

广发聚瑞股票型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

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 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|--|----|
| 1 | 重要提示及目录..... | 2 |
| 1.1 | 重要提示..... | 2 |
| 1.2 | 目录..... | 3 |
| 2 | 基金简介..... | 5 |
| 2.1 | 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 | 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 | 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 | 其他相关资料..... | 6 |
| 3 | 主要财务指标和基金净值表现..... | 6 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 7 |
| 4 | 管理人报告..... | 8 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 9 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 5 | 托管人报告..... | 12 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12 |
| 5.3 | 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| 6 | 半年度财务会计报告（未经审计）..... | 13 |
| 6.1 | 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 | 利润表..... | 14 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 | 报表附注..... | 16 |
| 7 | 投资组合报告..... | 30 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况..... | 30 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合..... | 31 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 32 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 34 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| 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..... | 36 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 7.9 | 投资组合报告附注..... | 36 |
| 8 | 基金份额持有人信息..... | 37 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |
| 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..... | 37 |
| 9 | 开放式基金份额变动..... | 37 |
| 10 | 重大事件揭示..... | 38 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 38 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 38 |
| 10.5 | 报告期内改聘会计师事务所情况..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 38 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 40 |
| 11 | 备查文件目录..... | 42 |
| 11.1 | 备查文件目录..... | 42 |
| 11.2 | 存放地点..... | 43 |
| 11.3 | 查阅方式..... | 43 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------|
| 基金名称 | 广发聚瑞股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 广发聚瑞股票 |
| 基金主代码 | 270021 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年6月16日 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,445,629,112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 | | 广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 510308 | 100032 |
| 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 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 99,874,395.52 |
| 本期利润 | -689,041,816.35 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1909 |
| 本期加权平均净值利润率 | -19.05% |
| 本期基金份额净值增长率 | -18.62% |
| 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 | -435,656,206.31 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1264 |
| 期末基金资产净值 | 3,009,972,905.69 |
| 期末基金份额净值 | 0.874 |
| 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 | -12.60% |

注：(1) 本基金基金合同于 2009 年 6 月 16 日生效。

(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 |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -8.77% | 1.92% | -5.98% | 1.33% | -2.79% | 0.59% |
| 过去三个月 | -15.31% | 1.92% | -18.30% | 1.46% | 2.99% | 0.46% |
| 过去六个月 | -18.62% | 1.62% | -21.81% | 1.28% | 3.19% | 0.34% |
| 过去一年 | -13.21% | 1.90% | -14.45% | 1.52% | 1.24% | 0.38% |
| 自基金成立起至今 | -12.60% | 1.86% | -10.12% | 1.49% | -2.48% | 0.37% |

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

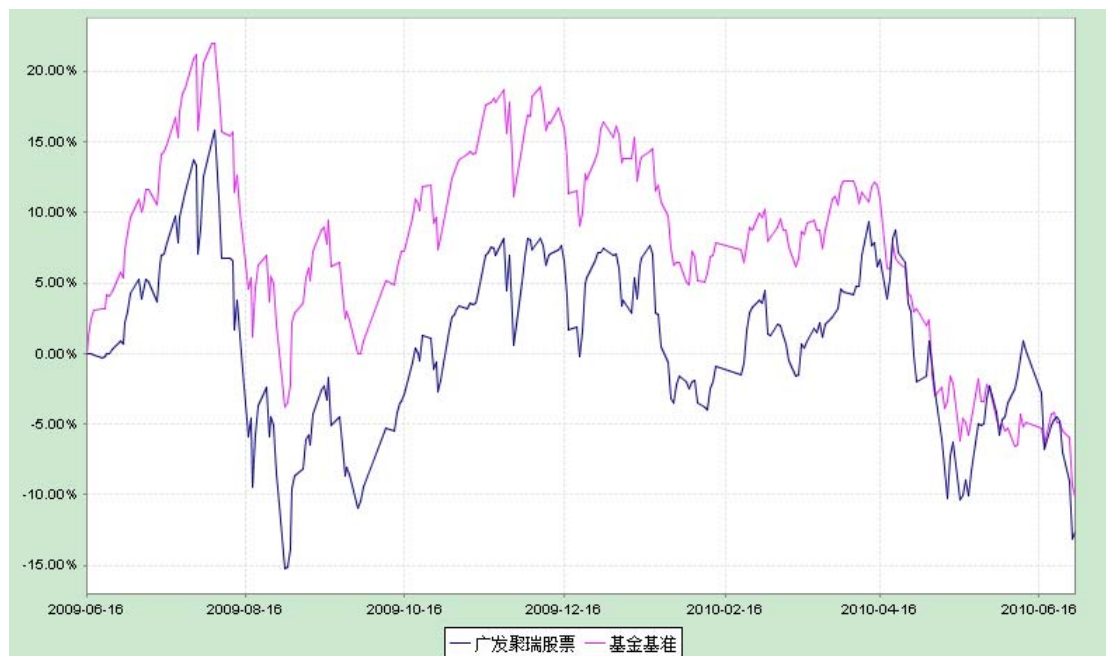
业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发聚瑞股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 6 月 16 日至 2010 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、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 | | |
| 刘明月 | 广发聚瑞股票基金的基金经理 | 2009-06-16 | - | 6 | 男，中国籍，金融学硕士，持有证券业执业资格证书，2004 年 7 月至 2007 年 2 月任广发基金管理有限公司研究发展部研究员，2007 年 2 月至 2009 年 5 月先后任广发基金管理有限公司研究发展部副总经理、机构投资部总经理，2009 年 6 月 16 日起任广发聚瑞股票基金的基金经理。 |

