
广发聚丰股票型证券投资基金
2009 年年度报告摘要
2009 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

报告送出日期：二〇一〇年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2010 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发聚丰股票	
基金主代码	270005	
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	
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	35,793,780,966.11份	

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	010-66106912
	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	010-66106904	

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	深圳市鹏城会计师事务所有限公司	深圳市福田区滨河大道5022号联合广场A座7楼
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、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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	-1,853,349,132.42	-8,439,438,465.23	1,858,868,714.28
本期利润	13,381,175,807.32	-22,346,076,401.41	4,533,028,079.62
加权平均基金份额本期利润	0.3555	-0.5829	0.4172
本期加权平均净值利润率	52.47%	-86.48%	34.02%
本期基金份额净值增长率	75.64%	-55.60%	157.68%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	-1,447,992,320.23	256,660,991.83	8,727,503,550.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0405	0.0067	0.2272
期末基金资产净值	29,083,845,390.00	17,762,141,332.39	40,018,323,286.18
期末基金份额净值	0.8125	0.4626	1.0420
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率	390.28%	179.14%	528.68%

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	15.22%	1.59%	15.91%	1.40%	-0.69%	0.19%
过去六个月	12.69%	1.85%	11.55%	1.69%	1.14%	0.16%
过去一年	75.64%	1.73%	77.21%	1.63%	-1.57%	0.10%
过去三年	100.95%	2.05%	61.97%	2.02%	38.98%	0.03%
自基金成立起至今	390.28%	1.91%	238.92%	1.83%	151.36%	0.08%

注：

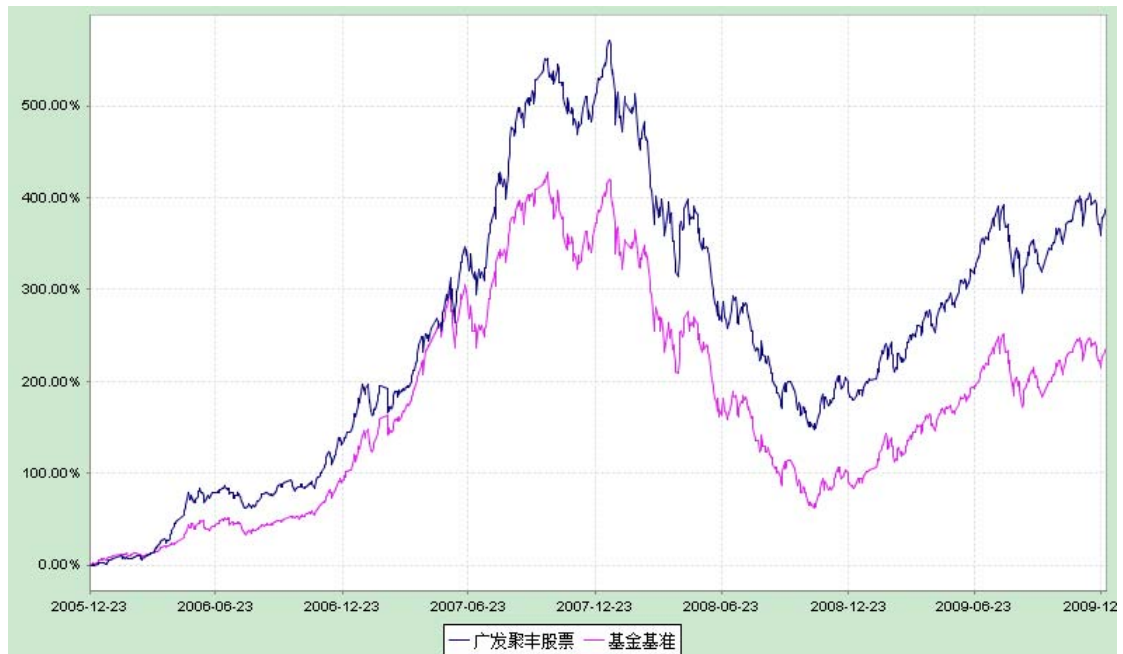
- 1、业绩比较基准: $80\% \times \text{新华富时 A600 指数} + 20\% \times \text{新华巴克莱资本中国全债指数}$ 。
- 2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发聚丰股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年12月23日至2009年12月31日)

