

# 广发聚丰股票型证券投资基金

## 2008 年年度报告

2008 年 12 月 31 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

送出日期：2009 年 3 月 31 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 2009 年 3 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。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.6 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
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的说明 .....	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 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对基金投资运作的说明 .....	14
5.3 托管人对本年度报告发表意见 .....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
7.4 报表附注 .....	19
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
8.3 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 .....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
8.6 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 .....	49
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 .....	49
8.8 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 .....	49
8.9 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	50
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
11.2 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 .....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
11.4 基金投资策略的改变 .....	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
11.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录: .....	60
12.2 存放地点: .....	60
12.3 查阅方式: .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发聚丰股票型证券投资基金
基金简称	广发聚丰股票型基金
交易代码	270005/270015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 23 日
报告期末基金份额总额	38,398,014,526.05 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场，通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选，寻求基金资产长期增值
投资策略	本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产，在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票，同时保持两类资产的适度均衡配置，构建股票投资组合
业绩比较基准	80%×新华富时 A600 指数+20%×新华巴克莱资本中国全债指数
风险收益特征	较高风险，较高收益

### 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	蒋松云
	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	广东省珠海市凤凰北路 19 号农行商业大厦 1208 室	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	马庆泉	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 2.6 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	深圳市鹏城会计师事务所有限公司	广发基金管理有限公司
办公地址	深圳市福田区滨河大道 5022 号联合广场 A 座 7 楼	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
本期已实现收益	-8,439,438,465.23	1,858,868,714.28	839,000,475.82
本期利润	-22,346,076,401.41	4,533,028,079.62	1,867,925,599.33
加权平均基金份额本期利润	-0.5829	0.4172	1.2420
本期加权平均净值利润率	-86.48%	34.02%	80.27%
本期基金份额净值增长率	-55.60%	157.68%	144.08%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
期末可供分配利润	256,660,991.83	8,727,503,550.84	523,317,194.74
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.2272	0.3559
期末基金资产净值	17,762,141,332.39	40,018,323,286.18	3,166,641,417.24
期末基金份额净值	0.4626	1.0420	2.1538
3.1.3 累计期末指标	2008 年	2007 年	2006 年
基金份额累计净值增长率	179.14%	528.68%	143.98%

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（不含公允价值变动损益）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) 期末可供分配利润指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

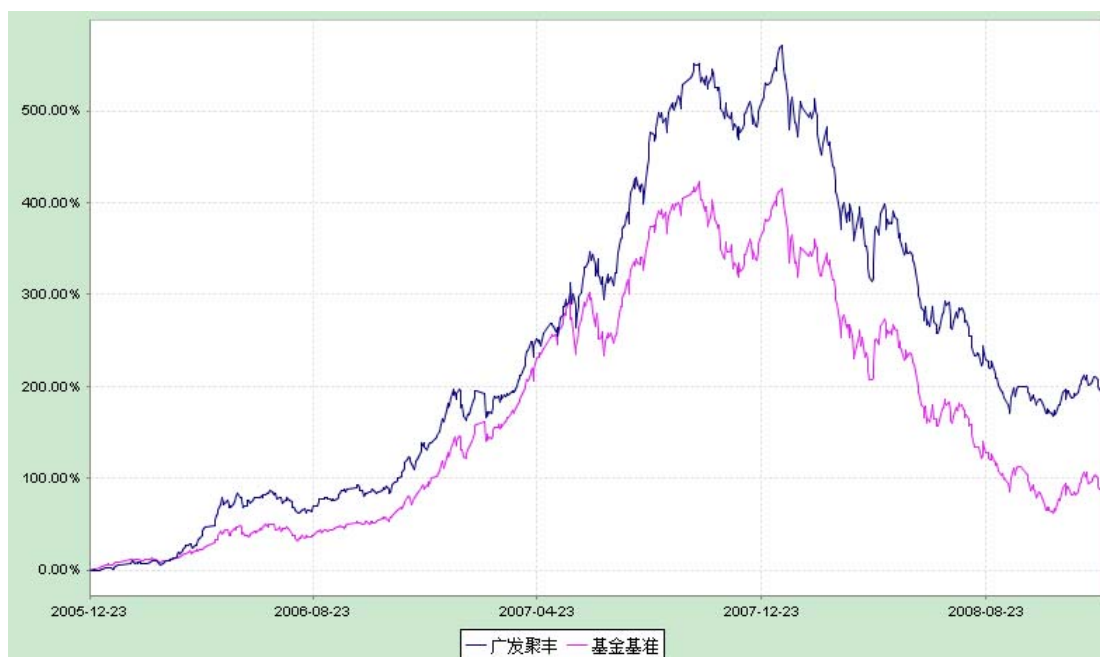
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-7.09%	2.10%	-12.17%	2.42%	5.08%	-0.32%
过去六个月	-23.99%	2.12%	-26.06%	2.39%	2.07%	-0.27%
过去一年	-55.60%	2.33%	-50.31%	2.44%	-5.29%	-0.11%

过去三年	179.25%	1.98%	80.15%	1.90%	99.10%	0.08%
自基金合同生效起至今	179.14%	1.97%	83.61%	1.89%	95.53%	0.08%

注：1、业绩比较基准： $80\% \times \text{新华富时 A600 指数} + 20\% \times \text{新华巴克莱资本中国全债指数}$ 。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

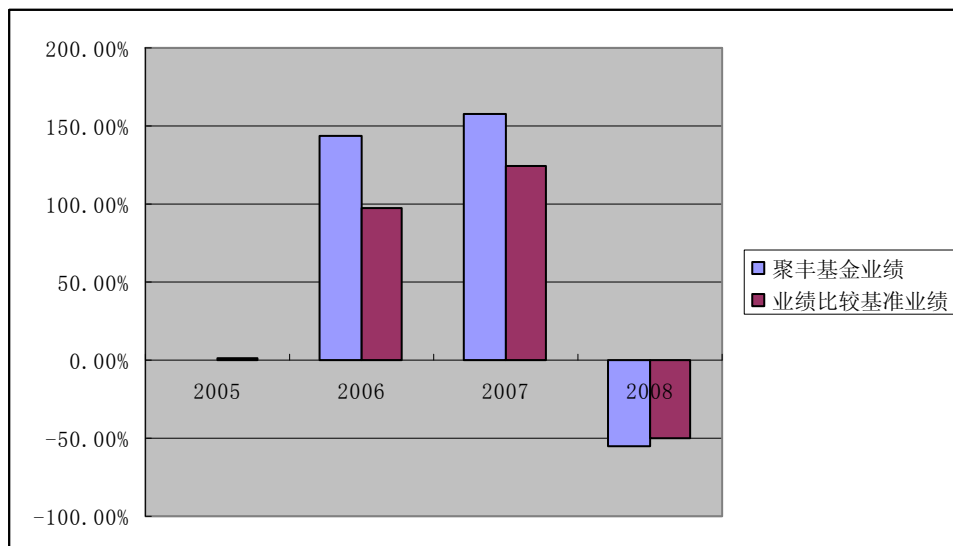
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金基金合同生效日为 2005 年 12 月 23 日，图示时间段为 2005 年 12 月 23 日至 2008 年 12 月 31 日。

