

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金

2010 年半年度报告

2010 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 20 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。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 4 月 19 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	35
7.1	期末基金资产组合情况.....	35
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	39
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	39

7.9	投资组合报告附注.....	40
8	基金份额持有人信息.....	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	41
9	开放式基金份额变动.....	41
10	重大事件揭示.....	41
10.1	基金份额持有人大会决议.....	41
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4	基金投资策略的改变.....	41
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	42
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	43
12	备查文件目录.....	44
12.1	备查文件目录.....	44
12.2	存放地点.....	44
12.3	查阅方式.....	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发内需增长混合
基金主代码	270022
交易代码	270022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月19日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,061,645,466.20份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于受益于内需增长的行业中的优质上市公司，分享中国经济和行业持续增长带来的投资收益，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>(1) 大类资产配置</p> <p>本基金管理人将根据宏观经济研究员对宏观经济形势的研究，策略研究员对市场运行趋势的研究，以及行业研究员对行业投资价值的研究，综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例，并定期或不定期地进行调整。</p> <p>(2) 行业配置策略</p> <p>本基金主要投资于受益于内需增长的行业，以分享中国经济长期持续发展和经济增长方式转变所带来的行业投资收益的增长。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资采用备选库制度，本基金的备选库包括一级库和二级库。一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围。二级库是本基金所独有的风格股票投资范围，其构建过程如下：</p>

	<p>首先，在一级股票库内，根据行业配置策略，筛选出符合要求的行业的股票。</p> <p>其次，通过定量、定性相结合的方法，从上述股票中筛选出基本面良好的优质公司的股票构建本基金的二级库，并重点关注受益于内需增长的行业的优质企业。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资上，遵循稳健投资的原则，在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下，采用久期控制下的主动性投资策略，通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较，发现和确认市场失衡，把握投资机会，实现风险收益的最优化。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的。</p>
业绩比较基准	55%×沪深300指数+45%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军
	联系电话	020-89899117
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn
尹东	010-67595003	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话	95105828, 020-83936999	010-67595096
传真	020-89899158	010-66275853
注册地址	广东省珠海市拱北情侣南路255号4层	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510308	100033
法定代表人	马庆泉	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-67,647,787.43
本期利润	-511,118,001.60
加权平均基金份额本期利润	-0.1221
本期加权平均净值利润率	-12.81%
本期基金份额净值增长率	-12.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-499,578,942.98
期末可供分配基金份额利润	-0.1230
期末基金资产净值	3,562,066,523.22
期末基金份额净值	0.877
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.30%

注：注：(1) 上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。

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

(4) 本基金合同生效日期为 2010 年 4 月 19 日，至披露时点未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.30%	1.44%	-3.99%	0.91%	-2.31%	0.53%
自基金成立起至今	-12.30%	1.22%	-12.82%	1.07%	0.52%	0.15%

注：(1) 本基金业绩比较基准：55%×沪深 300 指数+45%×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

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2010 年 4 月 19 日至 2010 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日期为 2010 年 4 月 19 日，至披露时点未满一年。本基金建仓期为 6 个月。

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，还设立了北京办事处和北京分公司、广州分公司、上海分公司。

截至 2010 年 6 月 30 日，本基金管理人管理十三只开放式基金——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)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 854.78 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		
陈仕德	广发小盘成长股票 (LOF) 基金的基金经理；广发内需增长混合基金的基金	2010-04-19	-	16	男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，1997 年至 2001 年任职于广发证券股份有限公司，2001 年至 2003 年 8 月参与筹建广发基金管理有限公司，

	经理；投资管理 管理部副 总经理			2003 年 8 月至今任广发基金管理有限公司投资管理 管理部副总经理，2005 年 2 月 2 日起任广发小 盘成长股票（LOF）基 金的基金经理，2010 年 4 月 19 日起任广发内需 增长混合基金的基金经 理。
--	------------------------	--	--	--

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发内需增长灵活配置混合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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。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

与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发聚富混合、广发稳健增长混合、广发策略优选混合和广发大盘成长混合。本投资组合在本报告期仍处于建仓期，故本投资组合不宜进行业绩比较。

