**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:二〇一二年三月二十九日**

# 广发策略优选混合型证券投资基金

## 2011 年度 报告摘要

**2011年12月31日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2012年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况,财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 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 | |
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 7,305,967,118.24份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 广发基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 段西军 | 赵会军 |
| | 联系电话 | 020-83936666 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | dxj@gffunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105828,020-83936999 | 95588 |
| 传真 | | 020-89899158 | 010-66105798 |

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址 | http://www.gffunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼 |

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2011年 | 2010年 | 2009年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 607,686,436.22 | 1,762,935,851.50 | 1,246,167,855.26 |
| 本期利润 | -2,945,537,458.36 | 2,050,903,863.24 | 5,744,737,179.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3984 | 0.2773 | 0.8040 |
| 本期加权平均净值利润率 | -28.05% | 17.61% | 50.51% |
| 本期基金份额净值增长率 | -24.41% | 18.37% | 70.7500% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011年末 | 2010年末 | 2009年末 |
| 期末可供分配利润 | 1,314,511,857.74 | 3,624,919,480.40 | 3,915,736,350.10 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1799 | 0.5127 | 0.5919 |
| 期末基金资产净值 | 8,620,478,975.98 | 13,057,355,374.31 | 12,489,595,639.64 |
| 期末基金份额净值 | 1.1799 | 1.8469 | 1.8880 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2011年末 | 2010年末 | 2009年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 153.69% | 235.61% | 183.56% |

注:①上述基金业绩指标不包括持有人认购或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(不含公允价值变动损益)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期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | -9.13% | 1.23% | -6.64% | 1.08% | -2.49% | 0.15% |
| 过去六个月 | -16.48% | 1.14% | -17.25% | 1.04% | 0.77% | 0.10% |
| 过去一年 | -24.41% | 1.13% | -19.52% | 0.98% | -4.89% | 0.15% |
| 过去三年 | 52.79% | 1.45% | 26.26% | 1.25% | 26.53% | 0.20% |
| 过去五年 | 74.25% | 1.75% | 17.86% | 1.62% | 56.39% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 153.69% | 1.67% | 62.58% | 1.57% | 91.11% | 0.10% |

注:1.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。

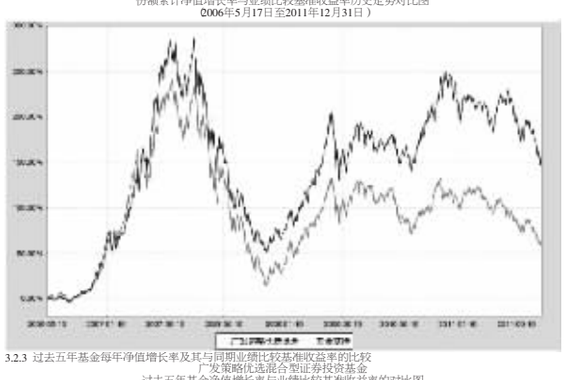
2.业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

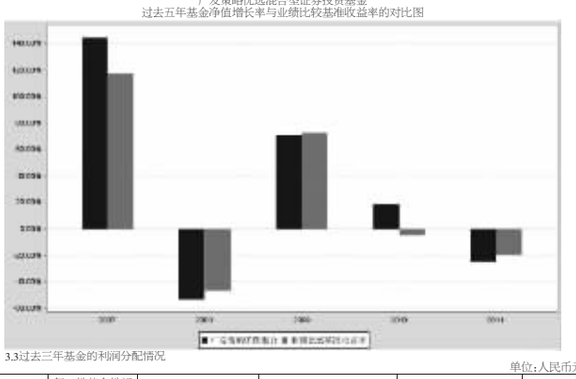
(2006年5月17日至2011年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发策略优选混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2011 | 2.600 | 509,667,102.21 | 1,324,686,723.49 | 1,834,353,825.70 | - |
| 2010 | 3.200 | 639,699,608.49 | 1,536,411,345.50 | 2,176,110,953.99 | - |
| 2009 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 5.800 | 1,149,366,710.70 | 2,861,098,068.99 | 4,010,464,779.69 | - |

### §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准,于2003年8月5日成立,注册资本1.2亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司具有企业年金投资管理人(QDII、特定资产管理业务资格和社保基金投资管理人资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和17个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、机构理财部、市场拓展部、国际业务部。此外,还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心和香港子公司(广发国际资产管理有限公司)。

