
广发聚瑞股票型证券投资基金
2009 年年度报告
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。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	11
§6 审计报告.....	11
6.1 管理层对财务报表的责任.....	12
6.2 注册会计师的责任.....	12
6.3 审计意见.....	12
§7 年度财务报表.....	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
7.4 报表附注.....	15
§8 投资组合报告.....	34
8.1 期末基金资产组合情况.....	34
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
8.7 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.....	41
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.....	41
8.9 投资组合报告附注.....	41
§9 基金份额持有人信息.....	42

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
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	42
§10 开放式基金份额变动	42
§11 重大事件揭示	42
11.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
11.4 基金投资策略的改变	42
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
§12 备查文件目录	48

§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	4,204,802,094.46份

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律，把握主题投资机会，通过精选个股和有效的风险控制，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1. 资产配置策略</p> <p>本基金为股票型基金，基金的资产配置比例范围为：股票资产占基金资产的60%—95%；现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%—40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>2. “主题投资分析框架”策略</p> <p>在股票投资方面，本基金主要采用自上而下的“主题投资分析框架”（Thematic Investing Analysis Frame），通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤，挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票，通过定量和定性相结合的方法，筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。</p>
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	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
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	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6月16日至2009年12月31日
本期已实现收益	-167,409,816.52
本期利润	431,741,972.56
加权平均基金份额本期利润	0.0674
本期加权平均净值利润率	6.66%
本期基金份额净值增长率	7.40%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末
期末可供分配利润	-23,819,502.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0057
期末基金资产净值	4,517,941,583.28
期末基金份额净值	1.074
3.1.3 累计期末指标	2009年末
基金份额累计净值增长率	7.40%

注：（1）本基金基金合同2009年6月16日生效，合同生效至披露时点未满一年。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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
过去三个月	18.67%	1.64%	15.28%	1.41%	3.39%	0.23%
过去六个月	6.65%	2.12%	10.29%	1.71%	-3.64%	0.41%
自基金成立起至今	7.40%	2.03%	16.35%	1.65%	-8.95%	0.38%

注：业绩比较基准： $80\% \times$ 沪深 300 指数 $+ 20\% \times$ 中证全债指数。

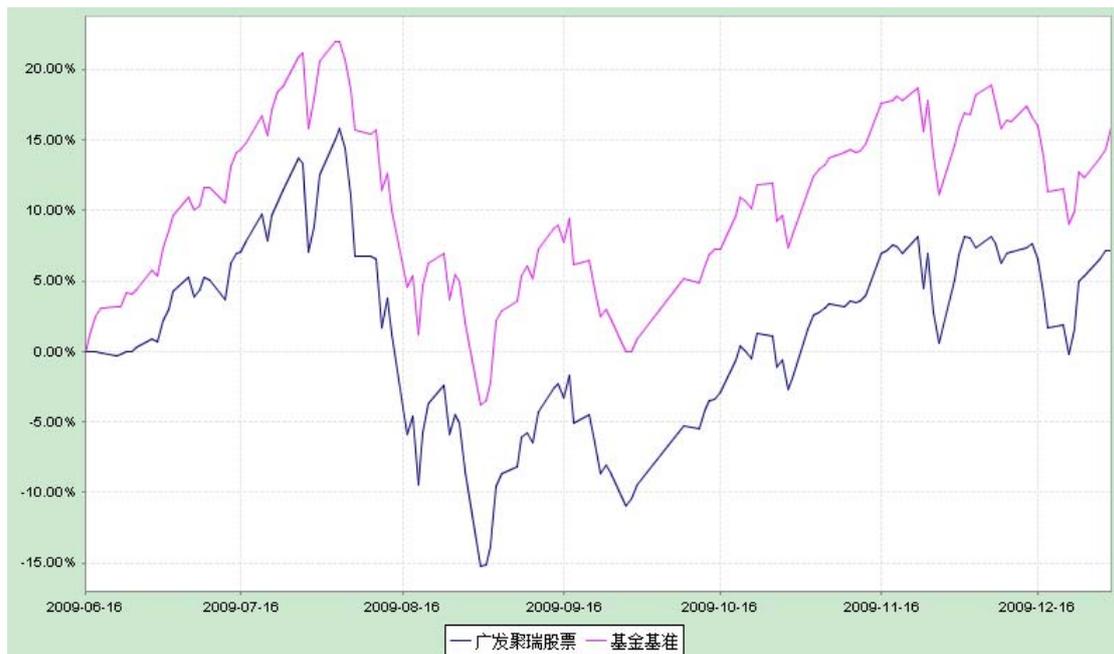
业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

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 2009 年 12 月 31 日)

