广发聚富开放式证券投资基金 2010年年度报告摘要

基金管理人的前 别及连带的法律员 基金托管人中目 况、财务会计报告 基金管理人承诺	二〇一一年三月 董事会、董事保证 责任。本年度报告 国工商银行股份存 、投资组合报告等 以以该实合用、勤	本报告所 已经公司 (1000年) (1000年)	「载资料不存 力之二以上独 根据本基金 是证复核内容 的原则管理和	§1 重在虚假记载、设立董事签字同 会同规定,于20 不存在虚假记 运用基金资产	要提示 具导性陈述或重 意,并由董事长)11 年 3 月 25 「 载、误导性陈述 ,但不保证基金	大遗漏,并x 签发。 日复核了本持 或者重大遗 一定盈利。	対其内容的 设告中的则 漏。	真实性、准	主确性和完整性承 争值表现、利润分配 更新。
平1区市別日 201	10 平 1 月 1 口起	€表現。 E文,投资 至 2010 €	と近有风险。1 経者欲了解详 ∓12月31日		₹質供東則应付 集年度报告正文 :金簡介	细阅读本盘	並的招募1	兄明节及步	l·史新。
2.1 基金基本 基金简称	情况								广发聚富混合
占金主代码									270001
2.易代码					27000	1			270011
基金运作方式									契约型开放式
基金合同生效日 基金管理人								r** 40 :	2003年12月3日 協会管理有限公司
5金托管人 5金托管人									8行股份有限公司
设告期末基金份额	LO.80							5,	163,474,535.77 (/)
2.2 基金产品	说明								
免疫目标									资,在控制风险的
2 安策略			积极投资第 面,根据不 本面的基础	(略,在资产配) 同行业的发展; 出上挖捆价格尚	置层面,重视股! 前景进行行业债 未完全反映投	票资产和债: 化配置,在 资价值的潜	非资产的对 个股选择是 力股的投资	态平衡配 图,在深。 {机会。	置,在行业配置层 把握上市公司基
业绩比较基准					z益+20%×中信				
风险收益特征 23 基全管理	人和基金杆管人		本基金风险	2收益特征介于	成长基金与价	直基金之间:	适度风险	.较高收益	-
2.3 悬金官理			1	1金管理人			35	金托管人	
名称		广发基	金管理有限2			中国工商等			
	生名	段西军				赵会军			
	关系电话	020-898				010-66105			
1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年	1.子邮箱	7.0	inds.com.cn 28,020=8393	cooo		custody@icl 95588	be.com.cn		
5 M		020-898		3999		010-66105	798		
2.4 信息披露	方式								
登载基金年度报告	正文的管理人互	.联网网:	£		http://www.gff	unds.com.cn			
基金年度报告备置	地点				广州市海珠区		1号保利[国际广场南	塔 31-33 楼
3.1 主要会计	数据和财务指标	§3	主要兒	财务指标、基金	净值表现及利润	月分配情况			
		-							金额单位:人民币:
3.1.1 期间: 本期已实现收益	数据和指标	-	2010)#: 46.717.373.36	2	38,985,8			008年 1,640,957,147.67
14期已头现収益 14期利润				-88 , 156 , 049, 48		38,985,8			5.313.677.991.98
平别列四 加权平均基金份剩	F 大田 利 河	+		-0.0154			182.85		-0.8024
太阳基金份额净值				-0.0154			800%		-49 50%
7770232377407742	数据和指标		2010		20	09年末	KROO /L	20	08年末
明末可供分配基金				-0.1313		-(0.2110		-0.2220
明末基金资产净值	[6,6	64,861,828.18		7,787,031,6	534.06		5,493,823,815.03
明末基金份額净值				1.2908		1	1.3031		0.8171
校益加上本期公分 (3)期末可供分 (3) 基金海債	。财务指标不包括 收益指基金本期 论价值变动收益。 配利润采用期末 表现 争值增长率及其	资产负债	表中未分配	利润与未分配					期利润为本期已:
阶段	份額净值增长 ①	区 份额 柯	等值增长率 注准差②	业绩比较基准 益率③	收 业绩比较 率标准	基准收益 世差④	(I)-(i		2-4
过去三个月	5.199		1.16%	4.9		1.40%		0.25%	-0.24%
过去六个月 过去一年	20.169	_	1.06%	17.8		1.22%		2.36%	-0.16%
±去一年 +去=年	-0.949		1.06%	-8.4 -28.5	. ,	1.25%		7.53%	-0.19% -0.32%
1去二平 1去五年	-20.239 296.909	_	1.52%	-28.5 207.7	- 1-	1.73%		8.36%	-0.32% -0.23%
3 基金成立起至	393.529	_	1.37%	158.1		1.56%		35.39%	-0.19%
注-1. 业级比较	基准:80%中信制 注是根据基金合同 同生效以来基金	晋 300 扫 关于资	自数收益+20 产配置比例	%中信标普全信 的规定构建的。	所指数收益。	Dalla Makaba	Links Likks		

3.3 过 注:本	去三年基金的和 基金过去三年和	利润分配情况 尽进行利润分配。	§4	管理人报告	
4111	基金管理人及3 16金管理人及其	管理基金的经验	-		
券股份有	於管理人经中国 限公司、烽火通信 里人、QDⅡ、特定	证监会证监基金字 2003 91 信科技股份有限公司、香江投	号文批准,于 资有限公司、	2003年8月5日成立,注册资本1.2亿元人民币。公司的股东为广约 集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 资格。 格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决等	发证 业年
本基金	生人、VDII、行正 会管理人在董事 控制委员会和 I	17 个部□・综合管理部. 財务部	 人力资源; 	昭、监客楷核部、基金会计部、注册登记部、信日技术部、中央交易部	K. ⇔
外、北京分	研究发展部、投公司、广州分公	司 F海及公司和悉进子公司	设部、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。 注答理有關公司	办事
金、广发小	2010 年 12 月 31 盘成长股票型ii 台洞合型iii 寿持	日、本基金管理人管理十五 E券投资基金 (LOF)、广发货币 资基金 广安博福佛美刑证券	只井放式基5 市场基金、 投资基金	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 一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、 一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 一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	
47. 超大均匀10. g	更利证单扣容量	今 广告由证 500 指物证券团	送北冬 (百)		- Wat
4.1.2	医生性斑组合 医金经理 成基:	金经理小组)及基金经理助理的	的简介		
姓名	IE %	任本基金的基金经理(助 理)期限	证券从业	IO EFI	

