

广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

2012 年半年度报告

2012 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：二〇一二年八月二十七日

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 2012 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	13
6 半年度财务会计报告 (未经审计).....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46

7.9 投资组合报告附注.....	46
8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
9 开放式基金份额变动.....	48
10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	53
11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证500指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	广发中证500指数 (LOF)
场内基金简称	广发500
基金主代码	162711
交易代码	162711
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月26日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,372,185,709.58份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年1月8日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用被动式投资策略, 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段, 力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.35%, 年跟踪误差不超过4%, 实现对中证500指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 基金管理人会对投资组合进行适当调整, 降低跟踪误差。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证500指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。
风险收益特征	较高风险、较高预期收益, 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	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 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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 (2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-204,537,338.27
本期利润	135,810,157.42

加权平均基金份额本期利润	0.0307
本期加权平均净值利润率	3.84%
本期基金份额净值增长率	5.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-973,167,770.35
期末可供分配基金份额利润	-0.2226
期末基金资产净值	3,399,017,939.23
期末基金份额净值	0.777
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-22.30%

注：(1) 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。

(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）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.72%	1.16%	-7.15%	1.18%	0.43%	-0.02%
过去三个月	1.97%	1.14%	1.51%	1.16%	0.46%	-0.02%
过去六个月	5.14%	1.51%	5.96%	1.53%	-0.82%	-0.02%
过去一年	-23.52%	1.50%	-22.96%	1.53%	-0.56%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-22.30%	1.53%	-21.83%	1.60%	-0.47%	-0.07%

注：(1) 业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。

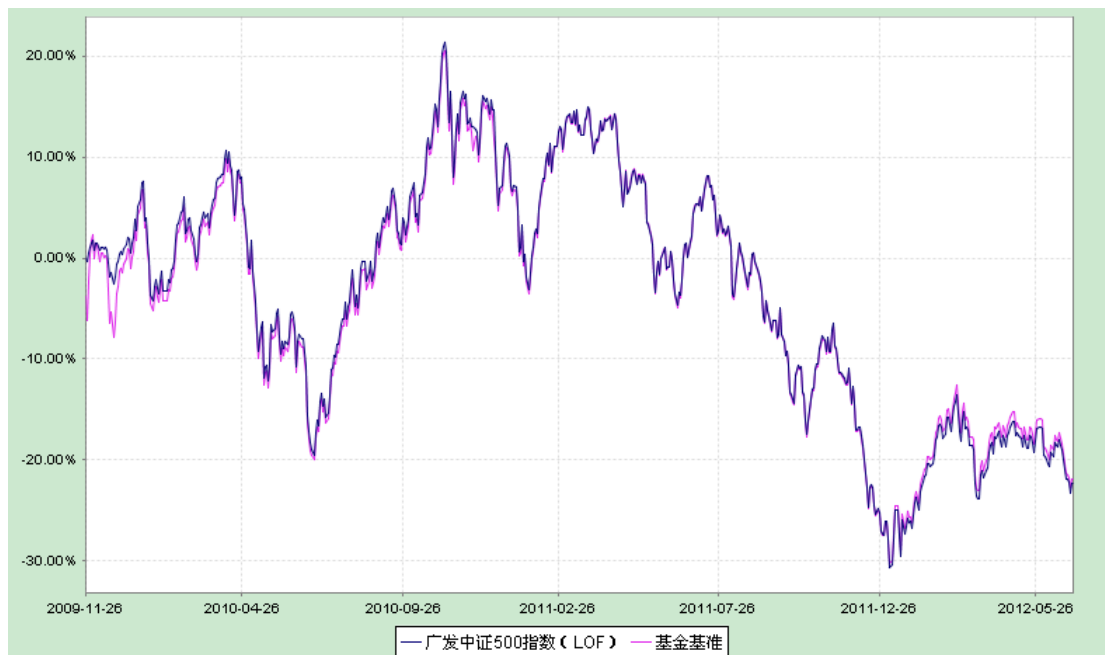
(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

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 11 月 26 日至 2012 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、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、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2012年6月30日，本基金管理人管理二十四只开放式基金——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、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金和广发消费品精选股票型证券投资基金, 管理资产规模为 1207.82 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		
陈盛业	本基金的基金经理; 广发中证 500 指数 (lof) 的基金经理	2010-12-01	-	5	男, 中国籍, 经济学博士, 持有证券业执业证书, 2007 年 3 月至 2009 年 9 月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管, 2009 年 9 月至 2010 年 8 月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理, 2010 年 8 月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作, 2010 年 12 月 1 日起任广发沪深 300 指数基金及广发中证 500 指数 (lof) 基金的基金经理。

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. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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、《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)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。监察稽核部风险控制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;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,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与其他投资组合发生的同日反向交易中,成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共有 12 次,原因是本投资组合调仓。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1) 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内, 本基金日均跟踪误差为 0.07%, 年化跟踪误差为 1.14%, 符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过 0.35% 和年跟踪误差不超过 4% 的要求。

报告期内, 本基金跟踪误差来源主要有两个: 一是基金成份股调整因素, 本基金结合标的指数成份股调整面积较大的实际情况, 分批对成份股进行调整, 较好的控制了成份股调整的冲击成本; 二是申购和赎回因素, 本基金规模较大, 申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2) 简要展望

作为指数基金, 本基金将继续秉承指数化被动投资策略, 积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击, 进一步降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 5.14%, 业绩比较基准收益率为 5.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

通过前期的下跌, 中证 500 指数成份股释放了部分高估值的风险, 但随着中报的逐渐披露, 可能还会存在盈利下调的风险。中央已经意识中国经济的明显下滑, 因此我们可以预期经济政策将逐步放松, 而且经济结构转型的大方向仍然不会动摇, 以中证 500 指数成份股为代表的中小股票可以长期看好。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,本基金本期末可供分配利润为-973,167,770.35 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

2012 年上半年,本基金托管人在对广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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

2012 年上半年,广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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,广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 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: 广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	120,673,519.79	178,465,857.09
结算备付金		567,998.96	7,693,630.53
存出保证金		1,675,701.00	1,381,355.05
交易性金融资产	6.4.7.2	3,275,418,478.17	2,715,335,617.35
其中: 股票投资		3,129,978,478.17	2,715,335,617.35
基金投资		-	-
债券投资		145,440,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,880,266.09	38,391.66
应收股利		315,716.00	-
应收申购款		1,927,631.14	1,388,836.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,403,459,311.15	2,904,303,687.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	27,961,619.88
应付赎回款		1,087,714.07	1,591,348.62
应付管理人报酬		1,725,092.96	1,582,257.81
应付托管费		431,273.23	395,564.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	974,246.02	473,696.33
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	223,045.64	283,411.14
负债合计		4,441,371.92	32,287,898.24
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,372,185,709.58	3,885,836,712.17
未分配利润	6.4.7.10	-973,167,770.35	-1,013,820,922.67
所有者权益合计		3,399,017,939.23	2,872,015,789.50
负债和所有者权益总计		3,403,459,311.15	2,904,303,687.74

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.777 元，基金份额总额 4,372,185,709.58 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		152,244,684.67	-264,752,795.85
1.利息收入		2,235,608.73	1,011,712.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	584,089.10	788,423.17
债券利息收入		1,477,827.87	2,172.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		173,691.76	221,117.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-191,228,834.45	83,647,613.79