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





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	-	-	-	-	
2007年	4.500	488,240,613.96	897,230,651.79	1,385,471,265.75	
2006年	2.000	205,776,221.39	92,103,648.39	297,879,869.78	
合计	6.500	694,016,835.35	989,334,300.18	1,683,351,135.53	

## § 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

本基金管理人成立于 2003 年，截至本报告期末，本基金管理人旗下管理 10 只开放式基金，管理资产规模为 669.46 亿元，基金总份额为 943.79 亿份。

#### 4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易阳方	投资总监、投资管理部总	2005.12.23	—	13	易阳方，男，中国籍，硕士研究生学历，1997 年 1 月至 2002 年 11

	经理、基金经理				月任职于广发证券股份有限公司，2002 年 11 月至今在广发基金管理有限公司工作，2003 年 12 月至 2007 年 3 月曾任广发聚富基金基金经理，曾任公司总经理助理，现任公司投资总监、投资管理部总经理、基金经理。
傅友兴	研究发展部 副总经理、基金经理助理	2008. 10. 10	—	7	傅友兴，男，中国籍，硕士研究生学历，持有特许金融分析师证（CFA），曾任职于天同基金管理有限公司，2006 年 4 月至今在广发基金管理有限公司工作，曾任研究发展部研究员、规划发展部副总经理，现任公司研究发展部副总经理、基金经理助理。

注：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、《广发聚丰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分析评估，保证公平交易原则的实现。

投资决策的内部控制方面，投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，超过一定投资比例后必须来源于核心股票库，或通过投资决策委员会的审批；公司建立严格

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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，不同投资组合经理下达的对同一证券的交易指令，由同一交易员执行。交易员通过投资交易系统，公平对待各投资组合。

督察长、监察稽核部以及绩效评估与风险管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控、准实时监控及预警，实现投资风险的事中和事后风险控制；金融工程部绩效评估与风险管理岗通过技术系统平台，及时有效地评估投资组合的绩效和风险状况，对投资风险进行事后的评估及管理。

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

管理人旗下股票型基金业绩比较		
	广发小盘股票型基金	广发核心股票型基金
本报告期净值增长率	-59.25%	-2.90%
本基金与其他同类基金的业绩比较	3.65%	-52.70%

本报告期，本基金与广发小盘股票型基金的业绩表现差异未超过 5%，本基金与广发核心股票型基金的业绩差异为 -52.70%。本基金与广发核心股票型基金的业绩差异较大的原因：广发核心股票基金基金合同生效于本报告期第三季度，较低的股票资产仓位使其受市场系统性风险的影响较小。

#### 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的说明

2008 年，次贷危机全面爆发，已经由金融危机演变成全球经济危机。从影响范围及危害程度来看，本次危机应是 1945 年以来全球最严重的经济危机。全球证券市场成为重灾区，投资者信心崩溃，股市一泻千里，叠创新低，不少全球性金融机构纷纷破产倒闭。下半年，各国政府联手采取了一系列经济拯救政策来应对危机，避免了经

济形势进一步恶化，但投资者信心恢复及证券市场的企稳还有待救市政策的效果显现。

本基金尽管在年初也预见到了 2008 年证券市场面临调整的压力，但对百年不遇的经济危机危害程度预见性不强，错误地认为中国经济发展已经同美国经济“脱钩”，因而在整体策略方面没有对大类资产配置进行较大的调整，没有大比例降低权益类资产配置的比重，这是本基金运做三年来最需要检讨、吸取教训之处。第四季度，本基金吸取前三季度教训，加大了对大类资产配置的调整，在权益持仓结构上也加大了调整力度，配置重点转向与内需相关的行业及国家重点加大投资受益的领域。基金净值全年下跌 49.5%，同期基金比较基准下跌 50.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济格局达到再平衡及金融去杠杆需要一个相当长的时间，因此全球经济复苏可能也需要一个相当长的时间。国内来看，经济增长模式需要重新调整，存货出清到产能出清需要一段痛苦漫长的过程，因而经济复苏也要假以时日，接下来将会是一个较长的调整期，应该强调的是这种调整是相对中国连续 30 多年高速增长奇迹的理性休整，是经济结构调整及经济增长模式转型期的中速增长期，不是经济下行期。

2008 年下半年，全球各国政府联手干预救市，无论是力度还是规模都是前所未有的。救市带来的宽裕的流动性会逐步稳固经济，证券市场也会稳固反弹。从历史经验看，危机爆发的次年，证券市场也会回升 30%到 50%。预计 09 年证券市场能给投资者带来许多期待。流动性暂时“泛滥”及经济活动从危机最严重时期停滞萧条逐步向较低水平复苏，周期性行业会有阶段性投资机会。本基金在继续保持重点投资在下游中受益于内需及国家重点投资和扶持的相关产业的同时，阶段性参与流动性充裕带来的上游原材料价格回升带来的投资机会，如煤炭、有色、航运等。本基金认为，流动性过剩的盛宴终将曲终人散，不可能持续较长时间，证券市场最终会回归于经济基本面。因此本基金将不断进行结构的优化，寻找并投资于能穿透本次经济危机、具有强大创新能力、适应经济结构调整的企业，力争取得较好的长期投资绩效。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，

致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

#### 4.7 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。本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同第十五部分“基金收益与分配”之“三、基金收益分配原则”的相关规定，由于本基金本报告期内为净亏损，可不进行利润分配。

## § 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

2008年，本基金托管人在对广发聚丰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 托管人对基金投资运作的说明

2008年，广发聚丰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丰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，广发聚丰股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告发表意见

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丰股票型证券投资基金2008年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

深鹏所股审字[2009]052 号

广发聚丰股票型证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的广发聚丰股票型证券投资基金（简称“广发聚丰基金”）财务报表，包括 2008 年 12 月 31 日的资产负债表和 2008 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 一、基金管理人对于财务报表的责任

按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《广发聚丰股票型证券

投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是广发聚丰基金的基金管理人——广发基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

## 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 三、审计意见

我们认为，广发聚丰基金财务报表已经按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允地反映了广发聚丰基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 年度的经营成果。

深圳市鹏城会计师事务所有限公司

中国注册会计师

中国 · 深圳

2009 年 3 月 30 日

杨克晶

中国注册会计师

侯立勋

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：广发聚丰股票型证券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,483,180,930.22	9,905,897,625.53
结算备付金		12,524,034.81	36,065,236.49
存出保证金		2,222,273.36	2,809,637.00
交易性金融资产	7.4.7.2	15,137,049,362.33	30,035,810,562.46
其中：股票投资		12,061,437,049.74	29,992,966,865.04
基金投资		-	-
债券投资		3,075,612,312.59	42,843,697.42
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	300,622,082.93
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		236,255,487.23	112,518,801.36
应收利息	7.4.7.5	57,562,924.71	2,675,155.13
应收股利		-	-
应收申购款		8,377,558.02	70,744,233.07
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		17,937,172,570.68	40,467,143,333.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2008 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2007 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		-	-
应付证券清算款		51,602,377.27	302,464,539.84



