

广发聚瑞股票型证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：二〇一二年八月二十七日

1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 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.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35

7.9 投资组合报告附注.....	35
8 基金份额持有人信息.....	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
9 开放式基金份额变动.....	36
10 重大事件揭示.....	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	37
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.....	38
10.8 其他重大事件.....	42
11 备查文件目录.....	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

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	3,413,882,187.29份
基金合同存续期	不定期

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	020-83936666	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（2012年1月1日至2012年6月30日）
本期已实现收益	-84,451,353.14
本期利润	625,945,678.79
加权平均基金份额本期利润	0.1946
本期加权平均净值利润率	18.40%
本期基金份额净值增长率	19.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	269,904,633.23
期末可供分配基金份额利润	0.0791
期末基金资产净值	4,032,483,449.62
期末基金份额净值	1.181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.10%

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	1.81%	1.24%	-5.09%	0.87%	6.90%	0.37%
过去三个月	16.82%	1.25%	0.70%	0.89%	16.12%	0.36%
过去六个月	19.66%	1.53%	4.57%	1.06%	15.09%	0.47%
过去一年	4.70%	1.41%	-13.76%	1.07%	18.46%	0.34%
过去三年	17.28%	1.63%	-15.36%	1.25%	32.64%	0.38%
自基金合同生效起	18.10%	1.62%	-11.20%	1.25%	29.30%	0.37%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

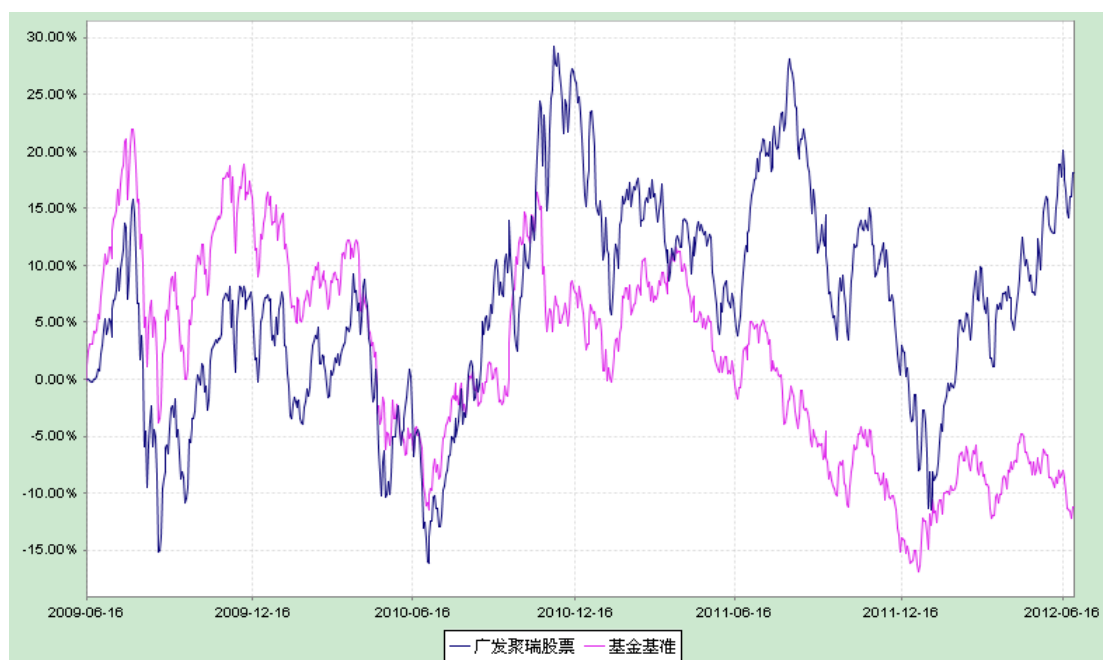
注：业绩比较基准： $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证全债指数}$ 。
业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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 2012 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、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、深圳理财中心、杭州理财中心和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人管理二十四只开放式基金——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、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和广发消费品精选股票型证券投资基金，管理资产规模为 1207.82 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金、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		
刘明月	本基金的基 金经理	2009-06-16	-	8	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，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需要进行反向交易的，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：