姓名	职务	任本基金的基金经理(助 理)期限		证券从业	isà सम्ब	
		任职日期	高任日期			
王阿强	本基金的基金经理	2009-09-10	2010-12-30	8	9. 然於字報上,持有证券业执业证券,2002年7月至2004年1 月在职于华级基金管理有限公司,在2004年5月至2007年9月至2007年日 第十天近基金管理有限公司,在2006年4月19日至2007年9月至2007年2 月27日曾北京城傳統部各基金的基金經過2007年9月至2007年2 月至2007年2 日本五金管理有限公司,2009年9月10日至2010年12月3	
祝俭	本基金的基金经理	2010-12-31	-	4	男,经济学硕士,持有证券业执业证书,2005年7月至2007年7 月在广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员,2008年8 月至2010年5月任安低正理基金管理有限公司研究部行业研究的,2010年5月至今任职于广发基金管理有限公司,2010年 12月31日起任广发聚高混合基金的基金差型。	

4.2 官埋人对报告期内争恭觉运作理规寸信情优的规则
本报告期内,本基金管理人严格遵守《任券投资基金法》及其配套法规、《广发聚富开放式证券投资基金基金台同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用,勤勉尽贵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,无损害基金份额持
有人利益的行为。
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各选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公
司建立了严极的协资经权制度 协资和人权和左经权范围由司门自主击等 权计协资权阻的操作账单终计严极的审批程序 无态具计程由
中央交易解放服 附间优先 价格优先 比例分配 综合平衡 的原则 公平分配投资抗令 公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易 餡数型基金除外,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。
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
公司风险经制证期间通过技术交易系统和技术交易执行政方式的工作。 资、研究及交易等全流程的独立监察辖核、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稳健增长混合、广发策略优选混合、广发大盘成长混合和广发内需增长混合。报告期内、本基金与广发大盘成长混合的净值增长单差异未超过 5%。报告期内、本基金与广发稳健增长混合的差异为 7.52%,主要原因是上述
73、千金至一),久久至此人而古诗为"自古代土至界不知及","然后以古明","不参至一一),久久至此自由之不为,"江水","主安师位王至一所基金不合价配置方面存在一定差异所变,报告期内,本基金与广发策略优选混合的差异为 19.31%,主要原因是上本所基金不行业配置方
而存在一定差异所致,广发内需摘长混合在本报告期仍外于建仓期,放不活宜进行业输比较。
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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

44.1 报告期内基金投资销略和运行分析
2010,市场跌宕起伏。上半年,伴随房地产价格的快速上涨,新一轮的行业调控在时间和力度上都超过了市场的预期。A 股市场引来了
较大幅度的下跌。周期股跌幅居前。下半年,市场关注的焦点是经济转型和十二五规划,消费和新兴行业有较大的涨幅,成为市场的热点。10
较大幅度的下跌。周期股跌幅居前。下半年,市场关注的焦点是经济转型和十二五规划,消费和新兴行业有较大的涨幅,成为市场的热点。IC 月上旬,周期股大幅反弹,而在11月中旬,市场又大幅下跌,四季度维持震荡的格局。虽然周期股估值便宜,市场仍然对通货膨胀有很大的
國患,担心紧缩政策带来负面冲击。
本年度,基金的仓位和持股没有大的变动,保持相对稳定。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金本年度净值增长-0.94%,同期比较基准增长-8.47%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
至少在 2011 年上半年,通货膨胀问题仍然是困扰 A 股市场的主要矛盾。如果通货膨胀率持续维持在高位,甚至再创新高,关于结构和

全少在 2011 年上半年,迪贡膨胀问题仍然是困扰 A 胶市场的王要才值。如果迪贡膨胀率持续维持在高位,甚至再创新高,关于结构和
周期问题的讨论就没有意义。民生压力最终会迫使政府采取较为严厉的紧缩政策。
我们不认同通货膨胀带来加息,加息带来股市下跌的简单逻辑。因为按照这样的逻辑,如果不加息市场就应该上涨。我们的逻辑是,如
我们不认同通货膨胀带来加息,加息带来股市下跌的简单逻辑。因为按照这样的逻辑,如果不加息市场就应该上涨。我们的逻辑是,如 果通货膨胀长期处于高位,经济增长和物价上涨两种力量最终会消耗过多的流动性。这必然带来市场整体估值水平的不断下降。而加息仅
仅是结果,或者理解成无奈。
不管中间的过程如何曲折,政府已经把通货膨胀问题作为工作重点,同收流动性是必然之举。这就意味着,通货膨胀终归会在某个时点
不管中间的过程如何曲折,政府已经把通货膨胀问题作为工作重点,回收流动性是必然之举。这就意味着,通货膨胀终归会在某个时点得到控制,如果在今年下半年,通货膨胀有所回落,预计市场关注焦点将会转向新一轮经济周期的启动。与此相关的周期股将会有很好表
现。
同时,新一轮经济周期的新的推动力来自哪里,这个问题已经信得投资者认真思考。在地产和低端出口之外,中国经济体是否具备了一
同时,新一轮经济周期的新的推动力来自哪里,这个问题已经值得投资者认真思考。在地产和低端出口之外,中国经济体是否具备了一些新的行业,这些行业将会在未来的经济周期中引领经济增长。随着时间的推进,资本市场会挖掘出这些行业。我们会保持高敏感度,作好
准备、参与到这个过程、分享中国经济的成长。
准备、参与到这个过程、分享中国经济的成长。 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况
本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求、致力于内控机制的建立和完善、加强内部风险的控制
与防范、以保证各项法规和管理制度的落实、保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序、独立地开展监察稽核工
作。公司门园以及时是中海进入设计工程,以及公司工程,以为公司工程,以及公司工程,以及公司,以证证证,以证证,以证证,以证,以证证,以证证证,以证证证证,以证,以证证证证证,以证证证证证证

作。发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改,同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察辖核报告。本报告期 金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控、对投资证券的研究、决策和交易,以及会计核算和相关信息披露工作	内.3
金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控,对投资证券的研究、决策和交易,以及会计核算和相关信息披露工作	乍进行
了重点检查和合规性审核,确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则,保障了基金运作过程中的合法合规。	
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	
4.7 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	当的信
值方法, 经公司管理尼批准后方可实施, 估值零品全的成品包括, 公司分管投研, 估值的副总经理, 督察长, 投资管理部负责人, 研究先	分展音
负责人。金融工程部负责人。监察辖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,在发生了影响估值和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保和托管行标	直政領
和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保和托管行标	亥对一
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,确保信	占值的
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、确保信公允性、金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察指核部边贯定即对基金估值程序和方法进行核资。确保估值要员会约各条模似了效比方,以上所有相关人员具条款成的专业能力标准部分下少少规定经验。为除证基金估值的客观处证。基金经理不多分别	各项は
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	直的月
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	户悲る
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信息。	毒券品