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-209,067,189.07	69,375,082.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	406,344.03
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	17,838,354.62	13,866,187.18
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	340,347,495.69	-351,448,637.88
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	890,414.70	2,036,515.34
减：二、费用		16,434,527.25	19,292,189.24
1. 管理人报酬		10,493,053.04	11,489,112.49
2. 托管费		2,623,263.27	2,872,278.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,092,885.96	4,731,158.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	225,324.98	199,640.59
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		135,810,157.42	-284,044,985.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		135,810,157.42	-284,044,985.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	3,885,836,712.17	-1,013,820,922.67	2,872,015,789.50
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本期利 润）	-	135,810,157.42	135,810,157.42
三、本期基金份额交易产	486,348,997.41	-95,157,005.10	391,191,992.31

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	1,425,751,516.06	-265,515,162.37	1,160,236,353.69
2. 基金赎回款	-939,402,518.65	170,358,157.27	-769,044,361.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	4,372,185,709.58	-973,167,770.35	3,399,017,939.23
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	3,418,670,771.06	324,863,183.48	3,743,533,954.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-284,044,985.09	-284,044,985.09
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)	49,141,782.74	13,174,045.09	62,315,827.83
其中: 1. 基金申购款	1,745,448,824.23	118,104,555.01	1,863,553,379.24
2. 基金赎回款	-1,696,307,041.49	-104,930,509.92	-1,801,237,551.41
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)	3,467,812,553.80	53,992,243.48	3,521,804,797.28

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: 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 指数证券投资基金 (“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (“中国证监会”) 证监许可 [2009] 982 号文核准, 由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民

《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《广发中证 500 指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2009 年 11 月 26 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,并于 2009 年 11 月 26 日获确认。

本基金募集期为 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 20 日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币 8,635,797,223.98 元,有效认购户数为 107,956 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 634,322.52 元,折合基金份额 634,322.52 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 2009 年 11 月 26 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,635,797,223.98 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》等有关规定和基金合同的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、到期日在一年以内的政府债券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准采用:95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率。

本基金的财务报表于 2012 年 8 月 24 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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的说明

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 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估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关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，股权的股息、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、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，上市公司在代扣代缴时，减按 50% 计算应纳税所得额。
- 4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5、对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。
- 6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	120,673,519.79
定期存款	-
其他存款	-
合计	120,673,519.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,801,654,365.66	3,129,978,478.17	-671,675,887.49
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	145,022,250.00	145,440,000.00	417,750.00
	合计	145,022,250.00	145,440,000.00	417,750.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,946,676,615.66	3,275,418,478.17	-671,258,137.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	21,060.64
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	230.04
应收债券利息	2,858,975.41
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,880,266.09

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	974,246.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	974,246.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,038.42
预提费用	220,007.22
合计	223,045.64

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,885,836,712.17	3,885,836,712.17
本期申购	1,425,751,516.06	1,425,751,516.06
本期赎回 (以“-”号填列)	-939,402,518.65	-939,402,518.65
本期末	4,372,185,709.58	4,372,185,709.58

注：本基金申购含转换转入份 (金) 额，赎回含转换转出份 (金) 额。

6.4.7.10 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	408,942,172.01	-1,422,763,094.68	-1,013,820,922.67
本期利润	-204,537,338.27	340,347,495.69	135,810,157.42
本期基金份额交易产生的变动数	36,398,025.15	-131,555,030.25	-95,157,005.10
其中：基金申购款	96,725,459.03	-362,240,621.40	-265,515,162.37
基金赎回款	-60,327,433.88	230,685,591.15	170,358,157.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	240,802,858.89	-1,213,970,629.24	-973,167,770.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	535,975.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	32,729.63
其他	15,384.10
合计	584,089.10

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	952,686,032.42
减：卖出股票成本总额	1,161,753,221.49
买卖股票差价收入	-209,067,189.07

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,838,354.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,838,354.62

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	340,347,495.69
——股票投资	339,929,745.69
——债券投资	417,750.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	340,347,495.69

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	889,584.18
手续费返还	-
基金转换费收入	830.52
印花税返还	-
其他	-
合计	890,414.70

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	3,092,360.96
银行间市场交易费用	525.00
合计	3,092,885.96

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	3,817.76
账户维护费	6,000.00
上市费	26,545.72
合计	225,324.98

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

2012年8月1日，广发基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议决议，将公司旗下基金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天健会计师事务所(特殊普通合伙)。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	321,715,895.42	15.01%	440,660,443.11	13.89%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	764,451.00	49.68%

6.4.10.1.4 债券回购交易

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 2012年1月1日至2012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	269,461.37	15.68%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	374,563.07	14.56%	-	-

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

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；

3：本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,493,053.04	11,489,112.49
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,668,326.91	3,272,852.03

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60 %的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	2,623,263.27	2,872,278.10

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	100,006,000.06	100,006,000.06
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	100,006,000.06	100,006,000.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.29%	2.88%

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

本报告期末及上年度末无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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011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	120,673,519.79	535,975.37	85,178,955.03	754,918.61

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保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

000767	*ST 漳电	2012-06-01	重大 事项	3.72	2012-07-27	3.90	1,338,740	5,353,328.89	4,980,112.80	-
600499	科达机电	2012-06-20	重大 事项	10.28	2012-07-02	10.11	1,028,554	15,916,926.48	10,573,535.12	-
600780	通宝能源	2012-01-18	重大 事项	6.70	-	-	858,170	5,530,990.40	5,749,739.00	-

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 2012 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息,或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降,将对基金资

产造成的损失。为了防范信用风险,本基金主要投资于信用等级较高的证券,且通过分散化投资以分散信用风险,本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。但是,随着短期资金市场的发展,本基金的投资范围扩大以后,可能会在一定程度上增加信用风险。

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

本基金本报告期末未持有除央行票据以外的债券,因此与债券相关的信用风险不重大。本基金上年度末未持有债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012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	120,673,519.79	-	-	-	120,673,519.79
结算备付金	567,998.96	-	-	-	567,998.96

存出保证金	-	-	-	1,675,701.00	1,675,701.00
交易性金融资产	145,440,000.00	-	-	3,129,978,478.17	3,275,418,478.17
应收利息	-	-	-	2,880,266.09	2,880,266.09
应收申购款	-	-	-	1,927,631.14	1,927,631.14
资产总计	266,681,518.75	-	-	3,136,462,076.40	3,403,143,595.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,087,714.07	1,087,714.07
应付管理人报酬	-	-	-	1,725,092.96	1,725,092.96
应付托管费	-	-	-	431,273.23	431,273.23
应付交易费用	-	-	-	974,246.02	974,246.02
其他负债	-	-	-	223,045.64	223,045.64
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	4,441,371.92	4,441,371.92
利率敏感度缺口	266,681,518.75	-	-	3,132,020,704.48	3,398,702,223.23
上年度末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	178,465,857.09	-	-	-	178,465,857.09
结算备付金	7,693,630.53	-	-	-	7,693,630.53
存出保证金	-	-	-	1,381,355.05	1,381,355.05
交易性金融资产	-	-	-	2,715,335,617.35	2,715,335,617.35
应收利息	-	-	-	38,391.66	38,391.66
应收申购款	1,388,836.06	-	-	-	1,388,836.06
资产总计	187,548,323.68	-	-	2,716,755,364.06	2,904,303,687.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,591,348.62	1,591,348.62