上半年市场整体表现为震荡行情，上上下下最后收平。医药、食品饮料、品牌服装等行业表现较好，银行、煤炭、有色等行业表现要差些，防御性行业和品种表现相对较好。大盘下跌的主要原因是对于房地产调控和欧债危机导致经济增速下降的担忧，在经济预期不好的前提下消费等防御品种表现相对要好些。

2、操作回顾：

广发聚瑞上半年配置方向为稳定增长类行业，重点配置了食品饮料、装饰园林、医药、纺织服装、节能减排等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

聚瑞本报告期收益率为 19.66%，而基准收益率为 4.57%，跑赢基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内宏观政策已转向为稳增长。通胀压力已下降，国内商品房市场调控初见成效，流动性相关政策已定向宽松，总之对过去的宏观调控政策进行了预调微调。国内经济依然在增长、结构和通胀之间进行均衡，政府在流动性定向宽松、产业政策、财政税收等方面陆续出台了一些稳增长调结构的措施。个人仍认为国内经济增速会放缓但也不会急降，稳增长已成为主要矛盾。

国内房地产调控和欧债危机对未来国内外经济的影响仍不确定，投资者尽管对今年经济增速的预期已降低，但到底能稳定在什么水平心里还是没底。

基于前述判断和市场走势，对强周期类股票和大金融类股票仍比较谨慎。重点投资方向仍为大消费类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，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

本基金本报告期内未进行利润分配，本基金本期末可供分配利润为 269,904,633.23 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

2012 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

2012 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 2012 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	374,906,393.80	371,793,931.13
结算备付金		4,573,374.10	226,462.68
存出保证金		2,132,892.01	2,214,912.52
交易性金融资产	6.4.7.2	3,701,994,081.11	2,869,872,491.87
其中：股票投资		3,701,994,081.11	2,869,872,491.87
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	66,333.67	51,323.36
应收股利		-	-
应收申购款		15,248,538.56	3,960,142.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,098,921,613.25	3,248,119,263.65

负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		51,751,216.97	141,845,722.72
应付赎回款		5,625,068.17	8,641,404.38
应付管理人报酬		4,686,022.15	4,159,781.99
应付托管费		781,003.71	693,296.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,384,986.81	2,736,505.65
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,865.82	318,559.18
负债合计		66,438,163.63	158,395,270.90
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,413,882,187.29	3,129,721,610.26
未分配利润	6.4.7.10	618,601,262.33	-39,997,617.51
所有者权益合计		4,032,483,449.62	3,089,723,992.75
负债和所有者权益总计		4,098,921,613.25	3,248,119,263.65

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.181 元，基金份额总额 3,413,882,187.29 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		661,002,625.39	-178,357,186.46
1.利息收入		993,515.80	701,728.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	993,515.80	701,728.05
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）		-51,487,351.80	78,944,156.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-69,073,809.82	69,448,034.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	17,586,458.02	9,496,121.80
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	710,397,031.93	-258,880,267.50
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	1,099,429.46	877,196.45
减：二、费用		35,056,946.60	28,431,945.93
1. 管理人报酬		25,166,916.08	19,449,191.92
2. 托管费		4,194,486.05	3,241,531.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,490,824.53	5,533,387.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	204,719.94	207,834.77
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		625,945,678.79	-206,789,132.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		625,945,678.79	-206,789,132.39

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	3,129,721,610.26	-39,997,617.51	3,089,723,992.75

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	625,945,678.79	625,945,678.79
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）	284,160,577.03	32,653,201.05	316,813,778.08
其中：1. 基金申购款	1,206,238,161.97	101,050,841.64	1,307,289,003.61
2. 基金赎回款	-922,077,584.94	-68,397,640.59	-990,475,225.53
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）	3,413,882,187.29	618,601,262.33	4,032,483,449.62
项目	上年度可比期间		
	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

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 2012 年 8 月 24 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 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相一致。

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》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 2012年6月30日
活期存款	374,906,393.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	374,906,393.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,084,745,091.07	3,701,994,081.11	617,248,990.04
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		3,084,745,091.07	3,701,994,081.11	617,248,990.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金报告期末无买断式回购交易中取得的债权。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	64,481.38
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	1,852.29
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	66,333.67

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,384,986.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,384,986.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,404.32
预提费用	193,461.50
合计	209,865.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,129,721,610.26	3,129,721,610.26
本期申购	1,206,238,161.97	1,206,238,161.97
本期赎回（以“-”号填列）	-922,077,584.94	-922,077,584.94
本期末	3,413,882,187.29	3,413,882,187.29