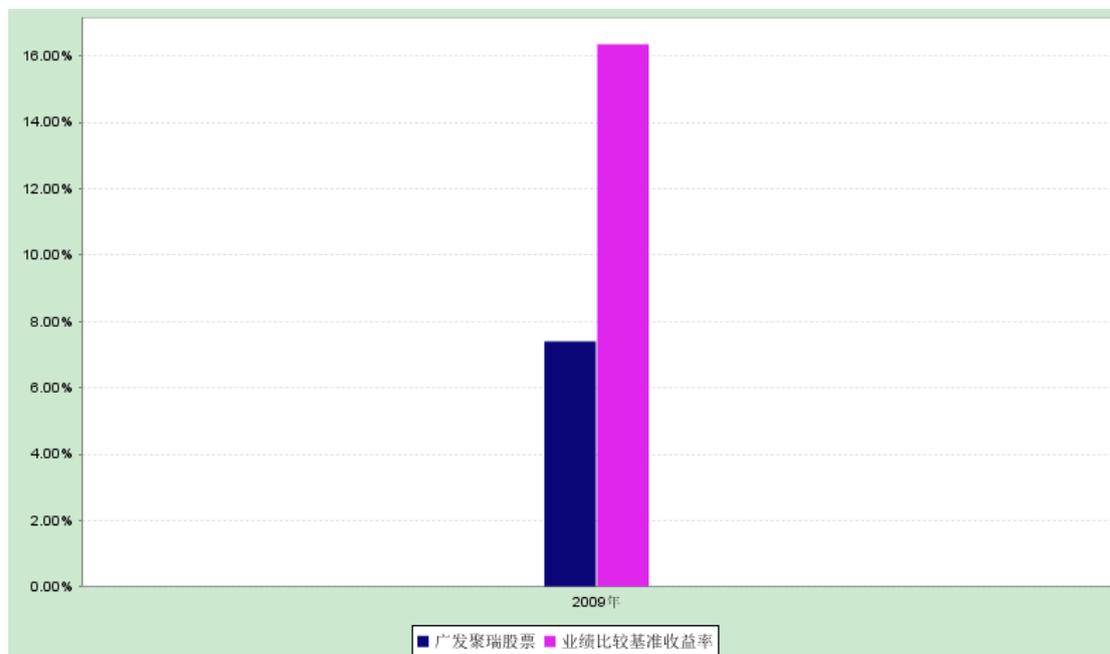


注：（1）基金合同生效日为 2009 年 6 月 16 日，基金合同生效日起至披露时点不满一年；
（2）本基金建仓期为六个月，本基金建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

广发聚瑞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



注：合同生效当年（2009 年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

§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		
刘明月	本基金的基金经理	2009-06-16	-	5	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。

(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、《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，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聚丰股票、广发核心精选股票和广发小盘股票三只开放式基金。本基金未完整运作满整个报告期，故本基金不适宜进行业绩比较。

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

在聚瑞基金建仓期间，配置主要集中在大金融、大周期类行业：煤炭、有色、钢铁、交运、化工、银行、保险、地产、通讯等。主要基于如下判断：国内经济企稳并开始复苏，刺激经济的一系列政策在逐步落实，同时预期 09 年下半年房地产投资增速将上升，因财富积累房地产、汽车、家电消费增速将会持续，国外经济可能已经见底但还未完全复苏。

随着国内经济形势不断好转、房价不断创新高、出口数据开始变好，防通胀成为政府调控的一个重要因素。宏观政策上开始动态微调，突出表现在地产行业政策和金融政策上。聚瑞基金的组合在第四季度也发生了较大的变化，从大金融大周期转向银行和大消费上，到 09 年底主要配置了银行、保险、医药、通讯、电子元器件、电力设备、商业、食品饮料等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发聚瑞基金从 6 月下旬即上证综指处于 2850 点左右开始建仓，到 09 年底为止收益率为 7.40%。在此期间，聚瑞基金的比较基准上涨 16.35%，落后基准的主要原因：聚瑞基金

为新基金，前三个月基本上为建仓期，建仓成本高、仓位低，同时仓位结构也不好。聚瑞基金在第三季度末建仓基本完毕，在第四季度聚瑞基金收益率为 18.67%，比较基准的收益率为 15.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国外经济不可能太好，缓慢回升；国内经济受地产调控的影响也不可能太乐观，总体上看经济将比较平稳。宏观经济政策层面不断动态调整，同时市场有一定的融资压力，所以说市场气氛和政策偏负面。

从证券市场的估值水平来看，医药电力设备通讯等稳定类股票的估值水平，按 10 年业绩来看估值水平基本合理。银行保险地产等大金融类股票受宏观预期的影响略有低估。钢铁有色煤炭等强周期类股票整体上来看高估，需要进一步的业绩提升来消化目前的高估值。

综合判断 2010 年，大盘将维持震荡向上的格局，但上涨幅度有限。结构性机会将比较突出，聚瑞基金将从宏观政策的变化、产业政策的调控方向以及具体受益的子行业子公司、估值水平等方面来配置子行业和精选个股。本基金相对比较看好大消费、自主创新技术和新兴战略性新兴产业。

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-23,819,502.47，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

深鹏所股审字[2010]071号

广发聚瑞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瑞股票型证券投资基金（简称“广发聚瑞基金”）财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表和 2009 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 基金管理人对财务报表的责任

按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《广发聚瑞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瑞基金的基金管理人——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。

6.2 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。

6.3 审计意见

我们认为，广发聚瑞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》、《广发聚瑞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瑞基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日的经营成果。