注：1. “任职日期”和“离任日期”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小盘股票、广发聚丰股票和广发核心精选股票三只开放式基金。报告期内，本基金与广发小盘股票和广发核心精选股票的净值增长率差异均未超过 5%。报告期内，本基金净值增长率与广发聚丰股票净值增长率差异为 6.52%，主要原因是上述两基金在仓位配置方面存在一定差异所致。

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

年初以来市场经历了很大波动，不管是大盘还是结构变动。在六月前，医药、TMT、能源设备、食品饮料、商业等行业表现强势，而强周期类行业如地产、钢铁、有色、煤炭等走势较弱；在六月中之后，由于对经济二次探底的忧虑加重和稳定类股票估值也较高，前期强势的股票大幅下跌，强周期类股票跌幅反而收窄。总的来说，今年以来稳定预期类股票强

于周期类且有一定的正收益。截止 2 季度末，静态看 10 年业绩，市场估值水平还在合理范围内，但市场气氛开始悲观起来。

上半年广发聚瑞的组合调整不大，降低了家电汽车的比重，调高了智能电网、节能减排等行业的比重，在 6 月前，组合表现较好。主要失误是：在 6 月中投资组合估值水平比较高时没有及时降低仓位，从而带来净值较大波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内净值增长率为-18.62%，好于基准的-21.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对未来宏观经济的判断以及广发聚瑞基金的操作计划与上半年将有所不同。我们认为全球经济仍逐步好转，但受债务危机的影响，全球经济复苏的力度和速度可能没有之前预期那么大。国内商品房在调控政策的压制下，成交价格开始松动，成交量总体上下降较多。尽管很多投资者在内忧外患下预期我国经济通缩将出现，但我们认为，政府在经济增长和宏观调控之间会有所均衡，经济增速大幅放缓的可能性比较小。

同时预期政府在收缩流动性方面也会把握好度，将视国外经济复苏的力度和我国经济增长情况来保持相应的收缩力度。

操作计划上，在经济逐步改善的过程中，将按经济复苏的力度和企业改善的程度来布局投资组合。与上半年不同的是，我们在坚持自上而下选择子行业，自下而上精选个股，重点配置医药、TMT、部分机械与化工子行业、商业、食品等科技、消费类品种的同时，将关注低估值的传统产业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、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

本报告期内本基金未进行利润分配，期末可供分配利润为-435,656,206.31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

2010年上半年，本基金托管人在对广发聚瑞股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2010年上半年，广发聚瑞股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发聚瑞股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发聚瑞股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发聚瑞股票型证券投资基金2010年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

报告截止日：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 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 209,065,289.25 | 289,200,217.80 |
| 结算备付金 | | 4,625,567.74 | 11,530,077.91 |
| 存出保证金 | | 2,461,314.83 | 11,914,818.92 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,800,992,553.89 | 4,243,894,414.64 |
| 其中：股票投资 | | 2,800,992,553.89 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 59,955,063.86 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 46,947.58 | 65,932.72 |
| 应收股利 | | 37,395.27 | - |
| 应收申购款 | | 5,087,980.13 | 4,300,040.30 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 3,022,317,048.69 | 4,620,860,566.15 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2010 年 6 月 30 日 | 上年度末 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 | | 4,275,107.66 | 88,849,695.84 |
| 应付管理人报酬 | | 3,950,092.57 | 6,068,137.29 |
| 应付托管费 | | 658,348.74 | 1,011,356.22 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.6 | 3,255,744.58 | 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 | 6.4.7.7 | 204,849.45 | 417,203.48 |
| 负债合计 | | 12,344,143.00 | 102,918,982.87 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 3,445,629,112.00 | 4,204,802,094.46 |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | -435,656,206.31 | 313,139,488.82 |
| 所有者权益合计 | | 3,009,972,905.69 | 4,517,941,583.28 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,022,317,048.69 | 4,620,860,566.15 |

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.874 元，基金份额总额 3,445,629,112.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2010年1月1日至2010 年6月30日 | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金 合同生效日）至2009年 6月30日 |
|---------------------------|----------|--------------------------------|---|
| 一、收入 | | -646,103,597.73 | 54,582,230.25 |
| 1.利息收入 | | 1,079,157.62 | 1,586,667.63 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 1,079,157.62 | 1,586,667.63 |
| 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） | | 139,984,300.52 | 3,908,807.94 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | 129,252,267.58 | -34,965.73 |
| 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 | 10,732,032.94 | 3,943,773.67 |
| 3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列） | 6.4.7.13 | -788,916,211.87 | 49,086,754.68 |

| | | | |
|----------------------------|----------|------------------------|----------------------|
| 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 | 1,749,156.00 | - |
| 减：二、费用 | | 42,938,218.62 | 7,956,373.09 |
| 1. 管理人报酬 | | 26,972,094.78 | 4,071,432.61 |
| 2. 托管费 | | 4,495,349.16 | 678,572.08 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.15 | 11,257,943.60 | 3,189,398.72 |
| 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 | 212,831.08 | 16,969.68 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -689,041,816.35 | 46,625,857.16 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -689,041,816.35 | 46,625,857.16 |