注：本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 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	330,718,346.85	-370,715,964.36	-39,997,617.51
本期利润	-84,451,353.14	710,397,031.93	625,945,678.79
本期基金份额交易产生的变动数	23,637,639.52	9,015,561.53	32,653,201.05

其中：基金申购款	102,119,398.14	-1,068,556.50	101,050,841.64
基金赎回款	-78,481,758.62	10,084,118.03	-68,397,640.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	269,904,633.23	348,696,629.10	618,601,262.33

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	966,958.51
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	23,387.02
其他	3,170.27
合计	993,515.80

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	1,799,030,687.79
减：卖出股票成本总额	1,868,104,497.61
买卖股票差价收入	-69,073,809.82

6.4.7.13 债券投资收益

本基金报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,586,458.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,586,458.02

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	710,397,031.93
——股票投资	710,397,031.93

——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	710,397,031.93

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	772,336.94
基金转换费收入	327,092.52
其他	-
合计	1,099,429.46

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	5,490,824.53
银行间市场交易费用	-
合计	5,490,824.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	6,758.44
账户维护费	9,000.00
合计	204,719.94

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

2012年8月1日，广发基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议决议，将公司旗下基金年审会计师事务所由深圳市鹏城会计师事务所有限公司更换为天健会计师事务所(特殊普通合伙)。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	33,905,448.25	0.90%	136,456,033.52	3.69%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内无通过关联方席位进行权证的交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内无通过关联方席位进行的债券交易。

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间内无通过关联方席位进行的债券回购交易。

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 2012年1月1日至2012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	27,912.43	0.92%	4,260.64	0.13%
关联方名称	上年度可比期间 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%

司				
---	--	--	--	--

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. 上述佣金按市场佣金率计算，佣金比率是公允的。

3. 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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,166,916.08	19,449,191.92
其中：支付销售机构的客户 维护费	3,554,520.73	3,315,409.15

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。管理费的计算方法如下：

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	4,194,486.05	3,241,531.96

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

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间内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（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 2012年1月1日至2012年6月	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
----	-------------------------	---------------------------------

	30日	
期初持有的基金份额	74,057,905.10	48,262,548.26
期间申购/买入总份额	-	25,795,356.84
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	74,057,905.10
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.17%	3.45%

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	374,906,393.80	966,958.51	132,578,583.80	649,364.75

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

6.4.11 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（2012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
002029	七匹狼	2012-06-26	2013-06-27	非公开发行流通受限	23.00	23.08	900,000	20,700,000.00	20,772,000.00	-

002081	金螳螂	2011-11-23	2012-11-26	非公开发行流通受限	36.00	32.23	1,200,000	28,800,000	38,676,000.00	2012年5月22日分红送股，比例：每10股转5股派发现金红利2元（含税）
--------	-----	------------	------------	-----------	-------	-------	-----------	------------	---------------	---------------------------------------

注：截至本报告期末 2012 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

截止本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金无暂时停牌等流通受限股票。

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 2012 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

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公司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交易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。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资。

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 2012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	374,906,393.80	-	-	-	374,906,393.80
结算备付金	4,573,374.10	-	-	-	4,573,374.10
存出保证金	-	-	-	2,132,892.01	2,132,892.01
交易性金融资 产	-	-	-	3,701,994,081. 11	3,701,994,081. 11
应收利息	-	-	-	66,333.67	66,333.67
应收申购款	15,248,538.56	-	-	-	15,248,538.56
资产总计	394,728,306.46	-	-	3,704,193,306. 79	4,098,921,613. 25
负债					
应付证券清算 款	-	-	-	51,751,216.97	51,751,216.97
应付赎回款	-	-	-	5,625,068.17	5,625,068.17
应付管理人报 酬	-	-	-	4,686,022.15	4,686,022.15
应付托管费	-	-	-	781,003.71	781,003.71
应付交易费用	-	-	-	3,384,986.81	3,384,986.81
其他负债	-	-	-	209,865.82	209,865.82
负债总计	-	-	-	66,438,163.63	66,438,163.63
利率敏感度缺 口	394,728,306.46	-	-	3,637,755,143. 16	4,032,483,449. 62
上年度末2011 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	371,793,931.13	-	-	-	371,793,931.13
结算备付金	226,462.68	-	-	-	226,462.68
存出保证金	-	-	-	2,214,912.52	2,214,912.52
交易性金融资 产	-	-	-	2,869,872,491. 87	2,869,872,491. 87
应收利息	-	-	-	51,323.36	51,323.36

