广发大盘成长混合型证券投资基金招募说明书【更新】摘要

(上接C39版)

公司网站:www.hongtazq.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:冉云
联系人:金喆
电话:028-86690126
传真:028-86690126
客服电话:4006600109
公司网站:www.gjzq.com.cn
(96)名称:中天证券有限责任公司
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:李学琦
联系人:袁劲松
电话:024-23266917
传真:024-23257490
客服电话:400-6180-315
公司网站:www.stockren.com
(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:徐刚
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.lxzq.com.cn
(98)名称:新时代证券有限责任公司
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
法人代表:马金声
联络人:孙恺
联系电话:010-83561149
客服电话:400-698-9898
传真:010-83561094
网址:www.xsdzq.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:陈韦杉
联系电话:010-88086830-730 010-88086830-737
传真:010-66412537
客服电话:010-88086830
公司网址:www.rxzq.com.cn
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
法定代表人:王志伟
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师集团(广州)事务所
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:程秉、李彩霞
联系人:程秉
四、审计基金资产的会计师事务所
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:卢伯卿
联系人:胡小骏
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏、洪锐明

四、基金的名称

广发大盘成长混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式混合型基金

六、基金的投资目标

依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过投资于成长性较好的大市值公司股票,追求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的配置比例为30%-95%,债券资产的配置比例为0-70%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略
本基金各类资产的投资比例范围根据本基金的投资理念和投资方针决定,股票资产的配置比例为30%-95%,债券资产的配置比例为0-70%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
如果有关法律法规许可,本基金资产配置比例可作相应调整,股票资产投资比例可达到有关法律法规规定的最高上限及最低下限。
在既定的经济变量下,投资组合的期望收益和方差为:

[illegible]

本基金将对此模型计算出来的最优比重根据实际情况作出适当调整后在前述资产配置范围内确定基金的大类资产配置比例。
(二)股票投资策略
本基金的股票投资策略是大市值成长导向型。在股票投资方法上,通过"自下而上"为主的股票分析流程,以成长性分析为重点,对大市值公司的基本面进行科学、全面的考察,挖掘投资机会。
本基金的股票库包括一级库和二级库。
1.一级库构建:一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围,入选条件主要是根据广发企业价值评估体系,通过研究、筛选出基本面良好的股票进入一级库。
2.二级库的构建:主要投资于大市值公司是本基金股票投资策略的一个重要特点。
本基金将80%以上的股票资产投资于大盘成长类股票。其中,大盘股定义如下:A股按总市值从大到小排序,位于市场中位数之前或者行业三分之一以前的股票为大盘股。(行业分类按证监会颁布的《上市公司行业分类指引》确定,其中制造行业按子行业进行计算)。在此期间对于未纳入最近一次排序范围内的股票(如新股、恢复上市股票等),本基金参照上述规则决定是否属于大盘股。基金因所持有股票价格的变化而导致大盘股投资比例低于上述规定的不在限制之内,但基金管理人应在合理期限内进行调整,最长不超过6个月。未来,随股票市场发展和个股市值差异的变化,基金管理人可在保持大盘风格的前提下适当调整大盘股定义标准,并及时公告。
接下来,本基金将通过定性与定量相结合的分析方法进一步选出成长性较好的大市值公司股票建立二级股票库。二级库是基金经理小组进行股票投资的范围。
(1)定量选股指标:主指标为预期主营业务收入增长率,辅助指标为预期主营业务利润率
本基金管理人认为,公司的成长性最终需要体现在利润的增长上,因此本基金将成长性定位于主营业务利润增长率。主营业务利润取决于主营业务收入和主营业务利润率。当主营业务利润率保持稳定的时候,主营业务利润成长主要来自于主营业务收入的增长,当主营业务收入比较稳定的时候,主营业务利润的成长主要来自于主营业务利润率的提高。真实的、可持续的利润增长既要有主营业务收入的增长,还要有合适的主营业务利润率。因此本基金将预期主营业务收入增长率作为本基金成长性考察的主指标,而将预期主营业务利润率作为辅助指标。
(2)定性分析
定量的选股指标为股票选择提供了一个简洁、客观、可操作性强的遴选平台,但是科学的投资需要在这基础上对上市公司继续进行全方位的分析。
◇公司的研究能力和新产品推出能力,重点考察有效研发费用投入比率。
◇公司的融资政策对公司经营业绩有着深远的影响,公司的分红政策、财务杠杆是否合理及发展趋势。
◇公司在行业内的地位变化,竞争能力变化趋势,竞争对手的竞争策略,公司的应对策略。
◇公司产品市场占有率的变动趋势,包括广告在内的营销策略是否科学合理。
◇公司成本控制能力是否增强,毛利率的变动趋势。
◇管理层的进取心和经营规划,管理层的团结度及经营能力。
(3)估值
本基金将综合运用PE、PB、PEG等相对估值方法与股利折现模型、自由现金流折现模型等绝对估值方法对股票进行估值,从而确定合理的投资评级。