注：本基金于 2009 年 6 月 16 日合同生效成立，上年度可比期间不完整。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发聚瑞股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010 年 1 月 1 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） | 4,204,802,094.46 | 313,139,488.82 | 4,517,941,583.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -689,041,816.35 | -689,041,816.35 |
| 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） | -759,172,982.46 | -59,753,878.78 | -818,926,861.24 |
| 其中：1. 基金申购款 | 600,686,934.23 | -20,804.52 | 600,666,129.71 |
| 2. 基金赎回款 | -1,359,859,916.69 | -59,733,074.26 | -1,419,592,990.95 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |

| | | | |
|--|---|-----------------|------------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,445,629,112.00 | -435,656,206.31 | 3,009,972,905.69 |
| 项目 | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日）至2009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） | 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） | - | 46,625,857.16 | 46,625,857.16 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 7,070,893,298.01 | 46,625,857.16 | 7,117,519,155.17 |

注：本基金于 2009 年 6 月 16 日合同生效成立，上年度可比期间不完整。

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 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 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日的经营成果。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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 | 209,065,289.25 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 209,065,289.25 |

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 | | 2,990,756,976.68 | 2,800,992,553.89 | -189,764,422.79 |
| 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 | | 2,990,756,976.68 | 2,800,992,553.89 | -189,764,422.79 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金未持有衍生金融资产/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

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金未持有买入返售证券金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金未持有买断式回购交易中取得的债券。

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 | 41,770.52 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,457.10 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 3,719.96 |
| 其他 | - |
| 合计 | 46,947.58 |

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 | 3,255,744.58 |

| | |
|-------------|--------------|
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 3,255,744.58 |

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 | - |
| 应付赎回费 | 11,910.35 |
| 预提费用 | 192,939.10 |
| 合计 | 204,849.45 |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,204,802,094.46 | 4,204,802,094.46 |
| 本期申购 | 600,686,934.23 | 600,686,934.23 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,359,859,916.69 | -1,359,859,916.69 |
| 本期末 | 3,445,629,112.00 | 3,445,629,112.00 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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 |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | -23,819,502.47 | 336,958,991.29 | 313,139,488.82 |
| 本期利润 | 99,874,395.52 | -788,916,211.87 | -689,041,816.35 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,185,642.88 | -46,568,235.90 | -59,753,878.78 |
| 其中：基金申购款 | 10,900,932.59 | -10,921,737.11 | -20,804.52 |
| 基金赎回款 | -24,086,575.47 | -35,646,498.79 | -59,733,074.26 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 62,869,250.17 | -498,525,456.48 | -435,656,206.31 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 1,035,976.05 |
| 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 | 36,207.03 |
| 其他 | 6,974.54 |
| 合计 | 1,079,157.62 |

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1月1日至2010年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 3,991,465,925.87 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,862,213,658.29 |
| 买卖股票差价收入 | 129,252,267.58 |

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 10,732,032.94 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 10,732,032.94 |

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -788,916,211.87 |
| ——股票投资 | -788,916,211.87 |
| ——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 | -788,916,211.87 |

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,655,987.56 |
| 转换费 | 93,168.44 |
| 合计 | 1,749,156.00 |

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日 |
|-----------|------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 11,257,943.60 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 11,257,943.60 |

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日 |
|-------|------------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 148,767.52 |
| 银行汇划费 | 15,391.98 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 其他 | - |
| 合计 | 212,831.08 |

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

本报告期不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。

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 |
| 广发证券股份有限公司 | 基金管理人股东、代销机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、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1月1日 至 2010年6月30日 | | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日） 至 2009年6月30日 | |
|------------|------------------------------|--------------|--|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 2,184,812,424.85 | 30.48% | 2,832,750,543.97 | 91.24% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期末通过关联方席位进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期末通过关联方席位进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期末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1月1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 | 1,791,289.37 | 30.04% | 934,475.68 | 28.70% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日） 至 2009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 | 2,379,966.13 | 91.14% | 2,379,966.13 | 91.14% |

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1月1日 至 2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日） 至 2009年6月30日 |
|----------------|------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 26,972,094.78 | 4,071,432.61 |

| | | |
|-----------------|--------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,690,205.94 | 702,822.78 |
|-----------------|--------------|------------|

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至 2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日）至 2009年6月30日 |
|----------------|-----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,495,349.16 | 678,572.08 |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期本基金未与关联方进行银行间同业市场的证券(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1月1日至 2010年6月30日 | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日）至 2009年6月30日 |
|-------------------|-----------------------------|--|
| 期初持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 期间申购/买入总份额 | 48,262,548.26 | 0.00 |
| 期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 期末持有的基金份额 | 48,262,548.26 | 0.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.40% | 0% |

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。
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。

