广发聚富开放式证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30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 报告送出日期:二〇〇九年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金管理人的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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

本基金托管人——中国工商银行股份有限公司根据《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》(以下简称"本基金合同")规定,于2009年8月20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。

本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。

本报告中的财务会计报告未经审计。

本报告期自2009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	广发聚富混合
交易代码	270001
前端交易代码	270001
后端交易代码	270011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月3日
报告期末基金份额总额	6,593,307,959.69份

2.2 基金产品说明

投资目标	依托高速发展的宏观经济和资本市场,通过基金管理人科学研究,审慎投资,在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。
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优化配置;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投资价值的潜力股的投资机会。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益+20%×中信标普全债指数收益
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。

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	蒋松云
	联系电话	020-83899117	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		020-83899158	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文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(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	-356,634,150.51
本期利润	2,383,852,460.31
加权平均基金份额本期利润	0.3536
本期加权平均净值利润率	35.91%
本期基金份额净值增长率	43.26%
3.1.2 期末数据和指标	2009年6月30日
期末可供分配利润	-1,809,491,881.11
期末可供分配基金份额利润	-0.2744
期末基金资产净值	7,718,439,269.06
期末基金份额净值	1.1706
3.1.3 累计期末指标	2009年6月30日
基金份额累计净值增长率	347.53%

(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和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。

(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
过去一个月	11.07%	0.85%	11.30%	0.95%	-0.23%	-0.10%
过去三个月	20.37%	1.09%	20.15%	1.22%	0.22%	-0.13%
过去六个月	43.26%	1.30%	57.29%	1.55%	-14.03%	-0.25%
过去一年	9.47%	1.58%	11.92%	2.03%	-2.45%	-0.45%
过去三年	106.76%	1.66%	105.52%	1.93%	1.24%	-0.27%
自基金成立起至今	347.53%	1.41%	155.16%	1.60%	192.37%	-0.19%

1、业绩比较基准:80%中信标普300指数收益+20%中信标普全债指数收益。

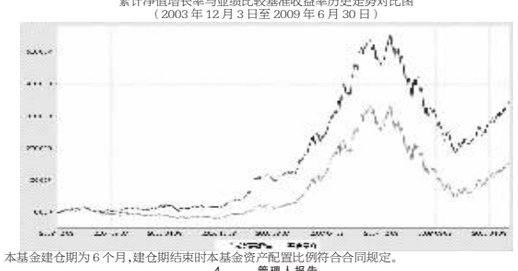
2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发聚富开放式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2003年12月3日至2009年6月30日)



本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金资产配置比例符合合同规定。

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、广州科技风险投资有限公司和康美药业股份有限公司。公司具有企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务资格。

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16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、投资管理部、中央交易部、固定收益部、研究发展部、机构理财部、机构投资部、国际业务部、金融工程部、市场拓展部。此外,还设立了北京分公司、广州分公司和上海分公司。

截至2009年6月30日,本基金管理人管理十一只开放式基金——广发聚富证券投资基金、广发稳健增长证券投资基金、广发小盘成长证券投资基金、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,管理资产规模为982.08亿元。同时,公司还管理着多个企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江湧	本基金的基金经理	2006-5-26	-	10	江湧,男,中国籍,经济学、法学双学士,1999年7月至2002年8月任职于广发证券股份有限公司,2002年8月至今在广发基金管理有限公司工作,曾任公司研究发展部行业研究员,2005年2月2日至2006年5月25日曾任广发小盘成长股票基金(LOF)的基金经理,2006年5月26日起任广发聚富混合基金的基金经理。

注:

(1)此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

(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、《广发聚富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。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。

公司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

本公司管理的投资组合包括开放式基金11只,企业年金4只,特定客户资产管理计划2个。与本投资组合投资风格相似的投资组合包括广发稳健增长混合、广发策略优选混合和广发大盘成长混合。报告期内,本投资组合与广发大盘成长混合的差异为10.73%,与广发稳健增长混合的差异为12.68%,与广发策略优选混合的差异为10.54%。导致该较大差异的原因是本基金与该三只基金的仓位和行业配置存在一定差异所致。

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说明

1、市场回顾:

市场反弹的强度出人意料。经过了一年修整的市场,在经济复苏和充裕的流动性配合下,重新爆发了活力,上证综合指数半年上涨了62.53%。这是中国证券史上第二好的半年度涨幅,甚至超过了10年前拥有5.19行情的那半年。

2、基金运作及表现回顾:

本基金在今年上半年年初始,较快增仓至基金契约规定上限,持仓行业主要是金融保险、地产、能源、食品、商业和医药,整体仍保持了基金一贯相对均衡的特点。由于投资风格偏于保守,对于强周期高弹性品种基本没有配置,这也影响了基金净值的表现。上半年基金净值增长43.26%,同期比较基准增长57.29%。净值增长率位于同类型基金的前列。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然市场主流观点较为乐观,但本基金在操作上会随着市场点位的不断创出反弹新高而逐步谨慎,主要基于以下几点:一、流动性充裕是这轮行情的资金基础,随着IPO放开并不断加快,已上市公司再融资越来越密集、金额也越来越大,股价上涨后微发的解禁限售股的减持意愿会加强,这些,会稀释岸市场进一步上涨依赖的流动性;二、上一轮的经济刺激政策的直接影响在减弱,新的政策出台的时间和力度会有一个观察期,如上半年宽松的信贷不会一直持续;三、虽然经济复苏趋势仍在继续,企业盈利也走出了最困难的阶段,但即使给一个中性偏乐观的预期,企业的估值也已经接近了07年高点的水平;四、回顾几年来的市场变化,我们很难判断具体出现市场转折的时点,但有一点,企业的估值和企业价值最终是起决定性作用的,07年四季度,我们都知道市场有泡沫,估值高企,08年四季度,很容易看到从企业价值角度被大幅低估的企业。当泡沫越来越明显的在身边产生的时候,保持适当的清醒,对于避免重蹈历史覆辙总是有好处的。

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。本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,截至2009年6月30日本基金可供分配利润-1,809,491,881.11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

2009年上半年,本基金托管人在对广发聚富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

2009年上半年,广发聚富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聚富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,广发聚富混合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富混合型证券投资基金2009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:广发聚富开放式证券投资基金

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	331,228,152.96	1,091,257,330.45
结算备付金	1,575,507.00	473,921.46
存出保证金	1,638,464.91	1,348,780.49
交易性金融资产	7,347,791,208.79	4,383,349,679.39
其中:股票投资	5,754,309,566.99	3,223,783,394.39
债券投资	1,593,481,641.80	1,159,566,285.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	39,737,694.71	22,345,402.13
应收利息	25,625,036.73	25,116,610.92
应收股利	-	-
应收申购款	4,708,171.34	2,718,962.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,752,304,236.44	5,526,610,687.15
负债和所有者权益	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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	-	19,609,192.51
应付赎回款	20,512,861.41	2,697,271.07
应付管理人报酬	9,185,626.44	7,203,581.60
应付托管费	1,530,937.75	1,200,596.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,580,309.10	1,220,410.06
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,055,232.68	855,819.93
负债合计	33,864,967.38	32,786,872.12
所有者权益:		
实收基金	6,593,307,959.69	6,723,231,214.61
未分配利润	1,125,131,309.37	-1,229,407,399.58
所有者权益合计	7,718,439,269.06	5,493,823,815.03
负债和所有者权益总计	7,752,304,236.44	5,526,610,687.15

报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1.1706元,基金份额总额6,593,307,959.69份。

6.2 利润表

会计主体:广发聚富开放式证券投资基金

本报告期:2009年1月1日-2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
一、收入	2,447,687,735.95	-3,543,710,188.36
1.利息收入	22,193,552.62	32,330,085.41
其中:存款利息收入	2,434,348.32	2,206,444.56
债券利息收入	19,759,204.30	30,123,640.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-315,569,514.56	-426,881,036.36
其中:股票投资收益	-349,852,344.62	-414,550,598.66
债券投资收益	-33,700.00	-32,315,587.28
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	34,316,530.06	19,985,149.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,740,486,610.82	-3,151,467,860.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	577,087.07	2,308,623.50
二、费用(以"-"号填列)	-63,835,275.64	-101,746,603.08
1. 管理人报酬	-49,068,615.49	-68,832,543.48
2. 托管费	-8,178,102.54	-11,472,090.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-6,378,088.77	-21,040,681.09
5. 利息支出	-	-184,700.00
其中:卖出回购金融资产支出	-	-184,700.00
6. 其他费用	-210,468.84	-216,587.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,383,852,460.31	-3,645,456,791.44
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,383,852,460.31	-3,645,456,791.44

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发聚富开放式证券投资基金

本报告期:2009年1月1日-2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009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)	6,723,231,214.61	-1,229,407,399.58	5,493,823,815.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,383,852,460.31	2,383,852,460.31
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)	-129,923,254.92	-29,313,751.36	-159,237,006.28
其中:1.基金申购款	605,323,009.89	-22,916,386.17	582,406,623.72
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-735,246,264.81	-6,397,365.19	-741,643,630.00
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)	6,593,307,959.69	1,125,131,309.37	7,718,439,269.06

项目	上年度可比期间 2008年1月1日-2008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)	6,591,868,475.96	4,074,134,396.80	10,666,002,872.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,645,456,791.44	-3,645,456,791.44
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)	-48,960,059.75	24,843,991.66	-24,116,068.09
其中:1.基金申购款	1,398,404,192.86	645,051,307.64	2,043,455,500.50
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,447,364,252.61	-620,207,315.98	-2,067,571,568.59
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)	6,542,908,416.21	453,521,597.02	6,996,430,013.23