应付管理人报酬	-	-	-	1,582,257.81	1,582,257.81
应付托管费	-	-	-	395,564.46	395,564.46
应付交易费用	-	-	-	473,696.33	473,696.33
其他负债	-	-	-	283,411.14	283,411.14
应付证券清算款	-	-	-	27,961,619.88	27,961,619.88
负债总计	-	-	-	32,287,898.24	32,287,898.24
利率敏感度缺口	187,548,323.68	-	-	2,684,467,465.82	2,872,015,789.50

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变动且其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	市场利率上升25个基点	-157,921.39	-
	市场利率下降25个基点	158,265.17	-

注：本基金上年度末未持有债券投资，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 2012年6月30日		上年度末 2011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	3,129,978,478.17	92.08	2,715,335,617.35	94.54
交易性金融资产-债券投资	145,440,000.00	4.28	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,275,418,478.17	96.36	2,715,335,617.35	94.54

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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	168,861,635.33	143,724,854.56
	业绩比较基准下降 5%	-168,861,635.33	-143,724,854.56

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	3,129,978,478.17	91.96
	其中: 股票	3,129,978,478.17	91.96
2	固定收益投资	145,440,000.00	4.27
	其中: 债券	145,440,000.00	4.27
	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	121,241,518.75	3.56
6	其他各项资产	6,799,314.23	0.20

7	合计	3,403,459,311.15	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	56,314,059.14	1.66
B	采掘业	50,881,028.45	1.50
C	制造业	1,800,645,226.05	52.98
C0	食品、饮料	183,834,878.63	5.41
C1	纺织、服装、皮毛	110,482,736.16	3.25
C2	木材、家具	13,970,842.81	0.41
C3	造纸、印刷	56,155,011.82	1.65
C4	石油、化学、塑胶、塑料	286,684,536.62	8.43
C5	电子	255,490,491.66	7.52
C6	金属、非金属	191,870,192.38	5.64
C7	机械、设备、仪表	418,047,800.18	12.30
C8	医药、生物制品	251,949,290.18	7.41
C99	其他制造业	32,159,445.61	0.95
D	电力、煤气及水的生产和供应业	136,273,778.50	4.01
E	建筑业	62,508,551.10	1.84
F	交通运输、仓储业	136,928,385.61	4.03
G	信息技术业	144,085,685.21	4.24
H	批发和零售贸易	206,790,514.29	6.08
I	金融、保险业	30,976,736.27	0.91
J	房地产业	229,740,888.48	6.76
K	社会服务业	116,450,573.76	3.43
L	传播与文化产业	71,652,214.67	2.11
M	综合类	86,730,836.64	2.55
	合计	3,129,978,478.17	92.08

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	000970	中科三环	866,785	34,394,028.80	1.01
2	000963	华东医药	835,168	25,222,073.60	0.74
3	002029	七匹狼	834,642	23,203,047.60	0.68

4	600079	人福医药	952,132	22,079,941.08	0.65
5	000799	酒鬼酒	396,584	20,781,001.60	0.61
6	600199	金种子酒	791,422	19,769,721.56	0.58
7	000522	白云山 A	935,048	19,018,876.32	0.56
8	600060	海信电器	1,054,502	17,726,178.62	0.52
9	600827	友谊股份	1,560,358	17,647,648.98	0.52
10	002236	大华股份	567,696	17,428,267.20	0.51
11	600702	沱牌舍得	480,276	17,410,005.00	0.51
12	000917	电广传媒	661,522	16,359,439.06	0.48
13	600300	维维股份	1,700,581	16,121,507.88	0.47
14	600478	科力远	573,076	15,857,012.92	0.47
15	600138	中青旅	840,108	15,105,141.84	0.44
16	002065	东华软件	644,151	14,300,152.20	0.42
17	000826	桑德环境	607,955	13,922,169.50	0.41
18	600643	爱建股份	1,668,900	13,768,425.00	0.41
19	000939	凯迪电力	1,535,121	13,017,826.08	0.38
20	000793	华闻传媒	2,069,494	12,789,472.92	0.38
21	600436	片仔癀	142,440	12,519,051.60	0.37
22	002051	中工国际	466,200	12,382,272.00	0.36
23	600141	兴发集团	594,791	12,306,225.79	0.36
24	000877	天山股份	1,253,232	12,219,012.00	0.36
25	600570	恒生电子	888,216	12,186,323.52	0.36
26	000998	隆平高科	676,853	12,068,288.99	0.36
27	600637	百视通	906,253	11,871,914.30	0.35
28	000540	中天城投	1,561,272	11,522,187.36	0.34
29	000539	粤电力 A	1,734,830	11,449,878.00	0.34
30	600325	华发股份	1,329,616	11,328,328.32	0.33
31	600601	方正科技	4,464,941	11,207,001.91	0.33
32	600059	古越龙山	774,907	11,057,922.89	0.33
33	002250	联化科技	629,850	10,864,912.50	0.32
34	601566	九牧王	389,619	10,850,889.15	0.32
35	600311	荣华实业	1,353,934	10,831,472.00	0.32
36	000926	福星股份	1,159,260	10,827,488.40	0.32
37	000690	宝新能源	2,458,672	10,793,570.08	0.32
38	600805	悦达投资	1,153,909	10,765,970.97	0.32
39	600717	天津港	1,703,400	10,765,488.00	0.32
40	600816	安信信托	646,605	10,746,575.10	0.32
41	600366	宁波韵升	512,800	10,645,728.00	0.31
42	600499	科达机电	1,028,554	10,573,535.12	0.31
43	600158	中体产业	1,373,037	10,531,193.79	0.31
44	600844	丹化科技	832,795	10,418,265.45	0.31

