广发沪深300指数证券投资基金

2010 第二季度报告

2010年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年七月二十日

§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2010年7月16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2010年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300指数
基金主代码	270010
交易代码	270010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月30日
报告期末基金份额总额	1,892,652,367.95份
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。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,基金经理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%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,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(2010年4月1日-2010年6月30日)
1.本期已实现收益	21,769,992.62
2.本期利润	-602,673,380.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3386
4.期末基金资产净值	2,316,356,423.11
5.期末基金份额净值	1.224

注: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

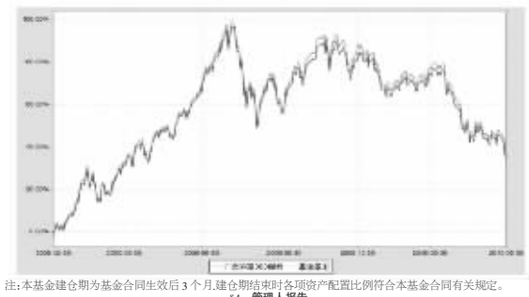
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-22.29%	1.72%	-22.21%	1.73%	-0.08%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发沪深300指数证券投资基金

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

(2008年12月30日至2010年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后3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		
邱春杨	广发沪深300指数基金的基金经理;广发中证500指数(lof)的基金经理;金融工程部总经理	2008-12-30	-	9	男,中国籍,金融学硕士,持有证券业执业资格证书,2001年3月至2002年10月任职于南方证券资产管理部,2002年11月至2008年1月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、研究发展部产品设计小组组长、机构理财部副总经理、金融工程部副总经理,2008年2月1日起任公司金融工程部总经理,2008年12月30日起任广发沪深300指数基金的基金经理,2009年11月26日起任广发中证500指数(lof)基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资组合管理遵规守信情况的说明

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、《广发沪深300指数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。

公司风险控制管理沟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

本基金管理人不管理与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年上半年,世界经济延续了去年复苏的态势,新兴经济体继续领先发达经济体强劲增长。但是,欧洲主权债务危机的不断恶化引发全球金融市场的剧烈动荡,而新兴经济体经济过热引发的通胀预期进一步增强,打破了经济复苏的良好预期。在脆弱的经济复苏表现下,各国政府面临宏观调控的两难处境:过早退出刺激性政策可能引致经济复苏成果的夭折,过晚退出则又面临恶性通胀的巨大威胁。3季度世界经济增长将减速,但由于欧洲出台了高达7500亿欧元的史上最大救助机制,世界经济二次探底可能性不大。中国经济也不致于"二次探底"。鉴于复苏的曲折性,政策面的态度也正在逐步转变。这将带动传统行业盈利能力触底企稳,沪深300成份股覆盖了国民经济主要产业的重点公司,与宏观经济环境息息相关,其经营状态直接反应了中国经济的复苏态势,有望在经济触底和政策预期的回暖的相互交织中震荡上行。

§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	2,188,800,887.34	93.50
	其中:股票	2,188,800,887.34	93.50
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	126,834,504.60	5.42
6	其他各项资产	25,266,161.29	1.08
7	合计	2,340,901,553.23	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	8,973,902.80	0.39
B	采掘业	234,990,174.26	10.14
C	制造业	646,752,671.06	27.92
C0	食品、饮料	96,041,348.40	4.15
C1	纺织、服装、皮毛	11,544,498.18	0.50
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	5,397,200.52	0.23
C4	石油、化学、塑胶、塑料	49,907,820.28	2.15
C5	电子	9,139,843.80	0.39
C6	金属、非金属	173,725,195.79	7.50
C7	机械、设备、仪表	215,813,765.31	9.32
C8	医药、生物制品	78,237,611.82	3.38
C99	其他制造业	6,945,386.96	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,877,806.05	3.41
E	建筑业	65,034,212.31	2.81
F	交通运输、仓储业	105,364,318.88	4.55
G	信息技术业	80,216,977.36	3.46
H	批发和零售贸易	63,892,277.41	2.76
I	金融、保险业	710,669,807.78	30.68
J	房地产业	124,325,219.80	5.37
K	社会服务业	19,397,148.46	0.84
L	传播与文化产业	7,357,289.80	0.32
M	综合类	42,949,081.37	1.85
	合计	2,188,800,887.34	94.49