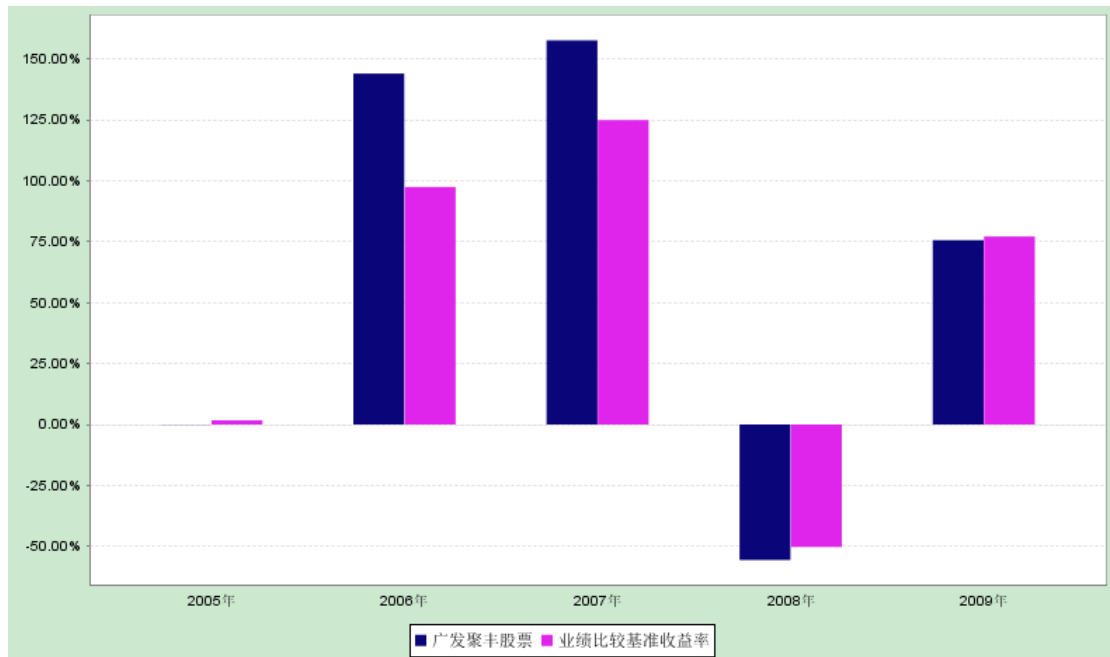


注：本基金基金合同生效日为2005年12月23日，图示时间段为2005年12月23日至2009年12月31日。

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

广发聚丰股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：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
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
2007	4.500	488,240,613.96	897,230,651.79	1,385,471,265.75	-
合计	4.500	488,240,613.96	897,230,651.79	1,385,471,265.75	-

§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和特定资产管理业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和16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、投资管理部、中央交易部、固定收益部、研究发展部、机构理财部、机构投资部、国际业务部、金

融工程部、市场拓展部。此外，还设立了北京分公司、广州分公司和上海分公司。

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金管理人管理十二只开放式基金---广发聚富证券投资基金、广发稳健增长证券投资基金、广发小盘成长证券投资基金、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)，管理资产规模为 1104.71 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、投资管理部总经理、本基金的基金经理	2005-12-23	-	13	男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，1997 年 1 月至 2002 年 11 月任职于广发证券股份有限公司，2002 年 11 月至 2003 年 11 月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员，2003 年 12 月 3 日至 2007 年 3 月 28 日任广发聚富混合基金的基金经理，2005 年 5 月至今任广发基金管理有限公司投资管理部总经理，2005 年 12 月 23 日起任广发聚丰股票基金的基金经理，2006 年 9 月至 2008 年 4 月 16 日任广发基金管理有限公司总经理助理，2008 年 4 月 17 日起任广发基金管理有限公司投资总监。
傅友兴	研究发展部副总经理、本基金的基金经理助理	2008-10-09	-	8	男，中国籍，金融学硕士，持有证券业执业资格证书和特许金融分析师证（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，2007 年 7 月 24 日起任研究发展部副经理

					理, 2008年10月9日起任广发聚丰股票基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	---------------------------------

(1) 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

(2) 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。

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。

公司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

本公司管理的投资组合包括开放式基金 12 只, 企业年金 7 只, 特定客户资产管理计划 9 个。与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发小盘成长股票(LOF)、广发核心精选股票和广发聚瑞股票。报告期内, 本基金净值增长率与广发核心精选股票、广发小盘成长股票(LOF) 净值增长率差异分别为 6.61%和 11.95%, 主要原因是本基金与上述两基金在仓