深圳市鹏城会计师事务所有限公司 注册会计师 杨克晶、侯立勋

深圳市福田区滨河大道

5022 号联合广场 A 座 7 楼

2010-03-26

§7 年度财务报表

7.1 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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	289,200,217.80
结算备付金		11,530,077.91
存出保证金		11,914,818.92
交易性金融资产	7.4.7.2	4,243,894,414.64
其中：股票投资		4,243,894,414.64
基金投资		-
债券投资		-
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		59,955,063.86
应收利息	7.4.7.5	65,932.72
应收股利		-
应收申购款		4,300,040.30
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		4,620,860,566.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009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		-
应付赎回款		88,849,695.84
应付管理人报酬		6,068,137.29
应付托管费		1,011,356.22
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.6	6,572,590.04
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	417,203.48
负债合计		102,918,982.87
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.8	4,204,802,094.46
未分配利润	7.4.7.9	313,139,488.82
所有者权益合计		4,517,941,583.28
负债和所有者权益总计		4,620,860,566.15

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.074 元，基金份额总额 4,204,802,094.46 份。本基金成立于 2009 年 6 月 16 日，本报告实际报告期间为 2009 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 6 月 16 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日
一、收入		536,457,111.42
1. 利息收入		4,282,261.77
其中：存款利息收入	7.4.7.10	4,282,261.77
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）		-70,961,915.13
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-85,769,170.75
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	7.4.7.12	14,807,255.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	599,151,789.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	3,984,975.70
减：二、费用		104,715,138.86

1. 管理人报酬		52,661,555.40
2. 托管费		8,776,925.90
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7. 4. 7. 15	43,049,565.14
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. 16	227,092.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		431,741,972.56
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		431,741,972.56

7.3 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：2009年6月16日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）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）	7,070,893,298.01	-	7,070,893,298.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	431,741,972.56	431,741,972.56
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）	-2,866,091,203.55	-118,602,483.74	-2,984,693,687.29
其中：1. 基金申购款	202,740,861.02	4,400,603.74	207,141,464.76
2. 基金赎回款	-3,068,832,064.57	-123,003,087.48	-3,191,835,152.05
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）	4,204,802,094.46	313,139,488.82	4,517,941,583.28

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》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 2008 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 7,070,893,298.01 元人民币，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 997,938.74 元人民币，折合基金份额 997,938.74 份，按照《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》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《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为本基金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 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日的经营成果。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

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。

（3）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。

（4）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。

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

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。

(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同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同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同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同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

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。

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

每份基金份额面值为 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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日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；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后，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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无其他需要说明的重要会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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 2009 年 12 月 31 日
活期存款	289,200,217.80
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	289,200,217.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,644,742,625.56	4,243,894,414.64	599,151,789.08
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	3,644,742,625.56	4,243,894,414.64	599,151,789.08

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止, 本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有买入返售证券金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
应收活期存款利息	61,897.22
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	4,035.50
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	65,932.72

7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	6,572,590.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,572,590.04

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	332,703.48
预提审计费	80,000.00
预提银行间帐户维护费	4,500.00
合计	417,203.48

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,070,893,298.01	7,070,893,298.01

本期申购	202,740,861.02	202,740,861.02
本期赎回（以“-”号填列）	-3,068,832,064.57	-3,068,832,064.57
本期末	4,204,802,094.46	4,204,802,094.46

注：*申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**本基金募集期间的有效净认购金额 7,069,895,359.27 元人民币，折合基金份额 7,069,895,359.27 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 997,938.74 元人民币，折合基金份额 997,938.74 份。本基金募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 7,070,893,298.01 份。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-167,409,816.52	599,151,789.08	431,741,972.56
本期基金份额交易产生的变动数	143,590,314.05	-262,192,797.79	-118,602,483.74
其中：基金申购款	-10,272,338.88	14,672,942.62	4,400,603.74
基金赎回款	153,862,652.93	-276,865,740.41	-123,003,087.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,819,502.47	336,958,991.29	313,139,488.82

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日
活期存款利息收入	4,121,153.36
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	158,923.83
其他	2,184.58
合计	4,282,261.77

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
	2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日

卖出股票成交总额	12,928,467,131.28
减：卖出股票成本总额	13,014,236,302.03
买卖股票差价收入	-85,769,170.75

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年 12月31日
股票投资产生的股利收益	14,807,255.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,807,255.62

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009 年12月31日
1. 交易性金融资产	599,151,789.08
——股票投资	599,151,789.08
——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	599,151,789.08

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年1 2月31日
基金赎回费收入	3,879,417.32
转换费	105,558.38
合计	3,984,975.70

7.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）至200 9年12月31日
交易所市场交易费用	43,049,565.14

银行间市场交易费用	-
合计	43,049,565.14

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	120,000.00
账户维护费	7,500.00
其他	900.00
银行汇划费	18,692.42
合计	227,092.42

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
康美药业股份有限公司	基金管理人股东

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	
	2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	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	12,807,334,858.51	43.38%

7.4.10.1.2 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6月16日（基金合同生效日）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	10,628,125.21	43.04%	2,111,620.68	32.13%

股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）。

上述佣金按市场佣金率计算，佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

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 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	52,661,555.40
其中：支付销售机构的客户维护费	9,147,865.31

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,776,925.90

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本报告期基金管理人无与关联方进行银行间同业市场的证券（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