(三)债券投资策略
在债券投资上,坚持稳健投资的原则,控制债券投资风险。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。
本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险。尤其是在预期利率上升的时候,严格控制,保持债券投资组合较小的久期,降低债券投资风险。
(四)权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。根据有关规定,本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制:
1.本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
2.本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之三。
3.本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。
若法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,不受上述条款限制。
(五)投资决策依据和决策程序
1.决策依据
以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。
2.决策程序
(1)投资决策委员会制定整体投资战略;
(2)研究发展部根据自身或者其他研究机构的研究成果,构建股票备选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股、债券投资决策支持;
(3)基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,在研究部门研究报告的指引下,结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、行业配置、重仓个股投资方案;
(4)投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要;
(5)根据决策纪要基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易室执行;
(6)中央交易室按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组;
(7)金融工程小组定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案;
(8)风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;金融工程小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

九、业绩比较基准

75%* 沪深300指数+25%*上证国债指数

十、风险收益特征

较高风险,较高收益

十一、投资组合报告

本基金管理人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。
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1月5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9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
(一)期末基金资产配置组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,921,539,424.63	92.77
	其中:股票	7,921,539,424.63	92.77
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	594,741,806.69	6.97
6	其他各项资产	22,169,343.67	0.26
7	合计	8,538,450,574.99	100.00

(二)期末按行业分类的股票投资组合

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	38,052,534.54	0.45
B	采掘业	1,111,556,936.74	13.05
C	制造业	6,171,511,841.26	72.44
C0	食品、饮料	846,080,789.55	9.93
C1	纺织、服装、皮毛	155,605,825.47	1.83
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	328,918,011.40	3.86
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	3,477,118,477.51	40.81
C7	机械、设备、仪表	1,288,488,737.33	15.12
C8	医药、生物制品	75,300,000.00	0.88
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	45,352,302.58	0.53
E	建筑业	153,093,849.70	1.80
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	60,054,947.42	0.70
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	247,000.00	0.00
M	综合类	341,670,012.39	4.01
	合计	7,921,539,424.63	92.98

(三)期末基金投资前十名股票明细

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	000800	一汽轿车	38,050,000	435,292,000.00	5.11
2	600519	贵州茅台	2,200,000	419,298,000.00	4.92
3	600585	海螺水泥	22,699,936	390,438,899.20	4.58
4	600362	江西铜业	14,599,757	389,813,511.90	4.58
5	601168	西部矿业	30,009,669	372,119,895.60	4.37
6	600157	永泰能源	23,579,711	341,670,012.39	4.01
7	000630	铜陵有色	16,999,801	330,646,129.45	3.88
8	000877	天山股份	14,104,956	325,260,285.36	3.82
9	000527	美的电器	20,999,726	309,535,961.24	3.63
10	000960	锡业股份	12,650,329	299,812,797.30	3.52