位配置方面存在一定差异所致。广发聚瑞股票未完整运作满整个报告期，故本基金不适宜与其进行业绩比较。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年，全球政府为应对美国次贷危机引发的全球经济危机，一致采取了空前宽松的货币政策及积极的财政干预政策。中国借助稳健运行的银行体系，在世人一片崩溃的悲观论调中率先复苏。资本市场也绝地重生，投资者信心恢复，股指在估值回升和赢利增长双重推动下走出了较大的上升行情，三季度政府开始考虑政策退出，市场出现较大的调整，但第四季度在内需推动下，在良好的经济基本面推动下市场重新上升到 3000 点以上。本基金在年初坚信全球经济走向复苏，开始加大权益类配置比重，且重点投向受益于经济复苏最大的上游原材料行业和中游的制造业以及金融服务业和房地产业。三季度，全国房地产价格叠创新高，开始出现泡沫，本基金认为政府肯定会干预市场，于是果断减持了房地产行业的配置。基于对政府救经济政策逐步退出的预期，结合估值情况，本基金减持了上游周期性的配置，增加了下游消费品行业的持仓。

回顾本报告期的投资，本基金在节奏和配置方向上基本正确，这是全年取得较好的业绩绩效的根本原因。但有很多值得检讨之处，主要有：年初已经判断经济步入复苏之路，但在配置方面没有将股票仓位及时加到上限；三季度减持上游周期性行业和房地产时也没有做到彻底；在二季度国家推出刺激国内消费政策时，尽管也看到了包括汽车、家电的井喷，没有在上述行业追涨、增加配置；还有集中度较高等等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金净值增长 75.64%，比较基准增长 77.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为，国内经济增长趋势不会改变。国外经济体中尽管欧洲国家出现一些问题，但总体复苏格局不会改变，不会出现二次探底的状况。明年国外会进入补库存阶段，我国出口明年开始复苏。就政策而言，上半年国内救市政策的退出是一个大概率事件。政策退出对周期性股票产生压制，上半年很难有超额收益。影响资本市场明年走势的还有融资的压力。

2010 年应是中国经济转型元年，也是经济发展新周期开始。本基金将结合国内长期发展格局和短期推动因素，重点布局内需和新技术、新产业以及能源和优势制造业，适度参与国内区域经济政策调整带来的投资机会。本基金将认真总结过去运作的经验教训，努力实现基金业绩平稳增长。

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。本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“(三) 基金收益分配原则”的相关规定，本基金本年末可供分配利润为-1,447,992,320.23 元，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

2009 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 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 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丰股票型证券投资基金 2009 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

深圳市鹏城会计师事务所有限公司审计了广发聚丰股票型证券投资基金 2009 年 12 月 31 日的资产负债表和 2009 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，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资 产：			
银行存款		2,777,926,038.73	2,483,180,930.22
结算备付金		21,508,065.91	12,524,034.81
存出保证金		7,017,566.40	2,222,273.36
交易性金融资产		26,342,571,893.65	15,137,049,362.33
其中：股票投资		26,342,571,893.65	12,061,437,049.74
基金投资		-	-
债券投资		-	3,075,612,312.59
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		31,650,680.86	236,255,487.23
应收利息		470,546.27	57,562,924.71
应收股利		-	-

应收申购款		2,290,093.51	8,377,558.02
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		29,183,434,885.33	17,937,172,570.68
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2009年12月31日	2008年12月31日
负 债：			
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		9,504,733.75	51,602,377.27
应付赎回款		36,785,600.43	89,778,942.53
应付管理人报酬		36,961,925.29	23,775,491.30
应付托管费		6,160,320.87	3,962,581.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		8,447,413.50	4,098,078.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,729,501.49	1,813,766.47
负债合计		99,589,495.33	175,031,238.29
所有者权益：			
实收基金		7,906,943,101.18	8,482,222,002.55
未分配利润		21,176,902,288.82	9,279,919,329.84
所有者权益合计		29,083,845,390.00	17,762,141,332.39
负债和所有者权益总计		29,183,434,885.33	17,937,172,570.68

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8125 元，基金份额总额 35,793,780,966.11 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2009年1月1日至2009年12 月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12 月31日
一、收入	13,900,885,459.48	-21,818,495,483.56
1. 利息收入	52,532,285.77	99,051,506.25
其中：存款利息收入	22,471,345.59	43,464,757.90