截至本报告期内，本基金不存在基金管理人投资本基金的情况。

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，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 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	289,200,217.80	4,121,153.36

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2009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	备注
002146	荣盛发展	2009-09-04	2010-09-07	非公开发行	12.50	15.15	1,160,000	14,500,000.00	17,574,000.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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
7.4.12.1.3 受限证券类别：										
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

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有流通受限的债券及其他证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌的股票。

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 2009 年 12 月 31 日止，本基金无持有正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未进行交易所市场债券正回购交易。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

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，除附注 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2009年12月3 1日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产						
银行存款	289,200,217.80	-	-	-	-	289,200,217.80
结算备付金	11,530,077.91	-	-	-	-	11,530,077.91
存出保证金	11,914,818.92	-	-	-	-	11,914,818.92
交易性金融资产	4,226,320,414.64	-	17,574,000.00	-	-	4,243,894,414.64
应收证券清算款	59,955,063.86	-	-	-	-	59,955,063.86
应收利息	65,932.72	-	-	-	-	65,932.72

应收申购款	4,300,040.30	-	-	-	-	4,300,040.30
资产总计	4,603,286,566.15	-	7,574,000.00	-	-	4,620,860,566.15
负债						
应付赎回款	88,849,695.84	-	-	-	-	88,849,695.84
应付管理人报酬	6,068,137.29	-	-	-	-	6,068,137.29
应付托管费	1,011,356.22	-	-	-	-	1,011,356.22
应付交易费用	6,572,590.04	-	-	-	-	6,572,590.04
其他负债	417,203.48	-	-	-	-	417,203.48
负债总计	102,918,982.87	-	-	-	-	102,918,982.87
流动性净额	4,500,367,583.28	-	7,574,000.00-	-	-	4,517,941,583.28

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，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 2009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	289,200,217.80	-	-	-	-	-	289,200,217.80
结算备付金	11,530,077.91	-	-	-	-	-	11,530,077.91
存出保证金	11,914,818.92	-	-	-	-	-	11,914,818.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,243,894,414.64	4,243,894,414.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	59,955,063.86	59,955,063.86
应收利息	-	-	-	-	-	65,932.72	65,932.72
应收申购款	4,300,040.30	-	-	-	-	-	4,300,040.30
资产总计	316,945,154.93	-	-	-	-	4,303,915,411.22	4,620,860,566.15

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	88,849,695.84	88,849,695.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,068,137.29	6,068,137.29
应付托管费	-	-	-	-	-	1,011,356.22	1,011,356.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,572,590.04	6,572,590.04
其他负债	-	-	-	-	-	417,203.48	417,203.48
负债总计	-	-	-	-	-	102,918,982.87	102,918,982.87
利率敏感度缺口	316,945,154.93	-	-	-	-	4,200,996,428.35	4,517,941,583.28

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约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

于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有的交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,243,894,414.64	93.93
交易性金融资产-债券投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	4,243,894,414.64	93.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准（80%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数）变化且其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加218,465,065.26	-
	业绩比较基准下降5%	减少218,465,065.26	-

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1.置信区间：95%		
	2.观察期：1年		
分析	风险价值 (单位：元)	本期末(2009年12月31日)	上年度末(2008年12月31日)
	合计	148,285,018.00	-

7.4.14 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。

§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	4,243,894,414.64	91.84
	其中：股票	4,243,894,414.64	91.84
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	300,730,295.71	6.51
6	其他各项资产	76,235,855.80	1.65
7	合计	4,620,860,566.15	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	277,281,486.31	6.14
C	制造业	2,331,352,445.66	51.60

C0	食品、饮料	213,706,307.57	4.73
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	227,639,494.19	5.04
C5	电子	24,458,997.14	0.54
C6	金属、非金属	83,677,666.34	1.85
C7	机械、设备、仪表	1,421,221,134.25	31.46
C8	医药、生物制品	343,049,222.00	7.59
C99	其他制造业	17,599,624.17	0.39
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,725,736.17	0.77
F	交通运输、仓储业	28,311,930.40	0.63
G	信息技术业	603,675,369.54	13.36
H	批发和零售贸易	333,554,250.93	7.38
I	金融、保险业	476,987,213.35	10.56
J	房地产业	104,827,842.49	2.32
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	53,178,139.79	1.18
	合计	4,243,894,414.64	93.93

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	600690	青岛海尔	12,836,234	318,210,240.86	7.04
2	000063	中兴通讯	6,059,632	271,895,687.84	6.02
3	002024	苏宁电器	11,465,990	238,263,272.20	5.27
4	601166	兴业银行	4,860,573	195,929,697.63	4.34
5	600582	天地科技	4,894,363	170,079,114.25	3.76
6	000527	美的电器	6,999,949	162,398,816.80	3.59
7	601699	潞安环能	2,772,162	143,542,548.36	3.18
8	600178	东安动力	7,819,852	131,451,712.12	2.91
9	000538	云南白药	1,996,881	120,611,612.40	2.67
10	601169	北京银行	6,179,744	119,516,248.96	2.65
11	600519	贵州茅台	619,811	105,256,304.02	2.33
12	000521	美菱电器	7,999,844	105,037,951.72	2.32
13	600487	亨通光电	3,210,011	102,591,951.56	2.27
14	600000	浦发银行	4,654,690	100,960,226.10	2.23
15	600123	兰花科创	2,239,458	97,953,892.92	2.17