45	600072	中船股份	583,926	10,370,525.76	0.31
46	600675	中华企业	2,215,537	10,368,713.16	0.31
47	000759	中百集团	1,385,280	10,306,483.20	0.30
48	002477	雏鹰农牧	543,122	10,237,849.70	0.30
49	600594	益佰制药	513,741	10,172,071.80	0.30
50	600747	大连控股	2,165,058	10,110,820.86	0.30
51	600022	山东钢铁	3,927,859	10,094,597.63	0.30
52	600239	云南城投	1,172,475	9,954,312.75	0.29
53	000650	仁和药业	1,153,822	9,899,792.76	0.29
54	002154	报喜鸟	724,827	9,879,392.01	0.29
55	600157	永泰能源	1,078,696	9,794,559.68	0.29
56	600522	中天科技	1,146,467	9,779,363.51	0.29
57	000762	西藏矿业	677,772	9,705,695.04	0.29
58	000400	许继电气	615,634	9,646,984.78	0.28
59	600210	紫江企业	2,338,125	9,633,075.00	0.28
60	600750	江中药业	343,376	9,583,624.16	0.28
61	000518	四环生物	2,142,051	9,553,547.46	0.28
62	000816	江淮动力	1,771,923	9,479,788.05	0.28
63	600755	厦门国贸	1,895,007	9,475,035.00	0.28
64	002008	大族激光	1,487,148	9,339,289.44	0.27
65	600067	冠城大通	1,675,726	9,333,793.82	0.27
66	002123	荣信股份	820,197	9,325,639.89	0.27
67	600820	隧道股份	1,044,455	9,295,649.50	0.27
68	000541	佛山照明	1,072,691	9,257,323.33	0.27
69	601588	北辰实业	3,246,688	9,253,060.80	0.27
70	600458	时代新材	736,663	9,245,120.65	0.27
71	002005	德豪润达	1,186,348	9,229,787.44	0.27
72	600787	中储股份	1,025,405	9,105,596.40	0.27
73	600110	中科英华	2,339,983	9,079,134.04	0.27
74	000550	江铃汽车	422,503	9,020,439.05	0.27
75	600880	博瑞传播	894,500	8,918,165.00	0.26
76	600616	金枫酒业	624,668	8,901,519.00	0.26
77	600269	赣粤高速	2,375,365	8,883,865.10	0.26
78	000616	亿城股份	2,424,561	8,873,893.26	0.26
79	600651	飞乐音响	1,252,912	8,845,558.72	0.26
80	600557	康缘药业	597,264	8,827,561.92	0.26
81	000683	远兴能源	1,561,927	8,824,887.55	0.26
82	600220	江苏阳光	2,902,229	8,793,753.87	0.26
83	600858	银座股份	740,589	8,724,138.42	0.26
84	002022	科华生物	801,110	8,692,043.50	0.26
85	600517	置信电气	755,136	8,661,409.92	0.25

86	600653	申华控股	3,552,524	8,632,633.32	0.25
87	600867	通化东宝	1,105,252	8,609,913.08	0.25
88	600388	龙净环保	347,954	8,608,381.96	0.25
89	000735	罗牛山	1,780,323	8,598,960.09	0.25
90	000860	顺鑫农业	535,220	8,574,224.40	0.25
91	000503	海虹控股	1,462,782	8,498,763.42	0.25
92	000028	国药一致	284,656	8,477,055.68	0.25
93	600112	长征电气	725,027	8,461,065.09	0.25
94	600064	南京高科	735,022	8,452,753.00	0.25
95	600240	华业地产	934,521	8,391,998.58	0.25
96	600351	亚宝药业	1,287,556	8,381,989.56	0.25
97	000031	中粮地产	1,844,765	8,375,233.10	0.25
98	600122	宏图高科	1,843,431	8,369,176.74	0.25
99	600704	物产中大	938,060	8,358,114.60	0.25
100	600584	长电科技	1,735,416	8,329,996.80	0.25
101	600872	中炬高新	1,620,573	8,297,333.76	0.24
102	600521	华海药业	547,859	8,278,149.49	0.24
103	600298	安琪酵母	335,279	8,251,216.19	0.24
104	000652	泰达股份	2,101,141	8,215,461.31	0.24
105	600511	国药股份	584,438	8,182,132.00	0.24
106	000407	胜利股份	1,320,689	8,175,064.91	0.24
107	000900	现代投资	568,346	8,093,247.04	0.24
108	600720	祁连山	772,812	8,091,341.64	0.24
109	600797	浙大网新	1,712,824	8,067,401.04	0.24
110	000006	深振业 A	1,408,339	8,041,615.69	0.24
111	000636	风华高科	1,085,780	8,034,772.00	0.24
112	000850	华茂股份	1,177,996	8,010,372.80	0.24
113	000417	合肥百货	634,603	7,964,267.65	0.23
114	600597	光明乳业	853,715	7,956,623.80	0.23
115	000612	焦作万方	683,715	7,937,931.15	0.23
116	000488	晨鸣纸业	1,811,733	7,917,273.21	0.23
117	000667	名流置业	3,644,742	7,872,642.72	0.23
118	000848	承德露露	445,476	7,818,103.80	0.23
119	600326	西藏天路	779,162	7,776,036.76	0.23
120	600978	宜华木业	1,641,341	7,763,542.93	0.23
121	600586	金晶科技	1,736,463	7,727,260.35	0.23
122	000501	鄂武商 A	515,890	7,676,443.20	0.23
123	600575	芜湖港	990,788	7,668,699.12	0.23
124	000598	兴蓉投资	938,617	7,649,728.55	0.23
125	000930	中粮生化	1,569,442	7,627,488.12	0.22
126	600410	华胜天成	928,049	7,610,001.80	0.22

127	600572	康恩贝	715,603	7,606,859.89	0.22
128	002129	中环股份	589,307	7,572,594.95	0.22
129	000786	北新建材	584,984	7,569,692.96	0.22
130	000726	鲁泰 A	1,042,504	7,547,728.96	0.22
131	000897	津滨发展	2,631,931	7,527,322.66	0.22
132	600815	厦工股份	812,645	7,516,966.25	0.22
133	000988	华工科技	543,766	7,487,657.82	0.22
134	000571	新大洲 A	1,497,371	7,441,933.87	0.22
135	600525	长园集团	1,053,914	7,440,632.84	0.22
136	002408	齐翔腾达	456,174	7,417,389.24	0.22
137	000594	国恒铁路	3,021,529	7,402,746.05	0.22
138	000997	新大陆	726,620	7,375,193.00	0.22
139	000975	科学城	887,290	7,364,507.00	0.22
140	002097	山河智能	847,136	7,353,140.48	0.22
141	600236	桂冠电力	1,855,574	7,348,073.04	0.22
142	600736	苏州高新	1,291,239	7,308,412.74	0.22
143	000078	海王生物	1,061,842	7,294,854.54	0.21
144	600439	瑞贝卡	1,343,234	7,280,328.28	0.21
145	002011	盾安环境	681,814	7,261,319.10	0.21
146	000601	韶能股份	1,882,789	7,192,253.98	0.21
147	000962	东方铝业	537,973	7,187,319.28	0.21
148	600021	上海电力	1,305,845	7,182,147.50	0.21
149	600426	华鲁恒升	970,000	7,168,300.00	0.21
150	600835	上海机电	820,320	7,161,393.60	0.21
151	000627	天茂集团	2,202,832	7,159,204.00	0.21
152	001696	宗申动力	1,206,798	7,144,244.16	0.21
153	000511	银基发展	1,879,366	7,141,590.80	0.21
154	000927	一汽夏利	973,506	7,135,798.98	0.21
155	000426	兴业矿业	534,515	7,135,775.25	0.21
156	600017	日照港	2,560,715	7,067,573.40	0.21
157	600491	龙元建设	1,156,508	7,008,438.48	0.21
158	002140	东华科技	362,866	6,985,170.50	0.21
159	600993	马应龙	404,693	6,980,954.25	0.21
160	600176	中国玻纤	709,965	6,978,955.95	0.21
161	600884	杉杉股份	585,082	6,956,624.98	0.20
162	000973	佛塑科技	1,495,176	6,952,568.40	0.20
163	600069	银鸽投资	1,175,328	6,934,435.20	0.20
164	600654	飞乐股份	1,535,923	6,927,012.73	0.20
165	600425	青松建化	584,280	6,912,032.40	0.20
166	600251	冠农股份	368,249	6,897,303.77	0.20
167	600724	宁波富达	882,040	6,862,271.20	0.20

