境	33,612,217.17	1.09

7.4.3 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	1,945,779,347.91
卖出股票的收入（成交）总额	2,015,227,382.65

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本报告期内,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。

7.9.3 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	2,436,420.12
2	应收证券清算款	9,712,195.42
3	应收股利	-
4	应收利息	22,796.19
5	应收申购款	4,424,906.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,596,318.05

7.9.4 期末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。

7.9.5 期末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未存在流通受限情况。

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

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
61,933	34,708.70	182,222,669.02	8.48%	1,967,391,007.08	91.52%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	405,414.93	0.0189%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年6月16日）基金份额总额	7,070,893,298.01
本报告期期初基金份额总额	2,536,837,724.02
本报告期基金总申购份额	338,543,943.26
减：本报告期基金总赎回份额	725,767,991.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,149,613,676.10

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人重大人事变动：

1. 董事长、法定代表人变更

因我司第三届董事会任期届满，原董事长马庆泉因年龄原因不再任职。2011年3月16日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，选举王志伟为广发基金管理有限公司董事长。在中国证监会核准王志伟的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。董事会授权公司副董事长、总经理林传辉在中国证监会核准拟任董事长的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项前，代为履行董事长职责。代为履行职责的时间不得超过90日，法律、行政法规另有规定的除外。

2011年6月15日，公司在指定信息披露媒体刊登了《基金行业高级管理人员变更公告》，披露因我司拟任董事长王志伟先生的高级管理人员任职资格尚处于报批阶段，在其高管任职

资格获准前，继续由公司副董事长、总经理林传辉先生代为履行董事长职责。 2011 年 7 月 19 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司王志伟基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1119 号）。中国证监会核准了王志伟的基金行业高级管理人员任职资格，并对王志伟任我司董事长无异议。自 2011 年 7 月 19 日起，王志伟正式履行董事长职务。

2011 年 8 月 5 日，我司完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任董事长王志伟。

2. 聘任副总经理

2011 年 3 月 16 日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，董事会新聘任易阳方担任我司副总经理。在中国证监会核准易阳方的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。

2011 年 8 月 11 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司易阳方基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1267 号），中国证监会核准了易阳方的基金行业高级管理人员任职资格，并对易阳方任公司副总经理无异议。

自 2011 年 8 月 11 日起，易阳方副总经理任职正式生效。

本报告期内，基金托管人托管业务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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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

报告期内未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
江海证券	1	503,289,638.28	13.60%	327,137.13	11.50%	-
光大证券	3	462,394,458.47	12.50%	393,032.60	13.81%	-
长江证券	2	423,381,602.75	11.44%	343,999.64	12.09%	-
国信证券	1	419,546,373.44	11.34%	340,883.33	11.98%	-
平安证券	3	353,895,629.57	9.56%	230,031.82	8.08%	-
兴业证券	2	338,793,464.29	9.16%	275,272.32	9.67%	-
中信证券	2	300,547,972.11	8.12%	244,196.70	8.58%	-
安信证券	4	170,566,806.88	4.61%	144,981.98	5.10%	新增 3 个
齐鲁证券	3	137,427,349.21	3.71%	111,660.52	3.92%	新增 1 个
广发证券	6	136,456,033.52	3.69%	115,986.59	4.08%	-
银河证券	2	95,789,280.35	2.59%	77,830.12	2.74%	-
信达证券	1	91,794,919.89	2.48%	59,667.23	2.10%	-
方正证券	2	79,735,247.72	2.15%	48,838.37	1.72%	新增 1 个
华安证券	1	64,568,964.12	1.74%	41,969.21	1.47%	-
华泰联合	4	43,640,631.87	1.18%	35,761.78	1.26%	新增 1 个
广发华福	2	25,928,823.25	0.70%	21,067.32	0.74%	-
红塔证券	1	25,607,594.24	0.69%	15,684.63	0.55%	新增 1 个
英大证券	1	24,008,081.91	0.65%	15,605.11	0.55%	-
中银国际	1	2,958,352.00	0.08%	1,922.91	0.07%	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
国泰君安	4	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	新增 1 个
中投证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	新增 1 个
国联证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
国元证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
浙商证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
联讯证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
南京证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中航证券	2	-	-	-	-	新增 1 个

注：（1）交易席位选择标准：

- a 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- b 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- c 具备基金运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足基金进行证券交易的需要；
- d 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；
- e 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；
- f 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

a 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。

b 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
江海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

注：本报告期本基金不存在租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	广发基金管理有限公司关于增加财达证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-24
2	广发基金管理有限公司关于增加哈尔滨银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-14
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加海通证券基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-21
4	广发基金管理有限公司关于调整旗下基金通过中信建投证券定期定额投资申购起点金额的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
5	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
6	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销（含定期定额投资）申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
7	广发基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购广发聚瑞股票型证券投资基金的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-16
8	广发基金管理有限公司关于增加中信证券为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-17
9	广发基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行作为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》	2011-03-17
10	广发基金管理有限公司关于增加红塔证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》	2011-03-17
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加东莞银行网上银行及定期定额方式申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
12	广发基金管理有限公司关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
13	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行·盈基金2011”网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-06
14	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-11
15	广发基金管理有限公司关于增加国金证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-12
16	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加	《中国证券报》、	2011-04-12

	华夏银行基金定投申购费率优惠的公告	《证券时报》、《上海证券报》	
17	广发基金管理有限公司关于增加中天证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
18	广发基金管理有限公司关于增加浙江稠州商业银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
19	广发基金管理有限公司关于增加联讯证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-03
20	广发基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券推出定期定额投资等业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-11

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发聚瑞股票型证券投资基金募集的文件；
2. 《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》；
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《广发聚瑞股票型证券投资基金托管协议》；
5. 《广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版；
6. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一一年八月二十九日