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 市场回顾

上半年 A 股市场呈现出先稳后跌的特征，上证指数从 3277 点下跌至 2398 点，下跌幅度达 26.8%，同期深成指跌幅为 31.5%。从行业和板块来看，以服装纺织、中档消费品为代表的“内需类”股票表现较好；医药行业在本报告期的后半段受到行业性政策影响表现稍逊；受困于流动性偏紧和经济下滑的担忧，以煤炭和银行为代表的大盘蓝筹表现不佳。以创业板和部分中小板为代表的小市值股票本报告期呈现了前热后冷的状况，部分股票已经跌到上市以来最低价格。本报告期内，宏观经济基本面表现出降温的迹象，经济的先行指标呈现下滑趋势，工业企业利润增速也开始放缓。

2. 基金运作回顾

本基金报告期仍处建仓期，期间我们在以下两个方面进行了配置：一是利用了市场的情绪，在左侧逐渐增持了低估值的银行、地产、煤炭和保险；二是对一些长期稳定增长类商业贸易、食品饮料和技术类企业进行增持。但由于左侧介入较早，本报告期的净值有所损失。在行业配置上，我们重点配置了银行、地产、煤炭、食品饮料和商业贸易等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发内需增长基金本报告期内净值增长率为-12.3%，略好于基金业绩比较基准-12.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时期，由于城镇化的加速，中国经济增长的强劲动力仍在，同时在内外诸多因素制约和推动下经济将加速转型，经济复苏将延续。虽然增速高点已过，未来增速将逐步下移，对市场形成压力，但由于目前资本市场已在很大程度上预期了这种经济下行，同时随着前期房地产收缩政策效果的显现，政策取向将逐渐转向中性。下半年 A 股市场有望出现转机，大型周期股存在估值修复的投资机会，经济转型所带来的结构性机会也将长期存在。随着投资者风险偏好的提升以及市场投资情绪的稳定，低估值的银行、地产、煤炭等周期类股票将重获市场青睐；同时以医药、商贸零售、旅游等品牌消费行业和伴随收入分配改革和消费升级共同推动的大消费行业，以及智能电网、新能源汽车、三网融合和软件等新兴战略产业，都值得重点关注。

经过二季度的大幅下跌，目前整个市场的估值已经具有吸引力。在未来较长一段时间内，本基金将长短结合，价值与成长并举，重点投资在与内需紧密相关的行业，如银行、煤炭、医药、可选消费和商业贸易，同时挖掘新技术和新商业模式带来的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本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

本基金上半年度未进行利润分配，本报告期末可供分配利润为-499,578,942.98 元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日
-----	-----	------------------------

资 产:		
银行存款	6.4.7.1	888,028,499.97
结算备付金		13,145,828.36
存出保证金		250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,662,240,538.57
其中: 股票投资		2,604,848,645.57
基金投资		-
债券投资		57,391,893.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		13,934,833.12
应收利息	7.4.7.5	180,217.60
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		3,577,779,917.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年6月30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		6,815,638.94
应付管理人报酬		4,726,540.02
应付托管费		787,756.68
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.6	3,062,324.97
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	321,133.79
负债合计		15,713,394.40
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.8	4,061,645,466.20
未分配利润	6.4.7.9	-499,578,942.98
所有者权益合计		3,562,066,523.22
负债和所有者权益总计		3,577,779,917.62

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.877 元，基金份额总额 4,061,645,466.20。本基金合同生效日期为 2010 年 4 月 19 日，至披露时点未满一年。

6.2 利润表

会计主体：广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-493,297,250.17
1.利息收入		2,399,891.60
其中：存款利息收入	6.4.7.10	2,381,857.57
债券利息收入		18,034.03
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）		-52,418,256.94
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-60,332,367.37
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收 益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.12	7,914,110.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-443,470,214.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	191,329.34
减：二、费用		17,820,751.43
1. 管理人报酬		11,771,844.59
2. 托管费		1,961,974.11
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.15	4,034,025.29
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 其他费用	6.4.7.16	52,907.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-511,118,001.60
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-511,118,001.60

本基金合同生效日期为 2010 年 4 月 19 日，至披露时点未满一年。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,226,246,853.18	-	4,226,246,853.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-511,118,001.60	-511,118,001.60
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）	-164,601,386.98	11,539,058.62	-153,062,328.36
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-164,601,386.98	11,539,058.62	-153,062,328.36
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）	4,061,645,466.20	-499,578,942.98	3,562,066,523.22

注：本基金合同生效日期为 2010 年 4 月 19 日，至披露时点未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】226 号文《关于同意广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金设立的批复》的批准，由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《广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，于 2010 年 4 月 19 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2010 年 3 月 16 日至 2010 年 4 月 15 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金总额 4,225,946,136.88 元。有效认购户数为 57,357 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 300,716.30 元人民币，折合基金份额 300,716.30 份，按照《广发内需增长灵活配置混合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。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所验资。基金合同于 2010 年 4 月 19 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,226,246,853.18 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《广发内需增长灵活配置混合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 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及 2010 年 4 月 19 日至 2010 年 6 月 30 日期间的经营成果。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