应付赎回款		89,778,942.53	73,116,243.20
应付管理人报酬		23,775,491.30	48,468,486.85
应付托管费		3,962,581.91	8,078,081.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.6	4,098,078.81	14,990,176.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,813,766.47	1,702,520.32
负债合计		175,031,238.29	448,820,047.79
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.8	8,482,222,002.55	8,484,101,982.29
未分配利润	7.4.7.9	9,279,919,329.84	31,534,221,303.89
所有者权益合计		17,762,141,332.39	40,018,323,286.18
负债和所有者权益总计		17,937,172,570.68	40,467,143,333.97

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4626 元，基金份额总额 38,398,014,526.05 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发聚丰股票型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-21,818,495,483.56	4,886,705,186.79
1. 利息收入		99,051,506.25	27,757,925.43
其中：存款利息收入	7.4.7.10	43,464,757.90	27,746,097.75
债券利息收入		55,027,882.15	11,827.68
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		558,866.20	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-8,017,234,765.01	2,175,330,412.39
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-8,185,351,398.47	2,164,029,495.16
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.12	67,334,970.58	41,962.23
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-59,549,304.09	-13,384,319.23
股利收益	7.4.7.14	160,330,966.97	24,643,273.83
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.15	-13,906,637,936.18	2,674,159,365.34
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	6,325,711.38	9,457,483.63
<b>二、费用(以“-”号填列)</b>		<b>-527,580,917.85</b>	<b>-353,677,107.17</b>
1. 管理人报酬		-390,867,905.03	-193,626,014.75
2. 托管费		-65,144,650.88	-32,271,002.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.17	-71,120,121.43	-127,436,270.96
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.18	-448,240.51	-343,819.11
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-22,346,076,401.41</b>	<b>4,533,028,079.62</b>
所得税费用(以“-”号填列)		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-22,346,076,401.41</b>	<b>4,533,028,079.62</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 广发聚丰股票型证券投资基金

本报告期: 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,484,101,982.29	31,534,221,303.89	40,018,323,286.18
二、本期经营活动产生的	-	-22,346,076,401.41	-22,346,076,401.41

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-1,879,979.74	91,774,427.36	89,894,447.62
其中：1. 基金申购款	1,590,438,608.25	3,880,100,295.73	5,470,538,903.98
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,592,318,587.99	-3,788,325,868.37	-5,380,644,456.36
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）	8,482,222,002.55	9,279,919,329.84	17,762,141,332.39
项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,470,284,026.01	1,696,357,391.23	3,166,641,417.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,533,028,079.62	4,533,028,079.62
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）	7,013,817,956.28	26,690,307,098.79	33,704,125,055.07
其中：1. 基金申购款	9,336,740,555.56	32,596,468,688.76	41,933,209,244.32
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,322,922,599.28	-5,906,161,589.97	-8,229,084,189.25
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）	-	-1,385,471,265.75	-1,385,471,265.75
五、期末所有者权益（基金净值）	8,484,101,982.29	31,534,221,303.89	40,018,323,286.18

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发聚丰股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经证监基金字[2005]180号文《关于同意广发聚丰股票型证券投资基金募集的批复》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《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》发起，于2005年12月23

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，并获中国证监会基金部函[2005]293号《关于广发聚丰股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2005年11月21日至2005年12月21日，本基金为契约型开放式股票型基金，存续期限不定，首次募集资金为1,315,856,024.96元，有效认购户数为15,026户。其中，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币175,370.72元，利息结转的基金份额175,370.72份，按照《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》的有关约定计入投资者基金账户。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2005年12月23日生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,315,856,024.96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《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金于2007年9月4日公告对截至2007年9月11日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的基金份额，根据拆分比例实施拆分。拆分日为2007年9月11日，按照1:4.526975258的拆分比例进行了基金份额拆分，拆分后基金份额净值变更为1.0000元，相应地，基金份额持有人原来每1份基金份额拆分后为4.526975258份。基金份额拆分后，基金份额总数与持有人持有的基金份额数均相应调整，但调整后持有人持有的基金份额占基金份额总数的比例不发生变化，基金份额拆分对持有人的权益无实质性影响。

本基金财务报表由本基金的基金管理人广发基金管理有限公司于2009年3月26日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金编制财务报表以持续经营假设为基础，根据实际发生的交易和事项，遵循企业会计准则、中国证券业协会颁布的中证协发[2007]56号《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及其他相关规定进行确认和计量，基于下述重要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 年度的经营成果。

### 7.4.4 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

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示；与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

金融负债在初始确认时分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示；与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 1. 金融工具的确认与初始计量

金融资产及金融负债初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益。其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

##### (1) 股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

### (2) 债券投资

债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券的公允价值。配售及认购新发行的分离交易可转债，于成交日先按债券面值确认为债券投资，后于权证确认日单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

### (3) 权证投资

权证投资成本按成交日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零。配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值技术对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益。卖出权证按移动加权平均法结转成本。

### (4) 买入返售金融资产

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。于返售日按账面余额结转。

### (5) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计

入初始成本。于回购日按账面余额结转。

## 2. 金融工具的后续计量

(1) 本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用。但下列情况除外：应收款项，采用实际利率法按摊余成本进行计量；在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

(2) 本基金采用实际利率法按摊余成本对金融负债进行后续计量。但下列情况除外：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

#### 1. 股票投资

(1) 交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日收盘价为公允价值。

如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。当股票不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定股票的公允价值。本基金按照证监会《关于进一步规范股票投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008] 38 号）的要求、参照《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法对长期停牌股票进行估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率，并根据第一步所得的收益率计算该股票当日的公允价值。

(2) 由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

(3) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难

以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的另一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

(4) 非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的另一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的另一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的另一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

## 2. 债券投资

(1) 交易所上市实行净价交易的债券以估值日上市的收盘价为公允价值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价为公允价值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 未上市债券和在银行间同业市场交易的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

## 3. 权证投资

(1) 交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日收盘价为公允价值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 首次公开发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 配售及认购分离交易可转债，上市日前，获得分离交易可转债的债券部分时，按成本估值；获得权证部分后，按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价分别确定当日债券和权证的估值，自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述债



券投资和权证投资中相关原则进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

基金份额发售面值为人民币 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日列示。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金为申购、赎回、转入或转出款中所含的按基金未分配利润占基金净值比例计算的一部分金额，于计算基金申购、赎回、转入或转出确认日列示，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提；

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

买入返售金融资产收入按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率，在回购期限内逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，也可使用合同利率；

股票投资收益/（损失）为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认；

债券投资收益/（损失）为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认；

衍生工具投资收益/（损失）为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本

后的差额确认；

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认；

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益；

其他收入于在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

管理人报酬按照前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提；

托管费按照前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提；

交易费用按发生时实际支出金额确认；

卖出回购金融资产支出按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率，在回购期限内逐日计提。若合同利率与实际利率差异较小的，也可使用合同利率。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配比例为基金净收益的 100%，本基金每年收益分配次数最少一次，最多为六次，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金当年收益先弥补基金上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

