广发稳健增长开放式证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09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:二〇〇九年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发稳健增长混合
交易代码	270002
前端交易代码	270002
后端交易代码	270012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年7月26日
报告期末基金份额总额	6,421,724,115.26份
投资目标	在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增长。
投资策略	1、资产配置策略 基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,以稳健投资的原则在股票、债券、现金之间进行资产配置。为降低投资风险,股票投资上限为65%,下限为30%。 2、股票投资策略 在股票投资上,运用优化成长投资方法投资于价格低于内在价值的股票。股票投资对象主要是大盘绩优企业和规模适中、管理良好、竞争优势明显、有望成长为行业领先企业的上市公司。 3、债券投资策略 在债券投资上,坚持稳健投资的原则,控制债券投资风险。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。
业绩比较基准	65%*中信标普300指数收益+35%*中信标普国债指数收益
风险收益特征	适度风险基础上的基金资产稳健增长。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)
1.本期已实现收益	468,804,864.69
2.本期利润	-403,906,149.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0620
4.期末基金资产净值	9,105,889,395.91
5.期末基金份额净值	1.4180

(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-4.35%	2.31%	-3.00%	1.56%	-1.35%	0.75%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

广发稳健增长开放式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年7月26日至2009年9月30日)

本基金建仓期为基金合同生效后6个月。建仓结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许雪梅	广发稳健增长混合基金的基金经理;广发核心精选股票基金的基金经理	2008-2-14	-	10	女,中国籍,管理学硕士,持有证券业执业资格证书。1999年7月至2002年8月任职于广发证券股份有限公司,2002年8月至2008年2月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、研究发展部副总经理及总经理,2008年2月14日起任广发稳健增长混合基金的基金经理,2008年7月16日起任广发核心精选股票基金的基金经理。
冯永欢	广发稳健增长混合基金的基金经理;广发策略优选混合基金的基金经理	2007-3-29	-	5	男,中国籍,经济学硕士,持有证券执业资格证书,2004年2月至2007年3月先后任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究发展部总经理助理、广发稳健增长混合基金的基金经理助理,2007年3月29日起任广发稳健增长混合基金的基金经理,2008年2月14日起任广发策略优选混合基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发稳健增长开放式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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

公司风险控制管理阿通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;监察稽核部通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司管理的投资组合包括开放式基金11只,企业年金5只,特定客户资产管理计划3个。与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发策略优选混合、广发聚富混合和广发大盘成长混合。报告期内,本投资组合与广发大盘成长混合、广发策略优选混合、广发聚富混合的净值增长率差异未超过5%。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合,未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1.市场回顾

三季度,在信贷增速回落导致流动性疑虑加深的背景下,宏观经济层面的固定资产投资、出口恢复都处于等待数据和需要二次确认复苏的阶段,唯独国内消费不负众望,呈现出相对稳定的增长态势。IPO、再融资、创业板和大小非流通进一步加剧了市场的不安,在尚未出现有力数据以消除市场关于二次衰退恐慌的情绪下,三季度市场运行出现了冲顶回落的走势,上证综合指数在3000点附近多次反复。本季度沪深300指数取得5.11%的跌幅,主要因为权重较大的板块包括房地产、黑色金属、金融、综合、交通运输等行业跌幅较深,而医药、信息设备、食品饮料、交运设备、家用电器等行业则分别取得10%以内的涨幅。

2.操作回顾

鉴于对宏观经济恢复向上大趋势不变的判断,三季度本基金的股票仓位和行业配置基本保持不变,只进行了部分微调,相对增加了金属、金融、食品饮料等行业的比重,相对减少了机械、信息技术和批发零售行业的配置。由于重仓的金融地产在三季度调整较深,三度本基金净值下跌4.35%,逊于比较基准。

