

广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

2011 年年度报告

2011 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：二〇一二年三月二十九日

§ 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 2012 年 3 月 21 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 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	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.....	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	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	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.8	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.9	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	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6	审计报告.....	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	14
6.2	注册会计师的责任.....	14
6.3	审计意见.....	15
§ 7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注.....	19
§ 8	投资组合报告.....	39
8.1	期末基金资产组合情况.....	39
8.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	40
8.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	40
8.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	41
8.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	46

8.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	51
8.7	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	51
8.8	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	51
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	51
8.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	51
8.11	投资组合报告附注	52
§ 9	基金份额持有人信息	52
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
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	53
§ 10	开放式基金份额变动	53
§ 11	重大事件揭示	53
11.1	基金份额持有人大会决议	53
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	53
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4	基金投资策略的改变	54
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8	其他重大事件	58
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金
基金简称	广发亚太精选股票
基金主代码	270023
交易代码	270023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 18 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	160,953,258.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在亚太区域内进行积极的资产配置和组合管理，有效分散基金的投资组合风险，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置策略包括股票和债券等大类资产的配置及国家和地区间的资产配置。</p> <p>本基金的股票资产及其它权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具的比例 5%-40%。</p> <p>本基金将至少 80%的股票资产及其它权益类资产投资于亚太地区（除日本）证券市场以及在其它证券市场交易的亚太企业。亚太企业主要是指登记注册在亚太地区、在亚太地区证券市场进行交易或其主要业务收入或资产在亚太地区的企业。</p> <p>本基金将不高于 20%的股票资产及其它权益类资产投资于超出前述投资范围的其他市场（包括日本）的企业。</p> <p>（二）权益类投资策略</p> <p>本基金通过分析全球经济发展趋势下亚太区域市场的投资特点，进行自上而下的国家和地区配置，在此基础上对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握，采取自下而上的个股精选策略实现合理的投资组合配置。</p> <p>1、个股精选策略</p> <p>本基金力图对公司及行业所处的基本面进行深入</p>

	<p>分析和把握，采取自下而上的个股精选策略实现合理的投资组合配置。</p> <p>本基金个股选择策略由定量和定性两部分组成。</p> <p>2、基金的投资策略</p> <p>本基金对境外基金的投资，主要是作为股票投资的一种替代性投资工具。</p> <p>（三）固定收益类投资策略</p> <p>本基金固定收益类投资以分散投资风险和优化流动性管理为主要目标，一般不做主动性投资。</p> <p>（四）衍生品投资策略</p> <p>本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与金融衍生品投资，包括远期合约、掉期、期权、期货等，以实现投资组合风险管理。</p> <p>（五）币种配置和外汇管理</p> <p>本基金人民币与其他外币的转换目的是为了满足不同股票投资清算和应对赎回的需要，基金管理人将根据对汇率前景的预测、股票资产的地区配置要求，以及应对申购赎回的需要，对货币资产在港币、美元、日元、韩币、澳元、欧元、英镑、新币、人民币等币种之间进行配置。</p>
业绩比较基准	摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数（MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

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	赵会军
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市拱北情侣南路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	100140
法定代表人		王志伟	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	无	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼 32/F., Standard Chartered Bank Building, 4-4A Des Voeux Road, Central, Hong Kong
办公地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼 32/F., Standard Chartered Bank Building, 4-4A Des Voeux Road, Central, Hong Kong
邮政编码		无	无

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所有限公司	上海市延安东路222号外滩中心30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	2011 年	2010 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-13,071,613.48	-741,538.88
本期利润	-40,110,962.58	16,449,401.58
加权平均基金份额本期利润	-0.2262	0.0447
本期加权平均净值利润率	-23.84%	3.04%

本期基金份额净值增长率	-22.50%	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-32,346,883.78	192,531.09
期末可供分配基金份额利润	-0.2010	0.0008
期末基金资产净值	128,606,374.49	235,082,938.40
期末基金份额净值	0.799	1.031
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-20.10%	3.10%

注：1、本基金合同生效日为 2010 年 8 月 18 日。

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。

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

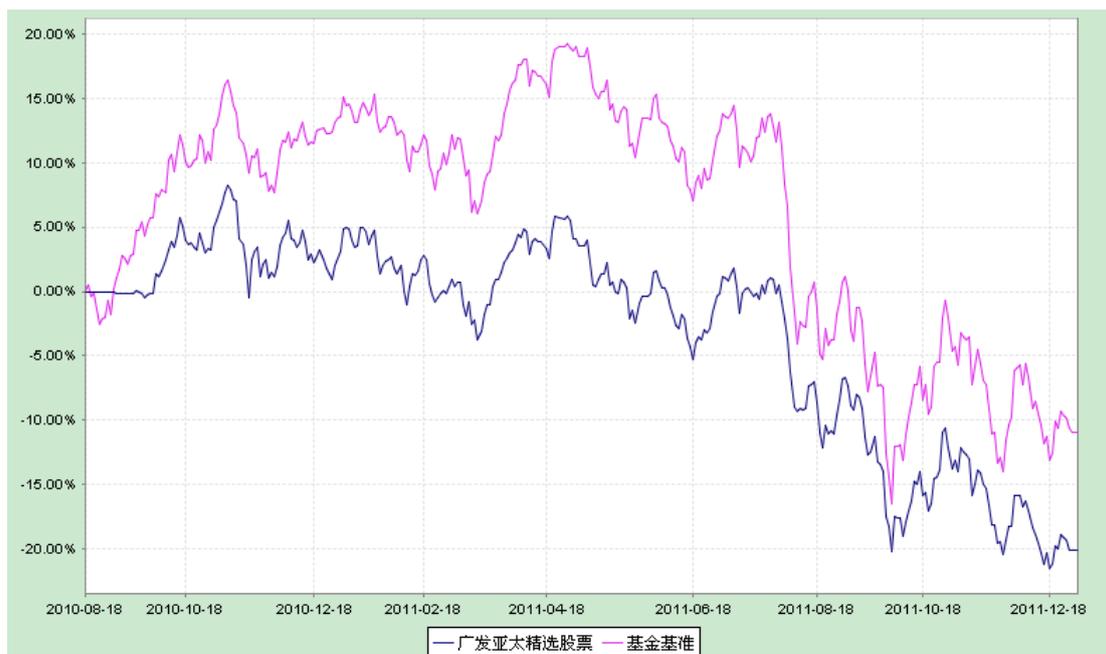
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.36%	1.31%	2.60%	1.72%	-3.96%	-0.41%
过去六个月	-19.78%	1.34%	-20.46%	1.81%	0.68%	-0.47%
过去一年	-22.50%	1.15%	-21.59%	1.47%	-0.91%	-0.32%
基金合同成立至今	-20.10%	1.08%	-10.90%	1.34%	-9.20%	-0.26%