基金投资当期出现亏损，则基金当年不进行收益分配；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券监督管理委员会公告 [2008] 38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会发布的《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，本基金自 2008 年 9 月 12 日起，按照指数收益法对相关停牌股票的估值调整为“如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。当股票不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定股票的公允价值。”上述估值调整影响本基金期末资产净值 -1,798,798.50 元，影响本期净利润 -1,798,798.50 元。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

2008 年 4 月 24 日以前，根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，按 3‰ 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，自 2008 年 4 月 24 日起，按 1‰ 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。经国务院批准，财政部、国家税务总局决定自 2008 年 9 月 19 日起，对证券（股票）交易出让方按 1‰ 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

##### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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，暂不征收企业所得税。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，本基金取得的股票的股息、红利收入及企业债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。根据财政部、国家税务总局[2005]102 号文《关于股息红利有关个人所得税有关政策的通知》与财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》，对本基金自 2005 年 6 月 13 日起从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
活期存款	2,483,180,930.22	9,905,897,625.53
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	2,483,180,930.22	9,905,897,625.53

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2008 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		22,387,084,653.40	12,061,437,049.74	-10,325,647,603.66
债券	交易所市场	248,078,195.66	253,168,312.59	5,090,116.93
	银行间市场	2,705,762,690.00	2,822,444,000.00	116,681,310.00
	合计	2,953,840,885.66	3,075,612,312.59	121,771,426.93
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		25,340,925,539.06	15,137,049,362.33	-10,203,876,176.73
项目		上年度末 2007 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值

股票		26,354,241,545.93	29,992,966,865.04	3,638,725,319.11
债券	交易所市场	29,228,600.00	42,843,697.42	13,615,097.42
	银行间市场	-	-	-
	合计	29,228,600.00	42,843,697.42	13,615,097.42
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		26,383,470,145.93	30,035,810,562.46	3,652,340,416.53

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
权证	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	
项目	上年度末 2007年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
权证	-	300,622,082.93	-	成本： 250,200,740.01
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	300,622,082.93	-	

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

本基金上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
应收活期存款利息	482,531.31	2,646,025.94
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	5,635.80	16,229.40
应收债券利息	57,073,822.17	10,121.17

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	935.43	2,778.62
其他	-	-
合计	57,562,924.71	2,675,155.13

#### 7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,077,928.81	14,990,176.45
银行间市场应付交易费用	20,150.00	-
合计	4,098,078.81	14,990,176.45

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,250,000.00
应付赎回费	229,205.72	372,459.57
预提费用	84,500.00	80,000.00
其他	60.75	60.75
合计	1,813,766.47	1,702,520.32

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,406,547,831.83	8,484,101,982.29
本期申购	7,199,685,547.16	1,590,438,608.25
本期赎回	-7,208,218,852.94	-1,592,318,587.99
本期末	38,398,014,526.05	8,482,222,002.55

注：申购含红利再投、转换入份额。

赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	本期		
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		
	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,727,503,550.84	22,806,717,753.05	31,534,221,303.89
本期利润	-8,439,438,465.23	-13,906,637,936.18	-22,346,076,401.41
本期基金份额交易产生的变动数	-31,404,093.78	123,178,521.14	91,774,427.36
其中：基金申购款	1,215,656,986.20	2,664,443,309.53	3,880,100,295.73

基金赎回款	-1,247,061,079.98	-2,541,264,788.39	-3,788,325,868.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	256,660,991.83	9,023,258,338.01	9,279,919,329.84

#### 7.4.7.10 存款利息收入

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,164,934.23	26,417,606.22
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	239,384.25	360,087.92
其他	60,439.42	968,403.61
合计	43,464,757.90	27,746,097.75

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,434,205,185.09	7,660,359,848.53
卖出股票成本总额	-19,619,556,583.56	-5,496,330,353.37
买卖股票差价收入	-8,185,351,398.47	2,164,029,495.16

#### 7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31 日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31 日
卖出债券成交金额	3,705,482,216.88	3,501,821.50
卖出债券成本总额	-3,588,128,339.60	-3,458,152.36
应收利息总额	-50,018,906.70	-1,706.51
债券投资收益	67,334,970.58	41,962.63

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出权证成交金额	236,032,766.82	61,577,578.39
卖出权证成本总额	-295,582,070.91	-74,961,897.62
买卖权证差价收入	-59,549,304.09	-13,384,319.23

注：买卖权证差价收入包含权证行权产生的差价收入。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	160,330,966.97	24,643,273.83
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	160,330,966.97	24,643,273.83

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-13,856,216,593.26	2,657,411,214.07
——股票投资	-13,964,372,922.77	2,643,796,116.65
——债券投资	108,156,329.51	13,615,097.42
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-50,421,342.92	16,748,151.27
——权证投资	-50,421,342.92	16,748,151.27
3. 其他	-	-
合计	-13,906,637,936.18	2,674,159,365.34

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	5,633,827.78	7,803,286.37
新债手续费返还	300,000.00	-
印花税手续费返还	76,736.53	-
转换费收入	315,147.07	1,654,197.26
合计	6,325,711.38	9,457,483.63

7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	71,087,796.43	127,436,270.96
银行间市场交易费用	32,325.00	-
合计	71,120,121.43	127,436,270.96

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日



审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	220,000.00
银行汇划费	45,740.51	25,819.11
其他	22,500.00	18,000.00
合计	448,240.51	343,819.11

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司、代销机构
广发期货经纪有限公司	基金管理人股东的子公司
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
香江投资有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广东康美药业股份有限公司	基金管理人股东

##### 7.4.9.1 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

注：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。

##### 7.4.9.2 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
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司、代销机构

注：

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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	9,544,335,942.57	37.91%	5,999,256,851.46	16.61%
广发华福证券 有限责任公司	2,676,792,003.54	10.63%	10,228,661,959.74	28.31%

7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	79,923,156.65	12.47%
广发华福证券 有限责任公司	56,207,834.44	70.02%	93,044,900.26	14.52%

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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
广发证券股份有限公司	12,026,375.90	3.61%	-	-
广发华福证券 有限责任公司	39,629,162.50	11.91%	-	-

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31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	8,066,276.09	38.05%	2,887,190.95	70.80%
广发华福证券 有限责任公司	2,182,488.26	10.29%	289,255.40	7.09%
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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	4,836,499.66	16.56%	2,596,316.71	17.32%
广发华福证券有限责任公司	8,378,293.60	28.68%	4,511,529.47	30.10%

股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额\*佣金比率-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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	390,867,905.03	193,626,014.75
其中：当期已支付	367,092,413.73	145,157,527.90
期末未支付	23,775,491.30	48,468,486.85

注：

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5 %的年费率计提。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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	65,144,650.88	32,271,002.35
其中：当期已支付	61,182,068.97	24,192,921.22
期末未支付	3,962,581.91	8,078,081.13

注：

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内不存在与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金上年度可比期间不存在与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

项 目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	282,114,249.52	46,494,389.09
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	25,559,913.21
期间因拆分增加的份额	-	210,059,947.22
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	282,114,249.52	282,114,249.52
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.73%	0.73%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

上年度可比期间，本基金管理人申购基金份额 25,559,913.21 份，申购费为 1000.00 元。

##### 7.4.10.4.2 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

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止，本基金不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。截至上报告期末 2007 年 12 月 31 日止，本基金不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 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	2,483,180,930.22	43,164,934.23	9,905,897,625.53	26,417,606.22