168	600596	新安股份	1,105,250	6,841,497.50	0.20
169	000655	金岭矿业	605,489	6,799,641.47	0.20
170	600195	中牧股份	396,656	6,766,951.36	0.20
171	000830	鲁西化工	1,489,950	6,764,373.00	0.20
172	600851	海欣股份	1,201,395	6,739,825.95	0.20
173	600330	天通股份	958,180	6,736,005.40	0.20
174	002233	塔牌集团	727,997	6,726,692.28	0.20
175	600531	豫光金铅	360,295	6,694,281.10	0.20
176	600611	大众交通	1,272,082	6,665,709.68	0.20
177	002056	横店东磁	417,954	6,653,827.68	0.20
178	002277	友阿股份	426,243	6,653,653.23	0.20
179	600078	澄星股份	808,646	6,622,810.74	0.19
180	600033	福建高速	2,791,410	6,587,727.60	0.19
181	000682	东方电子	1,989,846	6,586,390.26	0.19
182	600790	轻纺城	1,006,954	6,585,479.16	0.19
183	002475	立讯精密	222,720	6,581,376.00	0.19
184	600685	广船国际	445,920	6,577,320.00	0.19
185	600409	三友化工	1,003,739	6,554,415.67	0.19
186	600496	精工钢构	835,277	6,473,396.75	0.19
187	000563	陕国投 A	470,629	6,461,736.17	0.19
188	000088	盐田港	1,580,371	6,447,913.68	0.19
189	600831	广电网络	802,285	6,442,348.55	0.19
190	600171	上海贝岭	1,096,561	6,425,847.46	0.19
191	600322	天房发展	1,799,441	6,424,004.37	0.19
192	002223	鱼跃医疗	432,502	6,422,654.70	0.19
193	600004	白云机场	935,745	6,372,423.45	0.19
194	000861	海印股份	400,505	6,368,029.50	0.19
195	600509	天富热电	800,272	6,338,154.24	0.19
196	600545	新疆城建	1,099,760	6,312,622.40	0.19
197	002048	宁波华翔	900,258	6,310,808.58	0.19
198	600761	安徽合力	731,919	6,309,141.78	0.19
199	002254	泰和新材	557,533	6,294,547.57	0.19
200	600198	大唐电信	625,043	6,294,183.01	0.19
201	000510	金路集团	1,239,183	6,270,265.98	0.18
202	600261	阳光照明	525,098	6,248,666.20	0.18
203	002340	格林美	468,964	6,241,910.84	0.18
204	000513	丽珠集团	224,260	6,232,185.40	0.18
205	600197	伊力特	448,494	6,229,581.66	0.18
206	000659	珠海中富	1,830,846	6,188,259.48	0.18
207	600801	华新水泥	494,146	6,186,707.92	0.18
208	600139	西部资源	673,183	6,186,551.77	0.18

209	601880	大连港	2,052,544	6,137,106.56	0.18
210	600765	中航重机	791,353	6,101,331.63	0.18
211	002410	广联达	247,128	6,064,521.12	0.18
212	000537	广宇发展	834,361	5,999,055.59	0.18
213	002430	杭氧股份	495,566	5,991,392.94	0.18
214	002041	登海种业	286,397	5,954,193.63	0.18
215	600332	广州药业	259,689	5,952,071.88	0.18
216	002028	思源电气	536,617	5,951,082.53	0.18
217	600308	华泰股份	1,662,587	5,935,435.59	0.17
218	600435	北方导航	757,393	5,930,387.19	0.17
219	600628	新世界	865,444	5,928,291.40	0.17
220	600773	西藏城投	468,453	5,921,245.92	0.17
221	600292	九龙电力	445,134	5,902,476.84	0.17
222	000989	九芝堂	363,245	5,884,569.00	0.17
223	600284	浦东建设	806,198	5,869,121.44	0.17
224	002025	航天电器	402,801	5,860,754.55	0.17
225	000717	韶钢松山	2,377,314	5,824,419.30	0.17
226	600227	赤天化	1,546,658	5,799,967.50	0.17
227	002393	力生制药	185,548	5,764,976.36	0.17
228	600963	岳阳林纸	1,372,135	5,762,967.00	0.17
229	600387	海越股份	628,354	5,755,722.64	0.17
230	600416	湘电股份	866,414	5,752,988.96	0.17
231	600289	亿阳信通	939,888	5,752,114.56	0.17
232	600780	通宝能源	858,170	5,749,739.00	0.17
233	600754	锦江股份	363,887	5,749,414.60	0.17
234	002168	深圳惠程	616,059	5,717,027.52	0.17
235	000712	锦龙股份	433,698	5,707,465.68	0.17
236	000886	海南高速	1,645,881	5,694,748.26	0.17
237	600087	*ST 长油	3,452,291	5,661,757.24	0.17
238	600086	东方金钰	429,900	5,657,484.00	0.17
239	002470	金正大	425,031	5,627,410.44	0.17
240	000089	深圳机场	1,375,386	5,625,328.74	0.17
241	600723	首商股份	669,679	5,625,303.60	0.17
242	600103	青山纸业	1,728,068	5,616,221.00	0.17
243	600888	新疆众和	543,445	5,613,786.85	0.17
244	600580	卧龙电气	1,119,145	5,606,916.45	0.16
245	600482	风帆股份	656,447	5,599,492.91	0.16
246	600662	强生控股	1,285,699	5,579,933.66	0.16
247	002428	云南锗业	265,745	5,562,042.85	0.16
248	600056	中国医药	252,963	5,552,537.85	0.16
249	000852	江钻股份	325,721	5,520,970.95	0.16

250	600038	哈飞股份	330,362	5,513,741.78	0.16
251	000777	中核科技	260,013	5,457,672.87	0.16
252	002482	广田股份	312,437	5,452,025.65	0.16
253	600323	南海发展	794,056	5,447,224.16	0.16
254	600830	香溢融通	646,885	5,446,771.70	0.16
255	600449	宁夏建材	583,720	5,440,270.40	0.16
256	600329	中新药业	438,819	5,436,967.41	0.16
257	000099	中信海直	626,857	5,434,850.19	0.16
258	000931	中关村	960,949	5,429,361.85	0.16
259	002249	大洋电机	582,641	5,418,561.30	0.16
260	600106	重庆路桥	1,477,246	5,406,720.36	0.16
261	000525	红太阳	412,696	5,406,317.60	0.16
262	000159	国际实业	683,596	5,400,408.40	0.16
263	600995	文山电力	778,702	5,388,617.84	0.16
264	002237	恒邦股份	138,108	5,383,449.84	0.16
265	000996	中国中期	357,176	5,339,781.20	0.16
266	000685	中山公用	365,518	5,332,907.62	0.16
267	600707	彩虹股份	899,258	5,323,607.36	0.16
268	000066	长城电脑	1,346,260	5,304,264.40	0.16
269	600748	上实发展	881,573	5,298,253.73	0.16
270	600961	株冶集团	536,462	5,278,786.08	0.16
271	600533	栖霞建设	1,281,538	5,267,121.18	0.15
272	600467	好当家	740,681	5,258,835.10	0.15
273	002479	富春环保	348,275	5,251,987.00	0.15
274	600270	外运发展	736,722	5,245,460.64	0.15
275	002292	奥飞动漫	249,991	5,234,811.54	0.15
276	000822	山东海化	1,092,474	5,222,025.72	0.15
277	600163	福建南纸	1,027,296	5,218,663.68	0.15
278	002332	仙琚制药	416,698	5,208,725.00	0.15
279	600408	安泰集团	1,433,647	5,204,138.61	0.15
280	000751	*ST 锌业	1,580,766	5,200,720.14	0.15
281	002191	劲嘉股份	522,401	5,182,217.92	0.15
282	000090	深天健	715,225	5,171,076.75	0.15
283	000301	东方市场	1,734,714	5,169,447.72	0.15
284	600479	千金药业	433,933	5,163,802.70	0.15
285	600622	嘉宝集团	836,907	5,146,978.05	0.15
286	000887	中鼎股份	605,906	5,144,141.94	0.15
287	002083	孚日股份	1,145,463	5,143,128.87	0.15
288	002308	威创股份	521,885	5,140,567.25	0.15
289	600127	金健米业	1,107,593	5,139,231.52	0.15
290	600581	八一钢铁	779,556	5,137,274.04	0.15