注：业绩比较基准：摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index)。

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

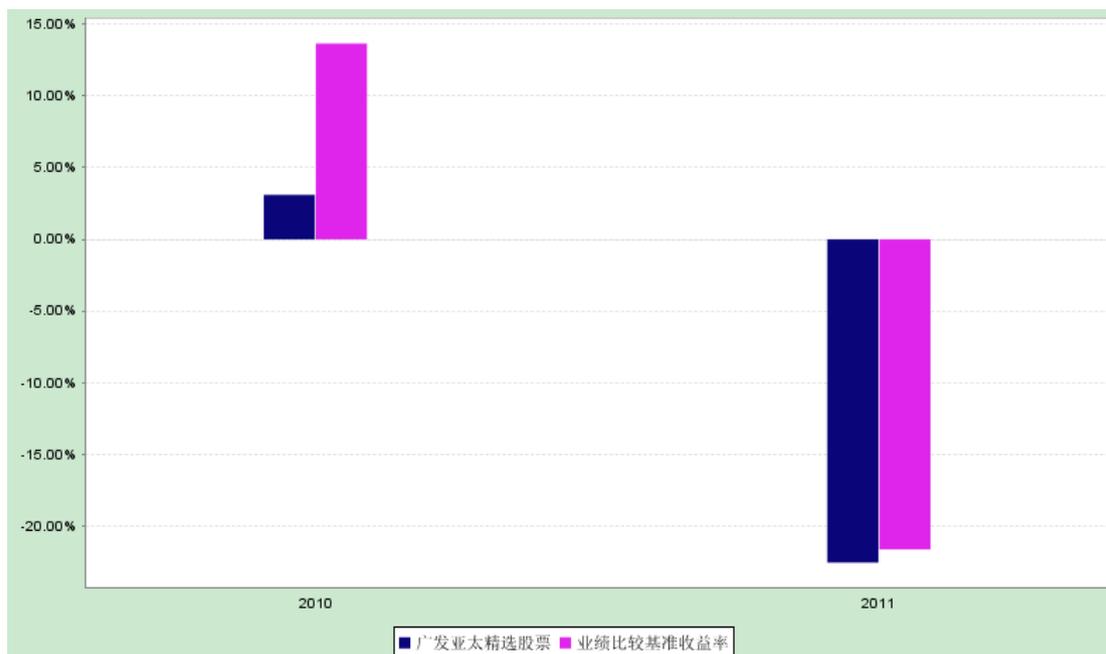
广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2010 年 8 月 18 日至 2011 年 12 月 31 日）



3.2.3 合同生效日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

广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：2010 年合同成立当年按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2010 年 08 月 18 日）至报告期末未进行利润分配。

§ 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、特定资产管理业务资格和社保基金投资管理人资格。

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 17 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、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、机构理财部、市场拓展部、国际业务部。此外，还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金管理人管理二十一只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、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、广发亚太（除日本）精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金和广发制造业精选股票型证券投资基金，管理资产规模为 983.80 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金、特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

YongHua Pan (潘永华)	本基金的基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理(兼)	2010-10-29	-	16	男，美国籍，金融学博士，持有中国证券业执业证书，曾任职于美国雷曼兄弟公司(纽约)，巴克莱投资银行(纽约)，法国巴黎银行(纽约)，BASSINI PLAYFAIR WRIGHT(纽约)和 SAC 资产管理公司(纽约)，从事证券研究、交易和投资工作，2009 年 5 月 8 日起任广发基金管理有限公司国际业务部总经理，2010 年 10 月 29 日起任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理，2011 年 1 月 6 日起任广发基金管理有限公司总经理助理。
-------------------	------------------------------	------------	---	----	--

注：（1）基金经理的“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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 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、《广发亚太（除日本）精选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。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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

监察稽核部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；监察稽核部稽核岗通过对投资、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。

4.4.2 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

本基金管理人未管理与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年是“复杂多变”的一年，日本地震、欧债危机、美国债务上限等事件给市场带来大量冲击，全年股票、大宗商品市场波动剧烈。全球经济面临很大不确定性，市场情绪不稳定，各主要经济都面临各自不一的结构性问题。其中，中国在高通胀和经济结构转型的背景下，经济增长逐季减缓。美国经济总体增长缓慢，失业率居高不下，消费需求受制于就业市场的恢复缓慢。欧元区则受到欧债危机的严重影响，经济显著放缓甚至部分国家进入衰退。其他新兴市场在高通胀的压力下，上半年都选择紧缩货币的政策。相对看，美国经济由于政策协调性好，同时受益于全球经济前景的不确定性，美国市场相对表现较好，其他市场普遍显著下跌。

