广发策略优选混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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：二〇一〇年十月二十五日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发策略优选混合	
基金主代码	270006	
交易代码	270006	270016
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年5月17日	
报告期末基金份额总额	7,372,145,511.07份	
投资目标	通过综合运用多种投资策略优选股票，分享中国经济和资本市场高速增长的成果，为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。	
投资策略	本基金将主要根据宏观经济政策、资金供求、市场波动周期因素的判断，确定资产配置策略；通过综合运用主题投资、买入持有、逆向投资等多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合；通过利率预测以及收益曲线策略进行债券投资；同时严格遵守有关权证投资的比例限制。	
业绩比较基准	75%＊新华富时A600指数+25%＊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（2010年7月1日-2010年9月30日）
1.本期已实现收益	338,930,913.31
2.本期利润	2,545,241,404.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.3446
4.期末基金资产净值	12,580,149,178.21
5.期末基金份额净值	1.7064

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。

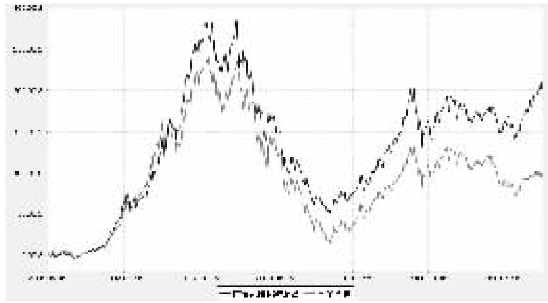
3.2 基金净值表现

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	25.30%	1.15%	13.25%	0.98%	12.05%	0.17%

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

广发策略优选混合型证券投资基金
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
（2006年5月17日至2010年9月30日）



注：注：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		
冯永欢	广发策略优选混合基金的基金经理；广发稳健增长混合基金的基金经理	2008-2-14	-	6	男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，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。

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 管理人对报告期内本基金运作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、《广发策略优选混合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。

4.3 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。

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发聚富混合、广发稳健增长混合、广发大盘成长混合和广发内需增长混合。报告期内，本投资组合与广发稳健增长混合、广发大盘成长混合的净值增长率差异均未超过5%。报告期内，本基金与广发聚富混合的净值增长率差异为11.07%，主要原因是两基金在仓位配置方面存在一定差异所致。广发内需增长混合在本报告期仍处于建仓期，故不适宜进行业绩比较。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第三季度，经济运行指标基本见底，工业增加值环比折年率已经接近历史最低点，并且有企稳迹象，先行指标PMI出现反弹；国外经济并无太大亮点，所以欧美日等各主要经济体继续宽松的货币政策，这促进了又一轮大宗商品上涨与股市的反弹。

在流动性重回宽松、经济环比见底的影响下，上证综指在三季度反弹10.73%，以成长股为主要反弹动力，消费、医药、TMT、工程机械等行业涨幅较大。

本基金在第三季度增持了医药、零售等行业，提高了股票仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金三季度净值涨幅25.30%，基金业绩比较基准涨幅13.25%，跑赢基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国庆之后，在外围量化宽松、大宗商品价格上涨的刺激下，大盘强劲反弹，本次的反弹与第三季度的上涨结构几乎完全相反，前期低迷的强周期股表现抢眼，而消费、医药等成长股普遍下跌。

基于对宏观经济环比回升和流动性较为宽松的预期，未来一段时间机会较多。我仍然坚定看好大消费，包括食品饮料、零售、医药、旅游等行业，“十二五”期间，居民收入在GDP中的分配比例会得到提升，收入增速提高会带动消费品的支出；我也看好先进制造业，包括装备制造、新材料、精细化工等细分行业，这些行业会成长出一批在国际上有竞争优势的优秀企业。对于周期性行业，我相对谨慎，靠流动性推升的业绩与估值是具有极强的波动性，极难把握，未来要警惕宽松货币政策所带来的资产泡沫风险与通胀风险。