16	600522	中天科技	3,740,569	92,653,894.13	2.05
17	000999	三九医药	4,499,915	89,818,303.40	1.99
18	000625	长安汽车	6,199,897	86,984,554.91	1.93
19	000404	华意压缩	10,241,572	86,643,699.12	1.92
20	601318	中国平安	1,099,674	60,581,040.66	1.34
21	600309	烟台万华	2,399,946	57,622,703.46	1.28
22	600352	浙江龙盛	5,000,000	57,100,000.00	1.26
23	000800	一汽轿车	2,004,829	52,165,650.58	1.15
24	600976	武汉健民	3,400,000	50,830,000.00	1.13
25	002010	传化股份	3,459,496	49,747,552.48	1.10
26	002253	川大智胜	1,358,003	49,444,889.23	1.09
27	002123	荣信股份	1,297,086	48,900,142.20	1.08
28	000921	ST 科 龙	5,566,795	47,039,417.75	1.04
29	600804	鹏博士	4,201,616	45,587,533.60	1.01
30	002048	宁波华翔	3,199,952	45,055,324.16	1.00
31	600426	华鲁恒升	1,899,925	44,629,238.25	0.99
32	002269	美邦服饰	1,960,209	44,398,733.85	0.98
33	002028	思源电气	1,644,940	44,215,987.20	0.98
34	600361	华联综超	4,499,778	43,062,875.46	0.95
35	000568	泸州老窖	1,099,924	42,941,032.96	0.95
36	600517	置信电气	2,169,835	40,467,422.75	0.90
37	600196	复星医药	1,915,100	37,478,507.00	0.83
38	600348	国阳新能	739,819	35,785,045.03	0.79
39	600820	隧道股份	2,500,053	34,725,736.17	0.77
40	002194	武汉凡谷	1,500,100	32,702,180.00	0.72
41	000858	五 粮 液	1,020,000	32,293,200.00	0.71
42	600418	江淮汽车	3,000,000	31,950,000.00	0.71
43	600570	恒生电子	1,499,950	31,513,949.50	0.70
44	000799	酒 鬼 酒	1,799,871	30,003,849.57	0.66
45	000418	小天鹅 A	1,999,991	29,259,868.33	0.65
46	600048	保利地产	1,299,752	29,114,444.80	0.64
47	000006	深振业 A	2,539,784	28,775,752.72	0.64
48	600079	人福科技	1,999,945	28,319,221.20	0.63
49	600575	芜湖港	1,862,627	28,311,930.40	0.63
50	000612	焦作万方	999,954	27,998,712.00	0.62
51	002133	广宇集团	2,839,542	27,713,929.92	0.61
52	600223	ST 鲁置业	1,999,913	24,858,918.59	0.55
53	600707	彩虹股份	1,999,918	24,458,997.14	0.54
54	600657	信达地产	2,038,374	22,870,556.28	0.51
55	002038	双鹭药业	499,993	22,199,689.20	0.49
56	600276	恒瑞医药	421,164	22,111,110.00	0.49

57	600391	成发科技	918,578	21,356,938.50	0.47
58	000826	合加资源	1,200,000	18,540,000.00	0.41
59	600208	新潮中宝	1,772,369	17,599,624.17	0.39
60	002146	荣盛发展	1,160,000	17,574,000.00	0.39
61	600595	中孚实业	299,926	7,795,076.74	0.17
62	002262	恩华药业	281,183	5,269,369.42	0.12
63	000869	张裕A	42,251	3,211,921.02	0.07
64	600511	国药股份	100,000	2,560,000.00	0.06
65	600456	宝钛股份	100,000	2,295,000.00	0.05
66	000506	ST中润	199,905	1,641,220.05	0.04
67	000616	亿城股份	1,000	6,890.00	0.00
68	000651	格力电器	100	2,894.00	0.00
69	600718	东软集团	100	2,261.00	0.00
70	000918	嘉凯城	100	1,605.00	0.00
71	600067	冠城大通	100	1,399.00	0.00
72	600173	卧龙地产	100	1,344.00	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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000825	太钢不锈	429,521,378.00	9.51
2	601318	中国平安	379,104,044.25	8.39
3	601699	潞安环能	377,990,015.97	8.37
4	600000	浦发银行	356,002,177.79	7.88
5	601919	中国远洋	329,744,494.31	7.30
6	600005	武钢股份	319,001,372.39	7.06
7	601857	中国石油	315,082,417.30	6.97
8	000002	万科A	304,647,045.60	6.74
9	600383	金地集团	294,496,547.10	6.52
10	600690	青岛海尔	281,667,627.37	6.23
11	601166	兴业银行	278,920,886.95	6.17
12	601939	建设银行	278,353,300.88	6.16
13	600050	中国联通	257,235,796.38	5.69
14	600123	兰花科创	255,258,543.47	5.65
15	600331	宏达股份	244,784,693.01	5.42
16	000024	招商地产	235,351,638.15	5.21
17	600348	国阳新能	230,402,157.22	5.10
18	600048	保利地产	228,465,459.37	5.06
19	000960	锡业股份	228,161,017.06	5.05

