广发聚丰股票型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

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:二〇一二年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 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。本半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8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发聚丰股票	
基金主代码	270005	
交易代码	270005	270015
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年12月23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	30,151,959,287.80份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。
投资策略	本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票,同时保持两类资产的适度均衡配置,构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%×新华富时A600指数+20%×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

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-1,000,421,571.76
本期利润	1,243,764,195.26
加权平均基金份额本期利润	0.0409
本期基金份额净值增长率	6.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0593
期末基金资产净值	19,596,190,711.85
期末基金份额净值	0.6499

注:(1)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。

(2)期末可供分配利润指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)所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。

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
过去一个月	-3.53%	0.91%	-4.78%	0.88%	1.25%	0.03%
过去三个月	4.10%	1.01%	1.06%	0.89%	3.04%	0.12%
过去六个月	6.65%	1.26%	4.89%	1.08%	1.76%	0.18%
过去一年	-17.64%	1.28%	-14.74%	1.09%	-2.90%	0.19%
过去三年	-9.86%	1.43%	-12.98%	1.25%	3.12%	0.18%
自基金合同生效起至今	292.21%	1.72%	149.33%	1.60%	142.88%	0.12%

注:1.业绩比较基准:80%×新华富时A600指数+20%×新华巴克莱资本中国全债指数。

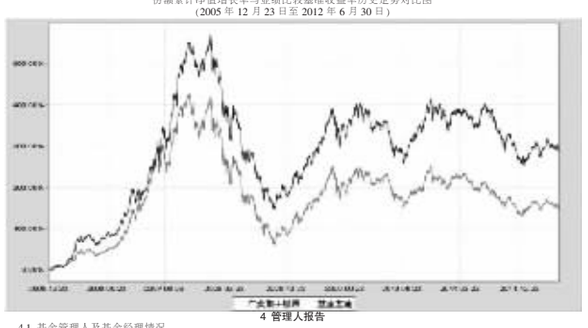
2.业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发聚丰股票型证券投资基金

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

(2005年12月23日至2012年6月30日)



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、佛山通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、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、北京、北京分公司、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2012年6月30日,本基金管理人管理二十四只开放式基金——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、广发策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、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金和广发消费品精选股票型证券投资基金,管理资产规模为1207.82亿元,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		
易阳方	本基金的基金经理;广发制造业精选股票基金的基金经理;公司副总经理,投资总监	2005-12-23	-	15	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,1997年1月至2002年11月任职于广发证券股份有限公司,2002年11月至2003年11月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员,2003年12月3日至2007年3月28日任广发聚富混合基金的基金经理,2005年5月13日至2011年1月5日任广发基金管理有限公司投资管理部总经理,2005年12月23日起任广发聚丰股票基金的基金经理,2006年9月4日至2008年4月16日任广发基金管理有限公司总经理助理,2008年4月17日起任广发基金管理有限公司副总经理,2011年9月20日起任广发制造业精选股票基金的基金经理。

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.基金经理助理的"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券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《证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚丰股票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,无损害基金份额持有人利益的行为,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,超过授权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。监察稽核部风险控制员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;稽核员通过对投资、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,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金,本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合曾发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%,发生反向交易的原因是其它被动型投资组合调仓以及其它特定客户资产管理组合调仓停止运作。

4.4管理人对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

上半年,全球经济特别是美国有一定程度改善但没有根本和明显改善,欧洲主权债务危机出现反复,危机开始蔓延和深化,西班牙和意大利危机开始暴露,欧盟采取了一系列措施,欧盟向统一的政治/银行/财政融合一体化迈进,这就能解决目前欧盟机制制度中根本缺陷,但是即能解决问题还需假以时日,包括中国在内的金砖国家受到外部需求不畅影响,各一金"成色下降,新兴国家经济增长速度快速下滑。