全年来看，韩国综合指数下跌 10.98%，马来西亚吉隆坡指数涨幅 0.78%，印度孟买 Sensex30 指数下跌 24.64%，纳斯达克综合指数下跌 1.80%，标普 500 指数涨幅 0.00%，美国道琼斯工业平均指数涨幅 5.53%，新加坡海峡指数下跌 17.04%，台湾加权指数下跌 21.18%，澳大利亚综合指数下跌 14.51%；国内上证综合指数下跌 21.68%；深证成份指数下跌 28.41%；沪深 300 指数下跌 25.01%。美元兑人民币全年贬值 4.5%。

广发亚太精选在国家区域配置方面，主要配置于中国香港、澳大利亚、韩国、印度股票以及美国上市的股票；在行业配置方面，主要配置于消费类，能源类和科技类股票。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金净值增长-22.50%，比较基准增长-21.59%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计欧债危机仍将持续发酵作用市场，欧洲经济增速下滑已成定局，未来全球经济将增速明显放缓，欧洲债务危机的演变和主要经济体经济数据好坏继续主导市场未来的走势。鉴于各国市场基本都处于历史上比较便宜的估值水平，也反应了相当悲观的经济基本面预期。我们认为主要资本市场最坏的时刻在 2011 年已经出现，但是未来结构性机会大于系统性机会，自下而上甄选股票对投资表现起关键作用。我们配置重点放在未来业绩增长明确的股票上，并将继续关注能源、科技以及估值便宜的消费类股票。

4.7 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。

4.8 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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.9 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-32,346,883.78 元，未进行利润分配。

§ 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

2011 年，本基金托管人在对广发亚太（除日本）精选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

2011 年，广发亚太（除日本）精选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亚太（除日本）精选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，广发亚太（除日本）精选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亚太（除日本）精选股票型证券投资基金 2011 年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

德师报(审)字(12)第 P0466 号

广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金全体持有人:

我们审计了后附的广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金(以下简称“广发亚太精选股票(QDII)”)的财务报表,包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表,2011 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发亚太精选股票(QDII)的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则,计划和执行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,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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，广发亚太精选股票(QDII)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了广发亚太精选股票(QDII) 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

德勤华永会计师事务所有限公司 注册会计师 胡小骏 余志亮

上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

2012-03-27

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	26,598,085.35	27,916,042.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	100,658,769.00	218,552,687.23
其中：股票投资		92,766,891.75	198,632,704.68
基金投资		7,891,877.25	19,919,982.55
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	0.00	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,184,580.95	-
应收利息	7.4.7.5	1,989.56	801.36

应收股利		11,533.12	-
应收申购款		13,515.71	63,071.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		129,468,473.69	246,532,602.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		331,650.15	10,873,599.55
应付管理人报酬		209,020.82	380,999.90
应付托管费		40,642.94	74,083.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	280,785.29	120,980.86
负债合计		862,099.20	11,449,663.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	160,953,258.27	227,944,763.35
未分配利润	7.4.7.10	-32,346,883.78	7,138,175.05
所有者权益合计		128,606,374.49	235,082,938.40
负债和所有者权益总计		129,468,473.69	246,532,602.03

注 1：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.799 元，基金份额总额 160,953,258.27 份。

注 2：上年度会计期间为 2010 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日）至2010年12月31日
一、收入		-33,957,577.10	20,790,359.60
1. 利息收入		66,308.44	420,253.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	66,308.44	420,253.96
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）		-5,131,882.04	5,818,396.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,748,227.88	4,548,846.95
基金投资收益	7.4.7.13	8,733.74	283,940.84
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	25,405.91	-
股利收益	7.4.7.16	2,582,206.19	985,608.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-27,039,349.10	17,190,940.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,951,547.10	-3,047,005.07
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	98,892.70	407,773.72
减：二、费用		6,153,385.48	4,340,958.02
1. 管理人报酬		3,039,433.49	2,550,472.56
2. 托管费		591,000.99	495,925.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,108,558.60	1,124,392.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	414,392.40	170,167.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40,110,962.58	16,449,401.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号		-40,110,962.58	16,449,401.58

填列			
----	--	--	--

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	227,944,763.35	7,138,175.05	235,082,938.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-40,110,962.58	-40,110,962.58
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）	-66,991,505.08	625,903.75	-66,365,601.33
其中：1. 基金申购款	13,681,363.83	-167,262.86	13,514,100.97
2. 基金赎回款	-80,672,868.91	793,166.61	-79,879,702.30
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）	160,953,258.27	-32,346,883.78	128,606,374.49
项目	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日）至2010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）	540,598,089.38	-	540,598,089.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,449,401.58	16,449,401.58
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）	-312,653,326.03	-9,311,226.53	-321,964,552.56
其中：1. 基金申购款	4,069,346.63	181,442.58	4,250,789.21
2. 基金赎回款	-316,722,672.66	-9,492,669.11	-326,215,341.77
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）	227,944,763.35	7,138,175.05	235,082,938.40

报表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：王志伟，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

广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2010]644号《关于同意广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2010年8月18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,境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。本基金已向中国证监会备案,并于2010年8月18日获得确认。

本基金募集期为2010年7月19日至2010年8月16日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集为人民币540,598,089.38元,有效认购户数为6,610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人民币23,922.99元,折合基金份额23,922.99份,按照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有限公司验资。基金合同于2010年8月18日生效,基金合同生效日的基金份额总额为540,598,089.38份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括:股票及其他权益类证券(包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等);现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具(包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具);政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。本基金投资的主要区域为亚太地区(除日本),包括韩国、印度、台湾、香港、澳大利亚、新西兰、新加坡、印度尼西亚、泰国、马来西亚和菲律宾等国家或地区。本基金将至少80%的股票资产及其它权益类资产投资于亚太地区(除日本)证券市场以及在其它证券市场交易的亚太企业,本基金将不高于20%的股票资产及其它权益类资产投资于超出前述投资范围的其他市场(包括日本)的企业。本基金的业绩比较基准采用:摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index)。