债券利息收入		30,060,940.18	55,027,882.15
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）		-1,388,725,011.24	-8,017,234,765.01
其中：股票投资收益		-1,699,105,741.72	-8,185,351,398.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益		103,163,116.04	67,334,970.58
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		36,030.97	-59,549,304.09
股利收益		207,181,583.47	160,330,966.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		15,234,524,939.74	-13,906,637,936.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,553,245.21	6,325,711.38
减：二、费用		519,709,652.16	527,580,917.85
1. 管理人报酬		379,415,677.83	390,867,905.03
2. 托管费		63,235,946.37	65,144,650.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		76,609,519.77	71,120,121.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		448,508.19	448,240.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,381,175,807.32	-22,346,076,401.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,381,175,807.32	-22,346,076,401.41

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：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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）	8,482,222,002.55	9,279,919,329.84	17,762,141,332.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,381,175,807.32	13,381,175,807.32
三、本期基金份额交易产生的基金净	-575,278,901.37	-1,484,192,848.34	-2,059,471,749.71

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	772,948,832.21	1,491,821,658.25	2,264,770,490.46
2. 基金赎回款	-1,348,227,733.58	-2,976,014,506.59	-4,324,242,240.17
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）	7,906,943,101.18	21,176,902,288.82	29,083,845,390.00
项目	上年度可比期间 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基金净值变动数（本期利润）	-	-22,346,076,401.41	-22,346,076,401.41
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	-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

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：马庆泉，主管会计工作负责人：林传辉，会计机构负责人：张晓

章

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 日宣告对截至 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 2010 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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《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》,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 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
康美药业股份有限公司	基金管理人股东

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	11,467,609,163.09	22.76%	9,544,335,942.57	37.91%
广发华福证券有限责任公司	1,777,734,419.55	3.53%	2,676,792,003.54	10.63%

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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
广发华福证券有限责任公司	-	-	56,207,834.44	70.02%

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	161,984,678.85	51.74%	12,026,375.90	3.61%
广发华福证券有限责任公司	-	-	39,629,162.50	11.91%

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009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	9,504,447.05	22.50%	2,754,888.14	32.61%
广发华福证券有限责任公司	1,501,103.69	3.55%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	379,415,677.83	390,867,905.03
其中：支付销售机构的客户维护费	59,458,058.39	58,520,580.49

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	63,235,946.37	65,144,650.88

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	675,548,892.89	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
基金合同生效日2005年12月23日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	282,114,249.52	282,114,249.52
期间申购/买入总份额	-	-
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	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	0.79%	0.73%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

截至本报告期末，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，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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	2,777,926,038.73	22,165,919.38	2,483,180,930.22	43,164,934.23

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度均无在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新股认购流通受限	5.43	5.43	13,000	70,590.00	70,590.00	-
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	网下认购流通受限	11.78	20.94	131,060	1,543,886.80	2,744,396.40	-
600765	中航重机	2009-03-30	2010-03-26	非公开发行流	10.50	19.52	10,000,000	105,000,000.00	195,200,000.00	2009年7月24日派

				通受限							息，每10股派发现金红利0.60元(含税)。
002330	得利斯	2009-12-25	2010-01-06	新股认购 流通受限	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	-	
002303	美盈森	2009-10-22	2010-02-03	网下认购 流通受限	25.36	31.50	51,415	1,303,884.40	1,619,572.50	-	
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	网下认购 流通受限	60.00	113.99	33,407	2,004,420.00	3,808,063.93	-	
002327	富安娜	2009-12-22	2010-03-30	网下认购 流通受限	30.00	39.66	27,665	829,950.00	1,097,193.90	-	
002122	天马股份	2009-02-17	2010-02-22	非公开发行 流通受限	23.50	28.54	2,000,000	47,000,000.00	57,080,000.00	2009年4月2日,天马股份送股,比例:10送10,派息:每10股派发现金红利1元(含税)	
002146	荣盛发展	2009-09-04	2010-09-07	非公开发行 流通受限	12.50	15.15	4,520,000	56,500,000.00	68,478,000.00	-	
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-01-08	新股认购 流通受限	28.99	28.99	500	14,495.00	14,495.00	-	
300040	九洲电气	2009-12-28	2010-01-08	新股认购 流通受限	33.00	33.00	500	16,500.00	16,500.00	-	
300011	鼎汉技术	2009-10-15	2010-02-01	网下认购 流通受限	37.00	70.00	31,325	1,159,025.00	2,192,750.00	-	
300014	亿纬锂能	2009-10-15	2010-02-01	网下认购 流通受限	18.00	39.55	32,686	588,348.00	1,292,731.30	-	