291	600006	东风汽车	1,627,398	5,126,303.70	0.15
292	002230	科大讯飞	258,167	5,085,889.90	0.15
293	600825	新华传媒	850,242	5,050,437.48	0.15
294	600117	西宁特钢	904,659	5,047,997.22	0.15
295	000410	沈阳机床	665,777	5,039,931.89	0.15
296	600121	郑州煤电	639,910	5,016,894.40	0.15
297	600824	益民集团	1,036,201	5,015,212.84	0.15
298	000767	*ST 漳电	1,338,740	4,980,112.80	0.15
299	600373	中文传媒	346,107	4,970,096.52	0.15
300	600529	山东药玻	523,541	4,952,697.86	0.15
301	600846	同济科技	1,016,700	4,910,661.00	0.14
302	600295	鄂尔多斯	497,975	4,910,033.50	0.14
303	002429	兆驰股份	432,482	4,887,046.60	0.14
304	600589	广东榕泰	856,799	4,875,186.31	0.14
305	600487	亨通光电	252,721	4,857,297.62	0.14
306	600874	创业环保	884,655	4,830,216.30	0.14
307	000987	广州友谊	365,116	4,826,833.52	0.14
308	000755	山西三维	668,251	4,804,724.69	0.14
309	002424	贵州百灵	287,009	4,795,920.39	0.14
310	002309	中利科技	488,782	4,760,736.68	0.14
311	600866	星湖科技	895,734	4,747,390.20	0.14
312	600420	现代制药	349,204	4,742,190.32	0.14
313	600869	三普药业	201,316	4,720,860.20	0.14
314	002078	太阳纸业	817,574	4,717,401.98	0.14
315	002181	粤传媒	498,555	4,711,344.75	0.14
316	000698	沈阳化工	941,103	4,696,103.97	0.14
317	000608	阳光股份	915,257	4,695,268.41	0.14
318	600510	黑牡丹	647,253	4,692,584.25	0.14
319	600569	安阳钢铁	1,936,715	4,686,850.30	0.14
320	600339	天利高新	823,286	4,684,497.34	0.14
321	600468	百利电气	371,184	4,643,511.84	0.14
322	000912	泸天化	594,987	4,623,048.99	0.14
323	600268	国电南自	516,912	4,616,024.16	0.14
324	600107	美尔雅	585,801	4,610,253.87	0.14
325	002465	海格通信	202,904	4,585,630.40	0.13
326	000979	中弘股份	617,690	4,570,906.00	0.13
327	601000	唐山港	688,383	4,570,863.12	0.13
328	601107	四川成渝	1,319,843	4,566,656.78	0.13
329	600246	万通地产	1,237,616	4,554,426.88	0.13
330	600602	仪电电子	1,073,543	4,530,351.46	0.13
331	002440	闰土股份	311,978	4,529,920.56	0.13

332	600673	东阳光铝	504,928	4,519,105.60	0.13
333	002179	中航光电	326,792	4,483,586.24	0.13
334	000554	泰山石油	782,448	4,483,427.04	0.13
335	601010	文峰股份	300,705	4,471,483.35	0.13
336	002601	佰利联	57,042	4,454,980.20	0.13
337	600590	泰豪科技	648,389	4,428,496.87	0.13
338	000837	秦川发展	642,012	4,417,042.56	0.13
339	000543	皖能电力	628,952	4,408,953.52	0.13
340	002342	巨力索具	585,801	4,393,507.50	0.13
341	600438	通威股份	699,224	4,391,126.72	0.13
342	002306	湘鄂情	406,848	4,373,616.00	0.13
343	600360	华微电子	1,103,423	4,347,486.62	0.13
344	600073	上海梅林	608,592	4,327,089.12	0.13
345	000919	金陵药业	512,657	4,316,571.94	0.13
346	601678	滨化股份	402,752	4,293,336.32	0.13
347	600223	鲁商置业	814,453	4,267,733.72	0.13
348	600063	皖维高新	1,523,470	4,250,481.30	0.13
349	600363	联创光电	603,473	4,248,449.92	0.12
350	600429	三元股份	720,135	4,241,595.15	0.12
351	000708	大冶特钢	457,074	4,168,514.88	0.12
352	002183	怡亚通	678,649	4,160,118.37	0.12
353	002238	天威视讯	291,645	4,150,108.35	0.12
354	000951	中国重汽	341,215	4,142,350.10	0.12
355	600686	金龙汽车	630,258	4,134,492.48	0.12
356	600864	哈投股份	666,839	4,134,401.80	0.12
357	600759	正和股份	744,564	4,124,884.56	0.12
358	600657	信达地产	930,219	4,120,870.17	0.12
359	000903	云内动力	969,372	4,119,831.00	0.12
360	600618	氯碱化工	457,655	4,118,895.00	0.12
361	000936	华西股份	912,933	4,117,327.83	0.12
362	600507	方大特钢	1,058,234	4,116,530.26	0.12
363	600829	三精制药	353,902	4,112,341.24	0.12
364	000428	华天酒店	877,497	4,106,685.96	0.12
365	600789	鲁抗医药	828,136	4,074,429.12	0.12
366	600501	航天晨光	475,097	4,066,830.32	0.12
367	600226	升华拜克	577,424	4,065,064.96	0.12
368	002064	华峰氨纶	751,026	4,048,030.14	0.12
369	600469	风神股份	457,599	4,045,175.16	0.12
370	600776	东方通信	777,913	4,045,147.60	0.12
371	000875	吉电股份	1,365,474	4,041,803.04	0.12
372	002252	上海莱士	298,808	4,036,896.08	0.12