本基金的财务报表于2012年3月27日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报

出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、基金合同、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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年度，即每年 1 月 1 日起至 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

(1)金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资、债券投资和基金投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

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。

(2)金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

- 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

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)，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。

- 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不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)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入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利率后，逐日确认债券利息收入。

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。

- 基金投资

买入基金于交易日按基金的公允价值入账，相关的交易费用直接计入当期损益。

卖出基金于交易日确认基金投资收益，卖出基金按移动加权平均法结转成本。

- 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(2)贷款及应收款项

- 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

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确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

(3)其他金融负债

- 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

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确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，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公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流

量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为：

第 1 层级：同类资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第 2 层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值；

第 3 层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

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

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日

计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

- 投资收益

股票投资收益于交易日按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。

债券投资收益于交易日按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。

基金投资收益于交易日按卖出或赎回基金的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

衍生工具投资收益于交易日按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。

股利收益和基金分红收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票和基金上市所在地适用的预交所得税后的净额入账。

- 公允价值变动收益

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.80%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.35%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3)基金的收益分配比例应当以期末可供分配利润为基准计算。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

(4)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；

(5)每一基金份额享有同等分配权；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额直接计入汇兑收益项目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额作为公允价值变动处理，直接计入当期损益。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示

如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2、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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3、基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	26,598,085.35	27,916,042.19
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	26,598,085.35	27,916,042.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	101,451,314.61	92,766,891.75	-8,684,422.86
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	9,055,863.03	7,891,877.25	-1,163,985.78
其他	-	-	-
合计	110,507,177.64	100,658,769.00	-9,848,408.64
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,238,807.02	198,632,704.68	15,393,897.66
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	18,122,939.75	19,919,982.55	1,797,042.80
其他	-	-	-
合计	201,361,746.77	218,552,687.23	17,190,940.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	0.00	0.00	0.00	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金本报告期末获配持有 XIWAW1 HK 认股权证，取得成本为 0.00 元，由于本报告期末行权价格高于西王糖业股票收盘价，权证估值价格为 0.00 元。本基金上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	1,989.56	801.36
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	-	-
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	1,989.56	801.36

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	785.29	40,980.86
预提费用	280,000.00	80,000.00
合计	280,785.29	120,980.86

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	227,944,763.35	227,944,763.35
本期申购	13,681,363.83	13,681,363.83
本期赎回（以“-”号填列）	-80,672,868.91	-80,672,868.91
本期末	160,953,258.27	160,953,258.27

7.4.7.10 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	192,531.09	6,945,643.96	7,138,175.05
本期利润	-13,071,613.48	-27,039,349.10	-40,110,962.58
本期基金份额交易产生的变动数	-304,523.94	930,427.69	625,903.75
其中：基金申购款	388,398.09	-555,660.95	-167,262.86
基金赎回款	-692,922.03	1,486,088.64	793,166.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,183,606.33	-19,163,277.45	-32,346,883.78

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日）至2010年12月31日
活期存款利息收入	66,027.35	420,164.01
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	-	-
其他	281.09	89.95
合计	66,308.44	420,253.96

7.4.7.12 股票投资收益-买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
卖出股票成交总额	449,805,766.98	161,783,397.34
减：卖出股票成本总额	457,553,994.86	157,234,550.39
买卖股票差价收入	-7,748,227.88	4,548,846.95

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年 12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生 效日）至2010年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	33,308,749.14	10,716,715.72
减：卖出/赎回基金成本总额	33,300,015.40	10,432,774.88
基金投资收益	8,733.74	283,940.84

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
卖出权证成交总额	25,405.91	-
减：卖出权证成本总额	0.00	-
买卖权证差价收入	25,405.91	-

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,360,426.72	944,014.57
基金投资产生的股利收益	221,779.47	41,594.17
合计	2,582,206.19	985,608.74

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效
------	----------------------------	------------------------------

	日	日) 至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-27,039,349.10	17,190,940.46
——股票投资	-24,078,320.52	15,393,897.66
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-2,961,028.58	1,797,042.80
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-27,039,349.10	17,190,940.46

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
基金赎回费收入	98,892.70	407,773.72
合计	98,892.70	407,773.72

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日）至20 10年12月31日
交易所市场交易费用	2,108,558.60	1,124,392.37
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,108,558.60	1,124,392.37

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	90,000.00
账户维护费	4,500.00	-
银行汇划费	449.50	167.85
其他	29,442.90	-
合计	414,392.40	170,167.85

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，本基金无需要披露的或有事项。

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，本基金无需要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
渣打银行(香港)有限公司	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
广发期货有限公司	基金管理人股东的子公司
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
香江投资有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
华福证券有限责任公司（原名：广发华福证券股份有限责任公司）	基金管理人股东的原子公司(2010年12月28日之前)、代销机构（注1）
广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)	基金管理人全资子公司（注2）
广发控股(香港)有限公司(GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited)	基金管理人股东全资子公司

注 1：广发证券股份有限公司于 2010 年 12 月 28 日将其持有广发华福证券有限责任公司的股权全部转让。广发华福证券有限责任公司在本报告期末及上年度末与本基金不属于关联方。广发华福证券有限责任公司于 2011 年 7 月 22 日更名为华福证券有限责任公司。

注 2：广发基金管理有限公司于 2010 年 12 月 10 日在香港设立全资子公司广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)。

除此之外，本报告期内及上年度可比期间内不存在其他控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效日）至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

广发控股(香港)有限公司	82,585,094.19	10.00%	-	-
--------------	---------------	--------	---	---

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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
广发控股(香港)有	81,410.73	6.33%	-	-

本基金上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

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。

注 2：本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

注 3：本基金对该类交易的佣金的计算方式是按双方约定的佣金率计算。

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 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,039,433.49	2,550,472.56
其中：支付销售机构的客户维护费	482,569.51	275,775.56