類得以有效执行。以上所有相关人员具备较高跨专业能力和主富的行业从业经验。为修正基金的信的客观独立、基金发理不参与信值的具体混乱。但在专业对相关股话由的信有先久的情况。问时估查受人是胜量复加起说。各方不存在任何重大相益冲突,一切现建冲基金持有人地监力准则。本基金管理人已与中央国债金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间业市场交易的债券品种的估量规值。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 根据本基金台同中基金收益与分配"之"亡")基金收益分配原则"的相关规定,本基金本年末可供分配利润为-677.751,088.57,未进 行利润分配。
85 杆管人报告
5.1 报告期内本基在任管人通常学信情况明 200年,基金任管人对学发密开放汇率转投资基金的托管过程中,严格遵守。征券投资基金法)及其他法律法规和基金合同的 有关规定。不存在任何附紧基金份额持有人纠结的行为,完全规则是对地履行了基金信管人应规约文务。 5.2 托管人对报告期内本基金的准确学员。他由任事,利何允许请记的时间, 2.5 托管人对报告期内本基金的准确学员。他由任事,利何允许请记的时间,发家富开放式证券投资基金的投资运作。基金资产 净值计算。基金领加等现在证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发家富开放式证券投资基金的投资运作。基金资产 净值计算。基金领加等随时,是金管照书等问题上,不存在任何调度基金份额持有人利益的行为,在各里要方面的运作严格按 跟基金合即的规定设行。采用告期内,"发家置开放工证券投资基金来让行利的分配。 5.3 托尼人对本年度指告中的外信息与许可的资金,他确们是被发生进 5.3 托尼人对本年度指告中的外信息等的经济区域,他确们是被发生进 经营入股票,但是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是

86 审计报告	
3-	德师报 伸 字 (11)第 P0439 号
广发聚宣开放式证券投资基金全体持有人.	
广发聚富开放式证券投资基金全体持有人; 我们审计了后附的广发聚富开放式证券投资基金(以下简称"广发聚富混合"的财务报表。包括 2010	年 12 月 31 日的资产负债表。
2010 年度的利润表、所有者权益 儖金净值)受动表以及财务报表附注。	
6.1 管理层对财务报表的责任	
编制和公允列报财务报表是广发聚富混合的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任,这种责	任包括:(1)按照企业会计准则
和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映	(2)设计、执行和维护必要的内
部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	

62 注册会计师的房任 我们的房任在托厅审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注 册会计师由计准则要表现了遵守中国注册会计师职业资德等则,比划职执行由计工作以对财务报表是否不存在重大销售获取会预修证。 审计工作的发表审计程序,这就有实好务报表金额和按照等时止证据。基格的审计程序现实于建设全计师的房外,包括对由于解	
我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则。计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。	
册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。	Ė
	_
审计上作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于对	#
弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计	t
恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理 性,以及评价财务报表的总体列报。	1
性,以及评价财务报表的总体列报。	
我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
6.3 実計意见	

67 年申时久採車	
2011-03-2	25
德勤华永会计师事务所有限公司 注册会计师 胡小骏 洪锐 上海市延安东路 222 号外滩中心 30 k	22
	IFI
i关规定编制, 公允反映了广发聚富混合 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
我们认为,广发聚富混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作	约
6.3 审计意见	
我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
3当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理 F_DB PF体例 F 相声的 ck	-10
>当的审计程序 但目的禁非对内都控制的有效性分类管目 审计工作还句技证价管理已选用会计改策的恰当性和作业会计估计的会计	#

Maraba An Alaraha	§7 年度财务报表	
7.1 资产负债表 会计主体:广发聚富开放式证券投资基金		
报告截止日:2010年12月31日		
		单位:人民币
按 产	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	291,562,192.05	577,970,634.45
结算备付金	2,417,315.39	3,716,004.86
存出保证金	1,699,532.78	1,022,666.30
交易性金融资产	6,349,334,533.23	7,199,852,915.40
其中:股票投资	4,956,734,533.23	5,612,557,348.20
基金投资	-	_
债券投资	1,392,600,000.00	1,587,295,567.20
资产支持证券投资	-	_
衍生金融资产	-	_
买人返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	36,432,814.36	33,027,231.12
应收股利	-	-
应收申购款	1,049,193.86	31,199,169.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,682,495,581.67	7,846,788,622.00
负债和所有者权益	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
实出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	26,638,039.48
应付赎回款	4,105,454.33	18,573,060.52
应付管理人报酬	8,542,254.22	9,888,766.95
应付托管费	1,423,709.03	1,648,127.84
应付销售服务费	-	_
应付交易费用	2,207,841.51	2,117,370.07
应交税费	-	_
应付利息	_	-
应付利润	-	_
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,354,494.40	891,623.08
de dide de la l	19 (20 952 10	

本报告期:2010年1月1日至2010年12月3	1 🗆	单位:人民币
项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
一、收入	46,064,066.68	3,372,015,335.1
1.利息收入	52,800,718.33	49,840,484.6
其中:存款利息收入	4,099,172.34	3,907,099.1
债券利息收入	48,559,431.06	45,933,385.4
资产支持证券利息收入	=	
买人返售金融资产收人	142,114.93	
其他利息收入	-	
2.投资收益(损失以"-"填列)	527,545,315.95	126,304,283.6
其中:股票投资收益	496,208,100.82	65,826,596.3
基金投资收益	_	
债券投资收益	-3,417,002.71	16,945,895.4
资产支持证券投资收益	_	
衍生工具收益	-	
股利收益	34,754,217.84	43,531,791.7
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-534,873,422.84	3,194,563,236.9
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	
5.其他收入(损失以""号填列)	591,455.24	1,307,329.9
减:二、费用	134,220,116.16	138,466,252.2
1.管理人报酬	104,418,557.37	106,974,601.
2.托管费	17,403,092.85	17,829,100.
3.销售服务费	=	
4.交易费用	10,337,134.10	12,773,511.9
5.利息支出	1,626,214.64	450,132.9
其中:卖出回购金融资产支出	1,626,214.64	450,132.5
6.其他费用	435,117.20	438,906.0
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-88,156,049.48	3,233,549,082.8
减:所得税费用	-	
四、净利润(净亏损以"-"号填列	-88,156,049.48	3,233,549,082.8