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

2008 年度，本基金无在承销期内参与关联方承销的证券。2007 年度，本基金无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末分配利润。

#### 7.4.12 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

##### 7.4.12.1.1 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	说明
600360	华微电子	2008-1-9	2009-1-7	非公开发行流通受限	8.25	3.48	8,000,000	66,000,000.00	27,840,000.00	2008 年 5 月 9 日，华微电子送股，比例：10 送 10
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	11.55	11.57	19,000,000	219,450,000.00	219,830,000.00	
600888	新疆众和	2008-1-31	2009-1-29	非公开发行流通受限	19.50	7.83	5,000,000	97,500,000.00	39,150,000.00	2008 年 6 月 19 日，新疆众和每股派发现金红利 0.04233 元（含税）
002257	立立电子	2008-6-30	-	新发	21.81	21.81	26,000	567,060.00	567,060.00	

002024	苏宁电器	2008-5-22	2009-5-22	非公开发行流通受限	22.50	17.91	8,000,000	180,000,000.00	143,280,000.00	2008年9月26日,苏宁电器送股,比例:10送10,派息:每10股派发现金红利1元(含税)
--------	------	-----------	-----------	-----------	-------	-------	-----------	----------------	----------------	--

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本基金未持有暂时停牌股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本基金无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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本基金无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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

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。

##### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12.1 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)的合约约定到期日均为一年以内且不计息，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2008年 12月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,483,180,930.22	-	-	-	-	-	2,483,180,930.22
结算备付金	12,524,034.81	-	-	-	-	-	12,524,034.81
存出保证金	2,222,273.36	-	-	-	-	-	2,222,273.36
交易性金融资产	-	-	196,580,000.00	2,540,308,971.49	338,723,341.10	12,061,437,049.74	15,137,049,362.33
应收证券清算款	-	-	-	-	-	236,255,487.23	236,255,487.23
应收利息	-	-	-	-	-	57,562,924.71	57,562,924.71
应收申购款	8,377,558.02	-	-	-	-	-	8,377,558.02
资产总计	2,506,304,796.41	-	196,580,000.00	2,540,308,971.49	338,723,341.10	12,355,255,461.68	17,937,172,570.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	51,602,377.27	51,602,377.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	89,778,942.53	89,778,942.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,775,491.30	23,775,491.30
应付托管费	-	-	-	-	-	3,962,581.91	3,962,581.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,098,078.81	4,098,078.81
其他负债	-	-	-	-	-	1,813,766.47	1,813,766.47



负债总计	-	-	-	-	-	175,031,238.29	175,031,238.29
利率敏感度缺口	2,506,304,796.41	-	196,580,000.00	2,540,308,971.49	338,723,341.10	12,180,224,223.39	17,762,141,332.39
上年度末 2007 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,905,897,625.53	-	-	-	-	-	9,905,897,625.53
结算备付金	36,065,236.49	-	-	-	-	-	36,065,236.49
存出保证金	2,809,637.00	-	-	-	-	-	2,809,637.00
交易性金融资产	-	-	32,023,152.52	10,820,544.90	-	29,992,966,865.04	30,035,810,562.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-	300,622,082.93	300,622,082.93
应收证券清算款						112,518,801.36	112,518,801.36
应收利息						2,675,155.13	2,675,155.13
应收申购款	70,744,233.07						70,744,233.07
资产总计	10,015,516,732.09		32,023,152.52	10,820,544.90		30,408,782,904.46	40,467,143,333.97
负债							
应付证券清算款						302,464,539.84	302,464,539.84
应付赎回款						73,116,243.20	73,116,243.20
应付管理人报酬						48,468,486.85	48,468,486.85
应付托管费						8,078,081.13	8,078,081.13

应付交易费用						14,990,176.45	14,990,176.45
其他负债						1,702,520.32	1,702,520.32
负债总计						448,820,047.79	448,820,047.79
利率敏感度缺口	10,015,516,732.09		32,023,152.52	10,820,544.90	-	29,959,962,856.67	40,018,323,286.18

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变动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：元）	
		本期末（2008年12月31日）	上年度末（2007年12月31日）
	1.市场利率上升25个基点	-22,289,259.42	-440,021.88
	2.市场利率下降25个基点	22,582,386.42	445,514.50

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 市场价格风险

##### 7.4.13.4.3.1 市场价格风险敞口

项目	本期末 2008年12月31日		上年度末 2007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	12,061,437,049.74	67.9053%	29,992,966,865.04	74.9481%
交易性金融资产-债券投资	3,075,612,312.59	17.3155%	42,843,697.42	0.1071%
衍生金融资产-权证投资	-	-	300,622,082.93	0.7512%
合计	15,137,049,362.33	85.2208%	30,336,432,645.39	75.8064%

##### 7.4.13.4.3.2 市场价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准（80%*新华富时 A600 指数收益+20%*新华雷曼中国全债指数收益）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：元）	
		本期末（2008 年 12 月 31 日）	上年度末（2007 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	789,083,128.69	1,811,029,220.32
	2.业绩比较基准下降 5%	-789,083,128.69	-1,811,029,220.32

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	12,061,437,049.74	67.24
	其中：股票	12,061,437,049.74	67.24
2	固定收益投资	3,075,612,312.59	17.15
	其中：债券	3,075,612,312.59	17.15
	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	2,495,704,965.03	13.91
6	其他资产	304,418,243.32	1.70
7	合计	17,937,172,570.68	100

### 8.2 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	753,000.00	0.00
B	采掘业	1,372,804,713.48	7.73
C	制造业	4,933,882,655.33	27.78
C0	食品、饮料	1,388,504,194.94	7.82
C1	纺织、服装、皮毛	4,735,000.00	0.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	82,299,512.10	0.46
C4	石油、化学、塑胶、塑料	743,384,521.06	4.19

C5	电子	135,066,454.26	0.76
C6	金属、非金属	321,977,077.64	1.81
C7	机械、设备、仪表	2,058,027,853.43	11.59
C8	医药、生物制品	177,700,516.19	1.00
C99	其他制造业	22,187,525.71	0.12
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	357,961,813.56	2.02
G	信息技术业	266,899,314.48	1.50
H	批发和零售贸易	1,247,131,939.48	7.02
I	金融、保险业	1,923,008,218.18	10.83
J	房地产业	1,749,007,787.01	9.85
K	社会服务业	149,891,614.40	0.84
L	传播与文化产业	14,917,425.90	0.08
M	综合类	45,178,567.92	0.25
	合计	12,061,437,049.74	67.91