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.8% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

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二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	591,000.99	495,925.24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年8月18日（基金合同生 效日）至2010年12月31日
基金合同生效日（2010年8月18日）持有的基金份额	-	40,000,400.01
期初持有的基金份额	40,000,400.01	-
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	40,000,400.01	40,000,400.01
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	24.85%	17.55%

注：基金管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发期货有限 公司	-	-	19,999,400.00	8.77%

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 8 月 18 日（基金合同生效日） 至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股 份有限公司	3,023,137.09	48,004.75	1,914,190.95	406,865.09
渣打银行(香港) 有限公司	23,574,948.26	18,022.60	26,001,851.24	13,298.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外资产托管人渣打银行(香港)有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 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

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无暂时停牌等流通受限股票。

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 2011 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

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的理念，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。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。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资。

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，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约约定到期日均为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。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，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，从而对流动性风险进行监控。

7.4.13.4 市场风险

本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重大风险，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、外汇风险和其他价格风险。

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、风险价值模型(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 2011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	26,598,085.35	-	-	-	26,598,085.35
交易性金融资产	-	-	-	100,658,769.00	100,658,769.00
应收股利	-	-	-	11,533.12	11,533.12
应收利息	-	-	-	1,989.56	1,989.56
应收申购款	13,515.71	-	-	-	13,515.71
应收证券清算款	-	-	-	2,184,580.95	2,184,580.95
资产总计	26,611,601.06	-	-	102,856,872.63	129,468,473.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	331,650.15	331,650.15
应付管理人报酬	-	-	-	209,020.82	209,020.82

应付托管费	-	-	-	40,642.94	40,642.94
其他负债	-	-	-	280,785.29	280,785.29
负债总计	-	-	-	862,099.20	862,099.20
利率敏感度缺口	26,611,601.06	-	-	101,994,773.43	128,606,374.49
上年度末2010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	27,916,042.19	-	-	-	27,916,042.19
交易性金融资产	-	-	-	218,552,687.23	218,552,687.23
应收利息	-	-	-	801.36	801.36
应收申购款	63,071.25	-	-	-	63,071.25
资产总计	27,979,113.44	-	-	218,553,488.59	246,532,602.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,873,599.55	10,873,599.55
应付管理人报酬	-	-	-	380,999.90	380,999.90
应付托管费	-	-	-	74,083.32	74,083.32
其他负债	-	-	-	120,980.86	120,980.86
负债总计	-	-	-	11,449,663.63	11,449,663.63
利率敏感度缺口	27,979,113.44	-	-	207,103,824.96	235,082,938.40

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日
----	--------------------

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	15,257,972.18	8,316,976.08	-	23,574,948.26
交易性金融资产	15,230,283.44	56,690,856.05	28,737,629.51	100,658,769.00
应收股利	11,531.22	1.90	-	11,533.12
资产合计	30,499,786.84	65,007,834.03	28,737,629.51	124,245,250.38
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	30,499,786.84	65,007,834.03	28,737,629.51	124,245,250.38
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	13,979,064.96	12,022,786.28	-	26,001,851.24
交易性金融资产	47,477,666.11	101,868,449.87	69,206,571.25	218,552,687.23
应收股利	-	-	-	-
资产合计	61,456,731.07	113,891,236.15	69,206,571.25	244,554,538.47
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	61,456,731.07	113,891,236.15	69,206,571.25	244,554,538.47

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	6,211,685.86	12,227,726.92
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,211,685.86	-12,227,726.92

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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、风险价值模型(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 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 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	92,766,891.75	72.13	198,632,704.68	84.49
交易性金融资产-基金投资	7,891,877.25	6.14	19,919,982.55	8.47
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	100,658,769.00	78.27	218,552,687.23	92.97

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(摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index))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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	4,771,228.22	10,849,077.61
	业绩比较基准下降 5%	-4,771,228.22	-10,849,077.61

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 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	92,766,891.75	71.65
	其中：普通股	90,052,464.03	69.56
	存托凭证	2,714,427.72	2.10
2	基金投资	7,891,877.25	6.10
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,598,085.35	20.54
8	其他各项资产	2,211,619.34	1.71
9	合计	129,468,473.69	100.00

注：本基金报告期内持有 XIWAW1 HK 认股权证，取得成本为 0.00 元，由于报告期末行权价格高于西王糖业股票收盘价，权证估值价格为 0.00 元。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	56,690,856.05	44.08
澳大利亚	16,534,110.78	12.86
韩国	11,654,300.35	9.06
美国	7,338,406.19	5.71
印度尼西亚	549,218.38	0.43
合计	92,766,891.75	72.13

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国权重包括印度和中国在美国上市的 ADR。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	12,123,803.93	9.43
材料	20,742,409.00	16.13
工业	3,670,818.73	2.85
非必须消费品	14,928,582.08	11.61
必须消费品	18,431,587.18	14.33

金融	8,484,395.61	6.60
信息技术	10,659,804.44	8.29
公共事业	3,725,490.78	2.90
合计	92,766,891.75	72.13

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	VINDA INTERN ATIONA L HOLDIN GS	维达纸业	3331 HK	香港证 券交易 所	中国香港	900,000	7,274,411.10	5.66
2	CHINA PETROL EUM & CHEMIC AL-H	中国石化	386 HK	香港证 券交易 所	中国香港	700,000	4,636,393.30	3.61
3	NATION AL AUSTRA LIA BANK LTD	澳大利亚 国民银行 有限公司	NAB AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	28,000	4,225,149.25	3.29
4	RIO TINTO LTD	力拓有限 公司	RIO AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	10,000	3,895,188.66	3.03
5	CHINA RESOUR CES GAS GROUP LT	华润燃气	1193 HK	香港证 券交易 所	中国香港	414,000	3,725,490.78	2.90
6	NEWCR EST MINING LTD	纽克雷斯 特矿业有 限公司	NCM AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	19,436	3,716,291.62	2.89
7	GIORDA	佐丹奴国	709 HK	香港证	中国香港	814,000	3,715,292.17	2.89