§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	11,345,186,027.40	89.52
	其中：股票	11,345,186,027.40	89.52
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	1,226,817,472.09	9.68
6	其他各项资产	101,404,996.17	0.80
7	合计	12,673,408,495.66	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	193,975,910.91	1.54
C	制造业	6,927,275,149.29	55.07
C0	食品、饮料	1,670,283,654.81	13.28
C1	纺织、服装、皮毛	623,338,336.61	4.95
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	51,194,920.70	0.41
C4	石油、化学、塑胶、塑料	375,022,006.17	2.98
C5	电子	155,160,840.59	1.23
C6	金属、非金属	65,596,961.84	0.52
C7	机械、设备、仪表	1,435,253,152.03	11.41
C8	医药、生物制品	2,402,096,019.54	19.09
C99	其他制造业	149,329,257.00	1.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	634,193,372.04	5.04
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	634,842,950.01	5.05
H	批发和零售贸易	1,796,401,708.60	14.28
I	金融、保险业	228,522,472.41	1.82
J	房地产业	537,697,442.16	4.27
K	社会服务业	115,930,190.21	0.92
L	传播与文化产业	159,733,123.29	1.27
M	综合类	116,613,708.48	0.93
	合计	11,345,186,027.40	90.18

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	002024	苏宁电器	37,552,777	599,717,848.69	4.77
2	002073	软控股份	22,734,688	477,655,794.88	3.80
3	600048	保利地产	37,953,942	469,110,723.12	3.73
4	601607	上海医药	18,714,510	418,269,298.50	3.32
5	000869	张 裕A	3,409,432	409,097,745.68	3.25
6	002304	洋河股份	1,843,257	377,849,252.43	3.00
7	600519	贵州茅台	2,124,308	358,434,488.84	2.85
8	002029	七 匹 狼	9,196,778	308,459,934.12	2.45
9	600690	青岛海尔	13,086,355	307,660,206.05	2.45
10	002154	报 喜 鸟	9,964,079	274,012,172.50	2.18

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	4,582,437.86
2	应收证券清算款	62,563,910.63
3	应收股利	-
4	应收利息	273,708.52
5	应收申购款	33,984,939.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,404,996.17

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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

§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	7,427,136,619.30
本报告期基金总申购份额	272,610,984.79
减：本报告期基金总赎回份额	327,602,093.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,372,145,511.07

§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策略优选混合型证券投资基金募集的文件；
2.《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》；
3.《广发策略优选混合型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.《广发策略优选混合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
二〇一〇年十月二十五日

广发沪深300指数证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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：二〇一〇年十月二十五日

§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10月22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7月1日起至9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	1,946,144,246.51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7月1日-2010年9月30日）
1.本期已实现收益	-17,093,688.56
2.本期利润	326,488,831.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.1637
4.期末基金资产净值	2,708,810,685.21
5.期末基金份额净值	1.392

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。

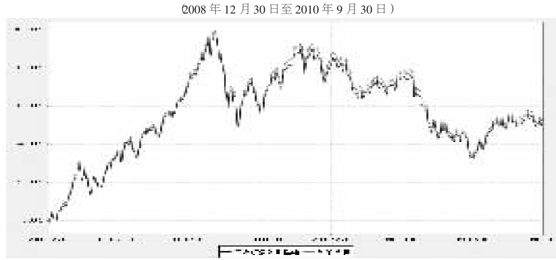
3.2 基金净值表现

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	13.73%	1.25%	13.81%	1.25%	-0.08%	0.00%

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9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 管理人对报告期内本基金运作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。

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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。

4.3.3 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

（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0.04%，符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

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，本基金季度末的成份股调整策略合理，较好的控制了该因素带来的误差；二是申购和赎回因素，本基金成立以来规模稳步增长，目前的规模水平下，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

截至本报告期末本基金份额净值为1.392元，本报告期基金份额净值增长率为13.73%，业绩比较基准收益率为13.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在2010年上半年，世界经济逐步复苏，以中国为代表的新兴市场表现突出，成为世界经济增长的主要力量。由于欧美政府对经济是否会再次衰退存在担心，再次量化宽松的刺激政策很可能出台，因此对投资者而言，市场环境会向好发展。在宽松的货币环境下，通胀预期持续存在，与资源相关的股票是合适的投资标的。同时，在经济基本面好转的情况下，与国民经济息息相关的重点公司盈利会逐步上升。沪深300成份股主要覆盖的是这两类公司，能够享受到经济复苏带来的投资收益，预计未来会有较大概率出现上行走势。

