

十一、基金投资组合报告  
广发基金管理有限公司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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。  
基金托管人中国工商银行根据本基金基金合同规定,于2011年6月10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。  
本投资组合报告所载数据截至2011年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 3,382,634,733.53 | 87.40        |
|    | 其中:股票             | 3,382,634,733.53 | 87.40        |
| 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      | 434,747,590.91   | 11.23        |
| 6  | 其他各项资产            | 52,926,752.59    | 1.37         |
| 7  | 合计                | 3,870,309,077.03 | 100.00       |

| 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   | 采矿业            | 183,126,352.49   | 4.78         |
| C   | 制造业            | 2,040,715,761.11 | 53.29        |
| C0  | 食品、饮料          | 151,124,610.85   | 3.95         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | -                | -            |
| C2  | 木材、家具          | -                | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | 115,710,247.95   | 3.02         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 133,675,079.67   | 3.49         |
| C5  | 电子、电器、通讯       | 54,391,039.02    | 1.42         |
| C6  | 金属、非金属         | 270,541,431.95   | 7.06         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 1,065,013,657.50 | 27.81        |
| C8  | 医药、生物制品        | 250,259,694.17   | 6.53         |
| C99 | 其他制造业          | -                | -            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -                | -            |
| E   | 建筑业            | -                | -            |
| F   | 交通运输、仓储业       | -                | -            |
| G   | 信息技术业          | 191,845,968.95   | 5.01         |
| H   | 批发和零售贸易        | 269,813,769.63   | 7.05         |
| I   | 金融、保险业         | 140,868,772.33   | 3.68         |
| J   | 房地产业           | 438,662,107.72   | 11.45        |
| K   | 社会服务业          | 34,708,257.10    | 0.91         |
| L   | 传播与文化产业        | 59,525,744.20    | 1.55         |
| M   | 综合类            | 23,368,000.00    | 0.61         |
|     | 合计             | 3,382,634,733.53 | 88.33        |

| 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  | 600835 | 上海机电 | 13,825,070 | 186,223,492.90 | 4.86         |
| 2  | 000002 | 万科A  | 17,244,208 | 149,852,167.52 | 3.91         |
| 3  | 600557 | 粤传媒  | 8,265,515  | 126,311,758.90 | 3.29         |
| 4  | 002480 | 圣龙股份 | 1,833,841  | 118,356,098.14 | 3.09         |
| 5  | 300005 | 探路者  | 4,200,009  | 115,710,247.95 | 3.02         |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 2,346,638  | 104,660,054.80 | 2.73         |
| 7  | 600104 | 上海汽车 | 5,062,163  | 93,396,907.35  | 2.44         |
| 8  | 002013 | 中航精机 | 3,185,622  | 92,223,756.90  | 2.41         |
| 9  | 600376 | 普开股份 | 5,209,800  | 92,005,068.00  | 2.40         |
| 10 | 601699 | 潞安环能 | 1,044,406  | 91,720,771.80  | 2.39         |

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.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。  
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。  
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。

8.投资组合报告附注  
(一)会以上10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于参与发行 芜湖市中小企业2011年度第一期集合票据》的议案;该议案尚需提交股东大会审议。

(二)优化公司资产负债结构,拓宽融资渠道,降低公司融资成本,促进公司主营业务稳健快速增长,公司拟申请与发行 芜湖市中小企业2011年度第一期集合票据。

(三)中小企业集合票据是指2个(含)以上、10个(含)以下具有法人资格的企业,在银行间债券市场以统一产品设计、统一券种冠名、统一信用增进、统一发行注册方式共同发行的,约定在一定期限还本付息的债务融资工具。

中小企业集合票据具有以下特点:  
a.发行规模:单只集合票据的发行规模不超过10亿元,其中任一企业的融资规模最高不超过企业净资产的40%且总金额不超过2亿元。  
b.发行方式:由2家以上、10家以下的企业作为联合发行人,共同发行一只统一冠名、统一利率、统一担保的债券。

c.信用增进:中小企业信用评级较低,不能达到投资者要求,集合票据需要专业的担保机构进行信用增进。  
d.涉及及的中介机构:信用评级机构、会计师事务所、律师事务所、担保公司。

5.发行审批机构:银行间市场交易商协会。  
6.公司设计计划:  
a.发行规模:本次公司拟发行集合票据的规模为不超过人民币1.5亿元(含1.5亿元),且待偿还余额不超过公司净资产(扣除应付债券)的40%且总金额不超过2亿元。  
b.发行对象:本次发行的对象为全国银行间债券市场机构投资者。  
c.发行期限:本次发行集合票据的期限不超过3年(含3年)。  
d.募集资金用途:用于补充生产经营流动资金、置换部分银行贷款。