3.未来展望

展望四季度,我们认为全球经济正进入全面复苏的巩固阶段,而国内经济正进入二次确认复苏的时期,澳大利亚央行的加息行为正好印证了全球需求恢复的大趋势。同时,我们认为澳洲加息并不意味着欧美主要国家加息的条件已经成熟,在全球制造业产能过剩而通胀为期尚远的背景下,为巩固经济复苏的成果,欧美主要国家的加息将姗姗来迟,而中国等国家鉴于升值压力其加息行为也将跟随美国。因此,全球流动性宽松的局面仍不会发生根本性变化。国内来看,资金成本低廉的大环境仍将有力支撑经济的内在复苏,未来一段时间,国内经济运行可能出现固定资产投资、出口、消费全面回升的良好局面,并转带动工业企业利润和上市公司业绩恢复增长。

在操作层面上,我们仍将重点关注资产价格和业绩增长两条线索。组合的一部分将坚定跟随资产价格趋势向好的行业,寻找其中的龙头品种进行投资,组合的另一部分将依据自下而上的方式,寻找业绩确定性高、估值合理或业绩改善明显的品种进行投资。此外,本基金还将依托经济复苏过程中产业整合的大环境,寻找有潜力的资产重组主题投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,349,211,415.83	62.04
	其中:股票	6,349,211,415.83	62.04
2	固定收益投资	2,419,670,479.60	23.64
	其中:债券	2,419,670,479.60	23.64
	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	1,180,140,372.73	11.53
6	其他资产	285,826,963.71	2.79
7	合计	10,234,849,231.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,441,593,890.03	15.83
C	制造业	2,589,040,478.34	28.43
C0	食品、饮料	189,025,139.73	2.08
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	412,566,858.84	4.53
C5	电子	25,871,479.20	0.28
C6	金属、非金属	1,238,547,865.53	13.60
C7	机械、设备、仪表	368,168,004.38	4.04
C8	医药、生物制品	178,572,868.90	1.96
C99	其他制造业	176,288,261.76	1.94
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,850,846.24	0.37
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	757,915,031.24	8.32
J	房地产业	1,301,967,135.18	14.30
K	社会服务业	224,844,034.80	2.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,349,211,415.83	69.73

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	75,010,557	418,558,908.06	4.60
2	600048	保利地产	16,999,903	410,377,658.42	4.51
3	600000	浦发银行	17,000,000	334,050,000.00	3.67
4	000983	西山煤电	9,499,924	297,442,620.44	3.27
5	600348	国阳新能	8,240,787	293,536,832.94	3.22
6	600383	金地集团	22,000,000	283,140,000.00	3.11
7	000960	锡业股份	11,299,922	273,571,111.62	3.00
8	000792	盐湖钾肥	5,000,000	248,150,000.00	2.73
9	600362	江西铜业	6,000,000	205,020,000.00	2.25
10	000338	潍柴动力	4,000,000	200,800,000.00	2.21

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	101,580,000.00	1.12
2	央行票据	1,409,790,000.00	15.48
3	金融债券	608,170,000.00	6.68
	其中:政策性金融债	608,170,000.00	6.68
4	企业债券	97,617,329.60	1.07
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	202,513,150.00	2.22
7	其他	-	-
8	合计	2,419,670,479.60	26.57

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央票47	3,000,000	311,040,000.00	3.42
2	0901044	09央票44	3,000,000	294,810,000.00	3.24
3	0302020	03国开02	2,000,000	208,180,000.00	2.29
4	0801044	08央票44	2,000,000	207,300,000.00	2.28
5	080222	08国开22	2,000,000	198,620,000.00	2.18

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查;在本报告编制日前一年内,本基金投资的前十名证券的发行主体之一青海盐湖钾肥股份有限公司由于未及时严格履行监管部门制定的氯化钾销售临时指导价格,受到监管部门500万元的经济处罚。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,105,571.56
2	应收证券清算款	235,988,444.40
3	应收股利	896,358.60
4	应收利息	36,481,632.48
5	应收申购款	9,354,956.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,826,963.71

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125709	唐钢转债	118,295,500.00	1.30
2	125960	锡业转债	84,217,650.00	0.92

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中无流通受限股票.

