

（上接C5版）
 客服电话:400-800-8899
 公司网站:www.cindasc.com
88 名称: 厦门证券有限公司
 注册地址:厦门市湖滨南路29号厦富大厦十七楼
 办公地址:厦门市莲前西路2号厦富大厦十七楼
 法定代表人:傅晓辉
 联系人:卢金文
 电话:(0592-5161642)
 传真:(0592-5161640)
 客服电话:(0592-5163588)
 公司网站:www.xmzq.com.cn
89 名称: 南京证券有限责任公司
 住所:江苏省南京市大钟亭8号
 法定代表人:张华东
 联系人:徐翔
 电话:(025-83367888-4201)
 传真:(025-83320066)
 客户服务热线:4008283888
 公司网站:www.njzq.com.cn
90 名称: 福建天福证券有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街8号
 办公地址:北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
 法定代表人:丁之刚
 联系人:陶海
 电话:(010-58568040)
 客服电话:(010-58568118)
 公司网站:www.hfsc.com.cn
91 名称: 浙商证券有限责任公司
 注册地址:杭州市上城区大新街1号
 办公地址:杭州市上城区大新街1号黄龙世纪广场A座6-7层
 法定代表人:吴承
 联系人:谢旗祥
 电话:(0571-87901053)
 传真:(0571-87901133)
 客服电话:(0571-96777)
 公司网站:www.stocke.com.cn
92 名称: 南京证券有限责任公司
 注册地址:南京市中环路江文路2号合国际大厦A幢6楼
 办公地址:南京市中环路江文路2号合国际大厦A幢6楼
 法定代表人:王珠林
 联系人:高建雄
 电话:(023-63786464)
 传真:(023-63786311)
 客服电话:4008-096-096
 公司网站:www.njzq.com.cn
93 名称: 信达证券股份有限公司
 注册地址:河北省石家庄市自强路35号
 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院9号
 法定代表人:高红
 联系人:刘亚静
 电话:(0311-66600693)
 传真:(0311-666006249)
 客服电话:400-612-8888
 公司网站:www.cindasc.com
94 名称: 日证证券有限公司
 注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号证大厦9楼
 办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号证大厦9楼
 法定代表人:况雨林
 电话:(0871-3577398)
 传真:(0871-3578827)
 公司网站:www.longteng.com
95 名称: 国金证券股份有限公司
 注册地址:成都市东城根上街95号
 办公地址:成都市东城根上街95号
 法定代表人:冉净怡
 联系人:冉净怡
 电话:(028-86690126)
 传真:(028-86690126)
 客服电话:400660109
 公司网站:www.gjzq.com.cn
96 名称: 中天证券股份有限公司
 注册地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
 办公地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
 法定代表人:李学涛
 联系人:袁嘉琦
 电话:(024-2326917)
 传真:(024-2325490)
 客服电话:400-6180-315
 公司网站:www.ztc.com.cn
97 名称: 联讯证券有限责任公司
 注册地址:广东省惠州市下埔路14号
 法定代表人:徐勇
 客服电话:400-8888-929
 联系人:丁宁
 电话:(010-64408820)
 传真:(010-64408252)
 公司网站:www.lunxun.com
98 名称: 新时代证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
 办公地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
 法定代表人:李琦
 联系人:孙旭
 联系电话:(400-8356149)
 客服电话:(400-698-9908)
 传真:(010-83561094)
 网址:www.xsdj.com.cn
99 名称: 日信证券有限责任公司
 注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
 办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
 法定代表人:孔佑杰
 联系人:陈志刚
 联系电话:(010-88086830-730) 010-88086830-737
 客服电话:(010-66412537)
 公司网站:www.rbxz.com.cn
 名称:广发基金管理有限公司
 注册地址:广东省珠海市横琴新区宝珠五路25号广发证券基金业务中心
 办公地址:广州市海珠区阅江中路68号保利国际广场南塔3-13楼

法定代表人:王志伟
 电话:(020-88991929)
 传真:(020-8899175)
 联系人:陈尔华
 电话:(020-88991929)
 传真:(020-8899175)
 联系人:程家
 电话:(020-88799345)
 传真:(020-88799335)
 经办律师:程家、章小波
 联系人:程家
 电话:(020)设计律师服务和511注册会计师
 名称:德勤华永会计师事务所有限公司
 办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
 法人代表:肖启耀
 联系人:胡小敏
 电话:(021-61418888)
 传真:(021-61350000)
 经办注册会计师:胡小敏、洪洪明

四、基金名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
 本基金为平衡型基金,依托快速发展的宏观经济和资本市场,通过基金管理人科学管理,审慎投资,在控制风险的基础上追求基金资产的长期增值。

七、基金的投资范围
 本基金投资标的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。
八、基金的投资策略
 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公司成长潜力的股票投资机会。

九、业绩比较基准
 80%×中债综合300指数收益+20%×中信标普综合指数收益

十、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。

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责任。

十二、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十三、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十四、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十五、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十六、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十七、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十八、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

十九、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十一、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十二、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十三、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十四、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十五、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十六、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十七、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十八、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

二十九、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十一、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十二、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十三、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十四、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十五、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十六、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十七、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十八、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

三十九、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

四十、基金投资组合报告
 截至2011年12月31日,本基金资产组合如下:
 1. 权益类资产: 3,196,876,878.53
 2. 固定收益类资产: 1,339,012,500.00
 3. 货币类资产: 492,101,138.19
 4. 其他资产: 204,638,442.78
 5. 其他负债: 23,571,090.12
 6. 合计: 5,256,200,049.58

H	批发和零售贸易	45,503,591.56	0.87
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	265,850,000.00	5.08
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化业	-	-
M	综合类	-	-
N	合计	3,196,876,878.53	61.10

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	002304	洋河股份	2,199,323	299,107,928.00	5.72
2	600123	兰花科创	6,000,000	259,200,000.00	4.97
3	002422	科伦药业	4,054,265	237,215,045.15	4.53
4	600809	山西汾酒	3,085,795	222,856,114.90	4.26
5	000895	双汇发展	3,321,530	215,900,750.00	4.13
6	000956	吉开资源	2,479,156	212,319,714.40	4.06
7	000858	五粮液	4,499,930	163,347,459.00	3.12
8	600448	保利地产	17,000,000	157,250,000.00	3.01
9	002431	棕榈园林	4,678,916	149,257,420.00	2.85
10	002293	罗莱家纺	1,777,287	147,514,821.00	2.82

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	25,062,500.00	0.48
2	央行票据	364,035,000.00	6.89
3	金融债券	349,915,000.00	6.69
4	其中:政策性金融债	349,915,000.00	6.69
5	企业债券	-	-
6	企业中期债券	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,339,012,500.00	25.59

序号	债券品种	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101051	11月05日 3,000,000	297,660,000.00	5.69
2	1201060	10月06日 2,300,000	224,940,000.00	4.30
3	080416	08年16日 2,000,000	200,020,000.00	3.82
4	1001037	10年03月 2,000,000	196,280,000.00	3.75
5	100226	10年02月 1,500,000	149,485,000.00	2.86

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,215,203.89
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	19,460,159.08
4	应收申购款	895,727.15
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	23,571,090.12

截至2011年9月30日,本基金未持有的处于转股期的可转换债券。
 截至2011年9月30日,本基金未持有权证。
 截至2011年9月30日,本基金未持有支持证券。
 截至2011年9月30日,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

十一、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