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	600036	招商银行	7,432,616	96,698,334.16	4.17
2	601318	中国平安	1,524,628	71,367,836.68	3.08
3	601328	交通银行	11,081,586	66,600,331.86	2.88
4	600016	民生银行	9,992,890	60,456,984.50	2.61
5	600030	中信证券	4,393,528	51,404,277.60	2.22
6	601166	兴业银行	2,206,959	50,826,265.77	2.19
7	600000	浦发银行	3,656,427	49,727,407.20	2.15
8	601939	建设银行	8,195,275	38,517,792.50	1.66
9	601088	中国神华	1,750,979	38,469,008.63	1.66
10	601601	中国太保	1,668,758	37,997,619.66	1.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

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,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	667,530.16
2	应收证券清算款	12,824,920.94
3	应收股利	1,222,815.93
4	应收利息	45,570.17
5	应收申购款	10,505,324.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,266,161.29

5.8.4 报告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换期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	71,367,836.68	3.08	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,687,942,748.42
本报告期基金总申购份额	612,120,400.85
减:本报告期基金总赎回份额	407,410,781.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,892,652,367.95

§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沪深300指数证券投资基金募集的文件;

2.《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》;

3.《广发沪深300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.《广发沪深300指数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。

广发基金管理有限公司
二〇一〇年七月二十日

广发聚瑞股票型证券投资基金

2010 第二季度报告

2010年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年七月二十日

§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2010年7月16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2010年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚瑞股票
基金主代码	270021
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	3,445,629,112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(2010年4月1日-2010年6月30日)
1.本期已实现收益	16,908,505.59
2.本期利润	-520,219,402.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1561
4.期末基金资产净值	3,009,972,905.69
5.期末基金份额净值	0.874

注: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

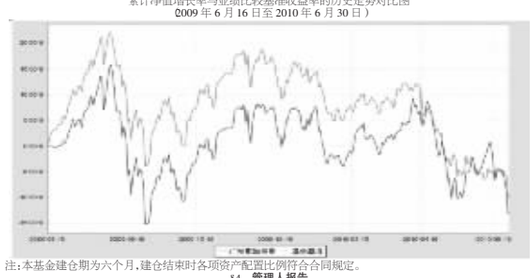
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.31%	1.92%	-18.30%	1.46%	2.99%	0.46%

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

广发聚瑞股票型证券投资基金

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

(2009年6月16日至2010年6月30日)



注:本基金建仓期为六个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
刘明月	广发聚瑞股票基金的基金经理	2009-6-16	-	6	男,中国籍,金融学硕士,持有证券执业资格证书,2004年7月至2007年2月任广发基金管理有限公司研究发展部研究员,2007年2月至2009年5月先后任广发基金管理有限公司研究发展部副总经理、机构投资部总经理,2009年6月16日起任广发聚瑞股票基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资组合管理遵规守信情况的说明

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

4.3 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。

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

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发小盘股票、广发聚丰股票和广发核心精选股票三只开放式基金。报告期内,本基金与广发小盘股票、广发聚丰股票和广发核心精选股票的净值增长率差异均未超过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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度市场经历了较大的波动,在六月中旬前,医药、TMT、能源设备、食品饮料、商业等预期稳定类行业表现强势,而强周期类行业如地产、钢铁、有色、煤炭等走势较弱;在六月中旬之后,由于对经济二次探底的忧虑加重和稳定类股票估值也较高,前期强势的股票大幅下跌,强周期类股票跌幅反而收窄。总的来说,单看第二季度预期稳定类股票强于周期类且有一定的正收益。截止2季度末,静态看10年业绩,市场估值水平还在合理范围内,但市场气氛开始悲观起来。