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	6,616,733,965.20
报告期期间基金总申购份额	719,735,983.75
报告期期间基金总赎回份额	914,745,833.69
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	6,421,724,115.26

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发稳健增长开放式证券投资基金募集的文件;

2.《广发稳健增长开放式证券投资基金基金合同》;

3.《广发稳健增长开放式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.《广发稳健增长开放式证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 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

7.3 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。

广发聚丰股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09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:二〇〇九年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚丰股票
交易代码	270005
前端交易代码	270005
后端交易代码	270015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月23日
报告期末基金份额总额	36,866,755,024.89份
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。
投资策略	本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票,同时保持两类资产的适度均衡配置,构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%*新华富时A600指数+20%*新华巴克莱资本中国全债指数
风险收益特征	较高风险,较高收益。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)
1.本期已实现收益	776,015,273.06
2.本期利润	-521,261,571.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0140
4.期末基金资产净值	25,997,311,672.69
5.期末基金份额净值	0.7052

(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-2.19%	2.06%	-3.64%	1.92%	1.45%	0.14%

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

广发聚丰股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年12月23日至2009年9月30日)

注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易阳方	广发聚丰股票基金的基金经理;投资总监;投资管理部总经理	2005-12-23	-	13	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,1997年1月至2002年11月任职于广发证券股份有限公司,2002年11月至2003年11月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员,2003年12月3日至2007年3月28日任广发聚富混合基金的基金经理,2005年5月至今任广发基金管理有限公司投资管理部总经理,2005年12月23日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2006年9月至2008年4月16日任广发基金管理有限公司总经理助理,2008年4月17日起任广发基金管理有限公司投资总监。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

公司风险控制管理阿通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;监察稽核部通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司管理的投资组合包括开放式基金11只,企业年金5只,特定客户资产管理计划3个。与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发小盘成长股票(LOF)、广发核心精选股票和广发聚瑞股票。报告期内,本基金净值增长率与广发核心精选股票、广发小盘成长股票(LOF)净值增长率差异未超过5%。广发聚瑞股票在本报告期仍处于建仓期,故本投资组合不适宜与其进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合,未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

三季度,前期全球规模空前、步调一致的经济拯救政策仍在发生效用,全球经济继续稳步回升,资源国如澳大利亚、巴西、加拿大等国经济回升力度更大,以至于有有我国家开始讨论政策的退出问题。国内方面,从同比数据看,无论是GDP还是工业增加值都有很好的增长,但这仅仅是因为去年同期数据很差的缘故。从环比看,二季度是增长的最高峰,三季度环比增速有较大幅度下降。目前国内经济增长依旧靠政府投资拉动,民间投资(表现在房地产)有启动激活迹象,但民间投资大部分是以出口为导向的制造业。由于外需不畅这部分民间投资依旧维持低迷格局,国内需求是推动经济增长最主要的因素。我国经济已经从二季度快速复苏阶段步入稳定低速增长时期。尽管政策层面依旧维持宽松的货币政策和积极的财政政策,但政策已经开始悄悄转向,宽松货币政策已经变成适度宽松,7月份信贷开始收缩,投资者原来二季度的乐观预期开始修正,股指在本季度冲高回落,进入震荡格局。本基金三季度对持仓结构进行较大的优化,投资重点转向内需主导的行业,减持流动性因素推动的部分原材料行业如有色、钢铁,降低了估值过高的房地产行业的配置,青睐与出口相关的行业股票如航运。加大了对食品饮料、零售、医药等内需型行业配置,同时对优势制造业中机械、通讯设备中的龙头也加大了配置。这些调整措施在9月份开始对基金绩效产生积极的正面贡献。