	NO INTERN ATIONA L LTD	际		券交易 所				
8	LG CHEM LTD	LG 化学有 限公司	051910 KS	韩国证 券交易 所	韩国	2,000	3,471,796.17	2.70
9	BHP BILLITO N LTD	必和必拓 有限公司	BHP AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利 亚	15,000	3,335,134.17	2.59
10	AAC TECHNO LOGIES HOLDIN GS IN	瑞声科技	2018 HK	香港证 券交易 所	中国香 港	230,000	3,251,879.84	2.53
11	HENGA N INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港证 券交易 所	中国香 港	53,000	3,121,559.82	2.43
12	CHINA SHENHU A ENERGY CO-H	中国神华	1088 HK	香港证 券交易 所	中国香 港	110,000	3,005,264.90	2.34
13	QUIMIC A Y MINERA CHIL-SP ADR	-	SQM US	纽约证 券交易 所	美国	8,000	2,714,427.72	2.11
14	UNI-PRE SIDENT CHINA HOLDIN GS	统一企业 中国	220 HK	香港证 券交易 所	中国香 港	700,000	2,638,828.50	2.05
15	HUTCHI SON WHAMP OA LTD	和记黄埔	13 HK	香港证 券交易 所	中国香 港	50,000	2,636,801.75	2.05
16	SHENGU AN HOLDIN GS GROUP	神冠控股	829 HK	香港证 券交易 所	中国香 港	650,000	2,371,297.50	1.84

	LTD							
17	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	香港证券交易所	中国香港	160,000	2,220,669.44	1.73
18	LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	乐天制果株式会社	004990 KS	韩国证券交易所	韩国	200	1,866,568.84	1.45
19	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	1,759,219.00	1.37
20	HYUNDAI MOTOR CO	现代汽车公司	005380 KS	韩国证券交易所	韩国	1,500	1,746,832.88	1.36
21	NCSOFT CORPORATION	NCSOFT 公司	036570 KS	韩国证券交易所	韩国	900	1,513,101.72	1.18
22	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽约证券交易所	美国	8,000	1,389,222.43	1.08
23	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港证券交易所	中国香港	70,000	1,381,838.15	1.07
24	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	1,358,733.20	1.06
25	INTIME DEPARTMENT STORE	银泰百货商店	1833 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	1,289,013.00	1.00
26	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	中国山水水泥集团	691 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	1,257,395.70	0.98
27	KIMBERLY-CLARK	金佰利	KMB US	纽约证券交易所	美国	2,500	1,158,735.51	0.90

	K CORP			所				
28	INTL BUSINE SS MACHIN ES CORP	国际商业 机器	IBM US	纽约证 券交易 所	美国	1,000	1,158,609.49	0.90
29	CHOW SANG SANG HLDG	周生生集 团国际	116 HK	香港证 券交易 所	中国香港	80,000	1,134,980.00	0.88
30	SOHO CHINA LTD	SOHO 中 国	410 HK	香港证 券交易 所	中国香港	254,000	1,064,595.03	0.83
31	SINOPE C SHANG HAI PETROC HEM-H	S 上石化	338 HK	香港证 券交易 所	中国香港	500,000	1,049,856.50	0.82
32	CHINA OILFIEL D SERVICE S-H	中海油服	2883 HK	香港证 券交易 所	中国香港	100,000	993,918.20	0.77
33	CHINA EVERBR IGHT LTD	中国光大 控股	165 HK	香港证 券交易 所	中国香港	100,000	985,811.20	0.77
34	HYUND AI MOBIS	现代精工	012330 KS	韩国证 券交易 所	韩国	600	957,887.70	0.74
35	SINA CORP	新浪公司	SINA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,800	917,411.04	0.71
36	KIA MOTORS CORPOR ATION	起亚汽车 公司	000270 KS	韩国证 券交易 所	韩国	2,500	911,688.21	0.71
37	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港证 券交易 所	中国香港	150,000	886,500.45	0.69
38	ORIGIN ENERGY	Origin 能 源有限公	ORG AU	澳大利 亚证券	澳大利亚	10,000	861,721.67	0.67

	LTD	司		交易所				
39	POLY HONG KONG INVESTMENTS	保利香港	119 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	819,617.70	0.64
40	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	780,704.10	0.61
41	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	750,302.85	0.58
42	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 HK	香港证券交易所	中国香港	80,000	717,307.36	0.56
43	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港证券交易所	中国香港	400,000	677,745.20	0.53
44	HONAM PETROCHEMICAL CORP	湖南石油化学公司	011170 KS	韩国证券交易所	韩国	400	651,713.55	0.51
45	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	550,465.30	0.43
46	UNITED TRACTORS TBK PT	-	UNTR IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	30,000	549,218.38	0.43
47	HYUNDAI DEPT STORE CO	韩国现代百货商店	069960 KS	韩国证券交易所	韩国	600	534,711.28	0.42
48	ILUKA RESOURCES LTD	艾璐卡资源有限公司	ILU AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,000	500,625.41	0.39
49	CHINA SINGYE	中国兴业太阳能技	750 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	484,798.60	0.38

	S SOLAR TECH	术		所				
50	CHINA SANJIA NG FINE CHEMIC AL	中国叁江 化工	2198 HK	香港证 券交易 所	中国香港	100,000	149,979.50	0.12
51	MAGIC HOLDIN GS INTERN ATIONA L	美即控股	1633 HK	香港证 券交易 所	中国香港	78	185.91	0.00