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1月1日 至 2010年6月30日 | | 上年度可比期间 2009年6月16日（基金合同生效日） 至 2009年6月30日 | |
|------------------|------------------------------|--------------|--|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 股份有限公司 | 209,065,289.25 | 1,035,976.05 | 4,306,754,921.86 | 1,586,667.63 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。
上年度可比期内本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|---------|----------------|----------------|----------------|----------|------------|----------------------|-------------------|-------------------|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功 认购日 | 可流 通日 | 流通 受限 类型 | 认购 价格 | 期末估 值单价 | 数量 （单 位： 股） | 期末 成本总额 | 期末 估值总额 | 备注 |
| 600804 | 鹏博 士 | 2010-01- 15 | 2011-01- 13 | 非公 开发 行 | 7.79 | 8.30 | 4,000,0 00 | 31,160,00 0.00 | 33,200,00 0.00 | 2010 年6 月7 日， 鹏博 士每 股派 现金 红利 0.040 元 （含 税）。 |
| 002146 | 荣盛 | 2009-09- | 2010-09- | 非公 | 7.81 | 8.97 | 1,856,0 | 14,500,00 | 16,648,32 | 2010 |

| | | | | | | | | | | |
|--|----|----|----|---------|--|--|----|------|------|--|
| | 发展 | 04 | 07 | 开发 行 | | | 00 | 0.00 | 0.00 | 年5 月26 日， 荣盛 发展 每10 股送 2股， 派1 元人 民币 现金 (含 税)， 同时 以资 本公 积每 10股 转增 4股。 |
|--|----|----|----|---------|--|--|----|------|------|--|

注：截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金未持有流通受限的债券及其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金未持有正回购交易中作为抵押的债券。

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，本基金未进行交易所市场债券正回购交易。

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。

截止 2010 年 6 月 30 日,本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求,在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足,导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险,或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则,在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市,其余亦可银行间同业市场交易,除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外,本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末 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 | 209,065,289.25 | - | - | - | 209,065,289.25 |
| 结算备付金 | 4,625,567.74 | - | - | - | 4,625,567.74 |
| 存出保证金 | 2,461,314.83 | - | - | - | 2,461,314.83 |
| 交易性金融 资产 | - | - | - | 2,800,992,553.89 | 2,800,992,553.89 |
| 应收利息 | - | - | - | 46,947.58 | 46,947.58 |
| 应收股利 | - | - | - | 37,395.27 | 37,395.27 |
| 应收申购款 | 5,087,980.13 | - | - | - | 5,087,980.13 |
| 资产总计 | 221,240,151.95 | - | - | 2,801,076,896.74 | 3,022,317,048.69 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,275,107.66 | 4,275,107.66 |
| 应付管理人 报酬 | - | - | - | 3,950,092.57 | 3,950,092.57 |
| 应付托管费 | - | - | - | 658,348.74 | 658,348.74 |
| 应付交易费 用 | - | - | - | 3,255,744.58 | 3,255,744.58 |
| 其他负债 | - | - | - | 204,849.45 | 204,849.45 |
| 负债总计 | - | - | - | 12,344,143.00 | 12,344,143.00 |
| 利率敏感度 缺口 | 221,240,151.95 | - | - | 2,788,732,756.74 | 3,009,972,905.69 |
| 上年度末 2009年12月 31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 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 |
| 应收利息 | - | - | - | 65,932.72 | 65,932.72 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 应收申购款 | 4,300,040.30 | - | - | - | 4,300,040.30 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 59,955,063.86 | 59,955,063.86 |
| 资产总计 | 316,945,154.93 | - | - | 4,303,915,411.22 | 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 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 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

于 2010 年 6 月 30 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。

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。

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 | | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 2,800,992,553.89 | 93.06 | 4,243,894,414.64 | 93.93 |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,800,992,553.89 | 93.06 | 4,243,894,414.64 | 93.93 |

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（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） | |
| | | 本期末 2010 年 6 月 30 日 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 12,495.61万元 | 21,846.51万元 |
| | 业绩比较基准下降5% | -12,495.61万元 | -21,846.51万元 |

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 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
| | 合计 | 8,566.49万元 | 14,828.50万元 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明的会计事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 2,800,992,553.89 | 92.68 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：股票 | 2,800,992,553.89 | 92.68 |
| 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 | 213,690,856.99 | 7.07 |
| 6 | 其他各项资产 | 7,633,637.81 | 0.25 |
| 7 | 合计 | 3,022,317,048.69 | 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 | 19,084,144.60 | 0.63 |
| B | 采掘业 | 15,271,011.36 | 0.51 |
| C | 制造业 | 1,477,634,763.27 | 49.09 |
| C0 | 食品、饮料 | 208,877,460.06 | 6.94 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 70,646,618.97 | 2.35 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 46,670,832.00 | 1.55 |
| C5 | 电子 | 17,325,000.00 | 0.58 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 429,902,691.67 | 14.28 |
| C8 | 医药、生物制品 | 699,635,549.23 | 23.24 |
| C99 | 其他制造业 | 4,576,611.34 | 0.15 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 232,974,382.71 | 7.74 |
| F | 交通运输、仓储业 | 37,756,299.91 | 1.25 |
| G | 信息技术业 | 790,892,980.52 | 26.28 |
| H | 批发和零售贸易 | 142,418,396.17 | 4.73 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 16,648,320.00 | 0.55 |
| K | 社会服务业 | 64,767,835.05 | 2.15 |
| L | 传播与文化产业 | 2,884,020.30 | 0.10 |
| M | 综合类 | 660,400.00 | 0.02 |
| | 合计 | 2,800,992,553.89 | 93.06 |