20	000063	中兴通讯	226,110,690.81	5.00
21	000878	云南铜业	224,135,432.44	4.96
22	002024	苏宁电器	218,186,107.89	4.83
23	600582	天地科技	210,292,704.92	4.65
24	600019	宝钢股份	207,725,169.77	4.60
25	000898	鞍钢股份	200,458,950.16	4.44
26	600026	中海发展	195,366,655.27	4.32
27	000937	金牛能源	194,642,508.79	4.31
28	000527	美的电器	193,595,919.08	4.29
29	601088	中国神华	187,947,211.96	4.16
30	000625	长安汽车	164,423,911.87	3.64
31	000425	徐工机械	162,008,039.98	3.59
32	600432	吉恩镍业	152,322,206.43	3.37
33	600036	招商银行	150,665,570.84	3.33
34	600997	开滦股份	145,091,738.58	3.21
35	600519	贵州茅台	144,963,733.76	3.21
36	601169	北京银行	144,803,395.03	3.21
37	000755	山西三维	144,555,812.42	3.20
38	600508	上海能源	142,101,272.40	3.15
39	601328	交通银行	140,962,938.97	3.12
40	601600	中国铝业	140,441,218.41	3.11
41	000778	新兴铸管	133,663,009.72	2.96
42	600166	福田汽车	132,161,407.28	2.93
43	601001	大同煤业	131,161,481.83	2.90
44	000528	柳工	130,966,010.41	2.90
45	600307	酒钢宏兴	126,583,590.14	2.80
46	000932	华菱钢铁	125,735,989.76	2.78
47	600196	复星医药	123,363,141.91	2.73
48	600517	置信电气	122,011,122.24	2.70
49	000006	深振业 A	117,918,827.72	2.61
50	600583	海油工程	117,030,352.18	2.59
51	000538	云南白药	114,807,873.78	2.54
52	600657	信达地产	113,847,120.55	2.52
53	600239	云南城投	113,180,492.28	2.51
54	600188	兖州煤业	112,410,328.74	2.49
55	600067	冠城大通	107,678,481.40	2.38
56	600195	中牧股份	107,469,631.86	2.38
57	600178	东安动力	106,811,273.99	2.36
58	000807	云铝股份	102,148,909.13	2.26
59	600361	华联综超	100,747,736.08	2.23
60	600062	双鹤药业	99,342,749.63	2.20

61	002028	思源电气	99,084,994.08	2.19
62	600016	民生银行	97,222,617.89	2.15
63	000999	三九医药	97,068,961.29	2.15
64	000069	华侨城A	95,515,673.07	2.11
65	600487	亨通光电	93,259,130.13	2.06
66	600089	特变电工	92,456,934.17	2.05
67	000404	华意压缩	91,643,679.92	2.03

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000825	太钢不锈	385,150,730.84	8.52
2	601318	中国平安	339,113,871.11	7.51
3	000002	万科A	312,882,422.39	6.93
4	600383	金地集团	298,412,363.95	6.61
5	601699	潞安环能	285,444,657.92	6.32
6	601939	建设银行	283,228,480.91	6.27
7	601857	中国石油	274,418,639.18	6.07
8	600005	武钢股份	273,535,592.39	6.05
9	601919	中国远洋	273,046,784.30	6.04
10	600000	浦发银行	272,935,070.01	6.04
11	600050	中国联通	262,795,283.96	5.82
12	600019	宝钢股份	223,021,932.64	4.94
13	600348	国阳新能	218,201,333.17	4.83
14	000024	招商地产	209,460,665.46	4.64
15	000898	鞍钢股份	199,400,733.98	4.41
16	600123	兰花科创	193,682,003.76	4.29
17	600048	保利地产	190,539,599.65	4.22
18	601088	中国神华	188,725,877.61	4.18
19	000878	云南铜业	188,284,951.42	4.17
20	600331	宏达股份	184,892,728.29	4.09
21	000960	锡业股份	180,967,891.19	4.01
22	000425	徐工机械	174,337,602.07	3.86

23	600036	招商银行	164,796,053.53	3.65
24	000937	金牛能源	163,452,981.61	3.62
25	600026	中海发展	162,382,067.10	3.59
26	601001	大同煤业	160,158,573.31	3.54
27	000528	柳工	146,737,590.26	3.25
28	600432	吉恩镍业	142,898,219.28	3.16
29	600997	开滦股份	142,584,413.66	3.16
30	000778	新兴铸管	142,282,010.76	3.15
31	600166	福田汽车	139,326,356.52	3.08
32	600307	酒钢宏兴	137,313,457.61	3.04
33	600582	天地科技	137,113,926.74	3.03
34	601328	交通银行	135,010,039.11	2.99
35	000932	华菱钢铁	134,976,675.84	2.99
36	600508	上海能源	130,435,382.40	2.89
37	601166	兴业银行	123,653,957.15	2.74
38	600195	中牧股份	120,519,676.81	2.67
39	600583	海油工程	117,880,129.21	2.61
40	000755	山西三维	116,922,821.44	2.59
41	601600	中国铝业	116,309,161.85	2.57
42	600067	冠城大通	113,328,897.45	2.51
43	000807	云铝股份	110,274,360.67	2.44
44	600062	双鹤药业	103,339,339.20	2.29
45	600239	云南城投	101,753,971.58	2.25
46	600521	华海药业	99,969,641.65	2.21
47	600089	特变电工	97,621,787.51	2.16
48	600196	复星医药	96,498,801.21	2.14
49	600016	民生银行	93,320,487.67	2.07
50	000625	长安汽车	91,618,588.34	2.03
51	600188	兖州煤业	91,212,746.01	2.02
52	600657	信达地产	90,485,616.13	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	16,658,978,927.59
卖出股票的收入（成交）总额	12,928,467,131.28