（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。

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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；

3. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

5. 本基金收益分配方式分为两种：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除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

7. 基金收益分配后每一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；

8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
活期存款	888,028,499.97
定期存款	-
其他存款	-
合计	888,028,499.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,048,965,752.74	2,604,848,645.57	-444,117,107.17
债券	交易所市场	56,745,000.00	57,391,893.00	646,893.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	56,745,000.00	57,391,893.00	646,893.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,105,710,752.74	2,662,240,538.57	-443,470,214.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售证券金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应收活期存款利息	157,582.47
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	4,601.10
应收债券利息	18,034.03
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	180,217.60

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,062,324.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,062,324.97

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	25,686.91
预提费用	45,446.88
合计	321,133.79

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至2010年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,226,246,853.18	4,226,246,853.18
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-164,601,386.98	-164,601,386.98
本期末	4,061,645,466.20	4,061,645,466.20

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-67,647,787.43	-443,470,214.17	-511,118,001.60
本期基金份额交易产生的变动数	578,367.56	10,960,691.06	11,539,058.62
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	578,367.56	10,960,691.06	11,539,058.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-67,069,419.87	-432,509,523.11	-499,578,942.98

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,350,686.37
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	31,171.20
其他	-
合计	2,381,857.57

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	295,791,232.58
减：卖出股票成本总额	356,123,599.95
买卖股票差价收入	-60,332,367.37

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至 2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,914,110.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,914,110.43

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至 2010年6月30日
1. 交易性金融资产	-443,470,214.17
——股票投资	-444,117,107.17
——债券投资	646,893.00
——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	-443,470,214.17

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
基金赎回费收入	189,609.86
转换费	1,719.48
合计	191,329.34

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
交易所市场交易费用	4,034,025.29
银行间市场交易费用	-
合计	4,034,025.29

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
审计费用	22,723.44
信息披露费	22,723.44
银行汇划费	6,560.56
其他	900.00
合计	52,907.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期关联方关系未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至 2010年6月30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	3,666,404,397.17	99.62%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方席位进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方席位进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至 2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	3,053,779.15	99.72%	3,053,779.15	99.72%

注：注：（1）股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）。

上述佣金按市场佣金率计算，佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,771,844.59
其中：支付销售机构的客户维护费	2,368,964.66

注：（1）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。

(2) 本基金合同生效期为 2010 年 4 月 19 日,截至报告日成立未满一年。对比会计期间无数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2010年4月19日(基金合同生效日)至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,961,974.11

注:注:(1)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。

(2) 本基金合同生效期为 2010 年 4 月 19 日,截至报告日成立未满一年。对比会计期间无数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期
	2010年4月19日(基金合同生效日)至2010年6月30日
基金合同生效日(2010年4月19日)持有的基金份额	50,003,000.06
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	50,003,000.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.23%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的费率是公允的。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年4月19日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 股份有限公司	888,028,499.97	2,350,686.37

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未出现在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2010年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日，本基金未持有认购新发股票。

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日，本基金未持有认购新发债券。

6.4.12.2 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
000001	深发展 A	2010-06-30	重大 事项	17.51	-	-	8,559,720	167,737,649.43	149,880,697.20	-
601318	中国平安	2010-06-29	重大 事项	46.81	-	-	2,099,988	102,734,018.41	98,300,438.28	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券银行间债券正回购交易形成的

卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 在董事会下设立合规及风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息, 或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降, 将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险, 本基金主要投资于信用等级较高的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险, 本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。但是, 随着短期资金市场的发展, 本基金的投资范围扩大以后, 可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司, 违约风险较小; 银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求, 在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足, 导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险, 或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则, 在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市, 其余亦可银行间同业市场交易, 除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外, 本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金

所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大的风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、VAR 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年6 月30日	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	888,028, 499.97	-	-	-	888,028, 499.97
结算备付 金	13,145,8 28.36	-	-	-	13,145,8 28.36
存出保证 金	250,000. 00	-	-	-	250,000. 00
交易性金 融资产	-	-	57,391,8 93.00	2,604,84 8,645.57	2,662,24 0,538.57
应收证券 清算款	-	-	-	13,934,8 33.12	13,934,8 33.12
应收利息	-	-	-	180,217. 60	180,217. 60
资产总计	901,424, 328.33	-	57,391,8 93.00	2,618,96 3,696.29	3,577,77 9,917.62
负债					
应付赎回	-	-	-	6,815,63	6,815,63