(四)按券种分类的债券投资组合
本报告期末本基金未持有债券投资。
(五)债券投资前五名组合
本报告期末本基金未持有债券投资。
(六)投资组合报告附注
1.本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。
2.报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
3.本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
4.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,744,462.52
2	应收证券清算款	14,097,598.40
3	应收股利	-
4	应收利息	110,696.75
5	应收申购款	1,216,586.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,169,343.67

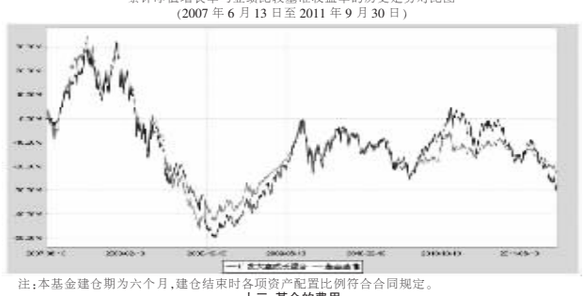
5.本基金期末未持有处于转股期的可转换债券。
6.本报告期内本基金未主动或被动持有权证投资。
7.本报告期末基金未持有资产支持证券。
8. 本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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9月30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)
2011.1.1-2011.9.30	-28.33%	1.48%	-12.42%	0.95%	-15.91%	0.53%
2010.1.1-2010.12.31	3.66%	1.40%	-8.58%	1.19%	12.24%	0.21%
2009.1.1-2009.12.31	70.93%	1.80%	72.75%	1.59%	-1.82%	0.21%
2008.1.1-2008.12.31	-54.63%	2.17%	-47.11%	2.27%	-7.52%	-0.10%
2007.6.13-2007.12.31	21.25%	1.43%	24.32%	1.62%	-3.07%	-0.18%
自基金合同生效至今	-30.14%	1.73%	-22.62%	1.61%	-7.52%	0.12%

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比较图
广发大盘成长混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年6月13日至2011年9月30日)



注:本基金建仓期为六个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

十三、基金的费用

(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.销售服务费;
4.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5.基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金的证券交易费用;
8.银行汇划费用;
9.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
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
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
2.基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的2.5%e的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×2.5%e÷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
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
3.销售服务费
销售服务费是指基金管理人根据基金合同的约定及届时有效的相关法律法规的规定,从开放式基金财产中计提的一定比例的费用,用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。
基金管理人可以选取适当的时机(但应于中国证监会发布有关收取开放式证券投资基金销售费用的规定后)开始计提销售服务费,但至少应提前2个工作日在至少一种指定报刊和网站上公告。公告中应规定计提销售服务费的条件、程序、用途和费率标准。
基金管理人依据本基金合同及届时有效的有关法律法规公告收取基金销售服务费或酌情降低基金销售服务费的,无须召开基金份额持有人大会。
上述"(一)基金费用"的种类中第4-7项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
4.与基金销售有关的费用
(1)认购费
1)认购费率
投资人可选择在认购本基金或赎回本基金时交纳认购费用。投资人选择在认购时交纳的称为前端认购费用,投资人选择在赎回时交纳的称为后端认购费用。
投资人选择交纳前端认购费用时,按认购金额采用递减比例费率,具体费率如下:

认购金额(M,含认购费)	费率
M<100万元	1.2%
100万元≤M<500万元	0.8%
500万元≤M<1000万元	0.2%
M≥1000万元	每笔1000元

投资人选择交纳后端认购费用时,按持有时间采用递减比例费率,具体费率如下:

持有期限(N)	费率
N<1年	1.8%
1年≤N<2年	1.5%
2年≤N<3年	1.2%
3年≤N<4年	0.9%
4年≤N<5年	0.5%
N≥5年	0

认购费用用于本基金直接发售和代理发售时发生的开支,包括市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用,不列入基金资产。
2)认购费用的计算
如果投资人选择交纳前端认购费用,计算方法如下:
前端认购费用=认购金额×前端认购费率
净认购金额=认购金额-前端认购费用
认购份数=净认购金额/基金份额面值
如果投资人选择交纳后端认购费用,计算方法如下:
赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值
后端认购费用= 赎回份额 × 认购日基金份额净值× 对应的后端认购费率
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-后端认购费用-赎回费用
基金份额面值为1.00元。基金份额份数保留小数点后两位,小数点后第三位四舍五入,由此产生的误差在基金资产中列支。
(2)申购费
基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第八部分"基金份额的申购、赎回与转换"。
(3)赎回费
本基金的赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减,最高不超过赎回总额的0.5%。赎回费用的25%归入基金资产,其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第八部分"基金份额的申购、赎回与转换"。
(4)基金转换费
基金转换费率等依照本招募说明书及本基金管理人相关业务公告的规定执行,基金转换费用于支付有关手续费和注册登记费。
(三)本基金不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3.基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(四)基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可经协商一致后酌情调低基金管理费率或基金托管费率,经中国证监会核准后公告,此项调整不需要召开基金份额持有人大会。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对《广发大盘成长混合型证券投资基金招募说明书【更新】[2011年第2号]》的内容进行了更新,主要更新的内容如下:
1.在"三 基金管理人"部分,根据基金管理人人员变动情况进行了相应更新。
2.在"四 基金托管人"部分,根据托管行人员变动情况和基金托管业务经营情况对托管人信息进行了相应更新。
3.在"五 相关服务机构"部分,增加了相关的代销机构,对原有销售机构的资料进行更新,相关事宜均已公告。
4.在"九 基金的投资"部分,更新了截至2011年9月30日的基金投资组合报告。
5.在"十 基金的业绩"部分,更新了截至2011年9月30日的本基金业绩。
6.根据最新公告,对"二十二 其他应披露的事项"内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一二年一月二十日

广发聚瑞股票型证券投资基金招募说明书【更新】摘要

(上接C37版)

82)名称:华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:宋歌
电话:021-50122086
传真:021-50122200
客服电话:4008209898
公司网站:www.cnhbstock.com
83)名称:英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:王睿
电话:0755-83007069
传真:0755-83007167
客服电话:4008-698-698
公司网站:www.ydsc.com.cn
84)名称:中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人:赵大建
联系人:李微
联系电话:010-59355941
客服电话:40088-95618
公司网站:www.e5618.com
85)名称:华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-4890100
传真:0931-4890118
客服电话:400-6898888
公司网站:www.hlzqgs.com
86)名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
87)名称:厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
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.cn
88)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:022-83320066
客户服务热线:4008285888
公司网站:www.njzq.com.cn
89)名称:华融证券股份有限公司
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:丁之锁
联系人:陶颖
电话:010-58568040
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn
90)名称:浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人:吴承
联系人:谢项辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客服电话:0571-967777
公司网站:www.stocke.com.cn
91)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
联系人:陈诚
电话:023-63786464
传真:023-63786311
客服电话:4008-096-096
公司网站:www.swsc.com.cn
92)名称:财达证券有限责任公司
注册地址:河北省石家庄市自强路35号
办公地址:石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
法定代表人:翟建强
联系人:刘亚静
电话:0311-66006393
传真:0311-66006249
客服电话:400-612-8888
公司网站:www.s10000.com
93)名称:红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
电话:0871-3577398
传真:0871-3578827
公司网站:www.hongtazq.com
94)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:冉云
联系人:金喆
电话:028-86690126
传真:028-86690126
客服电话:4006600109
公司网站:www.gjzq.com.cn
95)名称:中天证券有限责任公司
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:李学琦
联系人:袁劲松
电话:024-23266917
传真:024-23257490
客服电话:400-6180-315
公司网站:www.stockren.com
96)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:徐刚
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.lxzq.com.cn
97)名称:新时代证券有限责任公司
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
法人代表:马金声
联络人:孙恺
联系电话:010-83561149
客服电话:400-698-9898
传真:010-83561094
网址:www.xsdzq.cn
98)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:陈韦杉
联系电话:010-88086830-730 010-88086830-737
传真:010-66412537
客服电话:010-88086830
公司网址:www.rxzq.com.cn
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
法定代表人:王志伟
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师集团(广州)事务所
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:程秉、李彩霞
联系人:程秉
四、审计基金资产的会计师事务所
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:卢伯卿
联系人:胡小骏
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏、洪锐明