### 8.3 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	002024	苏宁电器	58,284,550	1,043,876,290.50	5.88
2	600519	贵州茅台	7,963,322	865,613,101.40	4.87
3	600048	保利地产	52,400,000	754,560,000.00	4.25
4	600089	特变电工	28,809,625	687,973,845.00	3.87
5	601166	兴业银行	43,427,690	634,044,274.00	3.57
6	600000	浦发银行	46,500,000	616,125,000.00	3.47
7	000792	盐湖钾肥	7,195,194	408,543,115.32	2.30
8	600875	东方电气	13,085,779	390,087,071.99	2.20
9	000157	中联重科	30,350,000	339,313,000.00	1.91
10	000858	五粮液	23,006,889	306,911,899.26	1.73
11	601318	中国平安	11,005,122	292,626,193.98	1.65
12	600036	招商银行	23,825,720	289,720,755.20	1.63
13	600123	兰花科创	24,156,426	287,703,033.66	1.62
14	600031	三一重工	20,000,000	280,200,000.00	1.58
15	601666	平煤股份	21,860,355	272,817,230.40	1.54
16	000002	万科A	38,000,000	245,100,000.00	1.38
17	600596	新安股份	7,754,291	243,019,479.94	1.37
18	000063	中兴通讯	8,647,505	235,212,136.00	1.32

19	600325	华发股份	24,918,090	231,738,237.00	1.30
20	600428	中远航运	35,877,809	229,617,977.60	1.29
21	600583	海油工程	19,000,000	219,830,000.00	1.24
22	601088	中国神华	10,067,958	176,591,983.32	0.99
23	600456	宝钛股份	14,300,000	162,734,000.00	0.92
24	000983	西山煤电	13,000,000	151,580,000.00	0.85
25	000926	福星股份	27,594,958	133,559,596.72	0.75
26	002122	天马股份	2,483,838	132,463,080.54	0.75
27	600383	金地集团	20,000,000	130,200,000.00	0.73
28	000069	华侨城 A	14,161,790	115,843,442.20	0.65
29	601898	中煤能源	17,506,033	113,264,033.51	0.64
30	600169	太原重工	7,500,000	106,500,000.00	0.60
31	002008	大族激光	17,553,298	102,686,793.30	0.58
32	601006	大秦铁路	12,152,598	97,463,835.96	0.55
33	000024	招商地产	7,276,100	95,462,432.00	0.54
34	000001	深发展 A	9,565,750	90,491,995.00	0.51
35	600195	中牧股份	7,455,368	87,675,127.68	0.49
36	000028	一致药业	4,912,540	80,614,781.40	0.45
37	600779	水井坊	7,004,243	78,447,521.60	0.44
38	000718	苏宁环球	15,200,000	78,280,000.00	0.44
39	002128	露天煤业	7,905,403	71,860,113.27	0.40
40	600888	新疆众和	7,539,746	59,036,211.18	0.33
41	601699	潞安环能	4,530,140	56,581,448.60	0.32
42	000667	名流置业	15,112,654	51,534,150.14	0.29
43	002018	华星化工	4,599,905	51,518,936.00	0.29
44	000869	张裕 A	1,027,970	49,856,545.00	0.28
45	600117	西宁特钢	11,402,903	47,322,047.45	0.27
46	600694	大商股份	2,552,754	45,847,461.84	0.26
47	600585	海螺水泥	1,763,157	45,718,661.01	0.26
48	600858	银座股份	2,753,112	45,178,567.92	0.25
49	600511	国药股份	1,220,410	34,867,113.70	0.20
50	002183	怡亚通	1,764,154	34,048,172.20	0.19
51	600736	苏州高新	10,934,200	33,239,968.00	0.19
52	600533	栖霞建设	10,507,884	32,784,598.08	0.18
53	002074	东源电器	3,425,442	32,541,699.00	0.18
54	600685	广船国际	2,588,550	31,865,050.50	0.18
55	600087	长航油运	8,000,000	30,880,000.00	0.17
56	002092	中泰化学	4,810,700	27,902,060.00	0.16
57	600360	华微电子	8,000,000	27,840,000.00	0.16
58	002153	石基信息	517,524	25,079,213.04	0.14
59	600641	万业企业	3,309,164	24,752,546.72	0.14

60	000417	合肥百货	2,690,989	23,142,505.40	0.13
61	002017	东信和平	3,429,293	22,187,525.71	0.12
62	600557	康缘药业	1,200,748	20,520,783.32	0.12
63	600150	中国船舶	517,191	19,777,383.84	0.11
64	600729	重庆百货	1,276,031	18,234,482.99	0.10
65	002177	御银股份	1,933,582	18,098,327.52	0.10
66	002152	广电运通	573,872	16,969,395.04	0.10
67	002244	滨江集团	2,047,931	16,076,258.35	0.09
68	600535	天士力	1,298,739	16,065,401.43	0.09
69	600037	歌华有线	1,571,910	14,917,425.90	0.08
70	600028	中国石化	2,000,000	14,040,000.00	0.08
71	600785	新华百货	1,284,464	13,551,095.20	0.08
72	600697	欧亚集团	900,384	13,010,548.80	0.07
73	000422	湖北宜化	1,604,260	12,400,929.80	0.07
74	600085	同仁堂	1,000,000	12,310,000.00	0.07
75	600196	复星医药	1,100,000	11,671,000.00	0.07
76	600607	上实医药	956,049	11,434,346.04	0.06
77	600327	大厦股份	1,842,452	10,225,608.60	0.06
78	002264	新华都	484,387	8,781,936.31	0.05
79	600188	兖州煤业	1,036,028	8,536,870.72	0.05
80	000759	武汉中百	903,295	8,490,973.00	0.05
81	600280	南京中商	1,201,478	7,833,636.56	0.04
82	600660	福耀玻璃	1,842,200	7,166,158.00	0.04
83	002251	步步高	155,630	6,552,023.00	0.04
84	600361	华联综超	980,855	6,042,066.80	0.03
85	600487	亨通光电	599,906	5,939,069.40	0.03
86	600436	片仔癀	281,773	5,317,056.51	0.03
87	600062	双鹤药业	212,983	5,130,760.47	0.03
88	600439	瑞贝卡	500,000	4,735,000.00	0.03
89	000987	广州友谊	443,391	4,691,076.78	0.03
90	600276	恒瑞医药	110,000	4,236,100.00	0.02
91	000910	大亚科技	1,017,598	4,019,512.10	0.02
92	002106	莱宝高科	570,776	3,972,600.96	0.02
93	600267	海正药业	200,000	2,988,000.00	0.02
94	600479	千金药业	150,000	2,907,000.00	0.02
95	600993	马应龙	99,950	2,416,791.00	0.01
96	600517	置信电气	100,000	2,239,000.00	0.01
97	600859	王府井	104,480	1,985,120.00	0.01
98	600216	浙江医药	100,000	1,404,000.00	0.01
99	600962	国投中鲁	100,000	753,000.00	0.00
100	002252	上海莱士	27,141	684,496.02	0.00