§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	2,578,472,003.18	94.87
	其中：股票	2,578,472,003.18	94.87
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	134,865,153.86	4.96
6	其他各项资产	4,633,684.74	0.17
7	合计	2,717,970,841.78	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	10,852,666.04	0.40
B	采掘业	284,486,297.50	10.50
C	制造业	859,365,534.58	31.72
C0	食品、饮料	137,412,617.72	5.07
C1	纺织、服装、皮毛	10,743,921.86	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,598,488.30	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	63,231,041.54	2.33
C5	电子	12,651,066.40	0.47
C6	金属、非金属	222,108,179.31	8.20
C7	机械、设备、仪表	299,847,780.42	11.07
C8	医药、生物制品	99,822,874.65	3.69
C99	其他制造业	9,949,564.38	0.37
D	电力、煤气及水的生产和供应业	82,589,634.13	3.05
E	建筑业	83,932,703.68	3.10
F	交通运输、仓储业	112,739,850.37	4.16
G	信息技术业	85,367,847.41	3.15
H	批发和零售贸易	78,544,689.44	2.90
I	金融、保险业	749,893,809.16	27.68
J	房地产业	140,854,755.35	5.20
K	社会服务业	24,383,166.93	0.90
L	传播与文化产业	5,141,438.50	0.19
M	综合类	60,319,610.09	2.03
	合计	2,578,472,003.18	95.19

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	7,675,216	99,394,047.20	3.67
2	601318	中国平安	1,755,728	92,860,453.92	3.43
3	601328	交通银行	10,879,286	63,099,858.80	2.33
4	600016	民生银行	11,836,548	60,366,394.80	2.23
5	600030	中信证券	4,865,528	51,769,217.92	1.91
6	601166	兴业银行	2,198,159	50,821,436.08	1.88
7	600000	浦发银行	3,609,227	46,775,581.92	1.73
8	000002	万 科A	5,072,744	42,611,049.60	1.57
9	601088	中国神华	1,728,379	40,807,028.19	1.51
10	601939	建设银行	8,073,575	37,138,445.00	1.37

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	655,209.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,301,032.65
4	应收利息	36,852.69
5	应收申购款	2,640,590.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,633,684.74

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

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限股票

§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	1,892,652,367.95
本报告期基金总申购份额	384,607,367.81
减：本报告期基金总赎回份额	331,115,489.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,946,144,246.51

§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
二〇一〇年十月二十五日

广发大盘成长混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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：二〇一〇年十月二十五日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发大盘成长混合	
基金主代码	270007	
交易代码	270007	270017
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年6月13日	
报告期末基金份额总额	14,137,653,487.09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，通过投资于成长性较好的大市值公司股票，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金通过“自下而上”为主的股票分析流程，以成长性分析为重点，对大市值公司的基本面进行科学、全面的考察，挖掘投资机会，构建股票投资组合；通过利率预测、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析进行债券投资；同时严格遵守有关权证投资的比例限制。	
业绩比较基准	75%＊沪深300指数+25%＊上证国债指数	
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（2010年7月1日-2010年9月30日）
1.本期已实现收益	29,300,884.93
2.本期利润	2,421,763,039.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1684
4.期末基金资产净值	13,154,892,091.71
5.期末基金份额净值	0.9305

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。

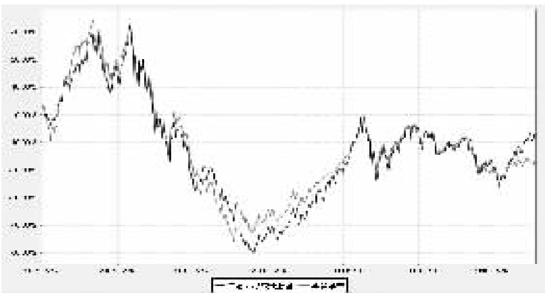
3.2 基金净值表现

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	22.06%	1.18%	11.10%	0.99%	10.96%	0.19%

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

广发大盘成长混合型证券投资基金
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
（2007年6月13日至2010年9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		
李琛	广发大盘成长混合基金的基金经理	2007-6-13	-	10	女，中国籍，经济学学士，持有证券业执业资格证书，2000年7月至2002年8月任职于广发证券公司，2002年8月至2007年6月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部中央交易室主管，2007年6月13日起任广发大盘成长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 管理人对报告期内本基金运作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、《广发大盘成长混合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。