		本期	单位:人民市
項目	2010年1月1日至2010年12月3		31 ⊞
	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)	5,975,974,166.53	1,811,057,467.53	7,787,031,634.0
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-88,156,049.48	-88,156,049.4
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)	-812,499,630.76	-221,514,125.64	-1,034,013,756.4
其中:1.基金申购款	508,776,042.41	109,511,934.42	618,287,976.8
2.基金赎回款	-1,321,275,673.17	-331,026,060.06	-1,652,301,733.2
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)	5,163,474,535.77	1,501,387,292.41	6,664,861,828.1
项目	上年 2009年1月1日		31 ⊞
	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)	6,723,231,214.61	-1,229,407,399.58	5,493,823,815.0
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利 润)	=	3,233,549,082.85	3,233,549,082.8
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)	-747,257,048.08	-193,084,215.74	-940,341,263.8
其中:1.基金申购款	1,059,358,453.43	79,345,297.61	1,138,703,751.0
2.基金赎回款	-1,806,615,501.51	-272,429,513.35	-2,079,045,014.8
四、本期向基金份額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)	5,975,974,166.53	1,811,057,467.53	7,787,031,634.0

报表附注为财务报表的组成部分。			
本报告 7.1 至 7.4,财务报表由下列负责人签署:			
本报告7.1至7.4.财务报表由下列负责人签署; 基金管理公司负责人:马庆泉,主管会计工作负责	贵人:林传辉,会计机构负责	人:张晓章 1.1 报表附注	
7.4.1 基金基本情况			
广发聚富开放式证券投资基金(本基金")经中[证券投资基金设立的批复]的批准,由广发基金管理	国证券监督管理委员会(中	国证监会")证监基金字 200	03 121 号文 供干同意广发聚富
证券投资基金设立的批复》的批准,由广发基金管理。	有限公司作为发起人,于 20	03 年 10 月 31 日向社会公:	F发行募集并于 2003 年 12 月 3
日正式成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份	不定,首次设立募集规模为:	3,131,907,040.29 份基金份	额。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。		
本基金募集期间为 2003 年 10 月 31 日至 2003 年	F 12 月 1 日,募集资金总额	ii为人民币 3.131.907.040 2	9 元,其中募集资金的银行存款
利息扣除认购费用为人民币 428,430.37 元,上述资金	业经深圳天健信德会计师	事务所验资。	
根据 中华人民共和国证券投资基金法》 (证券) 金合同"的有关规定,本基金的投资范围包括国内体	投资基金运作管理办法 》等 3	有关规定和《广发聚宫开放:	式证券投资基金基金合同》(集
金合同"的有关规定,本基金的投资范围包括国内依	、法公开发行的各类股票、债	券以及中国证监会允许基	金投资的其他金融工具。本基金
的业绩比较基准采用:80%×中信标普300指数收益+	20%×中信标普全债指数收	益。	

7.4.2 会计报表的辐制基础	
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	
本基金执行企业会计准则、基金合同、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告 2010 5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号《年度报告和半年度报告》》及中国证监会发布的关	
于基金行业实务操作的有关规定。	
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明	
本基金财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
7.4.4 重要会计改策和会计估计	

7.4.4 里安会计权或和会计估计
7.4.4.1 会计年度
7.4.4.1 会计年度 本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。
7.4.4.2 记帐本位币
7.4.4.2 记账本位币 本基金以人民币为记账本位币。

	(1)金融资产的分类
	根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的 资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资 住要为权证投
金	资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资 住要为权证投
资	其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。
	本基金持有的各类应收款项、买人返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应
収	则。
	②金融负债的分类
	根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将特有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

	其他金融色储包括各类应付款项。卖出回购金融资产款等。
	7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
	(I)以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产
	 股票投資
	买人股票于交易日按股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。
	因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价,于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本; 股票持有期间获得的股票股过活送红股和公积金转增股本 以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加
€	包括送红股和公积金转增股本 以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加
的	股票数量。

实出股票十交易日确认股票投资収益。实出股票按移动加权半均法结转成本。	
债券投资	
买人债券于交易日按债券的公允价值人账,相关交易费用直接计人当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买	美日
止的利息(作为应收利息单独核算)。 配售及认购新发行的分离交易可转换债券,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属引	干倍
券部分的成本	
买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利	削息
收入。	
卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。	

权证投资于交易日按公允价值人账,相关交易费用直接计人当期损益。	
获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。	
配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确	
定应归属于权证部分的成本。	
卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。	
2) 贷款及应收款项 _ 买人返售金融资产	
买人返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买人再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。	
可 1 近年夕勘咨产业内目目内支付款实际支付的公部价势 1 配 和关内目费用注 1 知经成本 可 1 近年夕勘咨产于近年日营业而今额	

头人 返售金融货产按父 易日应文行或头际文行的全部扩献人账,相天父易贺用计人创始成本。头人返售金融货产于返售日按账面余额
结转。
6) 其他金融负债
一、美出回购金融资产款 美出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买人票据、证券等金融资产所融入的资金。 卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买人票据、证券等金融资产所融入的资金。 卖出回购金融资产款于包购日按照面收或实际议到的金额人账、相关交易费用计人初始成本、卖出回购金融资产款于回购日按账面余
买出回购金融资产款为本品金按照回购协议元买出再按固定价格头人崇信、证券等金融资产所融入的资金。
卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额人账,相关交易费用计人初始成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余
黎产于。 第67年 4.5 全场资本和全场保健的任任阿刚

(1) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大
变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。
②)对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格
的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品
种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。
6) 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值目的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会
认为必要时,应采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。
具体投资品种的估值方法如下:
- 股票投资
六星底上市海通的股票以世往他日本证券六星底柱籍的收费价为从金价值

务的指导意见规定,若长期停降股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,经基金管理人估值委员会同	
意、可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素。如指数收益法)、调整最近交易市价、确定公允价值。	
由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资。按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公分价值。	
16/9公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公	
开发行有明确简定期的股票,于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。 非公开发行有明确简定期的股票,若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,以估值日	
事公开发行有明确镇定期的股票,若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收益价低于非公开发行股票的初始投资成本。以估值目	
证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值;若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按中国证监会相关规定处理。	
- 债券投资	
交易所 F 市实行净价交易的债券按估值 F 证券交易所 F 市的收费价为公会价值。交易所 F 市但未实行净价交易的债券按估值 F 收费	