373	601801	皖新传媒	370,187	4,012,827.08	0.12
374	600676	交运股份	877,101	3,999,580.56	0.12
375	601777	力帆股份	580,680	3,966,044.40	0.12
376	600644	乐山电力	464,853	3,955,899.03	0.12
377	600710	常林股份	651,254	3,933,574.16	0.12
378	002285	世联地产	265,552	3,930,169.60	0.12
379	600475	华光股份	312,484	3,906,050.00	0.11
380	600288	大恒科技	621,958	3,905,896.24	0.11
381	600460	士兰微	883,118	3,903,381.56	0.11
382	002506	超日太阳	321,697	3,866,797.94	0.11
383	600337	美克股份	643,423	3,860,538.00	0.11
384	600361	华联综超	677,216	3,846,586.88	0.11
385	000687	保定天鹅	770,314	3,836,163.72	0.11
386	000738	中航动控	383,583	3,835,830.00	0.11
387	600054	黄山旅游	256,587	3,830,843.91	0.11
388	600641	万业企业	819,965	3,821,036.90	0.11
389	000418	小天鹅 A	448,971	3,811,763.79	0.11
390	600088	中视传媒	335,941	3,809,570.94	0.11
391	002091	江苏国泰	366,111	3,803,893.29	0.11
392	600231	凌钢股份	817,763	3,802,597.95	0.11
393	600782	新钢股份	850,381	3,801,203.07	0.11
394	600075	新疆天业	535,266	3,795,035.94	0.11
395	600639	浦东金桥	534,314	3,788,286.26	0.11
396	000713	丰乐种业	364,803	3,761,118.93	0.11
397	002267	陕天然气	211,553	3,750,834.69	0.11
398	600810	神马股份	449,846	3,747,217.18	0.11
399	600129	太极集团	521,050	3,746,349.50	0.11
400	600488	天药股份	662,619	3,704,040.21	0.11
401	600291	西水股份	546,830	3,669,229.30	0.11
402	000042	深 长 城	194,895	3,650,383.35	0.11
403	600328	兰太实业	448,319	3,649,316.66	0.11
404	600966	博汇纸业	718,495	3,635,584.70	0.11
405	002449	国星光电	437,338	3,634,278.78	0.11
406	002276	万马电缆	672,773	3,632,974.20	0.11
407	601126	四方股份	248,191	3,631,034.33	0.11
408	600423	柳化股份	568,646	3,610,902.10	0.11
409	600293	三峡新材	490,569	3,610,587.84	0.11
410	002121	科陆电子	403,435	3,574,434.10	0.11
411	002384	东山精密	312,444	3,561,861.60	0.10
412	000533	万 家 乐	843,145	3,532,777.55	0.10
413	600480	凌云股份	441,500	3,532,000.00	0.10

414	600683	京投银泰	753,410	3,525,958.80	0.10
415	000620	新华联	650,083	3,516,949.03	0.10
416	002480	新筑股份	341,747	3,509,741.69	0.10
417	600290	华仪电气	535,881	3,493,944.12	0.10
418	600563	法拉电子	228,882	3,492,739.32	0.10
419	600983	合肥三洋	433,492	3,467,936.00	0.10
420	002006	精功科技	324,044	3,447,828.16	0.10
421	000911	南宁糖业	349,832	3,431,851.92	0.10
422	002242	九阳股份	464,372	3,417,777.92	0.10
423	002345	潮宏基	146,453	3,396,245.07	0.10
424	002109	兴化股份	437,380	3,385,321.20	0.10
425	002437	誉衡药业	170,842	3,382,671.60	0.10
426	600877	*ST 嘉陵	1,118,491	3,377,842.82	0.10
427	600667	太极实业	667,579	3,337,895.00	0.10
428	000905	厦门港务	540,049	3,332,102.33	0.10
429	002281	光迅科技	147,316	3,299,878.40	0.10
430	000158	常山股份	877,368	3,281,356.32	0.10
431	002612	朗姿股份	90,000	3,276,000.00	0.10
432	000631	顺发恒业	635,903	3,274,900.45	0.10
433	601003	柳钢股份	1,042,718	3,274,134.52	0.10
434	000572	海马汽车	1,003,656	3,271,918.56	0.10
435	600277	亿利能源	637,981	3,266,462.72	0.10
436	600333	长春燃气	469,423	3,257,795.62	0.10
437	600503	华丽家族	695,156	3,197,717.60	0.09
438	000514	渝 开 发	624,174	3,189,529.14	0.09
439	002336	人人乐	244,140	3,188,468.40	0.09
440	002585	双星新材	253,798	3,182,626.92	0.09
441	601311	骆驼股份	342,046	3,177,607.34	0.09
442	002320	海峡股份	259,832	3,164,753.76	0.09
443	000910	大亚科技	643,808	3,161,097.28	0.09
444	002461	珠江啤酒	276,689	3,126,585.70	0.09
445	600168	武汉控股	448,660	3,122,673.60	0.09
446	600386	北巴传媒	410,075	3,108,368.50	0.09
447	600725	云维股份	626,776	3,096,273.44	0.09
448	002232	启明信息	415,480	3,082,861.60	0.09
449	600743	华远地产	771,645	3,055,714.20	0.09
450	002489	浙江永强	294,035	3,046,202.60	0.09
451	002414	高德红外	183,049	3,045,935.36	0.09
452	600287	江苏舜天	444,265	3,034,329.95	0.09
453	000949	新乡化纤	1,012,088	3,026,143.12	0.09
454	002386	天原集团	390,364	2,966,766.40	0.09

455	000050	深天马 A	451,026	2,945,199.78	0.09
456	002534	杭钢股份	162,910	2,929,121.80	0.09
457	600202	哈空调	545,837	2,920,227.95	0.09
458	600178	东安动力	469,949	2,894,885.84	0.09
459	600806	昆明机床	476,205	2,866,754.10	0.08
460	000517	荣安地产	431,769	2,858,310.78	0.08
461	601011	宝泰隆	241,525	2,801,690.00	0.08
462	600523	贵航股份	293,726	2,758,087.14	0.08
463	601208	东材科技	375,725	2,742,792.50	0.08
464	002075	沙钢股份	641,263	2,725,367.75	0.08
465	000950	建峰化工	487,247	2,718,838.26	0.08
466	002444	巨星科技	309,354	2,694,473.34	0.08
467	000732	泰禾集团	413,833	2,669,222.85	0.08
468	002326	永太科技	195,524	2,663,036.88	0.08
469	600061	中纺投资	523,678	2,566,022.20	0.08
470	000893	东凌粮油	180,667	2,545,598.03	0.07
471	002315	焦点科技	73,324	2,540,676.60	0.07
472	000899	*ST 赣能	657,698	2,518,983.34	0.07
473	002218	拓日新能	298,877	2,516,544.34	0.07
474	600834	申通地铁	388,485	2,474,649.45	0.07
475	600126	杭钢股份	682,589	2,450,494.51	0.07
476	002362	汉王科技	217,754	2,414,891.86	0.07
477	601999	出版传媒	336,225	2,380,473.00	0.07
478	000597	东北制药	339,489	2,342,474.10	0.07
479	000617	石油济柴	233,919	2,308,780.53	0.07
480	002194	武汉凡谷	339,225	2,303,337.75	0.07
481	600258	首旅股份	188,270	2,295,011.30	0.07
482	002225	濮耐股份	297,158	2,246,514.48	0.07
483	000972	*ST 中基	686,444	2,230,943.00	0.07
484	600184	光电股份	127,771	2,200,216.62	0.06
485	002062	宏润建设	457,694	2,164,892.62	0.06
486	000925	众合机电	245,221	2,143,231.54	0.06
487	000029	深深房 A	556,554	2,081,511.96	0.06
488	002383	合众思壮	114,208	1,947,246.40	0.06
489	002110	三钢闽光	326,301	1,938,227.94	0.06
490	002172	澳洋科技	452,540	1,932,345.80	0.06
491	600359	*ST 新农	326,419	1,860,588.30	0.05
492	600278	东方创业	318,711	1,829,401.14	0.05
493	600819	耀皮玻璃	221,151	1,472,865.66	0.04
494	600648	外高桥	154,588	1,306,268.60	0.04
495	600623	双钱股份	126,435	1,228,948.20	0.04