款				8.94	8.94
应付管理费	-	-	-	4,726,54	4,726,54
费报酬				0.02	0.02
应付托管	-	-	-	787,756.	787,756.
费				68	68
应付交易	-	-	-	3,062,32	3,062,32
费用				4.97	4.97
其他负债	-	-	-	321,133.	321,133.
				79	79
负债总计	-	-	-	15,713,3	15,713,3
				94.40	94.40
利率敏感	901,424,		57,391,8	2,603,25	3,562,06
度缺口	328.33	-	93.00	0,301.89	6,523.22

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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：人民币）
		本期末 2010年6月30日
	市场利率上升25个基点	-71.42万元
	市场利率下降25个基点	72.58万元

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2010 年 6 月 30 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	2,604,848,645.57	73.13
交易性金融资产-债券投资	57,391,893.00	1.61
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,662,240,538.57	74.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准 (55%×沪深300指数+45%×中证全债指数) 变化且其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币)
		本期末 2010 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升5%	18,184.35万元
	业绩比较基准下降5%	-18,184.35万元

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

分析	风险价值	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币)
		本期末 2010 年 6 月 30 日
	合计	9,743.14万元

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,604,848,645.57	72.81
	其中: 股票	2,604,848,645.57	72.81
2	固定收益投资	57,391,893.00	1.60
	其中: 债券	57,391,893.00	1.60

	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	901,174,328.33	25.19
6	其他各项资产	14,365,050.72	0.40
7	合计	3,577,779,917.62	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	404,931,492.61	11.37
C	制造业	473,277,375.57	13.29
C0	食品、饮料	202,665,412.00	5.69
C1	纺织、服装、皮毛	26,320,104.09	0.74
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,608,000.00	0.47
C4	石油、化学、塑胶、塑料	122,557,939.94	3.44
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	43,852,000.00	1.23
C7	机械、设备、仪表	32,776,919.54	0.92
C8	医药、生物制品	28,497,000.00	0.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	68,874,425.00	1.93
E	建筑业	9,624,840.68	0.27
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	121,974,365.76	3.42
H	批发和零售贸易	210,860,841.00	5.92
I	金融、保险业	929,368,725.17	26.09
J	房地产业	168,390,754.53	4.73
K	社会服务业	109,998,911.00	3.09
L	传播与文化产业	61,623,223.20	1.73
M	综合类	45,923,691.05	1.29
	合计	2,604,848,645.57	73.13

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
1	002024	苏宁电器	18,496,565	210,860,841.00	5.92
2	600519	贵州茅台	1,503,325	191,463,472.00	5.38
3	601166	兴业银行	7,541,595	173,682,932.85	4.88
4	600036	招商银行	13,002,427	169,161,575.27	4.75
5	000001	深发展 A	8,559,720	149,880,697.20	4.21
6	600048	保利地产	11,999,935	122,759,335.05	3.45
7	600348	国阳新能	9,405,980	122,465,859.60	3.44
8	000063	中兴通讯	6,339,624	121,974,365.76	3.42
9	000933	神火股份	7,046,894	117,753,598.74	3.31
10	000792	盐湖钾肥	3,006,177	117,240,903.00	3.29
11	000069	华侨城 A	9,999,901	109,998,911.00	3.09
12	600000	浦发银行	8,059,957	109,615,415.20	3.08
13	601318	中国平安	2,099,988	98,300,438.28	2.76
14	600123	兰花科创	3,584,808	91,663,540.56	2.57
15	600015	华夏银行	7,068,849	78,605,600.88	2.21
16	601601	中国太保	3,449,937	78,555,065.49	2.21
17	601169	北京银行	5,900,000	71,567,000.00	2.01
18	000939	凯迪电力	5,509,954	68,874,425.00	1.93
19	600831	广电网络	7,091,280	61,623,223.20	1.73
20	000540	中天城投	5,074,441	45,923,691.05	1.29
21	000762	西藏矿业	1,800,000	45,900,000.00	1.29
22	000926	福星股份	5,511,041	45,631,419.48	1.28
23	000970	中科三环	3,800,000	43,852,000.00	1.23
24	600482	风帆股份	2,699,911	32,776,919.54	0.92
25	002424	贵州百灵	700,000	28,497,000.00	0.80
26	002128	露天煤业	1,594,157	27,148,493.71	0.76
27	600763	通策医疗	2,895,501	26,320,104.09	0.74
28	600963	岳阳纸业	2,400,000	16,608,000.00	0.47
29	000848	承德露露	311,165	11,201,940.00	0.31
30	000758	中色股份	811,538	9,624,840.68	0.27
31	600331	宏达股份	514,718	5,317,036.94	0.15