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	CHINA PETROLEU M & CHEMICAL -H	386 HK	12,266,404.44	5.22
2	AGRICULT URAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	11,943,923.38	5.08
3	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	10,473,090.68	4.46
4	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	10,029,002.32	4.27
5	HONAM PETROCHE MICAL CORP	011170 KS	9,243,614.91	3.93

6	LG CHEM LTD	051910 KS	9,147,234.13	3.89
7	CNOOC LTD	883 HK	7,838,538.20	3.33
8	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	7,363,021.34	3.13
9	HUTCHISON WHAMPOA LTD	13 HK	7,199,373.79	3.06
10	KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	011780 KS	7,018,578.70	2.99
11	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	6,729,383.88	2.86
12	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	3331 HK	6,622,937.37	2.82
13	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	6,116,581.13	2.60
14	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	6,089,450.92	2.59
15	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	TTM US	5,817,904.77	2.47
16	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	SQM US	5,727,011.47	2.44
17	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	5,711,612.14	2.43

18	CHINA MOBILE LTD	941 HK	5,505,312.24	2.34
19	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	1212 HK	5,398,605.64	2.30
20	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	5,384,340.18	2.29

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	22,027,130.15	9.37
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	19,125,333.72	8.14
3	CNOOC LTD	883 HK	17,952,652.44	7.64
4	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	TTM US	13,836,156.76	5.89
5	LG CHEM LTD	051910 KS	12,468,138.14	5.30
6	AGRICULT URAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	12,020,572.85	5.11
7	ZIJIN	2899 HK	10,293,848.89	4.38

	MINING GROUP CO LTD-H			
8	HONAM PETROCHE MICAL CORP	011170 KS	9,556,178.25	4.07
9	HYUNDAI MOBIS	012330 KS	8,793,034.35	3.74
10	JIANGXI COPPER CO LTD-H	358 HK	8,263,302.01	3.52
11	KOREA KUMHO PETROCHE MICAL CO	011780 KS	8,119,574.24	3.45
12	CHINA PETROLEU M & CHEMICAL -H	386 HK	7,902,271.14	3.36
13	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	7,559,912.28	3.22
14	DOCTOR REDDY'S LAB-ADR	RDY US	7,295,508.83	3.10
15	RIO TINTO LTD	RIO AU	7,181,601.36	3.05
16	YINGLI GREEN ENERGY HOLD-ADR	YGE US	6,686,906.23	2.84
17	OZ MINERALS LTD	OZL AU	6,496,660.35	2.76
18	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	6,268,325.24	2.67
19	AMOREPA CIFIC	090430 KS	6,211,983.96	2.64

	CORP			
20	361 DEGREES INTERNATIONAL	1361 HK	6,028,271.01	2.56
21	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	5,703,395.65	2.43
22	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	2877 HK	5,668,938.24	2.41
23	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	5,651,977.97	2.40
24	CHINA MOBILE LTD	941 HK	5,624,696.10	2.39
25	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	5,591,384.85	2.38
26	APPLE INC	AAPL US	5,494,420.03	2.34
27	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	5,142,140.16	2.19
28	MACQUARIE GROUP LTD	MQG AU	5,084,538.81	2.16
29	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	4,733,304.45	2.01

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	375,679,480.89
卖出收入（成交）总额	449,805,766.98

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	权证	XIWAW1 HK	0.00	0.00

注：本基金报告期内持有 XIWAW1 HK 认股权证，取得成本为 0.00 元，由于报告期末行权价格高于西王糖业股票收盘价，权证估值价格为 0.00 元。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ISHARES MSCI MALAYSIA	ETF 基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基金顾问公司)	3,951,420.41	3.07
2	ISHARES HIGH DIVIDEND EQ FD	ETF 基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基金顾问公司)	2,447,899.65	1.90
3	ISHARES S&P INDIA NIFTY 50 I	ETF 基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基金顾问公司)	1,492,557.19	1.16
4	-	-	-	-	-	-

5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 本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。

8.11.3 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	应收证券清算款	2,184,580.95
3	应收股利	11,533.12
4	应收利息	1,989.56
5	应收申购款	13,515.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,211,619.34

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	持有份额	占总份额比

			比例		例
2,768	58,147.85	40,001,400.00	24.85%	120,951,858.27	75.15%

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	5,157,080.94	3.2041%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年8月18日)基金份额总额	540,598,089.38
本报告期期初基金份额总额	227,944,763.35
本报告期基金总申购份额	13,681,363.83
减：本报告期基金总赎回份额	80,672,868.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,953,258.27

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

本报告期内，基金管理人人事变动如下：

（一）董事长、法定代表人变更

因我司第三届董事会任期届满，原董事长马庆泉因年龄原因不再任职。2011年3月16日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，选举王志伟为广发基金管理有限公司董事长。在中国证监会核准王志伟的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。董事会授权公司副董事长、总经理林传辉在中国证监会核准拟任董事长的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项前，代为履行董事长职责。代为履行职责的时间

不得超过 90 日，法律、行政法规另有规定的除外。

2011 年 6 月 15 日，公司在指定信息披露媒体刊登了《基金行业高级管理人员变更公告》，披露因我司拟任董事长王志伟先生的高级管理人员任职资格尚处于报批阶段，在其高管任职资格获准前，继续由公司副董事长、总经理林传辉先生代为履行董事长职责。2011 年 7 月 19 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司王志伟基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1119 号）。中国证监会核准了王志伟的基金行业高级管理人员任职资格，并对王志伟任我司董事长无异议。自 2011 年 7 月 19 日起，王志伟正式履行董事长职务。

2011 年 8 月 5 日，我司完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任董事长王志伟。

（二）聘任副总经理

2011 年 3 月 16 日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，董事会新聘任易阳方担任我司副总经理。在中国证监会核准易阳方的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。

2011 年 8 月 11 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司易阳方基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1267 号），中国证监会核准了易阳方的基金行业高级管理人员任职资格，并对易阳方任公司副总经理无异议。