年初受美国经济好转和国内预期修正影响,市场风险偏好上升,国内资本市场一季度有所反弹。二季度,受到欧盟经济危机加剧以及本季度经济又有转下迹象影响,市场开始调整,本基金采取积极防御策略,减少非游制造业配置,清理与出口相关产业的配置,资金集中在内需方面,重点配置在消费领域。本期增加了食品、医药等稳定增长行业配置,减持或清除煤炭和建筑建材配置。金融行业面临反缩实业的境地,基差缩小,本基金清空了所有银行股,同时对商贸零售行业也降低了配置,主要原因是电商对行业利润的冲击以及相关租金成本大幅上涨对该行业利润冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期,本基金净值增长6.65%,比较基准增长4.89%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最近两个世纪,决定经济周期最重要两个因素是技术和人口,技术方面,技术领先的美国手机、互联网、宽带渗透率已经达到了90%,标志以宽带智能终端为代表的互联网技术周期已近尾声,须新的标志性技术才能带领经济走入新的一轮增长周期。人口方面,美国和中国都面临人口老化问题,人口红利消失,两个因素叠加,中美两国经济必然要在谷底徘徊,更何况中国本身还存在经济发展模式转型的问题,受此影响,本基金预计市场将存现窄幅震荡格局,震荡中存在一定的结构性行情,机会集中在内需领域,主要是消费领域与国家扶持的产业。

4.6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债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,本基金本期未可供分配利润为-1,787,396,742.98元。

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

2012年上半年,本基金托管人在对广发聚丰股票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

2012年上半年,广发聚丰股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发聚丰股票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,广发聚丰股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3托管人对本半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聚丰股票型证券投资基金2012年半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。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:广发聚丰股票型证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	1,522,783,031.34	1,620,065,823.14
结算备付金	6,798,640.52	2,617,905.77
存出保证金	7,333,105.21	8,812,648.53
交易性金融资产	15,244,629,620.58	16,309,218,310.60
其中:股票投资	14,225,210,620.58	15,261,409,329.50
基金投资	-	-
债券投资	1,019,419,000.00	1,047,808,981.10
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,780,597,241.39	660,501,390.75
应收证券清算款	51,507,379.69	-
应收利息	26,000,414.32	6,157,837.46
应收股利	-	-
应收申购款	2,328,830.98	1,717,957.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,641,978,264.03	18,609,091,873.56
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	31,131,959.24
应付赎回款	9,368,534.22	4,841,939.16
应付管理人报酬	24,488,492.23	24,467,589.20
应付托管费	4,081,415.40	4,077,931.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,621,187.01	5,221,506.93
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,227,923.32	1,303,791.91
负债合计	45,787,552.18	71,044,717.98
所有者权益:		
实收基金	6,660,645,601.41	6,719,796,909.48
未分配利润	12,935,545,110.44	11,818,250,246.10
所有者权益合计	19,596,190,711.85	18,538,047,155.58
负债和所有者权益总计	19,641,978,264.03	18,609,091,873.56

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.6499元,基金份额总额30,151,959,287.80份。

6.2 利润表

会计主体:广发聚丰股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	1,429,100,418.40	-166,344,107.03
1.利息收入	38,226,382.84	9,590,299.07
其中:存款利息收入	8,952,018.89	8,136,143.76
债券利息收入	21,382,110.38	583.35
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,892,253.57	1,453,571.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-853,487,229.27	307,298,559.89
其中:股票投资收益	-966,701,293.25	172,628,606.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	401,523.61	213,862.73
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	112,812,540.37	134,456,090.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,244,185,767.02	-483,662,735.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	175,497.81	429,769.57
减:二、费用	185,336,223.14	237,552,920.38
1.管理人报酬	146,687,281.18	183,808,963.55
2.托管费	24,447,880.28	30,634,827.33
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	13,973,513.58	22,884,407.82
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	227,548.10	224,721.68
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,243,764,195.26	-403,897,027.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,243,764,195.26	-403,897,027.41

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发聚丰股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	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)	6,719,796,909.48	11,818,250,246.10	18,538,047,155.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,243,764,195.26	1,243,764,195.26
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)	-59,151,308.07	-126,469,330.92	-185,620,638.99
其中:1.基金申购款	173,786,252.70	332,061,141.50	505,847,394.20
2.基金赎回款	-232,937,560.77	-458,530,472.42	-691,468,033.19
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)	6,660,645,601.41	12,935,545,110.44	19,596,190,711.85