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 | 000538 | 云南白药 | 2,026,811 | 130,729,309.50 | 4.34 |
| 2 | 002081 | 金螳螂 | 2,721,528 | 85,183,826.40 | 2.83 |
| 3 | 000999 | 华润三九 | 3,299,915 | 75,733,049.25 | 2.52 |
| 4 | 600804 | 鹏博士 | 8,201,516 | 70,677,522.72 | 2.35 |
| 5 | 002123 | 荣信股份 | 2,075,729 | 66,423,328.00 | 2.21 |
| 6 | 600079 | 人福科技 | 4,111,677 | 65,786,832.00 | 2.19 |
| 7 | 002065 | 东华软件 | 2,586,991 | 62,346,483.10 | 2.07 |
| 8 | 600406 | 国电南瑞 | 1,619,921 | 62,188,767.19 | 2.07 |
| 9 | 000400 | 许继电气 | 2,150,036 | 56,502,946.08 | 1.88 |
| 10 | 600572 | 康恩贝 | 3,989,567 | 53,260,719.45 | 1.77 |
| 11 | 002163 | 中航三鑫 | 4,039,617 | 50,293,231.65 | 1.67 |
| 12 | 002325 | 洪涛股份 | 1,818,509 | 50,027,182.59 | 1.66 |
| 13 | 002253 | 川大智胜 | 1,585,018 | 49,135,558.00 | 1.63 |
| 14 | 002310 | 东方园林 | 336,167 | 47,470,142.07 | 1.58 |
| 15 | 000661 | 长春高新 | 1,307,124 | 47,056,464.00 | 1.56 |
| 16 | 002010 | 传化股份 | 3,739,650 | 46,670,832.00 | 1.55 |
| 17 | 002007 | 华兰生物 | 1,012,894 | 45,661,261.52 | 1.52 |
| 18 | 000826 | 合加资源 | 2,219,075 | 45,402,274.50 | 1.51 |
| 19 | 600537 | 海通集团 | 2,504,798 | 45,061,316.02 | 1.50 |
| 20 | 600588 | 用友软件 | 2,045,855 | 44,681,473.20 | 1.48 |
| 21 | 000021 | 长城开发 | 4,133,573 | 43,774,538.07 | 1.45 |
| 22 | 000063 | 中兴通讯 | 2,254,580 | 43,378,119.20 | 1.44 |
| 23 | 600976 | 武汉健民 | 3,405,694 | 43,082,029.10 | 1.43 |
| 24 | 600199 | 金种子酒 | 3,494,276 | 42,210,854.08 | 1.40 |
| 25 | 600198 | 大唐电信 | 2,693,594 | 40,915,692.86 | 1.36 |
| 26 | 002212 | 南洋股份 | 2,825,294 | 40,768,992.42 | 1.35 |
| 27 | 002339 | 积成电子 | 1,269,174 | 40,232,815.80 | 1.34 |
| 28 | 600570 | 恒生电子 | 2,569,666 | 38,596,383.32 | 1.28 |
| 29 | 000715 | 中兴商业 | 3,180,015 | 38,255,580.45 | 1.27 |
| 30 | 002269 | 美邦服饰 | 2,010,166 | 37,972,035.74 | 1.26 |
| 31 | 002322 | 理工监测 | 454,535 | 37,953,672.50 | 1.26 |
| 32 | 600521 | 华海药业 | 2,814,672 | 37,829,191.68 | 1.26 |
| 33 | 300040 | 九州电气 | 1,997,220 | 36,668,959.20 | 1.22 |
| 34 | 002038 | 双鹭药业 | 949,952 | 35,604,200.96 | 1.18 |
| 35 | 600536 | 中国软件 | 1,709,504 | 35,061,927.04 | 1.16 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 36 | 002327 | 富安娜 | 796,898 | 34,425,993.60 | 1.14 |
| 37 | 000858 | 五 粮 液 | 1,419,868 | 34,403,401.64 | 1.14 |
| 38 | 000799 | 酒 鬼 酒 | 2,895,698 | 33,676,967.74 | 1.12 |
| 39 | 600557 | 康缘药业 | 1,899,853 | 33,646,396.63 | 1.12 |
| 40 | 002293 | 罗莱家纺 | 612,625 | 32,695,796.25 | 1.09 |
| 41 | 300048 | 合康变频 | 794,530 | 29,794,875.00 | 0.99 |
| 42 | 002115 | 三维通信 | 2,303,797 | 28,567,082.80 | 0.95 |
| 43 | 002277 | 友阿股份 | 1,399,924 | 28,194,469.36 | 0.94 |
| 44 | 600196 | 复星医药 | 1,595,100 | 27,914,250.00 | 0.93 |
| 45 | 600276 | 恒瑞医药 | 688,618 | 26,904,305.26 | 0.89 |
| 46 | 000568 | 泸州老窖 | 949,778 | 26,802,735.16 | 0.89 |
| 47 | 000522 | 白云山 A | 2,271,636 | 26,373,693.96 | 0.88 |
| 48 | 002356 | 浩宁达 | 828,705 | 25,731,290.25 | 0.85 |
| 49 | 600268 | DR 国电南 | 1,599,851 | 25,357,638.35 | 0.84 |
| 50 | 600100 | 同方股份 | 1,199,999 | 25,247,978.96 | 0.84 |
| 51 | 000829 | 天音控股 | 1,599,897 | 23,134,510.62 | 0.77 |
| 52 | 600479 | 千金药业 | 1,579,815 | 22,117,410.00 | 0.73 |
| 53 | 600125 | 铁龙物流 | 1,599,862 | 21,614,135.62 | 0.72 |
| 54 | 600475 | 华光股份 | 1,548,392 | 20,980,711.60 | 0.70 |
| 55 | 002028 | 思源电气 | 824,940 | 20,953,476.00 | 0.70 |
| 56 | 002093 | 国脉科技 | 1,549,898 | 19,993,684.20 | 0.66 |
| 57 | 002315 | 焦点科技 | 299,897 | 19,730,223.63 | 0.66 |
| 58 | 000811 | 烟台冰轮 | 1,349,883 | 19,573,303.50 | 0.65 |
| 59 | 002200 | 绿 大 地 | 819,062 | 19,084,144.60 | 0.63 |
| 60 | 600261 | 浙江阳光 | 750,000 | 17,325,000.00 | 0.58 |
| 61 | 002146 | 荣盛发展 | 1,856,000 | 16,648,320.00 | 0.55 |
| 62 | 300004 | 南风股份 | 349,999 | 16,274,953.50 | 0.54 |
| 63 | 600575 | 芜湖港 | 1,114,021 | 16,142,164.29 | 0.54 |
| 64 | 002316 | 键桥通讯 | 897,842 | 15,981,587.60 | 0.53 |
| 65 | 002148 | 北纬通信 | 499,810 | 15,509,104.30 | 0.52 |
| 66 | 002340 | 格林美 | 304,446 | 15,271,011.36 | 0.51 |
| 67 | 600410 | 华胜天成 | 1,299,937 | 15,222,262.27 | 0.51 |