自 2011 年 8 月 11 日起，易阳方副总经理任职正式生效。

本报告期内，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

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。

11.4 基金投资策略的改变

本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

本报告期，本基金应支付德勤华永会计师事务所有限公司审计费 80,000.00 元。截至本报告期末，该事务所已为本基金提供审计服务 2 年。

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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	
United Bank of Switzerland	-	151,727,207.51	18.38%	230,133.32	17.88%	-
Morgan Stanley	-	96,690,407.50	11.71%	132,766.42	10.32%	-
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	-	82,585,094.19	10.00%	81,410.73	6.33%	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	67,046,059.86	8.12%	133,575.46	10.38%	新增
China International Capital Corporation Limited	-	59,124,780.91	7.16%	94,799.14	7.37%	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	41,159,808.34	4.99%	95,372.19	7.41%	-
KGI Asia Limited	-	35,511,433.99	4.30%	53,267.20	4.14%	-
Shinhan Investment	-	32,845,363.22	3.98%	55,836.55	4.34%	-

Corporation						
Samsung Securities Co., Ltd.	-	30,460,992.27	3.69%	60,921.80	4.73%	-
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	28,240,280.95	3.42%	42,360.42	3.29%	-
Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	28,166,939.30	3.41%	38,025.38	2.96%	-
Shenyin Wanguo Securities (H. K.) Limited	-	23,875,432.91	2.89%	35,813.17	2.78%	-
Daishin Securities Co., Ltd.	-	21,487,581.61	2.60%	38,677.48	3.01%	-
BOC International Securities	-	20,590,318.66	2.49%	30,885.49	2.40%	-
First Shanghai Securities Limited	-	19,896,342.78	2.41%	23,618.25	1.84%	新增
Deutsche Bank AG	-	18,129,029.85	2.20%	36,258.06	2.82%	-
China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	15,984,027.17	1.94%	26,431.15	2.05%	-
CIMB Securities (HK) Ltd.	-	11,935,694.22	1.45%	17,903.55	1.39%	-
BOCOM International Securities Limited	-	11,221,019.57	1.36%	14,961.06	1.16%	-
Daewoo Securities Co., Ltd.	-	9,830,024.38	1.19%	19,659.96	1.53%	-
CSC Capital Group	-	9,307,675.68	1.13%	9,307.67	0.72%	新增
Woori Investment and	-	5,327,544.74	0.65%	9,589.56	0.75%	-

Securities						
Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	3,176,276.88	0.38%	3,811.60	0.30%	-
Haitong International Securities Group Limited	-	842,792.45	0.10%	842.79	0.07%	-
Pingan of China Securities (Hong Kong)	-	340,765.96	0.04%	511.15	0.04%	-

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i.财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- ii.研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；
- iii.交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；
- iv.清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；
- v.能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；
- vi.经营行为规范，有健全的内部控制制度；
- vii.具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

- i.本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。
- ii.本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。
- iii.本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分，可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成交总额的比例

		交总 额的 比例		交总 额的 比例		交总 额的 比例		
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	14,437,658.92	24.56%
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	15,722,289.30	26.75%
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	7,162,500.00	12.18%
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	4,074,642.34	6.93%
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	13,645,082.62	23.21%
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	3,739,988.03	6.36%

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	广发基金管理有限公司关于增加财达证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-24
2	广发基金管理有限公司关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金暂停申购赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-24
3	广发基金管理有限公司关于增加哈尔滨银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-14
4	广发基金管理有限公司关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金 2011 年交易市场休市日暂停申购赎回的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-24
5	广发基金管理有限公司关于调整旗下基金通过中信建投证券定期定额投资申购起点	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证	2011-03-01

	金额的公告	券报》	
6	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销（含定期定额投资）申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
7	广发基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行作为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-03-17
8	广发基金管理有限公司关于增加红塔证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-03-17
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加东莞银行网上银行及定期定额方式申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
10	广发基金管理有限公司关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-06
12	广发基金管理有限公司关于增加国金证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-12
13	广发基金管理有限公司关于增加中天证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
14	广发基金管理有限公司关于增加浙江稠州商业银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
15	广发基金管理有限公司关于增加联讯证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-03
16	广发基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券推出定期定额投资等业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-11
17	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行推出定期定额投资业务并参加基金定期定额投资申购费率活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-06-20
18	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行推出定期定额投资业务的更正公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-06-21
19	广发基金管理有限公司关于增加北京农商银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-06-30
20	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金	《中国证券报》、《证	2011-06-30

	参加交通银行网上银行等电子渠道申购费率优惠活动的公告	券时报》、《上海证券报》	
21	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券非现场交易申购基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-01
22	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加浙商证券非现场委托基金申购的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-01
23	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券非现场交易基金申购费率优惠活动的补充公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-04
24	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加厦门证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-22
25	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券网上交易及手机证券交易基金申购（含定投）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-08
26	广发基金管理有限公司关于增加广州银行为旗下基金代销机构并实行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-12
27	广发基金管理有限公司关于增加南京银行为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-18
28	广发基金管理有限公司关于增加新时代证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-26
29	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销（含定期定额投资）申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-31
30	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-31
31	广发基金管理有限公司关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金暂停 2011 年 9 月 29 日申购赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-09-30
32	广发基金管理有限公司关于旗下基金增加河北银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-10-24
33	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华安证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-11-07
34	广发基金管理有限公司关于网上直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证	2011-11-14

		券报》	
35	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民族证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-12-05
36	广发基金管理有限公司关于旗下基金增加日信证券为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-12-06
37	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-12-20
38	广发基金管理有限公司关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金 2012 年交易市场休市日暂停申购赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-12-29

§ 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亚太（除日本）精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3.《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4.《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程；
- 6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值和其他临时公告。

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼。

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2.网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日