5.发行利率:本次拟发行集合票据的利率将按照市场情况确定,但不高于中国人民银行规定的同期银行贷款利率。  
6.发行方式:票据已在中国人民银行备案的金融机构承销发行。  
7.决议有效期:本次拟发行集合票据决议的有效期为自股东大会审议通过之日起24个月。

证券代码:002361 证券简称:神剑股份 编号:2011-022  
安徽神剑新材料股份有限公司  
第二届董事会第四次会议 临时 决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
安徽神剑新材料股份有限公司(以下简称“公司”)第二届董事会第四次会议,临时于2011年6月29日以传真或电子邮件方式通知全体董事,于2011年7月5日在公司四楼会议室,以通讯和现场会议方式召开。会议由董事长刘志坚先生主持,应参会董事10名,参与现场会议表决董事6名,通讯方式表决董事4名。会议在保障所有董事充分发表意见的前提下,以填写表决票方式对审议事项进行表决。本次会议的召集、召开和表决程序符合《公司法》、公司章程的有关规定。

经与会董事表决,通过如下决议:  
一、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于参与发行 芜湖市中小企业2011年度第一期集合票据》的议案;该议案尚需提交股东大会审议。

(二)优化公司资产负债结构,拓宽融资渠道,降低公司融资成本,促进公司主营业务稳健快速增长,公司拟申请与发行 芜湖市中小企业2011年度第一期集合票据。

(三)中小企业集合票据是指2个(含)以上、10个(含)以下具有法人资格的企业,在银行间债券市场以统一产品设计、统一券种冠名、统一信用增进、统一发行注册方式共同发行的,约定在一定期限还本付息的债务融资工具。

中小企业集合票据具有以下特点:  
a.发行规模:单只集合票据的发行规模不超过10亿元,其中任一企业的融资规模最高不超过企业净资产的40%且总金额不超过2亿元。  
b.发行方式:由2家以上、10家以下的企业作为联合发行人,共同发行一只统一冠名、统一利率、统一担保的债券。

c.信用增进:中小企业信用评级较低,不能达到投资者要求,集合票据需要专业的担保机构进行信用增进。  
d.涉及及的中介机构:信用评级机构、会计师事务所、律师事务所、担保公司。

5.发行审批机构:银行间市场交易商协会。  
6.公司设计计划:  
a.发行规模:本次公司拟发行集合票据的规模为不超过人民币1.5亿元(含1.5亿元),且待偿还余额不超过公司净资产(扣除应付债券)的40%且总金额不超过2亿元。  
b.发行对象:本次发行的对象为全国银行间债券市场机构投资者。  
c.发行期限:本次发行集合票据的期限不超过3年(含3年)。  
d.募集资金用途:用于补充生产经营流动资金、置换部分银行贷款。

5.发行利率:本次拟发行集合票据的利率将按照市场情况确定,但不高于中国人民银行规定的同期银行贷款利率。  
6.发行方式:票据已在中国人民银行备案的金融机构承销发行。  
7.决议有效期:本次拟发行集合票据决议的有效期为自股东大会审议通过之日起24个月。

二、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于提请股东大会授权董事会全权办理公司发行 芜湖市中小企业2011年度第一期集合票据事宜的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

三、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

四、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

五、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

六、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

七、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

八、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

九、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十一、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十二、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十三、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十四、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十五、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十六、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十七、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十八、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

十九、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

二十、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

二十一、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

二十二、会议以10票同意,0票反对,0票弃权的表决结果,审议通过了《关于修改 公司章程的议案》;该议案尚需提交股东大会审议。

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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

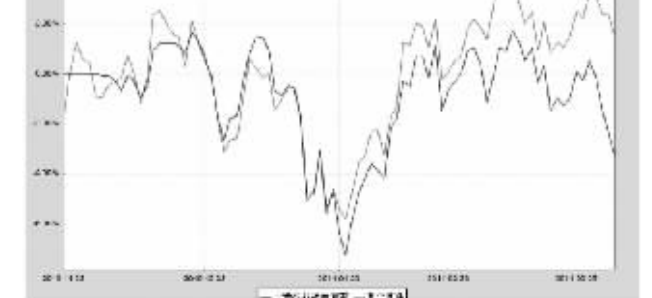
| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 600104 | 上海汽车 | 93,396,907.35  | 2.44         | 重大事项     |

十二、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2011年3月31日。

1. 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 阶段                   | 净值增长率① | 净值增长率② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率④ | ①-③    | ②-④ |
|----------------------|--------|--------|------------|------------|--------|-----|
| 2010.11.23-2011.1.31 | -3.30% | 0.99%  | 1.50%      | -4.80%     | -0.11% | -   |

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准对比图



4) 净值比较