| 68 | 600332 | 广州药业 | 1,669,916 | 15,179,536.44 | 0.50 |
| 69 | 300020 | 银江股份 | 739,844 | 14,959,645.68 | 0.50 |
| 70 | 000596 | 古井贡酒 | 351,093 | 14,851,233.90 | 0.49 |
| 71 | 002161 | 远 望 谷 | 910,000 | 14,760,200.00 | 0.49 |
| 72 | 002089 | 新 海 宜 | 901,104 | 14,489,752.32 | 0.48 |
| 73 | 002230 | 科大讯飞 | 400,000 | 14,260,000.00 | 0.47 |
| 74 | 002261 | 拓维信息 | 497,961 | 13,544,539.20 | 0.45 |
| 75 | 600391 | 成发科技 | 833,257 | 13,423,770.27 | 0.45 |
| 76 | 002296 | 辉煌科技 | 300,098 | 13,048,261.04 | 0.43 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 77 | 002255 | 海陆重工 | 299,950 | 11,908,015.00 | 0.40 |
| 78 | 000869 | 张裕A | 148,424 | 11,870,951.52 | 0.39 |
| 79 | 300033 | 同花顺 | 281,937 | 9,943,917.99 | 0.33 |
| 80 | 002422 | 科伦药业 | 100,000 | 9,380,000.00 | 0.31 |
| 81 | 600306 | 商业城 | 918,400 | 9,321,760.00 | 0.31 |
| 82 | 300015 | 爱尔眼科 | 199,979 | 8,139,145.30 | 0.27 |
| 83 | 300056 | 三维丝 | 208,600 | 7,321,860.00 | 0.24 |
| 84 | 002313 | 日海通讯 | 211,392 | 7,263,429.12 | 0.24 |
| 85 | 300036 | 超图软件 | 184,803 | 6,684,324.51 | 0.22 |
| 86 | 002159 | 三特索道 | 394,901 | 6,417,141.25 | 0.21 |
| 87 | 600280 | 南京中商 | 277,002 | 5,540,040.00 | 0.18 |
| 88 | 300002 | 神州泰岳 | 99,869 | 5,412,899.80 | 0.18 |
| 89 | 002104 | 恒宝股份 | 299,909 | 4,576,611.34 | 0.15 |
| 90 | 300055 | 万邦达 | 62,946 | 4,343,274.00 | 0.14 |
| 91 | 300044 | 赛为智能 | 182,284 | 3,855,306.60 | 0.13 |
| 92 | 002291 | 星期六 | 231,288 | 3,524,829.12 | 0.12 |
| 93 | 300086 | 康芝药业 | 62,599 | 3,287,699.48 | 0.11 |
| 94 | 300058 | 蓝色光标 | 108,626 | 2,884,020.30 | 0.10 |
| 95 | 300075 | 数字政通 | 30,000 | 1,429,500.00 | 0.05 |
| 96 | 002344 | 海宁皮城 | 20,000 | 660,400.00 | 0.02 |
| 97 | 300070 | 碧水源 | 5,000 | 466,000.00 | 0.02 |
| 98 | 300003 | 乐普医疗 | 10,000 | 264,900.00 | 0.01 |
| 99 | 600285 | 羚锐制药 | 10,000 | 89,200.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 002081 | 金螳螂 | 85,290,586.35 | 1.89 |
| 2 | 600536 | 中国软件 | 82,985,952.95 | 1.84 |
| 3 | 600537 | 海通集团 | 75,222,477.97 | 1.66 |
| 4 | 600198 | 大唐电信 | 70,069,073.92 | 1.55 |
| 5 | 600572 | 康恩贝 | 67,745,970.83 | 1.50 |
| 6 | 600406 | 国电南瑞 | 67,206,205.52 | 1.49 |
| 7 | 000400 | 许继电气 | 66,149,240.36 | 1.46 |
| 8 | 002065 | 东华软件 | 65,811,890.56 | 1.46 |
| 9 | 002163 | 中航三鑫 | 57,382,192.78 | 1.27 |
| 10 | 600050 | 中国联通 | 56,938,866.43 | 1.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 000661 | 长春高新 | 56,854,751.17 | 1.26 |
| 12 | 002339 | 积成电子 | 55,765,064.63 | 1.23 |
| 13 | 002322 | 理工监测 | 54,970,301.36 | 1.22 |
| 14 | 000021 | 长城开发 | 53,523,278.09 | 1.18 |
| 15 | 300040 | 九州电气 | 53,028,177.45 | 1.17 |
| 16 | 002325 | 洪涛股份 | 50,328,733.24 | 1.11 |
| 17 | 600588 | 用友软件 | 49,965,542.95 | 1.11 |
| 18 | 002310 | 东方园林 | 48,967,914.88 | 1.08 |
| 19 | 002212 | 南洋股份 | 48,855,071.19 | 1.08 |
| 20 | 600521 | 华海药业 | 48,328,530.71 | 1.07 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|----------------|-----------------|
| 1 | 600690 | 青岛海尔 | 255,756,802.56 | 5.66 |
| 2 | 002024 | 苏宁电器 | 205,242,828.79 | 4.54 |
| 3 | 000063 | 中兴通讯 | 202,573,977.64 | 4.48 |
| 4 | 000527 | 美的电器 | 177,381,594.25 | 3.93 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 163,701,340.08 | 3.62 |
| 6 | 600582 | 天地科技 | 153,521,022.28 | 3.40 |
| 7 | 600487 | 亨通光电 | 125,374,205.27 | 2.78 |
| 8 | 600178 | 东安动力 | 123,798,935.73 | 2.74 |
| 9 | 601699 | 潞安环能 | 123,763,402.77 | 2.74 |
| 10 | 000404 | 华意压缩 | 114,637,910.28 | 2.54 |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 101,053,182.42 | 2.24 |
| 12 | 600123 | 兰花科创 | 96,524,880.22 | 2.14 |
| 13 | 600522 | 中天科技 | 95,980,695.20 | 2.12 |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 92,943,163.66 | 2.06 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 90,755,659.44 | 2.01 |
| 16 | 000521 | 美菱电器 | 88,640,103.45 | 1.96 |
| 17 | 000625 | 长安汽车 | 79,574,122.06 | 1.76 |
| 18 | 600352 | 浙江龙盛 | 61,390,449.66 | 1.36 |
| 19 | 600707 | 彩虹股份 | 59,901,689.56 | 1.33 |
| 20 | 000921 | ST 科 龙 | 56,986,260.98 | 1.26 |