截至2011年12月31日,本基金管理人管理二十一只开放式基金---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基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广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、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广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、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发和睿金球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金和广发制造业精选股票型证券投资基金,管理资产规模为983.80亿元。同时,公司还管理着多个企业年金基金、特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 冯永欢 | 本基金的基金经理 | 2008-02-14 | - | 8 | 男,中国籍,经济学硕士,持有证券执业资格证书。2004年2月28日至2007年3月28日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日至2010年12月30日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基金经理的"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 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。

监察稽核部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;监察稽核部稽核岗通过对投资、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、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、广发内需增长混合的净值增长率差异均未超过5%。报告期内,本投资组合与广发聚富混合、广发大盘成长混合的净值增长率差异分别为5.11%、14.58%,主要原因是本投资组合与上述投资组合在行业配置方面存在一定差异所致。

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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2011年,政策层面上,为了控制通胀和高房价,紧缩成为主基调,后果就是,一方面社会资金成本急剧高涨,而且持续时间较长;另一方面经济活力受压,不同行业在时间和幅度上有所差异,但几乎没有什么行业能幸免。第二季度后部分较敏感的周期性行业开始受到影响,第三季度后更多行业受到压制,第四季度消费品的增速也出现放缓。

与此相对应,2011年的股市令人失望,实际利率的上升打压了市场的估值水平,经济活力的下降使得投资者对上市公司未来的盈利预期不断下调。

回顾过去的一年,本基金虽减持了部分业绩低于预期的股票,但市场估值水平的下降幅度超出我的预期,对政策紧缩程度的错判造成基金净值表现欠佳。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2011年本基金净值下跌24.41%,同期基金基准下跌19.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就政策层面来说,今年的环境将比去年有所改善,财政政策偏积极、货币政策回归中性。就短期(未来几个月)来看,经济虽仍在下滑,但幅度比之前预期要低,GDP增速并不是很低,消费仍在稳健增长,而且社会资金成本下降明显,这是对市场运行最有利的因素。如果看得更长一点,经济转型压力依旧存在,旧有的经济增长模式存疑、新的增长极尚未出现,经济发展的持续性面临较大挑战。

在投资方向上,我仍然认为消费品行业受宏观经济影响的波动较小、今年的业绩增长较为确定,将带来稳定回报。

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,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稽核报告。本报告期内,基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

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,负责制定账下基金投资品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法,经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽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,在发生了影响估值政策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,并确保和托管行核对一致。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,确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查,确保估值委员会的各项决策得以有效执行。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的具体流程,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,一切以维护基金持有人利益为准则。本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中《基金收益与分配》之"七)基金收益分配原则"的相关规定,本基金本年度未进行利润分配,其中,本基金于2011年1月18日进行的分红,是对2010年的利润的分配,符合合同规定。

### §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年,本基金托管人在对广发策略优选混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年,广发策略优选混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发策略优选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,广发策略优选混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为1,834,353,825.70元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发策略优选混合型证券投资基金2011年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002081 | 金螳螂 | 52,935,000.00 | 0.61 | 非公开发行流通受限 |

### §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 274,028 | 26,661.39 | 548,307,358.27 | 7.50% | 6,757,659,759.97 | 92.50% |

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 | 持有份额总数(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 | 6,704,210.66 | 0.0918% |

### §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2006年5月17日)基金份额总额 | 18,417,976,676.64 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,069,990,796.35 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,003,931,327.83 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,767,955,005.94 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,305,967,118.24 |

### §11 重大事件揭示

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,基金管理人人事变动如下:

(一)董事长、法定代表人变更

因我司第三届董事会任期届满,原董事长马庆泉因年龄原因不再任职。2011年3月16日,经我司第四届董事会第一次会议审议通过,选举王志伟为广发基金管理有限公司董事长。在中国证监会核准王志伟的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后,该任职事项方正式生效。董事会授权公司副董事长、总经理林传辉在中国证监会核准拟任董事长的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项前,代为履行董事长职责。代为履行职责的时间不得超过90日,法律、行政法规另有规定的除外。

2011年6月15日,公司在指定信息披露媒体刊登了《基金行业高级管理人员变更公告》,披露因我司拟任董事长王志伟先生的高级管理人员任职资格尚处于报批阶段,在其高管任职资格获准前,继续由公司副董事长、总经理林传辉先生代为履行董事长职责。2011年7月19日,公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司王志伟基金行业高级管理人员任职资格的批复》(证监许可[2011]1119号)。中国证监会核准了王志伟的基金行业高级管理人员任职资格,并对王志伟任我司董事长无异议。自2011年7月19日起,王志伟正式履行董事长职务。