交易所上市实行净价交易的惯券按估值日业券交易所上市的収益价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的惯券按估值日収益
价减去债券收益价中所含债券应收利息后的净价为公允价值。未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可
靠计量公允价值的情况下按成本估值。
全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。
同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别确定公允价值。
权证投资
交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。
关系中仁和光土(主的权证在(主为目前 亚甲什族壮主路会八厶从族 与什族壮主难以可靠让具 birt 含于让具

	配告及认购分离义勿当转换顺芬所状待的权证日头陈琳特日至往父勿所上印义勿削,米用怕直仅不明定公元所追。如怕直仅不难以当
靠	十量,则按成本计量。
	因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。 如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能
	如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能
反脑	央公允价值的价格。
	本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层
级。	公允价值的计量层级可分为:
	第1层级:同类资产或负债在活跃市场上 休经调整 的报价;
	第2层级:直接(比如取自价格)咸间接(比如根据价格推算的)可观察到的,除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值; 第3层级;以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。
	第3层级;以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销
当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以争额结算或同时变现该融资产和清偿该金融负债时、金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外、金融资产和金融负债在资产负
融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负
表内分别列示。不予相互抵销。
7.4.4.7 実験基金 かかを入る業績はたせん //weight-be-/-/から返こ中間 (株成 7.6元年刊 次原子) (1.4.4元日代 1.4.4元日 (1.4.4元日 (
实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认
7.4.4.8 损益平准金
损益平准金指申购、赎回、转人、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利分配 保分配利润 / 尼实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金分
力性。你力性的情况与大死的外来免职力任日日强逐步使用达尔·埃里斯里里进入为巨大的原理工作更要的不失免决理工作更要的展现工作更多。

7.4.4.8 损益平准金
描益平准金指申购、赎回、转人、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配、床分配利润。厂实现与未实现部分各自占基金净值的比例,描益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基
分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基
金申陷确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配 床分配利润)。
7.4.4.9 收入/ 假失)的确认和计量
- 利息收入
存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。
除贴息债外的债券利息收入在特有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的 个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率
个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率

	除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的 个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视信到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率
- /	(で) 2007 2007 2007 (大学 2007 2017 2017 2017 2017 2017 2017 2017
	A.所特忧后的伊徽,还自嘲认顺芬利忌収入。她总顺悦问到别一次注定争讨忌的附忌顺,依结共久行所、到别所和女行别既推算内否利羊
E	后 深口确认债券利自收入
71	21 C 6 C 6 C 6 C 6 C 7 C 6 C 6 C 7 C 6 C 6
	买人返售金融资产收入按买人返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率决逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用
1	今同利率计算确定利息收入。
F	11479-1-11 APANIAC TUZONA / Co
	投资収益
	机面机液旋补工六日口秒·赤山机面六日口的:含六百杯+6公六社社的机面机次:含于的单称(A)
	校术技术技术: - 大切日本子中校本大切日的成大型部门本库拉拉的校本技术成本的主题组织。
	股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息 偌有)后的差额确认。
	行生工具料密收益于水易日辨水易日的成水白蜡和除应结结的衍生工具料密成末后的美糖商品

	们生工具投资收益于父初日按父初日的成父忌额孔除应结转的们生工具投资成本后的差额明人。
	股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。
	— 公允价值变动收益
	公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产负债的公允价值变动形成的利得或损失确认。
相关	金融资产负债卖出或到期时转出计人投资收益。 74410费用的确认和计量
	7.4.4.10 费用的确认和计量
	本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率逐日计提。
	木基全的基全杆管费控前—日基全资产净值v0.25%的任费率深日计焊

	以公元价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计人交易费用。
	卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采
슴	同利率计算确定利息支出。.
- 1	7.4.4.11 基金的收益分配政策
	(1) 基金收益分配比例为基金净收益的 100%;
	② 基金收益分配方式分两种,现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转金份额进行再投资,若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,除下述情形外,在投资人选择现金分红时,不得将红利
怎.	金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;除下述情形外,在投资人选择现金分红时,不得将红利
役:	资;红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其
£	续费用时,基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。自动再投资的计算方法,依照《广

2)基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;除下述情形外,在投资人选择现金分红时,不得将红利
再投资;红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者目行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其
他手续费用时,基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。自动再投资的计算方法,依照《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定执行;
发基金管理有限公司 并放式基金业务规则 1的有关规定执行;
6) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多不超过6次。但若成立不满3个月可不进行收益分配,年
度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成;
4)基金当年收益先弥补基金上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;
 基金投资当期出现亏损,则基金当年不进行收益分配;
 基金收益分配后基金份额争值不能低于面值;
6) 毒一基金份额享有尚等分配权:"他们,

(8) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。
7.4.4.12 分部报告
根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础
制财务报表时的会计政策及计量基础一致。
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。
7.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。
本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。
2.452 * ## IT TO HER

金税收政策的通知》。财税 2005]102 号文 佚于股息红利个人所得税有关政策的通知》。财税 2005]103 号文 佚于股权分置试点税收政策问题的通知》。财税 2005]107 号文 佚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	改革
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
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外	印》及
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此	久人,
徽纳企业所得税。	
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繳20%的个人所得稅,上市公司在代扣代繳日	寸,减
%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繳20%的个人所得稅,暂不缴纳企业所得稅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%的稅率缴纳证券 股票 交易印花稅,受让方不再缴纳证券	
5、对于基金从事 A 股头卖,目 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,受让方不再缴纳证券	: (股別
易印花税。	

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
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的原子公司(2010年12月28日之前)、代销机构
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
香江投资有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东

7.94.8.1.1 (0.04.) (0.05)			金客	6单位:人民币元
关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金額	占当期股票成 交总额的比例	成交金額	占当期股票 成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	401,360,819.71	5.99%	2,789,120,383.57	34.81%
广发华福证券有限责任公司	148,608,373.91	2.22%	558,290,104.38	6.97%