101	002257	立立电子	26,000	567,060.00	0.00
102	002261	拓维信息	16,911	431,230.50	0.00
103	002268	卫士通	11,179	237,665.54	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	000002	万科A	1,001,028,417.45	2.50
2	601166	兴业银行	836,484,803.34	2.09
3	002024	苏宁电器	570,028,660.60	1.42
4	601919	中国远洋	552,238,621.54	1.38
5	600048	保利地产	513,413,716.73	1.28
6	600519	贵州茅台	512,494,242.87	1.28
7	000858	五粮液	509,840,777.80	1.27
8	600875	东方电气	452,828,145.62	1.13
9	000157	中联重科	406,659,581.34	1.02
10	600123	兰花科创	367,573,983.72	0.92
11	601898	中煤能源	338,044,823.63	0.84
12	600031	三一重工	318,163,863.08	0.80
13	600030	中信证券	296,939,512.87	0.74
14	000878	云南铜业	296,021,921.74	0.74
15	601318	中国平安	289,199,218.55	0.72
16	600000	浦发银行	280,798,904.65	0.70
17	600325	华发股份	276,126,730.10	0.69
18	600596	新安股份	258,661,868.75	0.65
19	600089	特变电工	248,051,659.48	0.62
20	600362	江西铜业	238,727,965.90	0.60

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

##### 8.4.2 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	601939	建设银行	527,098,621.30	1.32
2	000002	万 科A	516,524,112.91	1.29
3	600019	宝钢股份	475,543,910.56	1.19
4	601857	中国石油	421,156,527.91	1.05
5	600900	长江电力	363,504,635.56	0.91
6	000709	唐钢股份	302,282,156.63	0.76
7	601318	中国平安	298,294,389.18	0.75
8	000063	中兴通讯	277,666,450.90	0.69
9	600362	江西铜业	270,062,130.50	0.67
10	600000	浦发银行	266,131,843.58	0.67
11	000060	中金岭南	261,411,514.34	0.65
12	600030	中信证券	252,080,217.45	0.63
13	000001	深发展A	216,743,647.69	0.54
14	000755	山西三维	214,175,986.69	0.54
15	600875	东方电气	205,421,895.90	0.51
16	000878	云南铜业	193,674,465.86	0.48
17	600331	宏达股份	185,494,920.24	0.46
18	000858	五 粮 液	183,803,044.61	0.46
19	002018	华星化工	182,347,449.52	0.46
20	601919	中国远洋	182,133,142.80	0.46

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	15,652,399,691.03
卖出股票收入（成交）总额	11,434,205,185.09

#### 8.5 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	311,070,000.00	1.75
2	央行票据	1,511,519,000.00	8.51
3	金融债券	844,800,000.00	4.76
	其中：政策性金融债	844,800,000.00	4.76
4	企业债券	408,223,312.59	2.30
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,075,612,312.59	17.32



### 8.6 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

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	0801044	08 央票 44	4,300,000	459,455,000.00	2.59
2	0801047	08 央票 47	3,800,000	406,220,000.00	2.29
3	080019	08 国债 19	3,000,000	311,070,000.00	1.75
4	0801065	08 央票 65	2,200,000	235,884,000.00	1.33
5	112006	08 万科 G2	2,083,451	220,824,971.49	1.24

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.8 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。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

8.9.2 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。

#### 8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,222,273.36
2	应收证券清算款	236,255,487.23
3	应收股利	-
4	应收利息	57,562,924.71
5	应收申购款	8,377,558.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	304,418,243.32

#### 8.9.4 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。

### 8.9.5 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	002024	苏宁电器	143,280,000.00	0.81	非公开发行

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
3,143,973	12,213.21	498,348,155.68	1.30%	37,899,666,370.37	98.70%

### 9.2 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	664,454.89	0.0017%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( _年_月_日 ) 基金份额总额	1,315,856,024.96
报告期期初基金份额总额	38,406,547,831.83
报告期期间基金总申购份额	7,199,685,547.16
报告期期间基金总赎回份额	7,208,218,852.94
报告期期间基金拆分变动份额 ( 份额减少以 “-” 填列 )	0
报告期期末基金份额总额	38,398,014,526.05

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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等。

### 11.2 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

1、报告期内基金管理人发生的重大人事变动如下：

2008 年 3 月 9 日，经广发基金管理有限公司 2008 年度股东会第一次会议审议通过，公司董事、监事发生以下变更：1) 选举林传辉、翟美卿、戈俊为广发基金管理有限公司第二届董事会董事，同意李建绍辞去广发基金管理有限公司董事职务；2) 选举许冬瑾为广发基金管理有限公司第二届监事会监事，同意张永清辞去广发基金管理有限公司监事职务。

2008 年 6 月 6 日，经广发基金管理有限公司 2008 年度股东会第四次会议审议通过：1) 选举马庆泉、林传辉、孙晓燕、戈俊、翟美卿、许冬瑾、罗海平、董茂云、姚海鑫为广发基金管理有限公司第三届董事会董事；2) 选举余利平、匡丽军为广发基金管理有限公司第三届监事会股东监事。经广发基金管理有限公司职工民主选举，推举刘文红为广发基金管理有限公司第三届监事会职工监事。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度应支付审计机构深圳鹏城会计师事务所本基金审计费用捌万元。截至本报告期末，深圳鹏城会计师事务所已连续三年为本基金提供审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		权证交易		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	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	9,544,335,942.57	37.91%	12,026,375.90	3.61%	-	-	8,066,276.09	38.05%	
国泰君安	1	88,053,353.11	0.35%	-	-	-	-	71,543.15	0.34%	
银河证券	1	1,581,021,437.07	6.28%	-	-	-	-	1,343,877.63	6.34%	
申银万国	1	1,497,625,425.23	5.95%	5,223,545.73	1.57%	13,419,536.38	16.72%	1,272,980.34	6.00%	
广发华福	2	2,676,792,003.54	10.63%	39,629,162.50	11.91%	56,207,834.44	70.02%	2,182,488.26	10.29%	
中信建投	1	1,956,266,334.17	7.77%	-	-	-	-	1,662,815.58	7.84%	
长江证券	1	1,408,316,763.41	5.59%	-	-	-	-	1,197,061.09	5.65%	
联合证券	1	962,133,113.69	3.82%	28,500,211.40	8.57%	-	-	945,188.28	4.46%	
中信证券	1	2,922,985,555.83	11.61%	247,323,187.74	74.34%	10,648,173.10	13.26%	2,374,955.95	11.20%	
德邦证券	1	306,875,128.43	1.22%	-	-	-	-	260,839.34	1.23%	
国联证券	1	1,019,404,152.52	4.05%	-	-	-	-	828,273.94	3.91%	新增
平安证券	1	949,529,538.82	3.77%	-	-	-	-	771,500.26	3.64%	新增
国金证券	1	262,629,850.30	1.04%	-	-	-	-	223,234.61	1.05%	新增
合计	15	25,175,968,598.69	100%	332,702,483.27	100%	80,275,543.92	100.00%	21,201,034.52	100%	

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等服务；
- e 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：

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：a 研究报告时效性；b 研究报告的质量；c 报告数量；d 服务沟通情况。

**11.8 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	本基金及管理人旗下其他相关基金的参与了吉林华微电子股份有限公司（华微电子，代码：600360）非公开发行股票的认购。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 1 月 11 日
2	对通过浦发银行网上银行申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投资者给予申购费率优惠。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 1 月 12 日
3	本基金管理人已于 2008 年 1 月 15 日迁入新的地址办公：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 1 月 16 日
4	本基金及管理人旗下其他相关基金自 2008 年 1 月 16 日起新增平安银行为代销机构。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 1 月 16 日
5	自 2008 年 1 月 18 日到 2008 年 7	在《中国证券报》、	2008 年 1 月 18 日