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	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)	7,220,987,523.64	18,994,478,619.59	26,215,466,143.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-403,897,027.41	-403,897,027.41
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)	-404,679,445.85	-1,057,875,434.05	-1,462,554,879.90
其中:1.基金申购款	186,475,801.32	472,865,336.91	659,341,138.23
2.基金赎回款	-591,155,247.17	-1,530,740,770.96	-2,121,896,018.13
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)	6,816,308,077.79	17,532,706,158.13	24,349,014,235.92

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:王志伟,主管会计工作负责人:林传辉,会计机构负责人:张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发聚丰股票型证券投资基金("本基金")经证监基金字[2005]180号文《关于同意广发聚丰股票型证券投资基金募集的批复》批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2005年12月23日募集成立,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,本基金已向中国证券监督管理委员会("中国证监会")备案,并获中国证监会基金部函[2005]293号《关于广发聚丰股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2005年11月21日至2005年12月21日,本基金为契约型开放式股票型基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币1,315,856,024.96元,有效认购户数为15,026户,其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币175,370.72元,利息结转的基金份额175,370.72份,按照基金合同的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资,基金合同于2005年12月23日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,315,856,024.96份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和基金合同的有关约定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金于2007年9月4日宣告对截至2007年9月11日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的基金份额,根据折分比例实施拆分,拆分日为2007年9月11日,按照1:4.526975258的拆分比例进行了基金份额拆分,拆分后基金份额净值变更为1.0000元,相应地,基金份额持有人原来每1份基金份额拆分后为4.526975258份,基金份额拆分后,基金份额总数与持有人持有的基金份额数均相应调整,但调整后持有人持有的基金份额占基金份额总数的比例不发生变化,基金份额拆分对持有人的权益无实质性影响,本基金的业绩比较基准采用:80%×新华富时A600指数+20%×新华巴克莱资本中国全债指数。

本基金的财务报表于2012年8月24日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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。

6.4.3 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2012年06月30日的财务状况以及2012年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关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、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》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知》及其他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收入,暂不缴纳企业所得税。

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缴20%的个人所得税,上市公司在代扣代缴时,减按50%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缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

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%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	506,593,304.85	5.80%	2,354,904,359.95	15.64%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	130,081,101.70	25.33%	-	-

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	421,569.18	6.15%	241,166.84	3.65%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	2,001,669.37	16.64%	1,308,925.93	17.60%

注:1.股票交易佣金的计提标准:支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)。

2.本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3.本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,687,281.18	183,808,963.55
其中:支付销售机构的客户维护费	23,312,981.03	29,085,870.93

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,447,880.28	30,634,827.33

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算方法如下:

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	142,114,249.52	282,114,249.52
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	140,000,000.00
期末持有的基金份额	142,114,249.52	142,114,249.52
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%	0.46%

注:基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,522,783,031.34	8,912,530.44	1,786,884,496.23	8,025,194.42

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 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中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1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
2,320,788	12,992.12	66,646,255.83	0.22%	30,085,313,031.97	99.78%

8.2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	1,774,056.47	0.0059%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上;

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上。

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2005年12月23日)基金份额总额	1,315,856,024.96
本报告期期初基金份额总额	30,419,729,844.40
本报告期基金总申购份额	786,716,178.64
减:本报告期基金总赎回份额	1,054,486,735.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,151,959,287.80

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、基金托管人的专门托管业务部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内,因业务发展需要,广发基金管理有限公司第四届董事会第九次会议通过关于聘请2012年度基金审计机构的议案,本基金改聘深圳市鹏城会计师事务所有限公司负责本基金审计事务;因深圳市鹏城会计师事务所有限公司广州分公司已整体并入天健会计师事务所(特殊普通合伙),2012年8月,本基金改聘天健会计师事务所(特殊普通合伙)负责本基金审计事务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
申银万国	2	1,386,030,883.34	15.87%	1,188,556.02	17.35%	-
东北证券	1	1,003,343,984.67	11.48%	682,400.88	9.96%	-
中信建投	4	937,591,077.39	10.73%	780,466.84	11.39%	-
中信证券	3	649,065,