2011年8月5日,我司完成公司法定代表人变更的工商登记工作,公司法定代表人正式变更为现任董事长王志伟。

(二)聘任副总经理

2011年3月16日,经我司第四届董事会第一次会议审议通过,董事会新聘任易阳方担任我司副总经理。在中国证监会核准易阳方的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后,该任职事项方正式生效。

2011年8月11日,公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司易阳方基金行业高级管理人员任职资格的批复》(证监许可[2011]1267号),中国证监会核准了易阳方的基金行业高级管理人员任职资格,并对易阳方任公司副总经理无异议。

自2011年8月11日起,易阳方副总经理任职正式生效。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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,该事务所已为本基金提供审计服务2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、托管人及其高级管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

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 安信证券 | 4 | 854,390,119.70 | 6.13% | 584,735.17 | 5.64% | 新增3个 |
| 北京高华 | 1 | 34,961,951.79 | 0.25% | 29,717.81 | 0.29% | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | 811,338,542.04 | 5.82% | 527,372.52 | 5.09% | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | 649,090,717.71 | 4.66% | 421,911.37 | 4.07% | 新增1个 |
| 东兴证券 | 2 | 263,909,277.75 | 1.89% | 171,538.23 | 1.66% | 新增1个 |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 光大证券 | 3 | 664,797,392.27 | 4.77% | 565,074.98 | 5.45% | - |
| 华福证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 6 | 1,827,361,301.36 | 13.11% | 1,528,080.82 | 14.75% | - |
| 广州证券 | 1 | 182,225,782.76 | 1.31% | 111,613.60 | 1.08% | 新增1个 |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 4 | 1,646,331,463.61 | 11.81% | 1,337,653.21 | 12.91% | - |
| 国信证券 | 4 | 254,891,079.48 | 1.83% | 207,100.13 | 2.00% | 新增3个 |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | 708,480,930.18 | 5.08% | 602,206.49 | 5.81% | - |
| 红塔证券 | 1 | 1,274,593,481.33 | 9.15% | 780,692.33 | 7.53% | 新增1个 |
| 宏源证券 | 3 | 226,164,911.59 | 1.62% | 138,526.18 | 1.34% | 新增2个 |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | 560,772,220.33 | 4.02% | 476,655.17 | 4.60% | - |
| 华创证券 | 1 | 389,251,309.46 | 2.79% | 330,862.08 | 3.19% | - |
| 华融证券 | 1 | 199,627,087.66 | 1.43% | 122,272.30 | 1.18% | - |
| 华泰联合 | 4 | 261,332,622.59 | 1.88% | 212,333.60 | 2.05% | 新增3个 |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 1 | 83,175,868.65 | 0.60% | 54,063.65 | 0.52% | 新增1个 |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 平安证券 | 4 | 702,653,915.32 | 5.04% | 430,377.67 | 4.15% | 新增1个 |
| 齐鲁证券 | 3 | 66,776,762.62 | 0.48% | 56,760.28 | 0.55% | 新增1个 |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 申银万国 | 2 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 万联证券 | 1 | 22,499,680.95 | 0.16% | 19,124.75 | 0.18% | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 厦门证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 1 | 44,554,738.33 | 0.32% | 37,871.38 | 0.37% | 新增1个 |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | 159,644,796.51 | 1.15% | 97,782.33 | 0.94% | - |
| 银河证券 | 3 | 583,546,259.34 | 4.19% | 474,136.71 | 4.58% | 新增1个 |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 3 | 147,505,064.35 | 1.06% | 125,379.56 | 1.21% | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 3 | 77,345,853.21 | 0.55% | 65,743.70 | 0.63% | - |
| 中信建投 | 4 | 875,966,625.11 | 6.29% | 557,707.37 | 5.38% | 新增1个 |
| 中信证券 | 3 | 363,311,953.18 | 2.61% | 295,193.45 | 2.85% | 新增2个 |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 中原证券 | 2 | - | - | - | - | 新增1个 |

注:①交易席位选择标准:

(一)财务状况良好,在最近一年内无重大违规行为;

(二)经营行为规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(三)具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源,满足投资组合进行证券交易的需要;

(四)具有较强的研究官行业分析能力,能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;

(五)能积极为公司投资业务的开展,提供良好的信息交流和客户服务;

(六)能提供其他基金运作和管理所需的服务。

②交易席位选择流程:

1.对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。

2.协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 22,375,098.70 | 100.00% | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 厦门证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中原证券 | - | - | - | - | - | - |

**广发基金管理有限公司**
**二〇一二年三月二十九日**