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 | 3,208,228,009.41 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 3,991,465,925.87 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,461,314.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 37,395.27 |
| 4 | 应收利息 | 46,947.58 |
| 5 | 应收申购款 | 5,087,980.13 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,633,637.81 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1 | 600804 | 鹏博士 | 33,200,000.00 | 1.10 | 非公开发行新股 |

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 |
| 62,447 | 55,176.86 | 286,384,993.84 | 8.31% | 3,159,244,118.16 | 91.69% |

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 | 539,538.43 | 0.0157% |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2009年6月16日)基金份额总额 | 7,070,893,298.01 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,204,802,094.46 |
| 本报告期基金总申购份额 | 600,686,934.23 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,359,859,916.69 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,445,629,112.00 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

报告期内未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------|---|------------------|--------|--------------|--------|-------|
| 广发证券 | 3 | 2,184,812,424.85 | 30.48% | 1,791,289.37 | 30.04% | 新增一席位 |
| 江南证券 | 1 | 1,469,619,095.66 | 20.50% | 1,249,165.81 | 20.95% | 新增一席位 |
| 招商证券 | 2 | 641,657,324.11 | 8.95% | 545,405.11 | 9.15% | 新增一席位 |
| 国泰君安 | 4 | 539,835,786.74 | 7.53% | 438,621.82 | 7.36% | 新增二席位 |
| 齐鲁证券 | 2 | 423,396,383.45 | 5.91% | 347,152.66 | 5.82% | 新增二席位 |
| 第一创业 | 1 | 347,859,561.11 | 4.85% | 295,678.90 | 4.96% | 新增一席位 |
| 国海证券 | 1 | 233,842,010.54 | 3.26% | 189,998.34 | 3.19% | - |
| 华泰联合 | 2 | 222,586,446.69 | 3.11% | 180,852.50 | 3.03% | 新增二席位 |
| 中金公司 | 2 | 202,675,939.98 | 2.83% | 172,272.78 | 2.89% | 新增一席位 |
| 万联证券 | 1 | 195,224,288.66 | 2.72% | 165,940.07 | 2.78% | 新增一席位 |
| 申银万国 | 1 | 171,935,453.29 | 2.40% | 146,144.18 | 2.45% | - |
| 国都证券 | 1 | 145,029,361.14 | 2.02% | 117,837.20 | 1.98% | - |
| 银河证券 | 1 | 127,472,478.82 | 1.78% | 103,573.00 | 1.74% | - |
| 中投证券 | 2 | 125,804,564.98 | 1.75% | 102,217.27 | 1.71% | 新增一席位 |
| 平安证券 | 2 | 96,945,726.83 | 1.35% | 82,400.40 | 1.38% | 新增一席位 |
| 西部证券 | 1 | 39,837,088.43 | 0.56% | 33,861.64 | 0.57% | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发华福 | 3 | - | - | - | - | 新增二席位 |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | 新增一席位 |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | 新增一席位 |
| 厦门证券 | 1 | - | - | - | - | 新增一席位 |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | 新增一席位 |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | 新增一席位 |