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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	-	-

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

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：本报告期末本基金未持有债券投资。

8.7 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

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券投资。

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：本报告期末本基金未持有权证投资。

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	11,914,818.92
2	应收证券清算款	59,955,063.86
3	应收股利	-
4	应收利息	65,932.72
5	应收申购款	4,300,040.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,235,855.80

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在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：本基金本报告期末不存在前十名股票流通受限情况。

§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
69,823	60,220.87	50,616,019.69	1.20%	4,154,186,074.77	98.80%

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	544,479.39	0.0129%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	7,070,893,298.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	202,740,861.02
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,068,832,064.57
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,204,802,094.46

§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。

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	
第一创业	1	280,535,165.61	0.95%	238,452.90	0.97%	新增
东海证券	1	415,786,328.76	1.41%	353,416.47	1.43%	新增
方正证券	1	1,735,709,956.78	5.88%	1,475,344.12	5.97%	新增
广发证券	2	12,807,334,858.51	43.38%	10,628,125.21	43.04%	新增
国都证券	1	379,487,320.25	1.29%	308,339.51	1.25%	新增
国海证券	1	1,873,759,790.89	6.35%	1,522,448.71	6.16%	新增
国泰君安	2	2,445,029,864.28	8.28%	2,062,502.26	8.35%	新增
平安证券	1	1,166,851,844.53	3.95%	991,828.02	4.02%	新增
齐鲁证券	1	60,688,341.63	0.21%	51,584.92	0.21%	新增
申银万国	1	2,570,299,630.70	8.71%	2,184,739.63	8.85%	新增
银河证券	1	1,030,293,104.14	3.49%	837,123.75	3.39%	新增
招商证券	1	2,936,275,762.78	9.95%	2,495,819.87	10.11%	新增
中金公司	1	1,818,619,883.41	6.16%	1,545,821.07	6.26%	新增
广发华福	1	-	-	-	-	新增
中投证券	1	-	-	-	-	新增
国盛证券	1	-	-	-	-	新增
东海证券	1	-	-	-	-	新增
海通证券	1	-	-	-	-	新增

注：（1）交易席位选择标准：

- 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 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；
- 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；
- 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；
- 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

- 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。

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
第一创业	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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。

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	本公司决定自 2009 年 5 月 18 日起，通过天相投资顾问有限公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-05-14
2	本公司决定自 2009 年 5 月 15 日起，广发聚瑞股票型证券投资基金新增民生银行、浦发银行为代销机构。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-05-15
3	本公司决定自 2009 年 5 月 15 日起，广发聚瑞股票型证券投资基金新增广东发展银行为代销机构。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-05-15
4	本公司决定自 2009 年 5 月 27 日起，广发聚瑞股票型证券投资基金新增中信银行为代	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证	2009-05-27

	销机构。	券报》	
5	本公司决定自 2009 年 6 月 8 日起, 通过华宝证券经纪有限责任公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-06-05
6	经第三届董事会第六次会议审议通过, 本公司同意兰惠艳女士辞去公司督察长职务。经本公司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, 本公司聘任段西军先生为广发基金管理有限公司督察长。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-06-18
7	本公司决定自 2009 年 7 月 28 日起, 通过英大证券代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-07-28
8	本公司决定自 2009 年 8 月 31 日起增加浙商银行作为代销机构, 代理销售本基金及公司旗下部分其他基金; 并自 2009 年 8 月 31 日起至 2009 年 12 月 31 日期间, 对投资者通过浙商银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的申购费率 (只限前端申购费用) 以及定期定额申购的申购费率 (只限前端申购费用) 实行费率优惠。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-08-27
9	本公司决定自公告日起, 在国信证券股份有限公司正式推出本基金及公司旗下部分其他基金的“开放式基金定期定额投资业务”。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-08-29
10	本公司决定自 2009 年 9 月 1 日至 2010 年 9 月 30 日, 对投资者通过中国农业银行个人网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的申购费率 (只限前端申购费用) 实行费率优惠。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-01
11	本公司决定从 2009 年 9 月 4 日起, 在江海证券经纪有限责任公司正式推出本基金及公司旗下部分其他基金的“开放式基金定期定额投资业务”。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-01
12	本基金及公司旗下部分其他基金参与了荣盛房地产发展股份有限公司 (荣盛发展, 代码: 002146) 非公开发行股票认购。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-08
13	本公司决定自 2009 年 9 月 11 日起调整广发聚富开放式证券投资基金、广发货币市场基金在中国工商银行的基金转换业务规则; 同时调整本基金及公司旗下部分其他基金在中国农业银行的基金转换业务规则。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-10
14	本公司决定自 2009 年 9 月 10 日至 2010 年 8 月 30 日, 本基金及公司旗下部分其他基金参与齐鲁证券网上交易申购费率优惠活动。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-10