2月	31 日		
	本基金本报告期内及上年度可比期间 7.4.8.1.3 债券交易	内无通过关联方交易单元进行的权证交易。	
		本期 2010年1月1日至2010年12月31日	2000∉ 1 ∄ 1

	hX X S	E 861	额	的比例	以父玉则		交总额的比例	
一发证券股份有限公司	1	18,321,714.40		9.67%	9.67% 448,156,0		064.40 40.68%	
7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金	È					金	额单位:人民币	
关联方名称		2010年 1	月1日	本期 至 2010 年 12	2月31日			
大联刀右桥	当期 佣金	占当期佣金5 比例	总量的	期末	应付佣金余额	占期を	k应付佣金总额 的比例	
"发证券股份有限公司	333,472.57		6.23%		-		-	
一发华福证券有限责任 公司	120,746.38		2.26%		-		-	
关联方名称		2009年 1	月1日	度可比期间 至 2009 年 12	2月31日			
大联刀右桥	当期 佣金	占当期佣金5 比例	总量的	期末	应付佣金余额	占期を	k应付佣金总额 的比例	
一发证券股份有限公司	2,327,747.74		34.69%		622,494.21		29.47%	
一发华福证券有限责任 公司	474,541.23		7.07%		-		-	
注 1:股票交易佣金的计提标 注 2:本基金与关联方交易统	准:支付佣金=股票成交 在正常业务范围内按一	金额*佣金比例 投商业条款订》	列-正管 子 子 子 子 子 子 子 子	费-经手费-约 */佃全thi//d	吉算风险金(含债券交》 5服务范围还有任佣会	易); ⊮r=r==	7.为本非今担借	

7.4.8.2 关联方报酬 7.4.8.2.1 基金管理费		单位:人民币:
项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	104,418,557.37	106,974,601.19
其中:支付销售机构的客户维护费	3,953,469.96	4,056,998.60

	H=Ex1.5%: 当年天数	
	H 为每日应计提的基金管理费 F 为前一日的基金管产单值	
	F. 为前一日的基金资产净值	
	基金管理费每日计据、按月支付、由基金管理人向基金杆管人发送基金管理费划付指令、基金杆管人复核后干次月首	二个工作日内从
- 3	基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。	
	74822基金杆管费	
		单位:人民币元

日州及生的垄亚应义\\的代官员	17,403,092.83	17,829,100.14
注:基金托管费按前一日的基金资产净值的	的 0.25%的牛费率计提。计算万法如下:	
H=E×0.25%÷当年天数		
H 为每日应计提的基金托管费		
E为前一日的基金资产净值		
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管	理人向基金托管人发送基金托管费划付指令。	,基金托管人复核后于次月首二个工作日内从
基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法5 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债	尾节版目、休息目等,支付日期顺延。	
7.4.8.3 与天联力进行银行间间业市场的惯	存	(A PORT AND III
本基金平板古期内及上牛皮可比期间内充	与关联交易对手进行银行间同业市场的债券	管凹胸 戾芴。
7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资	A HI 2014 A MARKETI	
本报告期内及上年度可比期间内基金管理	・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・	
平似古别内及上午及引几别用内靠面言注 2.4.6.4.5.4.2.4.5.4.5.4.5.4.5.4.5.4.5.4.5.4.5	E人尤运用回有页面IX页平盘面的同仇。	
7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其	大块力式)(() 本盘亚的同位 数数数数数数数数数数数	
本报告期末及上年度末无除基金管理人之 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当	(作) 共10人 以 () () () () () () () () () (
7.4.8.3 田大吹刀体目的銀门针织水碗风当	(例) 生时利忌収入	MA IDT

				单位:人民币元			
	本		上年度可				
关联方名称	2010年1月1日至	2010年12月31日	2009年1月1日至	2009年12月31日			
	期末余额	当期利息收入	期末余額	当期利息收入			
中国工商银行股份 有限公司	291,562,192.05	4,054,180.43	577,970,634.45	3,852,056.47			
注,本基金的银行竞争由基金社营人担电工商银行股份有限公司保管。接银行同业利率计显。 7.48.6 本基金在车间期内参与关联方面进步的情况。 本基金基保护则及上年度可比期间内飞在水镇铜的参与关联方承销的证券。 7.4.9 期末 2010 年 12 月 31 日 沐基金持有的流通受限证券 7.4.9.1 因从购新发增发证券而于期末持有的流通受限证券 金额单位,人民币元							

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券 代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
601377	兴业证券	2010-09- 29	2011-01-	网下新 股认购 流通受 限	10.00	16.20	755,747	7,557,470.00	12,243,101.40	-
601933	永辉超市	2010-12- 09	2011-03- 15	网下新 股认通受 限	23.98	31.24	14,839	355,839.22	463,570.36	-
600199	金种子酒	2010-12- 14	2011-12- 08	非公开 发行流 通受限	16.02	16.30	1,000,000	16,020,000.00	16,300,000.00	-
002488	金固股份	2010-10- 13	2011-01- 21	网下新 股认购 流通受 限	22.00	24.41	98,400	2,164,800.00	2,401,944.00	-
300127	银河磁体	2010-09- 27	2011-01-	网下新 股认购 流通受 限	18.00	27.90	51,501	927,018.00	1,436,877.90	-
300128	锦宫新村	2010-09- 27	2011-01-	网下新 股认购 流通受 限	35.00	47.19	46,540	1,628,900.00	2,196,222.60	-
300131	英唐智控	2010-10- 12	2011-01- 20	网下新 股认购 流通受 限	36.00	56.88	40,476	1,457,136.00	2,302,274.88	-
300134	大富科技	2010-10- 14	2011-01- 26	网下新 股认购 流通受 限	49.50	66.00	70,093	3,469,603.50	4,626,138.00	-
300142	沃森生物	2010-11- 03	2011-02- 14	网下新 股认购 流通受 限	95.00	133.20	21,616	2,053,520.00	2,879,251.20	-

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。
7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。
7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2010年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。
7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
* 北 今 本 担 生 助 山 子 張 甲 道 明 右 助 于 理 解 む 心 好 耐 久 収 主 的 甘 仲 車 所

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%
1	权益投资	4,956,734,533.23	74.1
	其中:股票	4,956,734,533.23	74.1
2	固定收益投资	1,392,600,000.00	20.8
	其中:债券	1,392,600,000.00	20.8
	资产支持证券	=	
3	金融衍生品投资	-	
4	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	=	
5	银行存款和结算备付金合计	293,979,507.44	4.4
6	其他各项资产	39,181,541.00	0.5
7	合计	6,682,495,581.67	100.0