300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	网下认购 流通受限	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	-
300019	硅宝科技	2009-10-15	2010-02-01	网下认购 流通受限	23.00	43.74	41,754	960,342.00	1,826,319.96	-
300024	机器人	2009-10-19	2010-02-01	网下认购 流通受限	39.80	72.28	26,015	1,035,397.00	1,880,364.20	-

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有流通受限债券。

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有流通受限权证。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000159	国际实业	2009-12-10	重大 事项 停牌	18.77	2010-01-08	20.00	5,495,249	83,509,817.78	103,145,823.73	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 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。

§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	26,342,571,893.65	90.27
	其中：股票	26,342,571,893.65	90.27

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	2,799,434,104.64	9.59
6	其他各项资产	41,428,887.04	0.14
7	合计	29,183,434,885.33	100.00

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	-	-
B	采掘业	4,212,011,813.18	14.48
C	制造业	10,940,435,528.15	37.62
C0	食品、饮料	2,574,532,653.93	8.85
C1	纺织、服装、皮毛	11,586,894.54	0.04
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	458,240,778.26	1.58
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,319,774,509.98	7.98
C5	电子	34,092,731.30	0.12
C6	金属、非金属	1,179,343,911.96	4.05
C7	机械、设备、仪表	3,458,069,249.61	11.89
C8	医药、生物制品	904,794,798.57	3.11
C99	其他制造业	-	-
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	205,998,856.70	0.71
G	信息技术业	1,483,954,500.00	5.10
H	批发和零售贸易	3,405,386,368.14	11.71
I	金融、保险业	4,015,290,000.00	13.81
J	房地产业	1,847,473,595.04	6.35
K	社会服务业	105,340,755.34	0.36
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	126,680,477.10	0.44
	合计	26,342,571,893.65	90.57

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大股票投资明细

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	601166	兴业银行	65,000,000	2,620,150,000.00	9.01
2	600519	贵州茅台	14,950,000	2,538,809,000.00	8.73
3	002024	苏宁电器	115,900,000	2,408,402,000.00	8.28
4	000792	盐湖钾肥	26,181,588	1,492,088,700.12	5.13
5	000063	中兴通讯	33,000,000	1,480,710,000.00	5.09
6	601666	平煤股份	38,000,000	1,216,000,000.00	4.18
7	600000	浦发银行	56,000,000	1,214,640,000.00	4.18
8	600123	兰花科创	27,000,000	1,180,980,000.00	4.06
9	600089	特变电工	40,596,194	966,189,417.20	3.32
10	000157	中联重科	36,000,000	936,360,000.00	3.22

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.gffunds.com.cn 网站的年度报告正文。

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	000792	盐湖钾肥	1,221,286,310.19	6.88
2	601857	中国石油	1,088,537,983.76	6.13
3	600036	招商银行	1,085,115,308.20	6.11
4	600519	贵州茅台	985,798,247.80	5.55
5	600030	中信证券	919,636,373.69	5.18
6	002024	苏宁电器	907,792,154.00	5.11
7	601919	中国远洋	783,166,482.72	4.41
8	601166	兴业银行	766,200,139.92	4.31
9	000063	中兴通讯	707,729,356.36	3.98
10	600089	特变电工	682,669,542.64	3.84
11	600642	申能股份	615,423,696.59	3.46
12	601699	潞安环能	574,034,460.24	3.23
13	000402	金融街	530,822,397.77	2.99
14	000717	韶钢松山	517,705,669.53	2.91
15	600015	华夏银行	494,833,190.47	2.79
16	600583	海油工程	482,433,960.65	2.72
17	000933	神火股份	432,944,723.08	2.44
18	000060	中金岭南	425,215,598.11	2.39
19	601666	平煤股份	396,823,069.91	2.23
20	000680	山推股份	356,342,088.58	2.01