15	本公司提请投资者开立基金账户须提供合法身份证明文件。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-11
16	本公司决定自 2009 年 9 月 15 日起, 本基金及公司旗下部分其他基金参与第一创业证券网上交易申购费率优惠活动。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-11
17	本公司于决定自 2009 年 9 月 15 日起, 开始办理广发聚瑞股票型证券投资基金日常申购、赎回、转换等业务。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-12
18	本公司决定自 2009 年 9 月 15 日起, 广发聚瑞股票型证券投资基金参加中国工商银行等 36 家代销机构开展的定期定额申购费率优惠活动或网上银行(网上交易)基金申购费率优惠活动。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-15
19	本公司决定自 2009 年 9 月 15 日起, 在中国工商银行等 57 家代销机构推出广发聚瑞股票型证券投资基金定期定额投资业务。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-09-15
20	经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]887 号文批准, 广发基金管理有限公司住所变更为广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-24
21	根据《基金合同》中投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例和风险收益特征的规定, 本基金及公司旗下部分其他基金可以投资于创业板上市的股票和可转换债券; 另外, 广发增强债券型证券投资基金可以投资于创业板上市的股票和可转换债券, 其中股票投资只能参与新股申购, 不能在创业板二级市场买入股票。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-24
22	本公司决定自 2009 年 9 月 28 日起通过徽商银行股份有限公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-25
23	本公司决定自 2009 年 9 月 28 日起通过中国民族证券有限责任公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-09-25
24	本公司决定从公告日起至 2009 年 12 月 31 日期间, 对投资者通过民生银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的申购费率(只限前端申购费用)进行优惠幅度调整。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-10-13
25	本公司决定自 2009 年 10 月 19 日起, 通过华龙证券有限责任公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-10-16
26	本公司决定自 2009 年 10 月 23 日起通过信	《中国证券报》、《证	2009-10-20

	达证券股份有限公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	
27	本公司决定从 2009 年 10 月 28 日起, 在海通证券有限责任公司正式推出广发聚瑞股票型证券投资基金 “开放式基金定期定额投资业务”。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-10-27
28	本公司与工商银行股份有限公司合作, 面向工商银行的借记卡持卡人推出基金网上直销交易业务, 通过本公司网上交易系统办理相关手续后, 即可进行本公司旗下开放式基金的交易及查询等各项业务。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-10-28
29	本公司与交通银行合作, 面向交通银行的借记卡持卡人推出基金网上直销交易业务, 持有交通银行借记卡的投资者, 通过本公司网上交易系统办理相关手续后, 即可进行本公司旗下开放式基金的交易及查询等各项业务。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-10-28
30	本公司决定自 2009 年 10 月 30 日起, 本基金及公司旗下部分其他基金参与招商证券网上交易申购费率优惠活动。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-10-30
31	本公司决定自 2009 年 11 月 23 日起通过中国银行代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-11-20
32	本公司决定自 2009 年 12 月 2 日起, 对投资者通过广东发展银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的申购费率 (只限前端申购费用) 进行优惠幅度调整。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-02
33	本公司网上交易系统于 2009 年 12 月 3 日升级定期投资业务 (品牌名称: “赢定投”)。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-12-03
34	本公司决定自 2009 年 12 月 8 日起, 对投资者通过中国建设银行网上银行、电话银行、手机银行等电子渠道申购本基金及公司旗下部分其他基金的申购费率 (只限前端申购费用) 进行优惠幅度调整。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-08
35	本公司决定自 2009 年 12 月 11 日起通过厦门证券有限公司代理销售本基金及公司旗下部分其他基金。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-12-11
36	本公司决定本公司自 2009 年 12 月 11 日起, 对持有中国建设银行借记卡的个人投资者开通网上交易定期投资业务。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2009-12-11
37	本公司决定对投资者通过浙商银行网上银行或以定期定额投资方式申购本基金及公司旗下部分其他基金实行申购费率 (只限前	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-29

	端申购费用) 优惠。		
38	本公司决定自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日, 本基金及公司旗下部分其他基金参加中国工商银行开展的“2010 倾心回馈”基金定期定额投资优惠活动。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-29
39	本公司决定将湘财证券推出的关于本基金及公司旗下部分其他基金的定期定额申购费率优惠活动截止日期由原来的 2009 年 12 月 31 日改为自 2010 年 1 月 1 日起继续开展定期定额申购费率优惠活动, 活动结束时间另行公告。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-31
40	本公司决定对中信建投证券推出的关于本基金及公司旗下部分其他基金的定时定额申购费率优惠活动截止日期由原来的 2009 年 12 月 31 日延期至 2012 年 12 月 31 日。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-31
41	本公司决定将中国农业银行推出的关于本基金及公司旗下部分其他基金的定期定额申购费率优惠活动截止日期由原来的 2009 年 12 月 31 日改为 2014 年 12 月 31 日。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2009-12-31

§ 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。

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>。

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

二〇一〇年三月二十九

日