496	600636	三爱富	24,695	477,848.25	0.01
497	601002	晋亿实业	37,543	401,710.10	0.01
498	002161	远望谷	45,149	349,453.26	0.01
499	000823	超声电子	6,245	87,117.75	0.00
500	000506	中润资源	6,245	51,521.25	0.00
501	601800	中国交建	25	120.25	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	002029	七匹狼	21,364,285.67	0.74
2	600827	友谊股份	20,907,760.28	0.73
3	600325	华发股份	20,830,334.42	0.73
4	000031	中粮地产	19,106,436.26	0.67
5	600022	山东钢铁	14,489,240.00	0.50
6	000926	福星股份	14,372,806.11	0.50
7	000793	华闻传媒	12,715,026.80	0.44
8	600717	天津港	12,127,064.48	0.42
9	600517	置信电气	11,995,168.25	0.42
10	000963	华东医药	11,272,673.19	0.39
11	002005	德豪润达	10,871,439.07	0.38
12	000539	粤电力 A	10,741,030.81	0.37
13	600269	赣粤高速	10,523,985.44	0.37
14	000550	江铃汽车	10,040,335.57	0.35
15	000652	泰达股份	9,936,921.74	0.35
16	000518	四环生物	9,838,382.51	0.34
17	600157	永泰能源	9,820,778.18	0.34
18	601566	九牧王	9,718,034.77	0.34
19	600067	冠城大通	9,649,813.44	0.34
20	600220	江苏阳光	9,613,588.39	0.33

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	000581	威孚高科	21,791,126.03	0.76
2	600325	华发股份	21,684,028.84	0.76
3	000926	福星股份	14,349,720.86	0.50
4	600160	巨化股份	13,084,572.96	0.46
5	002038	双鹭药业	12,644,920.28	0.44
6	000031	中粮地产	12,605,776.38	0.44
7	600770	综艺股份	11,918,412.64	0.41
8	002353	杰瑞股份	11,553,294.59	0.40
9	600067	冠城大通	10,765,530.32	0.37
10	000006	深振业 A	9,300,716.66	0.32
11	600259	广晟有色	9,039,528.90	0.31
12	002344	海宁皮城	8,873,112.08	0.31
13	600022	山东钢铁	8,808,588.37	0.31
14	000596	古井贡酒	8,357,254.01	0.29
15	600298	安琪酵母	8,039,447.05	0.28
16	000616	亿城股份	7,846,002.80	0.27
17	600246	万通地产	7,686,758.87	0.27
18	000823	超声电子	7,314,131.11	0.25
19	600783	鲁信创投	7,108,998.24	0.25
20	601238	广汽集团	7,080,027.67	0.25

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	1,228,700,662.08
卖出股票的收入（成交）总额	952,686,032.42

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	145,440,000.00	4.28
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-

8	其他	-	-
9	合计	145,440,000.00	4.28

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1101094	11 央票 94	1,500,000	145,440,000.00	4.28

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。

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	1,675,701.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	315,716.00
4	应收利息	2,880,266.09
5	应收申购款	1,927,631.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,799,314.23

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的处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
186,997	23,381.05	666,531,995.88	15.24%	3,705,653,713.70	84.76%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	王玩嫦	5,000,450.00	3.14%
2	李建军	2,500,300.00	1.57%
3	姚惠民	2,471,800.00	1.55%
4	张正邦	2,010,480.00	1.26%
5	上海同济协力建设工程咨询有限公司	2,000,000.00	1.26%
6	高琪	1,482,817.00	0.93%
7	霍宝仪	1,474,718.00	0.93%
8	吴彤	1,390,200.00	0.87%
9	珠海优特电力科技股份有限公司	1,135,544.00	0.71%
10	王晨晔	1,000,100.00	0.63%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	6,634,612.56	0.1517%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间

为 100 万份以上;

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 11 月 26 日) 基金份额总额	8,635,797,223.98
本报告期期初基金份额总额	3,885,836,712.17
本报告期基金总申购份额	1,425,751,516.06
减：本报告期基金总赎回份额	939,402,518.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,372,185,709.58

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人托管业务部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，因业务发展需要，广发基金管理有限公司第四届董事会第九次会议通过关于聘请 2012 年度基金审计机构的议案，本基金改聘深圳市鹏城会计师事务所有限公司负责本基金审计事务；因深圳市鹏城会计师事务所有限公司广州分公司已整体并入天健会计师事

务所 (特殊普通合伙), 2012 年 8 月, 本基金改聘天健会计师事务所 (特殊普通合伙) 负责本基金审计事务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
安信证券	4	-	-	-	-	-
北京高华	1	282,879,248.86	13.20%	240,447.55	13.99%	-
渤海证券	1	206,750,964.21	9.65%	126,804.94	7.38%	-
财富证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	311,390,054.71	14.53%	264,834.24	15.41%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	124,308,564.20	5.80%	101,001.91	5.88%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	6	321,715,895.42	15.01%	269,461.37	15.68%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国信证券	4	55,924,354.86	2.61%	45,439.12	2.64%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	14,954,895.84	0.70%	12,711.87	0.74%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	217,176,779.50	10.13%	184,599.35	10.74%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	122,791,812.47	5.73%	75,209.75	4.38%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	108,243,299.74	5.05%	92,007.41	5.35%	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	3	118,404,677.63	5.52%	96,205.12	5.60%	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
中金公司	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	4	42,279,182.96	1.97%	34,352.49	2.00%	-

中信证券	3	216,496,993.14	10.10%	175,906.60	10.23%	-
中信浙江证 券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期回 购成交总 额的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	1,215,000,000.00	90.33%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	50,000,000.00	3.72%	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	80,000,000.00	5.95%	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江证 券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加浙商银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海 证券报》	2012-01-04
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行基金定期定额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》	2012-01-04
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续参加华夏银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海 证券报》	2012-01-04
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续参加深圳发展银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海 证券报》	2012-01-04
5	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞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》	2012-01-09
6	广发基金管理有限公司关于平安银行调整我司部分基金申购和基金定期定额申购费率的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海 证券报》	2012-01-20
7	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投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》	2012-02-06
8	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》	2012-02-29
9	广发基金管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销业务申购起点金额和最低持有份额的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海 证券报》	2012-03-20

10	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-14
11	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-29
12	广发基金管理有限公司关于网上交易系统开通广发中证500指数等旗下指数基金的后端收费模式的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-29

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中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的文件;
2. 《广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
3. 《广发中证 500 指数证券投资基金托管协议》;
4. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 《广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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

二〇一二年八月二十七日