应收申购款	3,960,142.09	-	-	-	3,960,142.09
资产总计	375,980,535.90	-	-	2,872,138,727.75	3,248,119,263.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	141,845,722.72	141,845,722.72
应付赎回款	-	-	-	8,641,404.38	8,641,404.38
应付管理人报酬	-	-	-	4,159,781.99	4,159,781.99
应付托管费	-	-	-	693,296.98	693,296.98
应付交易费用	-	-	-	2,736,505.65	2,736,505.65
其他负债	-	-	-	318,559.18	318,559.18
负债总计	-	-	-	158,395,270.90	158,395,270.90
利率敏感度缺口	375,980,535.90	-	-	2,713,743,456.85	3,089,723,992.75

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	3,701,994,081.11	91.80	2,869,872,491.87	92.88
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,701,994,081.11	91.80	2,869,872,491.87	92.88

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：人民币元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	业绩比较基准上升5%	232,536,827.06	151,981,611.86
	业绩比较基准下降5%	-232,536,827.06	-151,981,611.86

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	3,701,994,081.11	90.32
	其中：股票	3,701,994,081.11	90.32
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	379,479,767.90	9.26
6	其他各项资产	17,447,764.24	0.43
7	合计	4,098,921,613.25	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	61,068,684.30	1.51
B	采掘业	10,840.50	0.00
C	制造业	1,869,042,684.73	46.35
C0	食品、饮料	1,231,727,469.75	30.55
C1	纺织、服装、皮毛	188,123,077.58	4.67
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,741,472.50	0.17
C5	电子	355,818,117.93	8.82
C6	金属、非金属	352,451.60	0.01
C7	机械、设备、仪表	7,880.27	0.00
C8	医药、生物制品	86,272,215.10	2.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	948,657,728.33	23.53
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	131,330,138.10	3.26
H	批发和零售贸易	191,656,821.50	4.75
I	金融、保险业	3,780,500.00	0.09
J	房地产业	91,631,815.10	2.27
K	社会服务业	404,814,868.55	10.04
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,701,994,081.11	91.80

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	002081	金螳螂	8,956,791	333,434,058.00	8.27
2	002310	东方园林	4,874,846	286,202,208.66	7.10
3	002304	洋河股份	1,990,507	267,822,716.85	6.64
4	600199	金种子酒	10,431,348	260,575,073.04	6.46
5	601117	中国化学	42,549,901	245,512,928.77	6.09

6	002236	大华股份	6,395,392	196,338,534.40	4.87
7	600702	沱牌舍得	5,378,984	194,988,170.00	4.84
8	002503	搜于特	7,068,508	161,161,982.40	4.00
9	002051	中工国际	5,984,078	158,937,111.68	3.94
10	000799	酒鬼酒	2,949,560	154,556,944.00	3.83
11	002140	东华科技	6,714,290	129,250,082.50	3.21
12	000596	古井贡酒	2,555,615	120,727,252.60	2.99
13	002241	歌尔声学	3,289,777	120,043,962.73	2.98
14	600519	贵州茅台	451,852	108,060,405.80	2.68
15	600406	国电南瑞	4,993,814	93,334,383.66	2.31
16	002293	罗莱家纺	1,111,903	82,947,963.80	2.06
17	600809	山西汾酒	2,155,464	81,239,438.16	2.01
18	002477	雏鹰农牧	3,239,718	61,068,684.30	1.51
19	002375	亚厦股份	2,403,272	59,336,785.68	1.47
20	002482	广田股份	3,363,407	58,691,452.15	1.46
21	000989	九芝堂	3,459,731	56,047,642.20	1.39
22	002431	棕榈园林	2,099,942	54,157,504.18	1.34
23	600048	保利地产	3,859,366	43,765,210.44	1.09
24	002415	海康威视	1,449,839	39,435,620.80	0.98
25	002385	大北农	1,999,932	38,798,680.80	0.96
26	002410	广联达	1,547,708	37,980,754.32	0.94
27	002656	卡奴迪路	674,961	30,258,501.63	0.75
28	601566	九牧王	1,063,364	29,614,687.40	0.73
29	002327	富安娜	628,942	28,610,571.58	0.71
30	600267	海正药业	1,600,127	27,970,219.96	0.69
31	002325	洪涛股份	1,861,290	27,584,317.80	0.68
32	002612	朗姿股份	719,147	26,176,950.80	0.65
33	000024	招商地产	889,843	21,827,848.79	0.54
34	002029	七匹狼	900,000	20,772,000.00	0.52
35	600266	北京城建	799,660	12,146,835.40	0.30
36	000537	广宇发展	1,623,113	11,670,182.47	0.29
37	603001	奥康国际	250,000	6,727,500.00	0.17
38	002311	海大集团	199,923	3,570,624.78	0.09
39	600239	云南城投	200,000	1,698,000.00	0.04
40	000538	云南白药	19,075	1,130,766.00	0.03
41	600036	招商银行	100,000	1,092,000.00	0.03
42	002099	海翔药业	99,562	1,059,339.68	0.03
43	600887	伊利股份	49,925	1,027,456.50	0.03
44	601169	北京银行	100,000	977,000.00	0.02
45	600016	民生银行	150,000	898,500.00	0.02
46	600000	浦发银行	100,000	813,000.00	0.02