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发聚富开放式证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]121号文《关于同意广发聚富证券投资基金设立的批复》的批准,由广发基金管理有限公司作为发起人,于2003年10月31日向社会公开发行募集并于2003年12月3日正式成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为3,131,907,040.29份基金份额。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。

本基金募集期间为2003年10月31日至2003年12月1日,募集资金总额3,131,907,040.29元,其中募集资金的银行存款利息扣除认购费用为428,430.37元,上述资金业经深圳天健信德会计师事务所验资。

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《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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。

本基金财务报表由本基金的基金管理人广发基金管理有限公司于2009年8月20日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金编制财务报表以持续经营假设为基础,根据实际发生的交易和事项,遵循企业会计准则、中国证券业协会颁布的中证协发[2007]56号《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及其他相关规定进行确认和计量,基于下述重要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2009年6月30日的财务状况以及2009上半年度的经营成果。

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

本基金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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

1.印花税

2008年4月24日以前,根据财政部、国家税总局财税字[2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,按3‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。根据财政部、国家税务总局《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,自2008年4月24日起,按1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。经国务院批准,财政部、国家税务总局决定自2008年9月19日起,对证券(股票)交易出让方按1‰的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不征收营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。根据财政部、国家税务总局财税(2008)1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》,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,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金取得的股票的股息、红利收入及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局[2005]102号文《关于股息红利有关个人所得税有关政策的通知》与财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》,对本基金自2005年6月13日起从上市公司分配取得的股息红利所得,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额。

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

本报告期内,本公司股东广东康美药业股份有限公司正式更名为康美药业股份有限公司。

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
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司、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 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	1,529,852,342.32	36.63%	603,717,906.57	10.20%
广发华福证券有限责任公司	558,290,104.38	13.37%	1,647,295,522.26	27.83%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	171,328,580.20	41.12%	-	-
广发华福证券有限责任公司	-	-	294,638,554.10	28.98%

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	-	-	100,000,000.00	25.00%

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 2009年1月1日-2009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	1,272,564.92	36.42%	961,045.20	60.86%
广发华福证券有限责任公司	474,541.23	13.58%	35,041.58	2.22%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	490,522.59	9.57%	0.00	0.00%
广发华福证券有限责任公司	1,389,097.89	27.09%	221,412.85	10.43%

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)。

上述佣金按市场佣金率计算,佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》,本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

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 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
当期应支付的管理费	49,068,615.49	68,832,543.48
其中:当期已支付	39,882,989.05	59,534,116.70
期末未支付	9,185,626.44	9,298,426.78

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

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
当期应支付的托管费	8,178,102.54	11,472,090.67
其中:当期已支付	6,647,164.79	9,922,352.84
期末未支付	1,530,937.75	1,549,737.83

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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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

(1)本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。(2)本基金上年度可比期间未与关联方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

截至本报告期内2009年1月1日至2009年6月30日止,本基金不存在基金管理人投资本基金的情况。截至上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日止,本基金不存在基金管理人投资本基金的情况。

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

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。截至上报告期末2008年12月31日止,本基金不存在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 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	331,228,152.96	2,404,389.32	542,342,054.49	2,116,254.35

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.9 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	7.70	9.71	7,500,000	57,750,000.00	72,825,000.00	2009年5月26日,海油工程每10股送1股,转增4股,派1元(含税)
600765	力源液压	2009-3-30	2010-3-26	非公开发行流通受限	10.50	12.14	2,000,000	21,000,000.00	24,280,000.00	
002122	天马股份	2009-2-17	2010-2-19	非公开发行流通受限	23.50	25.27	900,000	21,150,000.00	22,743,000.00	2009年4月2日,天马股份每10股派1元(含税),每10股转增10股

(1)截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未持有流通受限债券。(2)截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未持有流通受限权证。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000792	盐湖钾肥	2009-6-26	重大资产重组	55.14	2009-7-27	60.65	2,500,000	93,869,816.10	137,850,000.00

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,754,309,566.99	74.23
	其中:股票	5,754,309,566.99	74.23
2	固定收益投资	1,593,481,641.80	20.55
	其中:债券	1,593,481,641.80	20.55
	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	332,803,659.96	4.29
6	其他资产	71,709,367.69	0.93
7	合计	7,752,304,236.44	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	502,358,288.40	6.51
C	制造业	1,621,655,343.39	21.01
C0	食品、饮料	432,555,376.74	5.60
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	56,946,723.30	0.74
C4	石油、化学、塑胶、塑料	388,422,373.90	5.03
C5	电子	132,825,644.42	1.72
C6	金属、非金属	267,021,746.03	3.46
C7	机械、设备、仪表	47,023,000.00	0.61
C8	医药、生物制品	296,860,479.00	3.85
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	188,063,216.32	2.44