	月 18 日, 本基金及管理人旗下其他相关基金参加光大银行推出的基金定投优惠活动。	《证券时报》、《上海证券报》发布公告	
6	本基金及管理人旗下其他相关基金自 2008 年 1 月 23 日起新增北京银行为代销机构。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 1 月 22 日
7	从 2008 年 1 月 29 日起, 在德邦证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司和国联证券有限责任公司、东海证券有限责任公司正式推出本基金及管理人旗下其他相关基金的“开放式基金定期定额投资业务”。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 1 月 29 日
8	本基金及管理人旗下其他相关基金参加招商银行网上银行申购费率(只限前端申购模式)优惠活动的活动截止日期由原来的 2008 年 2 月 29 日延期至 2008 年 3 月 31 日(截至当天法定交易时间)。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 2 月 25 日
9	自 2008 年 3 月 10 日起通过中国银行股份有限公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 3 月 7 日
10	本基金及管理人旗下其他相关基金参加上海银行推出的开放式基金定期定额投资业务优惠活动。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 3 月 12 日
11	2008 年 3 月 14 日起, 对通过中国农业银行定期定额申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投资	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日	2008 年 3 月 13 日

	者给予前端申购费率优惠。	报》发布公告	
12	从 2008 年 3 月 18 日起在兴业银行股份有限公司、深圳平安银行、北京银行股份有限公司开通基金转换业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 3 月 17 日
13	从 2008 年 3 月 18 日起在中信银行股份有限公司正式推出开放式基金定期定额投资业务和基金转换业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 3 月 17 日
14	从 2008 年 3 月 18 日起在东北证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司和国海证券有限责任公司正式推出“开放式基金定期定额投资业务”。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 3 月 17 日
15	从 2008 年 3 月 24 日起在华泰证券股份有限公司正式推出本基金及管理人旗下其他相关基金的开放式基金定期定额投资业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 3 月 24 日
16	自 2008 年 3 月 26 日起通过信泰证券有限责任公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 3 月 25 日
17	自 2008 年 3 月 31 日起通过渤海证券有限责任公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 3 月 29 日
18	对 2008 年 4 月 1 日—2009 年 3 月 31 日期间通过工商银行网上银行申购本基金及管理人旗下其他相	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日	2008 年 4 月 1 日

	关基金的投资者给予申购费率(只限前端申购费用)优惠。	报》发布公告	
19	自 2008 年 4 月 8 日起增加长江证券股份有限公司为本基金及管理人旗下其他相关基金的代理销售机构。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 4 月 8 日
20	从 2008 年 4 月 11 日起在北京银行股份有限公司正式推出本基金及管理人旗下其他相关基金的“开放式基金定期定额投资业务”。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 4 月 11 日
21	自 2008 年 5 月 6 日起增加国盛证券有限责任公司为本基金及管理人旗下其他相关基金的代理销售机构。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 5 月 6 日
22	对 2008 年 5 月 8 日起至 2008 年 12 月 31 日期间通过民生银行网上银行申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投资者给予申购费率(只限前端申购费用)优惠。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 5 月 8 日
23	本基金及管理人旗下其他相关基金参与了苏宁电器股份有限公司非公开发行股票的认购。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 5 月 24 日
24	自 2008 年 5 月 27 日起通过瑞银证券有限责任公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 5 月 27 日
25	自 2008 年 5 月 30 日起通过恒泰证券有限责任公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日	2008 年 5 月 30 日



		报》发布公告	
26	决定从 2008 年 5 月 30 日起在中国建设银行股份有限公司开通基金转换业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 5 月 30 日
27	从 2008 年 5 月 30 日起在中国农业银行开通基金转换业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 5 月 30 日
28	从 2008 年 6 月 13 日起, 华夏银行开始代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 6 月 11 日
29	本基金及管理人旗下其他相关基金自 2008 年 6 月 16 日起参与交通银行开展的定期定额申购业务费率优惠活动。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 6 月 13 日
30	对持有中国农业银行金穗卡的个人投资者开通网上交易定期定额投资业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 6 月 23 日
31	自 2008 年 6 月 26 日起通过宁波银行股份有限公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 6 月 26 日
32	对 2008 年 7 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日通过中信银行网上银行申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投资者给予申购费率(只限前端申购费用)优惠。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 7 月 1 日
33	从 2008 年 7 月 8 日起在国盛证券	在《中国证券报》、	2008 年 7 月 7 日

	有限责任公司正式推出"开放式基金定期定额投资业务"。	《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	
34	自公告之日起至2009年1月18日,本基金及管理人旗下其他相关基金参加光大银行推出的“用‘薪’投资,轻松理财”基金定投申购费率八折优惠活动。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008年7月19日
35	自2008年7月23日起,本公司通过中国民生银行办理的本基金及管理人旗下其他相关基金的基金定期定额投资业务,其最低申购金额变更为不低于人民币200元(含200元)。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008年7月23日
36	本公司已于2008年9月16日起,按照指数收益法对旗下基金相关停牌股票的估值方法进行了调整。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008年9月17日
37	从2008年9月18日起在恒泰证券有限责任公司正式推出“开放式基金定期定额投资业务”。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008年9月18日
38	于2008年10月1日起,对通过浦发银行网上银行申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投资者给予前端申购费率优惠。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008年9月24日
39	2008年10月7日起,对使用农行金穗卡网银结算方式的网上直销电子交易申购费率进行调整。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008年10月6日
40	从2008年10月27日起在万联证	在《中国证券报》、	2008年10月25日

	券有限责任公司正式推出“开放式基金定期定额投资业务”。	《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	
41	自 2008 年 11 月 3 日起本基金及管理人旗下其他相关基金参加浦发银行的基金定投优惠活动。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 10 月 30 日
42	自 2008 年 11 月 14 日起通过中国建银投资证券有限责任公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 11 月 13 日
43	从 2008 年 11 月 14 日起在安信证券股份有限公司开通本基金及管理人旗下其他相关基金的基金转换业务。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 11 月 13 日
44	自 2008 年 11 月 17 日起通过宏源证券股份有限公司代理销售本基金及管理人旗下其他相关基金。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》发布公告	2008 年 11 月 14 日
45	本基金及管理人旗下其他相关基金自 2008 年 11 月 25 日起参与广发证券开展的定期定额申购业务费率优惠活动。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 11 月 24 日
46	自 2008 年 12 月 15 日起，通过深圳平安银行网上银行申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投资者均可享有优惠。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 12 月 13 日
47	自 2008 年 12 月 15 日起，通过深圳发展银行电话银行申购本基金及管理人旗下其他相关基金的投	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 12 月 13 日

	资者均可享有优惠。		
48	本基金及管理人旗下其他相关基金参与建设银行推出的 2009 年基金定投长期申购费率优惠活动。	在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告	2008 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录:

1. 中国证监会批准广发聚丰股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《广发聚丰股票型证券投资基金托管协议》;
4. 《广发聚丰股票型证券投资基金招募说明书》;
5. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
6. 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值和其他临时公告。

### 12.2 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。

### 12.3 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>。