47	600223	鲁商置业	99,950	523,738.00	0.01
48	002541	鸿路钢构	29,420	352,451.60	0.01
49	000826	桑德环境	11,778	269,716.20	0.01
50	002277	友阿股份	10,000	156,100.00	0.00
51	000858	五粮液	4,348	142,440.48	0.00
52	000869	张裕A	1,600	107,616.00	0.00
53	600559	老白干酒	3,542	101,088.68	0.00
54	300070	碧水源	3,181	95,111.90	0.00
55	600697	欧亚集团	3,465	79,244.55	0.00
56	600079	人福医药	1,777	41,208.63	0.00
57	002161	远望谷	1,938	15,000.12	0.00
58	002250	联化科技	810	13,972.50	0.00
59	000650	仁和药业	1,278	10,965.24	0.00
60	300157	恒泰艾普	550	10,840.50	0.00
61	000568	泸州老窖	226	9,562.06	0.00
62	002073	软控股份	899	7,533.62	0.00
63	600976	武汉健民	325	6,386.25	0.00
64	600535	天士力	80	3,497.60	0.00
65	000423	东阿阿胶	50	2,000.50	0.00
66	600970	中材国际	84	969.36	0.00
67	002485	希努尔	80	904.00	0.00
68	300005	探路者	31	543.12	0.00
69	600248	延长化建	50	350.00	0.00
70	000661	长春高新	4	189.04	0.00
71	600785	新华百货	10	183.20	0.00
72	002006	精功科技	15	159.60	0.00
73	600859	王府井	5	136.80	0.00
74	002249	大洋电机	14	130.20	0.00
75	000715	中兴商业	20	129.80	0.00
76	002123	荣信股份	5	56.85	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	600702	沱牌舍得	125,978,555.99	4.08
2	600048	保利地产	121,612,113.76	3.94
3	002241	歌尔声学	113,989,351.29	3.69

4	600559	老白干酒	85,992,814.79	2.78
5	600383	金地集团	85,429,902.96	2.76
6	000799	酒 鬼 酒	85,376,577.12	2.76
7	000024	招商地产	67,265,409.03	2.18
8	000568	泸州老窖	66,389,532.95	2.15
9	002503	搜于特	66,369,063.72	2.15
10	002482	广田股份	58,086,289.89	1.88
11	000989	九 芝 堂	57,379,262.99	1.86
12	600267	海正药业	53,959,331.72	1.75
13	002431	棕榈园林	53,698,633.67	1.74
14	600252	中恒集团	52,530,197.41	1.70
15	600266	北京城建	52,110,656.75	1.69
16	002375	亚厦股份	48,907,877.63	1.58
17	002477	雏鹰农牧	48,659,914.69	1.57
18	000537	广宇发展	46,802,065.49	1.51
19	002293	罗莱家纺	45,728,185.33	1.48
20	600067	冠城大通	41,169,621.35	1.33