二季度广发聚瑞的组合调整不大,降低了家电汽车的比重,调高了智能电网、节能减排等行业的比重,在6月中旬前,组合表现较好。失误操作主要是:在6月中旬投资组合估值水平比较高时没有及时降低仓位,从而带来净值波动较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内净值增长率为-15.31%,优于比较基准的-18.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

§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	2,800,992,553.89	92.68
	其中:股票	2,800,992,553.89	92.68
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	213,690,856.99	7.07
6	其他各项资产	7,633,637.81	0.25
7	合计	3,022,317,048.69	100.00

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

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	000538	云南白药	2,026,811	130,729,309.50	4.34
2	002081	金螳螂	2,721,528	85,183,826.40	2.83
3	000999	华润三九	3,299,915	75,733,049.25	2.52
4	600804	鹏博士	8,201,516	70,677,522.72	2.35
5	002123	荣信股份	2,075,729	66,423,328.00	2.21
6	600079	人福科技	4,111,677	65,786,832.00	2.19
7	002065	东华软件	2,586,991	62,346,483.10	2.07
8	600406	国电南瑞	1,619,921	62,188,767.19	2.07
9	000400	许继电气	2,150,036	56,502,946.08	1.88
10	600572	康恩贝	3,989,567	53,260,719.45	1.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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 其他各项资产构成

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

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,722,842,758.43
本报告期基金总申购份额	412,447,088.53
减:本报告期基金总赎回份额	689,660,734.96
本报告期期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,445,629,112

§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瑞股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发聚瑞股票型证券投资基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发聚瑞股票型证券投资基金托管协议》;

5.《广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

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。

广发基金管理有限公司
二〇一〇年七月二十日

广发聚富开放式证券投资基金

2010 第二季度报告

2010年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年七月二十日

§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2010年7月16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2010年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚富混合	
基金主代码	270001	
交易代码	270001	270011
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年12月3日	
报告期末基金份额总额	5,797,221,583.05份	
投资目标	依托高速发展的宏观经济和资本市场,通过基金管理人科学研究,审慎投资,在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	积极投资策略,在资产配置层面,重视股票资产和债券资产的动态平衡配置;在行业配置层面,根据不同行业的发展前景进行行业优化配置;在个股选择层面,在深入把握上市公司基本面的基础上挖掘价格尚未完全反映投资价值的潜力股的投资机会。	
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益+20%×中信标普全债指数收益	
风险收益特征	本基金风险收益特征介于成长基金与价值基金之间;适度风险、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(2010年4月1日-2010年6月30日)
1.本期已实现收益	104,758,937.99
2.本期利润	-1,125,503,133.24
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1929
4.期末基金资产净值	6,227,119,096.83
5.期末基金份额净值	1.0742

注: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

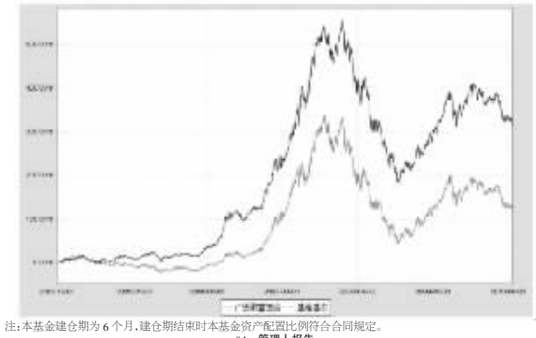
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.24%	1.16%	-18.15%	1.44%	2.91%	-0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发聚富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

(2003年12月3日至2010年6月30日)



注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金资产配置比例符合合同规定。

§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		
王国强	广发聚富混合基金的基金经理	2009-9-10	-	8	男,经济学硕士,持有证券业执业证书,2002年7月至2004年5月任职于华夏基金管理有限公司,2004年5月至2007年8月任职于天弘基金管理有限公司,在2006年4月19日至2007年7月27日曾任天弘精选混合基金的基金经理,2007年9月至2009年3月任职于大成基金管理有限公司,2009年4月至今任职于广发基金管理有限公司,2009年9月10日起任广发聚富混合基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资组合管理遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚富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。

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

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

与本投资组合投资风格相似