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	600036	招商银行	1,324,023,895.86	7.45
2	600048	保利地产	1,131,426,905.95	6.37
3	601857	中国石油	1,085,797,388.82	6.11
4	600383	金地集团	1,033,786,754.78	5.82
5	600030	中信证券	970,701,087.64	5.47
6	601318	中国平安	797,815,241.09	4.49
7	601919	中国远洋	724,471,492.24	4.08
8	600875	东方电气	706,830,140.95	3.98
9	600000	浦发银行	653,035,446.34	3.68
10	600089	特变电工	647,535,537.37	3.65
11	600642	申能股份	589,399,481.89	3.32
12	000060	中金岭南	530,440,958.31	2.99
13	600428	中远航运	518,461,544.06	2.92
14	600015	华夏银行	516,423,599.33	2.91
15	000002	万科A	488,747,675.92	2.75
16	600583	海油工程	458,620,084.18	2.58
17	000792	盐湖钾肥	456,996,682.25	2.57
18	002024	苏宁电器	445,971,512.77	2.51
19	000718	苏宁环球	437,698,043.39	2.46
20	601088	中国神华	405,543,228.28	2.28
21	000926	福星股份	388,121,384.16	2.19
22	000858	五粮液	361,611,551.04	2.04
23	601666	平煤股份	355,682,014.81	2.00

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

买入股票的成本（成交）总额	25,788,355,303.65
卖出股票的收入（成交）总额	25,163,844,024.69

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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大资产支持证券投资明细

注：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

注：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 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。

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 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	7,017,566.40
2	应收证券清算款	31,650,680.86
3	应收股利	-
4	应收利息	470,546.27
5	应收申购款	2,290,093.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,428,887.04

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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
2,880,377	12,426.77	87,857,145.17	0.25%	35,705,923,820.94	99.75%

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	1,973,458.18	0.0055%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005-12-23）基金份额总额	1,315,856,024.96
本报告期期初基金份额总额	38,398,014,526.05
本报告期期间基金总申购份额	3,498,980,287.36
减：本报告期期间基金总赎回份额	6,103,213,847.30
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	35,793,780,966.11

§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。

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：

经第三届董事会第六次会议审议通过，公司同意兰惠艳女士辞去公司督察长职务。

经第三届董事会第八次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2009】

501号文核准批复，公司聘任段西军先生为广发基金管理有限公司督察长。

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四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

11.7.1 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	1	1,633,427,452.85	3.24%	1,388,404.82	3.29%	新增
北京高华	1	4,289,732,844.83	8.51%	3,646,248.93	8.63%	新增
长江证券	1	4,033,314,266.23	8.01%	3,428,301.71	8.12%	-
德邦证券	1	1,118,811,166.54	2.22%	950,992.40	2.25%	-
广发华福	2	1,777,734,419.55	3.53%	1,501,103.69	3.55%	-
广发证券	2	11,467,609,163.09	22.76%	9,504,447.05	22.50%	-
国金证券	1	906,545,024.20	1.80%	770,557.03	1.82%	-
国联证券	1	982,980,900.58	1.95%	798,678.11	1.89%	-
国泰君安	1	1,444,037,303.23	2.87%	1,173,293.79	2.78%	-
联合证券	1	5,048,017,535.94	10.02%	4,290,781.48	10.16%	-
平安证券	2	1,832,953,236.86	3.64%	1,530,790.89	3.62%	新增 1个
申银万国	1	2,456,026,553.82	4.88%	2,087,608.86	4.94%	-
银河证券	1	3,643,115,182.18	7.23%	3,096,621.32	7.33%	-
英大证券	1	313,858,212.15	0.62%	266,783.76	0.63%	新增
中投证券	1	2,378,839,156.46	4.72%	2,021,998.18	4.79%	新增
中信建投	1	1,227,589,625.02	2.44%	1,043,445.46	2.47%	-
中信证券	1	5,825,227,366.95	11.56%	4,733,046.24	11.21%	-

注：

(1) 交易席位选择标准：

(一) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

(二) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(三) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需
要；

(四) 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；

(五) 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；

(六) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

(2) 交易席位选择流程：

1、对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选

择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
2、协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

11.7.2 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	48,289,259.70	15.43%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	161,660.00	0.05%	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
广发证券	161,984,678.85	51.74%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
联合证券	3,593,982.21	1.15%	-	-	535,253.05	100.00%
平安证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	99,018,736.65	31.63%	-	-	-	-

广发基金管理有限公司

二〇一〇年三月二十九

日