A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	460,884,066.11	6.92
C	制造业	1,916,420,224.47	28.75
C0	食品、饮料	446,111,601.36	6.69
C1	纺织、服装、皮毛	41,735,526.48	0.63
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	284,500,736.40	4.27
C5	电子	67,646,987.82	1.01
C6	金属、非金属	350,955,919.37	5.27
C7	机械、设备、仪表	407,908,993.93	6.12
C8	医药、生物制品	295,131,407.85	4.43
C99	其他制造业	22,429,051.26	0.34
D	电力、煤气及水的生产和供应业	20,926,070.00	0.31
E	建筑业	32,707,002.40	0.49
F	交通运输、仓储业	17,939,955.15	0.27
G	信息技术业	206,095,110.98	3.09
Н	批发和零售贸易	926,662,521.87	13.90
I	金融、保险业	1,034,958,989.97	15.53
J	房地产业	196,873,963.28	2.95
K	社会服务业	82,228,021.00	1.23
L	传播与文化产业	5,956,823.40	0.09
M	综合类	55,081,784.60	0.83
	合计	4,956,734,533.23	74.37

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	600859	王府井	7,774,116.00	403,787,585.04	6.06
2	600000	浦发银行	29,120,000.00	360,796,800.00	5.41
3	600519	贵州茅台	1,509,954.00	277,710,739.68	4.17
4	000937	冀中能源	6,600,000.00	264,330,000.00	3.97
5	002024	苏宁电器	20,141,717.00	263,856,492.70	3.96
6	600016	民生银行	46,294,309.00	232,397,431.18	3.49
7	601318	中国平安	2,887,089.00	162,138,918.24	2.43
8	601009	南京银行	16,250,000.00	161,525,000.00	2.42
9	000792	盐湖钾肥	2,001,085.00	132,551,870.40	1.99
10	601699	潞安环能	1,999,985.00	119,279,105.40	1.79
注:投 8.4 8.4.1	资者欲了解本报 报告期内股票投 累计买人金额超	告期末基金投资的所 资组合的重大变动 出期初基金资产净值	有股票明细,应阅读登载于 2%或前 20 名的股票明细	www.gffunds.com.cn 的年度报告正文。	A derick (). I I I I I I I

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	白州初基亚贝广伊祖比例 (%)
1	600348	国阳新能	124,758,778.84	1.60
2	000568	泸州老客	90,289,181.44	1.16
3	601699	潞安环能	75,405,148.48	0.97
4	000338	維柴动力	74,834,865.80	0.96
5	000612	無作万方	74,650,237.41	0.96
6	000501	鄂武商 A	65,849,990.78	0.85
7	600036	招商银行	60,936,581.95	0.78
8	002073	软控股份	57,018,971.24	0.73
9	002457	青龙管业	52,835,586.36	0.68
10	600805	悦达投资	47,002,197.15	0.60
11	600068	葛洲坝	46,823,338.54	0.60
12	300091	金通灵	45,951,231.35	0.59
13	000789	江西水泥	40,113,263.24	0.52
14	002089	新海宜	37,515,502.98	0.48
15	600585	海螺水泥	35,820,635.00	0.46
16	600352	浙江龙盛	35,281,181.83	0.45
17	601918	国投新集	35,146,756.06	0.45
18	600489	中金黄金	35,049,026.48	0.45
19	000988	华工科技	33,700,621.45	0.43
20	601899	紫金矿业	33,478,255.56	0.43
注:本 场上主动的 人"均按买 8.4.2 \$	成下项8.4.2、8.4.3 卖出、换股、要约收 卖成交金额(成交单 计卖出金额超出期	的买人包括基金二级市场 购、发行人回购及行权等 2价乘以成交数量,填列, 初基金资产净值 2%或前	为上主动的买人、新飲、食服、(傳持股、換股及行权等获 成少的股票,此外, 哭人金觸"(截 买人股票成本") 不考慮相关交易费用。 20 名的股票明细	等的股票,实出主要指二数F 、

1	600519	贵州茅台	250,081,312.15	3.21
2	600252	中恒集团	212,360,610.98	2.73
3	600030	中信证券	198,526,222.53	2.55
4	600348	国阳新能	144,268,505.64	1.85
5	601318	中国平安	131,235,530.17	1.69
6	000338	潍柴动力	124,943,132.30	1.60
7	600529	山东药玻	116,175,610.21	1.49
8	600660	福耀玻璃	100,824,447.11	1.29
9	601088	中国神华	100,576,854.76	1.29
10	000999	华润三九	77,906,256.97	1.00
11	000826	桑德环境	75,837,481.15	0.97
12	601628	中国人寿	70,891,177.76	0.91
13	000825	太钢不锈	60,961,883.96	0.78
14	600978	宜华木业	55,435,913.18	0.71
15	600805	悦达投资	55,108,757.29	0.71
16	000877	天山股份	49,088,506.69	0.63
17	600585	海螺水泥	48,762,604.85	0.63
18	600631	百联股份	47,174,906.22	0.61
19	600820	隧道股份	41,354,960.11	0.53
20	002200	绿大地	41,353,009.60	0.53

8.4.3 买	人股票的成本总额及	卖出股票的收人总数	ij.			单位:人民币元		
人股票的	成本(成交)总额					3,115,307,476.26		
出股票的	收入(成交)总额					3,762,467,721.84		
8.5 期	末按债券品种分类的	的债券投资组合				金额单位:人民币元		
序号	佞	分品种			五個平位:八尺田八 占基金资产净值比例 (%)			
1	3:	家债券			25,000,000.00	0.38		
2	央	- 行票据			1,367,600,000.00	20.52		
3	金	e融债券			-			
	其中:西	发策性金融债			-			
4	û	业债券			-			
5	企业	短期融资券			-			
6	ī	可转债			-			
7		其他			-			
8		合计		1,392,600,000.00 20				
8.6 期	末按公允价值占基金	会资产净值比例大小	非名的前五名债	券投资明组		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	0801017	08央票 17	2	,500,000	250,300,000.0	3.76		
2	1001060	10央票 60	2	,300,000	224,733,000.0	3.37		
3	0801041	08央票 41	2	,000,000	200,680,000.0	3.01		
4	1001037	10央票 37	2	,000,000	196,180,000.0	2.94		
5	0801047	08央票 47		,000,000	100,390,000.0	1.51		
8.7 期 本基金型	末按公允价值占基金 报告期末未持有资	2资产净值比例大小 产支持证券。	非名的前十名资	产支持证务	F投资明细			

8.9.3 期牙	其他各项资产构成	单位:人民币
序号	名称	金額
1	存出保证金	1,699,532.7
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	36,432,814.3
5	应收申购款	1,049,193.8
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	습나	39,181,541.0
8.9.4 期末 本基金本 8.9.5 期末 木基金木	持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 前十名股票中存在流通受赎情况的说明 报告期末前十名职票由不左在流通受删情况	