展望四季度,本基金认为全球经济逐渐步入正常发展之路,国内由于内部和外部需求会逐步好转,企业利润同比会有较大增长。原来推动经济增长的政策因素虽不会立即退出,但效用已经开始大大递减,且退出是迟早的事情。证券市场方面,前期影响市场走势的两大因素之一的流动性的影响力会很快衰退,盈利增长和估值因素会成为主导市场走势的主要因素。预计四季度证券市场会维持震荡向上的格局。本基金将继续以内需主导的产业为投资重点,同时关注周期性行业盈利变化带来的投资机会,力争取得较好的基金绩效。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,246,118,392.99	88.76
	其中:股票	23,246,118,392.99	88.76
2	固定收益投资	43,160,479.80	0.16
	其中:债券	43,160,479.80	0.16
	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	2,875,293,650.31	10.98
6	其他资产	23,863,786.48	0.09
7	合计	26,188,436,309.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	4,256,145,615.80	16.37
C	制造业	8,982,034,738.17	34.55
C0	食品、饮料	2,463,190,405.44	9.47
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	3,260,000.00	0.01
C3	造纸、印刷	734,626,479.09	2.83
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,904,878,952.76	7.33
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	504,760,614.00	1.94
C7	机械、设备、仪表	2,829,948,315.68	10.89
C8	医药、生物制品	541,369,971.20	2.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	477,865,451.36	1.84
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	2,868,106.06	0.01
G	信息技术业	1,356,210,182.76	5.22
H	批发和零售贸易	2,442,155,875.70	9.39
I	金融、保险业	3,877,129,093.12	14.91
J	房地产业	1,684,165,678.00	6.48
K	社会服务业	74,031,563.18	0.28
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	93,512,088.84	0.36
	合计	23,246,118,392.99	89.42

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	14,941,104	2,463,190,405.44	9.47
2	601166	兴业银行	60,000,000	2,027,400,000.00	7.80
3	002024	苏宁电器	104,790,377	1,717,514,279.03	6.61
4	000063	中兴通讯	35,521,482	1,356,210,182.76	5.22
5	000792	盐湖钾肥	23,385,930	1,160,643,705.90	4.46
6	600000	浦发银行	56,000,000	1,100,400,000.00	4.23
7	601666	平煤股份	39,415,856	1,031,118,792.96	3.97
8	600123	兰花科创	27,000,000	930,960,000.00	3.58
9	601857	中国石油	71,450,000	907,415,000.00	3.49
10	000157	中联重科	37,000,000	884,300,000.00	3.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	43,160,479.80	0.17
7	其他	-	-
8	合计	43,160,479.80	0.17

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110007	博汇转债	376,320	41,843,020.80	0.16
2	110006	龙盛转债	10,790	1,317,459.00	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查;在本报告编制日前一年内,本基金投资的前十名证券的发行主体之一青海盐湖钾肥股份有限公司由于未及时严格履行监管部门制定的氯化钾销售临时指导价格,受到监管部门500万元的经济处罚。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,977,649.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7,911,900.00
4	应收利息	496,492.59
5	应收申购款	8,477,744.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,863,786.48

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	37,896,485,147.65
报告期期间基金总申购份额	797,685,664.34
报告期期间基金总赎回份额	1,827,415,787.10
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	36,866,755,024.89

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚丰股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》;

3.《广发聚丰股票型证券投资基金托管协议》;

4.《广发聚丰股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

5.《广发聚丰股票型证券投资基金业务规则》;

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

7.2 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

7.3 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。

广发聚瑞股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09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:二〇〇九年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚瑞股票
交易代码	270021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月16日
报告期末基金份额总额	6,863,335,157.27份
投资目标	深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律,把握主题投资机会,通过精选个股和有效的风险控制,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金为股票型基金,基金的资产配置比例范围为:股票资产占基金资产的60%—95%;现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 2."主题投资分析框架"策略 在股票投资方面,本基金主要采用自上而下的"主题投资分析框架"(Thematic Investing Analysis Frame),通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤,挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票,通过定量和定性相结合的方法,筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年7月1日