注：(1) 交易席位选择标准：

- a 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- b 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- c 具备基金运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足基金进行证券交易的需要；
- d 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- e 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- f 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

(2)交易席位选择流程

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

知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本报告期本基金不存在租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-------------------------------|------------|
| 1 | 本公司决定自2010年1月8日起，本基金及公司旗下部分其他基金参加浦发银行的基金定投申购费率优惠活动。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-01-08 |
| 2 | 本公司网上交易系统于2010年1月11日开通约定交易业务。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-01-08 |
| 3 | 本公司决定自2010年1月18日起通过渤海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》 | 2010-01-15 |
| 4 | 本基金及公司旗下部分其他基金参与了成都鹏博士电信传媒集团股份有限公司（鹏博士，代码：600804）非公开发行股票认购。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-01-19 |
| 5 | 本公司拟于2010年3月2日通过广发证券股份有限公司申购广发聚瑞股票型证券投资基金5000万元，申购费1000元；申购广发小盘成长股票型证券投资基金5000万元，申购费1000元。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-02-26 |
| 6 | 本公司自2010年3月5日起，对持有中国工商银行借记卡的个人投资者开通网上直销定期投资业务，并按申购费率8折后不低于0.6%的方式对投资者通过中国工商银行借记卡开通网上直销定期投资业务进行优惠。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2010-03-05 |
| 7 | 本公司决定调整旗下开放式基金转换业务中基金转换后转入基金份额的持有期限计算规则，自2010年3月15日起，投资者进行基金转换后，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2010-03-11 |
| 8 | 经广发基金管理有限公司董事会批准，广发基金管理有限公司决定将公司旗下基金的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。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2010-03-20 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------------|------------|
| 9 | 本公司决定自2010年3月25日起,对投资者通过渤海银行个人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(只限前端申购费用)优惠。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-03-23 |
| 10 | 本公司决定自3月30日起,在东方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》 | 2010-03-29 |
| 11 | 本公司决定自2010年4月1日起通过南京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》 | 2010-03-29 |
| 12 | 本公司决定自2010年4月1日起,本基金及公司旗下部分其他基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-01 |
| 13 | 本公司决定将华夏银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的费率优惠活动及基金定期定额申购费率优惠活动截止日期由原来的2010年3月31日延期至2011年3月31日。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-01 |
| 14 | 本公司决定自2010年4月1日起,对通过上海银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的投资者实行申购费率(只限前端申购模式)优惠。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-01 |
| 15 | 本公司决定自2010年4月7日起,对投资者通过东方证券网上交易、电话、手机交易系统委托申购本基金及公司旗下部分其他基金(仅限于前端模式)实行申购费率优惠。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-06 |
| 16 | 本公司决定自2010年4月9日起对本基金及公司旗下部分其他基金通过上海浦东发展银行定期定额投资的申购起点金额进行调整。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-07 |
| 17 | 本公司决定自2010年4月9日起对投资者通过青岛银行个人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(只限前端申购费用)优惠。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-09 |
| 18 | 本公司决定自2010年4月12日起,本基金及公司旗下部分其他基金参加兴业证券的基金定投申购费率优惠活动。 | 《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-04-12 |
| 19 | 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 |
| 20 | 本公司决定自2010年5月24日起,本基金及 | 《中国证券报》、 | 2010-05-24 |

| | | | |
|----|---|-------------------------------|------------|
| | 公司旗下部分其他基金参加南京证券非现场交易系统申购基金的费率优惠活动。 | 《证券时报》、《上海证券报》 | |
| 21 | 本公司决定自2010年6月1日起，对通过中信银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的投资者实行申购费率（只限前端申购模式）优惠。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-06-01 |
| 22 | 本公司决定自2010年6月4日起至2010年8月31日，对通过中国农业银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的投资者实行申购费率（只限前端申购模式）优惠。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-06-03 |
| 23 | 本公司决定自6月7日起在申银万国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》 | 2010-06-04 |
| 24 | 本公司决定自6月8日起，本基金及公司旗下部分其他基金在信达证券正式推出“开放式基金定期定额投资业务”，并参加信达证券非现场委托方式基金申购费率优惠活动。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2010-06-08 |
| 25 | 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 |
| 26 | 本公司决定自2010年6月28日起，本基金及公司旗下部分其他基金参加安信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》 | 2010-06-25 |
| 27 | 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 |
| 28 | 本公司决定自2010年6月30日15:00至2010年12月31日15:00期间，对通过交通银行网上银行申购本基金及公司旗下部分其他基金的投资者实行申购费率（只限前端申购模式）优惠。 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2010-06-30 |

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发聚瑞股票型证券投资基金募集的文件；
2. 《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》；

3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《广发聚瑞股票型证券投资基金托管协议》；
5. 《广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版；
6. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一〇年八月二十五日