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	600519	贵州茅台	211,540,968.72	5.94
2	002024	苏宁电器	208,839,276.63	5.86
3	601166	兴业银行	207,016,912.83	5.81
4	600036	招商银行	186,688,564.21	5.24
5	000001	深发展 A	167,737,649.43	4.71
6	000063	中兴通讯	161,599,635.84	4.54
7	600348	国阳新能	161,211,532.22	4.53
8	000933	神火股份	159,308,610.24	4.47
9	600048	保利地产	143,912,249.99	4.04
10	000792	盐湖钾肥	139,977,333.79	3.93
11	600383	金地集团	136,243,391.83	3.82
12	600123	兰花科创	132,602,520.57	3.72
13	000069	华侨城 A	129,683,437.15	3.64
14	600000	浦发银行	123,659,193.18	3.47
15	601318	中国平安	102,734,018.41	2.88
16	000939	凯迪电力	89,450,103.68	2.51
17	601601	中国太保	83,882,760.15	2.35
18	601169	北京银行	82,103,709.17	2.30
19	600015	华夏银行	76,886,861.53	2.16
20	600831	广电网络	70,250,606.69	1.97

注：注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	600383	金地集团	118,632,778.35	3.33
2	000901	航天科技	35,071,584.09	0.98
3	000533	万 家 乐	30,205,883.10	0.85
4	002025	航天电器	27,499,400.00	0.77
5	600770	综艺股份	25,617,215.00	0.72
6	000662	索 芙 特	21,959,518.10	0.62
7	000524	东方宾馆	13,951,400.10	0.39
8	000651	格力电器	10,500,245.00	0.29

9	002034	美欣达	5,019,879.50	0.14
10	600331	宏达股份	3,667,770.82	0.10
11	000758	中色股份	2,472,213.52	0.07
12	002250	联化科技	1,193,345.00	0.03

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,405,089,352.69
卖出股票的收入（成交）总额	295,791,232.58

7.5 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	57,391,893.00	1.61
7	其他	-	-
8	合计	57,391,893.00	1.61

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	113001	中行转债	567,450	57,391,893.00	1.61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	13,934,833.12
3	应收股利	-
4	应收利息	180,217.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,365,050.72

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末持有的处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000001	深发展 A	149,880,697.20	4.21	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
56,223	72,241.71	478,326,495.47	11.78%	3,583,318,970.73	88.22%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	6,541,642.93	0.1611%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 4 月 19 日）基金份额总额	4,226,246,853.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	164,601,386.98
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	4,061,645,466.20

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2010 年 4 月 19 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人托管业务部门均无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

为了更好的适应公司业务发展的需要，经管理人与托管人协商一致，并经广发基金管理有限公司董事会批准，本基金拟将年审会计师事务所由深圳市鹏城会计师事务所有限公司更换为德勤华永会计师事务所有限公司，该事项已报中国证监会备案。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	3,666,404,397.17	99.62%	3,053,779.15	99.72%	新增 2 个
江南证券	1	13,951,400.10	0.38%	8,545.82	0.28%	新增 1 个

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-

注：（1）交易席位选择标准：

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

- c 具备基金运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足基金进行证券交易的需要；
- d 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- e 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- f 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

(2)交易席位选择流程

- a 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- b 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.8 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2010年4月23日起，调低在本公司网上直销设置定期投资业务基础金额的下限。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2010-04-23
2	本公司决定于2010年6月1日起开始办理本基金日常赎回、转换转出业务，但暂不开通本基金的日常申购（包括定期定额申购）与转换转入业务。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2010-05-29
3	本公司决定旗下基金自2010年6月25日起增加华融证券为代销机构，并自2010年6月25日起对投资者通过华融证券网上交易系统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（只限前端申购费用）优惠。	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2010-06-24
4	本公司决定自2010年6月28日起，通过浙商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》	2010-06-25

11 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任本行副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公

告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

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内需增长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《广发内需增长灵活配置混合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. 《广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
5. 《广发内需增长灵活配置混合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
二〇一〇年八月二十五日