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	600406	国电南瑞	226,699,448.18	7.34
2	600252	中恒集团	192,536,284.19	6.23
3	000858	五 粮 液	135,034,133.15	4.37
4	000869	张 裕 A	132,979,100.99	4.30
5	600809	山西汾酒	92,329,271.18	2.99
6	600559	老白干酒	85,610,995.98	2.77
7	600383	金地集团	82,048,720.34	2.66
8	600048	保利地产	78,249,969.20	2.53
9	000568	泸州老窖	63,717,619.98	2.06
10	002236	大华股份	58,251,753.76	1.89
11	000024	招商地产	45,811,096.33	1.48
12	000596	古井贡酒	44,239,374.90	1.43
13	002269	美邦服饰	43,471,129.38	1.41
14	600067	冠城大通	43,184,024.77	1.40
15	600266	北京城建	36,589,009.18	1.18

16	000537	广宇发展	32,275,247.42	1.04
17	600519	贵州茅台	31,368,905.83	1.02
18	601117	中国化学	28,326,023.60	0.92
19	000715	中兴商业	25,905,925.40	0.84
20	600267	海正药业	25,798,543.13	0.83

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	1,989,829,054.92
卖出股票的收入（成交）总额	1,799,030,687.79

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末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	2,132,892.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	66,333.67

5	应收申购款	15,248,538.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,447,764.24

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

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	002081	金螳螂	38,676,000.00	0.96	非公开发行流通受限

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

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
103,089	33,115.87	857,198,005.15	25.11%	2,556,684,182.14	74.89%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	1,889,732.24	0.0554%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

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	7,070,893,298.01
--------------------------------	------------------

总额	
本报告期期初基金份额总额	3,129,721,610.26
本报告期基金总申购份额	1,206,238,161.97
减：本报告期基金总赎回份额	922,077,584.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,413,882,187.29

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、基金托管人的专门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，因业务发展需要，广发基金管理有限公司第四届董事会第九次会议通过关于聘请 2012 年度基金审计机构的议案，本基金改聘深圳市鹏城会计师事务所有限公司负责本基金审计事务；因深圳市鹏城会计师事务所有限公司广州分公司已整体并入天健会计师事务所（特殊普通合伙），2012 年 8 月，本基金改聘天健会计师事务所（特殊普通合伙）负责本基金审计事务。

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	
安信证券	4	187,553,800.35	4.98%	114,877.00	3.80%	-
北京高华	1	401,704,933.54	10.66%	346,683.51	11.47%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
长城证券	1	283,410,759.21	7.52%	240,897.12	7.97%	-
长江证券	2	130,394,222.06	3.46%	109,217.11	3.61%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	85,071,715.18	2.26%	55,296.11	1.83%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	94,028,130.45	2.50%	63,281.30	2.09%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	100,240,787.42	2.66%	65,155.80	2.16%	新增 1 个
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	6	33,905,448.25	0.90%	27,912.43	0.92%	-
广州证券	1	105,173,540.49	2.79%	64,419.26	2.13%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国信证券	4	300,471,447.07	7.97%	244,134.46	8.08%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	53,633,149.49	1.42%	45,588.03	1.51%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	55,754,263.00	1.48%	48,673.09	1.61%	-
华福证券	2	65,050,524.27	1.73%	53,781.66	1.78%	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	295,823,086.42	7.85%	240,457.63	7.96%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	203,353,990.03	5.40%	173,604.51	5.75%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	101,606,926.56	2.70%	86,365.52	2.86%	-
瑞银证券	1	19,295,774.52	0.51%	16,845.36	0.56%	-
山西证券	1	80,754,340.89	2.14%	68,640.84	2.27%	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	67,449,599.74	1.79%	57,163.52	1.89%	-
银河证券	3	657,928,148.45	17.46%	545,144.33	18.04%	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
中金公司	2	47,369,405.30	1.26%	40,145.64	1.33%	-
中天证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	4	288,789,350.16	7.66%	242,085.69	8.01%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信浙江证 券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中银国际	1	109,396,399.86	2.90%	71,108.19	2.35%	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江证 券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金参加浙商银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-04
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续参加华夏银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-04
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国农业银行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》	2012-01-04
4	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞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》	2012-01-09
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金增加顺德农商银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-02-08
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》	2012-02-29
7	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金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》	2012-03-31
8	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-14
9	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中天证券推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-14
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金投资七匹狼（002029）非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-28
11	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行等电子渠道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》	2012-06-29

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
二〇一二年八月二十七日