	前十名股票中不存在流通受 i持有人户数及持有人结构	限情况 §9	基金份额持有	人信息					
9.1 別小部記式[7] 街	134日人厂奴奴34日人2010						份额单位:		
		持有人结构							
持有人户数(户) 户均持有的基金份额		机构投资者			个人投资者				
		持有份额		占总份额比例	1	持有份额	占总份額比例		
394,466	13,089.78		109,860,914.22	2.13%	5,0	053,613,621.55	97.87%		
9.2 期末基金管理	人的从业人员持有本开放式	(基金的	情况						
	项目		持有份	計額总数(份)		占基金:	总份额比例		
基金管理公司所有从	业人员持有本开放式基金			4	46,028.25 0.0009				
		§10	开放式基金位	分额变动		•	单位:		
基金合同生效日(2003	5年12月3日)基金份额总额	į					3,131,907,040.29		
本报告期期初基金份8	順总額				5,975,974,166.53				
本报告期基金总申购值	分額				508,776,042.41				
减:本报告期基金总赎				1,321,275,673.17					
本报告期基金拆分变	动份额						-		
本报告期期末基金份#	順总額						5,163,474,535.77		
		§1	1 重大事件	掲示					

11.1 基金份额持有人大会决议 本报告期内未召开基金份额持有人大会。	
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本报告期内、基金管理人无重大人事变动。经证监会审批、曼秋生任基金托管人资产托管部副总经理	
本报告期内,基金管理人无重大人事变动。经证监会审批,晏秋生任基金托管人资产托管部副总经理	£.
113 涉及基金管理人,基金财产,基金杆管业务的诉讼	
本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金杆管业务的诉讼事项。	
本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。 11.4 基金投资策略的改变	

	本报	告期内本記	基金投资	策略未发生	改变。									
				的会计师事务										
	为了	给基金提信	共更好的	支持和服务	本报告期	内,本基金改	(聘德勤华	5永会计师	[事务所有]	限公司负	贵本基金审 5务所有限2	计事务。	该事项经	本型
理	人並	事会审议	通过,已约	2基金托管/	人同意,并指	中国证监会	备案。从	2010 年志	 德勤华办 	:会计师項	¥务所有限2	司为本	基金提供'	申计
r. 7	本报台	与期,本基金	金应支付	德勤华永会	计师事务所	有限公司申	7计费 80,	000.00 元	。截至本报	告期末,i	亥事务所已	为本基金	提供审计	服
-														
	116	管理人. 才	千管 人 及	甘高级管理	人员巫蛇类	动外胃等标	57F2							

务。本报告期,本基金应支付德勤华永会计师事务所有限公司审计费 80,000.00 元。截至本报告期末,该事务所已为本年。	
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级营理人员受稽查或处罚的情况。 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7 1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况	
11.7 基金租用业券公司交易甲元的有关情况 11.7.1 基金租用业券公司交易甲元进行股票投资及佣金支付情况	全额单位、

		股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金額	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总 量的比例	
招商证券	3	764,961,633.98	11.41%	650,213.26	12.15%	新增
中航证券	1	564,174,173.40	8.42%	479,545.86	8.96%	新增
平安证券	3	492,234,217.73	7.34%	330,872.47	6.18%	新增
中信建投	3	483,815,585.06	7.22%	328,962.37	6.15%	新增
第一创业	1	478,316,584.71	7.14%	406,566.45	7.60%	
广发证券	6	401,360,819.71	5.99%	333,472.57	6.23%	新增
国都证券	1	381,511,050.57	5.69%	309,979.52	5.79%	
齐鲁证券	2	353,514,789.67	5.27%	287,654.88	5.38%	新增
安信证券	1	252,352,741.12	3.76%	214,497.95	4.01%	新增
中投证券	3	225,683,488.40	3.37%	191,099.99	3.57%	新增
华创证券	1	209,333,220.44	3.12%	177,932.45	3.33%	新增
东方证券	1	202,420,826.27	3.02%	164,469.00	3.07%	新增
长江证券	2	200,522,380.61	2.99%	162,925.66	3.05%	新增
国元证券	2	189,285,938.67	2.82%	115,937.90	2.17%	新增
申银万国	1	183,457,097.65	2.74%	155,935.84	2.91%	
广发华福	2	148,608,373.91	2.22%	120,746.38	2.26%	新增
国泰君安	4	146,634,817.18	2.19%	123,921.57	2.32%	新增
万联证券	1	143,126,909.48	2.14%	121,657.44	2.27%	新增
银河证券	2	140,089,654.48	2.09%	113,823.56	2.13%	新增
华融证券	1	113,911,384.14	1.70%	69,770.53	1.30%	新增
国海证券	1	108,058,788.51	1.61%	87,798.05	1.64%	
中金公司	2	106,149,545.99	1.58%	86,610.42	1.62%	新增
光大证券	3	99,691,951.16	1.49%	81,000.08	1.51%	新增
英大证券	1	84,880,252.03	1.27%	55,172.46	1.03%	新增
西部证券	1	76,927,374.59	1.15%	65,388.23	1.22%	新增
海通证券	2	52,382,381.92	0.78%	44,524.68	0.83%	新增
浙商证券	1	52,132,206.50	0.78%	31,930.99	0.60%	新增
兴业证券	2	43,308,574.05	0.65%	35,188.56	0.66%	新增
厦门证券	1	4,156,135.00	0.06%	2,545.64	0.05%	新增
北京高华	1	-	-	-	-	新增
德邦证券	1	-	-	-	-	新增
东北证券	1	-	-	-	-	新增
东海证券	1	-	-	1	-	
东吴证券	1	-	-	1	-	新增
东兴证券	1	-	-	-	-	新增
方正证券	1	-	-	1	-	
国金证券	1	-	-	-	-	新增
国联证券	1	-	-	-	-	新增
国盛证券	1	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	新增
宏源证券	1	-	-	1	-	新增
华安证券	1	-	-	-	-	新增
华宝证券	1	-	-	-	-	新增
华泰联合	3	-	-	-	-	新增
江海证券	1	-	-	-	-	新增
湘财证券	1	-	-	-	-	新增
信达证券	1	=	-	-	-	新增
中信证券	1	-	-	-	-	新增
	1	l				

	债券交易	5	回购交易		权证交易	
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	占当期回购 成交总额的 比例	成交金額	占当期权证 成交总额的 比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	48,161,112.00	25.41%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
第一创业	82,549,578.80	43.56%	-	-	-	-
广发证券	18,321,714.40	9.67%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	=	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	40,472,000.00	21.36%	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-