四、基金的名称

广发聚瑞股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

深入研究中国经济、社会发展过程中的结构性变化和趋势性规律,把握主题投资机会,通过精选个股和有效的风险控制,追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略
本基金为股票型基金,基金的资产配置比例范围为:股票资产占基金资产的60%—95%;现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
(二)股票投资策略
在股票投资方面,本基金主要采用自上而下的"主题投资分析框架"(Thematic Investing Analysis Frame),通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤,挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票,通过定量和定性相结合的方法,筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。
1.主题挖掘
本基金将通过自上而下的方式,从宏观经济运行、经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发,在深入研究的基础上,有效分析影响经济发展和企业盈利的关键性、趋势性因素,从而前瞻性地挖掘出中国经济发展过程中不断涌现出的投资主题。
2.主题配置
在主题挖掘的基础上,基金管理人定期召开投研联席会议,由研究员(宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员)和基金经理对主题因子进行分析,评估,最终确定各大主题资产在股票资产中的配置。
3.主题投资
(1)主题行业配置
在确定了主题配置后,本基金将明确各个主题所涵盖的主题行业,通过行业投资评级的方式,确定各个主题行业的配置比例,本基金将重点投资于那些主题特征明显、成长价值高的行业。
(2)个股精选
在个股投资方面,本基金采用备选库制度,本基金的备选库包括一级股票库和二级股票库。
一级股票库:主要根据本基金管理人开发的广发企业价值评估系统,通过考察企业的基本面状况,筛选出基本面良好的股票组成一级股票库。
二级股票库:在一级股票库的基础上,根据主题行业配置阶段所确定的各个主题所覆盖的主题行业,从一级股票库中挑选出所有属于主题行业的股票,通过定性、定量分析,精选增长潜力大、盈利能力好的优质上市公司,构成本基金的二级股票库。二级股票库是本基金的风格股票库。
(三)债券投资策略
在债券投资上,坚持稳健投资的原则,通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现和确认市场失衡,把握投资机会;在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下,为投资者获得稳定的收益。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。
利率预测:本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险。尤其是在预期利率上升的时候,严格控制,保持债券投资组合较短的久期,降低债券投资风险。
收益率曲线策略:首先确定收益曲线变动的类型以及各种变动对组合收益率变动的影响,具体包括子弹策略、杠铃策略和梯子策略,在此基础上以对收益率曲线形状变动的预期为依据建立或改变组合头寸。
债券配置:本基金将依照收益率及风险特征对债券类资产进行配置,确定投资组合,并随着投资环境的变化调整投资组合。
债券分析:本基金将根据不同债券品种的特点进行分析。
(1)国债:重点关注利率水平以及国债的供求关系等;
(2)企业债:重点关注发债企业的信用等级、收益率、债券的流动性以及债券的发行期限等指标;
(3)可转债:本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性,以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益;本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。
(四)权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的;同时,充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会,实现基金资产的增值。
根据有关规定,本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制:
1、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
2、本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之三。
3、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。
若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。
如果中证指数有限公司停止计算编制这些指数或更改指数名称,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2012年1月5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9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,991,623,314.62	93.28
	其中:股票	2,991,623,314.62	93.28
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	200,694,629.01	6.26
6	其他各项资产	14,743,061.38	0.46
7	合计	3,207,061,005.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	439.50	0.00
B	采掘业	22,550.00	0.00
C	制造业	1,525,300,125.05	47.90
C0	食品、饮料	1,097,070,867.08	34.45
C1	纺织、服装、皮毛	101,969,760.94	3.20
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,545.75	0.00
C5	电子	144,515,710.98	4.54
C6	金属、非金属	516,026.80	0.02
C7	机械、设备、仪表	16,866.41	0.00
C8	医药、生物制品	181,209,347.09	5.69
C99	其他制造业	-