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发聚富混合、广发稳健增长混合、广发策略优选混合和广发内需增长混合。报告期内，本投资组合与广发策略优选混合、广发稳健增长混合的净值增长率差异均未超过5%。报告期内，本基金净值增长率与广发聚富混合净值增长率差异为7.83%，主要原因是两基金在仓位配置方面存在一定差异所致。广发内需增长混合在本报告期仍处于建仓期，故不适宜进行业绩比较。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年三季度，宏观经济层面出现一个较为平稳的时期。经济增速出现见底回升的迹象，同时通胀也略有抬头。在实体经济上，价格上涨成了众多行业普遍现象。农产品价格和大宗商品价格都出现较大的上涨。同时房地产市场又重现涨价行情。本基金认为经济确实已经出现了良好的态势，但同时对于通胀也保持警惕，并认为政府将对通胀和资产价格泡沫有应对政策。因此本基金将组合集中在医药、消费、新兴产业等稳定成长类板块，并在三季度取得了良好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年三季度本基金收益率：22.06%，基准：11.1%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来，广发大盘认为，在目前整个世界经济格局比较混乱，货币体系乱战的格局下，汇率的波动将不断影响政策的决策和经济格局。但是货币不可能无限制的投放，通货膨胀始终是各国政府悬在头上的剑，并且如果经济逐步走出低谷，货币一定会逐渐收缩，只是时间的问题。因此对于未来的政策波动，也许以成长股的成长性去平抑是最好的选择。广发大盘将维持目前组合结构，采取精选个股的自下而上的方法，持续完善组合。

§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	11,602,139,156.70	87.24
	其中：股票	11,602,139,156.70	87.24
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	1,675,359,765.16	12.60
6	其他各项资产	22,111,792.26	0.17
7	合计	13,299,610,714.12	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	202,833,769.39	1.54
C	制造业	6,824,293,927.22	51.88
C0	食品、饮料	1,561,262,977.67	11.87
C1	纺织、服装、皮毛	303,612,628.16	2.31
C2	木材、家具	51,240,000.00	0.39
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	285,644,683.29	2.17
C5	电子	11,581,758.00	0.09
C6	金属、非金属	477,143,958.50	3.63
C7	机械、设备、仪表	1,994,468,254.57	15.16
C8	医药、生物制品	2,116,339,831.43	16.09
C99	其他制造业	22,999,835.60	0.17
D	电力、煤气及水的生产和供应业	70,871,993.28	0.54
E	建筑业	521,580,095.90	3.96
F	交通运输、仓储业	216,566,171.56	1.65
G	信息技术业	336,430,278.17	2.56
H	批发和零售贸易	1,831,244,929.65	13.92
I	金融、保险业	465,358,202.81	3.54
J	房地产业	457,077,670.96	3.47
K	社会服务业	245,796,738.06	1.87
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	430,085,379.70	3.27
	合计	11,602,139,156.70	88.20

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	002024	苏宁电器	50,000,000	798,500,000.00	6.07
2	600519	贵州茅台	2,450,000	413,388,500.00	3.14
3	601166	兴业银行	16,700,000	386,104,000.00	2.94
4	600690	青岛海尔	15,000,000	352,650,000.00	2.68
5	600970	中材国际	9,631,602	343,751,875.38	2.61
6	601607	上海医药	14,739,529	329,428,473.15	2.50
7	002073	青岛软控	15,000,000	315,150,000.00	2.40
8	002304	洋河股份	1,521,975	311,989,655.25	2.37
9	600256	广汇股份	8,000,000	250,480,000.00	1.90
10	000877	天山股份	8,600,000	235,984,000.00	1.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券投资。

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

本报告期末本基金未持有债券投资。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券投资。

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

本报告期末本基金未持有权证投资。

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	11,192,622.42
2	应收证券清算款	10,349,683.02
3	应收股利	-
4	应收利息	315,361.43
5	应收申购款	254,125.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,111,792.26

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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票不存在流通受限情况。

§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	14,498,901,905.24
本报告期基金总申购份额	16,283,809.43
减：本报告期基金总赎回份额	377,532,227.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,137,653,487.09

§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大盘成长混合型证券投资基金募集的文件；
2.《广发大盘成长混合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.《广发大盘成长混合型证券投资基金托管协议》；
5.《广发大盘成长混合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
二〇一〇年十月二十五日