广发增强债券型证券投资基金

2008年第三季度报告

2008年9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:2008年10月24日

§1 重要提示

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。

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2008年10月20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。

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自2008年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	广发强债
交易代码:	270009
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2008年3月27日
报告期末基金份额总额:	4,038,897,787.93份
投资目标:	在保持投资组合低风险和较高流动性的前提下,追求基金资产长期稳健的增值。
投资策略:	本基金主要投资于固定收益类金融工具,具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债券、可转换公司债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购,持有因可转债转股所形成的股票及该股票派发的权证或可分离交易可转债分离交易的权证等资产,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券品种。因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。本基金不通过二级市场买入股票或权证,本基金债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%,非债券类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,本基金持有的现金或期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 本基金通过利率预测、收益曲线预测、债券类属配置、信用策略和套利机会挖掘构建固定收益类资产投资组合;本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购参与标的、参与规模和退出时机。
业绩比较基准:	中证全债指数收益率
风险收益特征:	本基金为债券型基金,具有低风险,低预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2008年7月1日-2008年9月30日)
1.本期已实现收益	35,048,519.63
2.本期利润	126,725,147.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0341
4.期末基金资产净值	4,203,256,087.20
5.期末基金份额净值	1.041

注:(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。

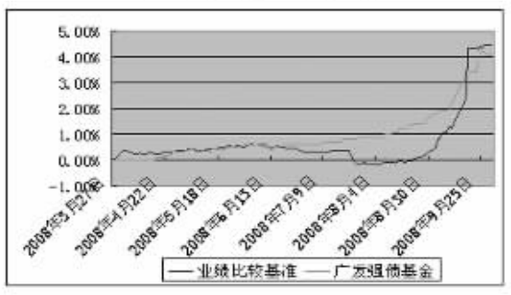
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去3个月	3.48%	0.12%	4.11%	0.22%	-0.63%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发增强债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年3月27日至2008年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
谢军	本基金的基金经理、广发货币市场基金的基金经理	2008-03-27	-	5	谢军,男,中国籍,金融学硕士,持有证券业执业资格证书和特许金融分析师牌(CFA),2003年7月至2006年9月先后任广发基金管理有限公司研究发展部产品设计人员、企业年金和债券研究员,2006年9月12日起任广发货币市场基金的基金经理,2008年3月27日起任本基金的基金经理。2008年4月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部总经理助理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发增强债券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 公平交易专项说明

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。

投资决策的内部控制方面,投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,超过一定投资比例后必须来源于核心股票库,或通过投资决策委员会的审批;公司建立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,按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,不同投资组合经理下达的对同一证券的交易指令,由同一交易员执行。交易员通过投资交易系统,公平对待各投资组合。

督察长、监察稽核部以及绩效评估与风险管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控、准实时监控及预警,实现投资风险的事中和事后风险控制;金融工程部绩效评估与风险管理岗通过技术系统平台,及时有效地评估投资组合的绩效和风险状况,对投资风险进行事后的评估及管理。

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

本基金管理人未管理与本基金投资风格相似的其他基金。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1.市场回顾及运作分析

2008年第三季度债券市场总体背景表现为:经济处于明显的下滑周期,通货膨胀大幅度超预期下降,美国金融危机和实体经济下滑程度严重超预期发展。

两个超预期都对债市极大利好。一年期央票利率虽下调不到5bp,但带给了多头极大的信心。伴随央行的双率下降政策,市场利率分两个阶段呈现快速平坦化甚至倒挂化下行。以10年期国债为例,下降幅度超过80bp。其他各类中长期债券也呈现类似局面。

前半年基金管理人的关注焦点在于滞胀阶段还会维持多久。而管理人通过对新数据的深入及时分析,及时调整了观点,认识到中国经济很可能或者已经受全球经济影响而步入中波周期的衰退阶段。在这个阶段,要素价格尤其是利率价格必须充分调整是经济周期顺利复辟的前提条件。

基于这种认识,管理人开始试探性的买入长期债券,对冲了二季度的短期头寸,组合久期提高到3年以上。事后来看,行情的发展速度和节奏确实很难事前预料,但总体来说,组合保持了基本正确的头寸,获得了较好的收益。第三季度总体收益为3.48%。

三季度,股票市场进一步底部波动,可转债整体也表现较差。基于对宏观经济周期的判断,基金的股票仓位进一步降低。

2.市场展望和策略

市场展望并不容易,有时甚至相差甚远。比如说,美联储主席伯南克上任之前以研究美国大萧条和通货膨胀目标制而出名,其06年上任时,大多数评论家关注的是后者可能给美国货币政策带来的变化,且几乎没有任何人能够想到恰恰是前者让其生逢其时,成为化解美国金融危机的不二人选。站在06年的位置看,这是个大概不到1%的人认为会发生的结果。站在08年的位置看,这个意外对世界经济的影响意义重大。这个现象却很好地符合了索罗斯的投资世界观,他认为,世界在99%的时间内都按照"常理"运作,但会有1%的冲击巨大的意外。可以说,过去1-2年,确实几乎所有资本市场都进入了这1%的世界,表现癫狂,过分执著于"常理世界"经验的传统投资家纷纷落马。

有意思的是,我国债市第三季度的行情,在这个1%的意外框架下可能更容易解释。在传统上,我国债市以银行为主力机构,债券投资票息收益和其负债成本的匹配是理解债市的关键。收益率倒挂即使不是不可能,也不太可能长期维持下去,更难想象贯穿行情的大部分阶段。这种变化在全球范围的"常理世界"经验里甚为罕见。造成意外的关键原因可能有二,一是托过去两年股市的繁荣,基金为主体的民间投资力量空前壮大。这部分资金较少的受到所谓的成本约束,更重视债券作为经济周期变化阶段中资产配置的作用。二是生逢全球金融格局乱世,债券作为资金避险工具的优势突出。在目前银行间债市容量稍显不足的背景下,上述动力显得相对强大,行情表现以超常态的模式发展。当这种动力温和的时候,更多的体现一种合理的资产配置需求,而当这种动力演化为狂热的时候,有可能显现出资金推动的特征。

市场时而如温和的河流,时而有如波涛汹涌的大海,机会和风险并存,本基金投资管理团队深感自身如一叶扁舟,始终对市场保持敬畏,唯有依靠深入的研究、大胆的假设和严谨的纪律,把好风险和收益的平衡舵,为基金持有人带来超额收益。

§5 投资组合报告

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	8,062,417.30	0.16
	其中:股票	8,062,417.30	0.16
2	固定收益投资	4,582,271,819.16	92.12
	其中:债券	4,582,271,819.16	92.12
	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	259,904,156.65	5.22
6	其他资产	124,162,418.94	2.50
7	合计	4,974,400,812.05	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,808,314.62	0.14
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	1,009,453.87	0.02
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,208,544.00	0.10
C8	医药、生物制品	590,316.75	0.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	169,473.64	0.00
H	批发和零售贸易	2,084,629.04	0.05
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	-	-
M	综合类	-	-
	合计	8,062,417.30	0.19

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601766	中国南车	1,025,882	3,590,587.00	0.09
2	002269	美邦服饰	43,006	1,096,653.00	0.03
3	002251	步步高	22,142	987,976.04	0.02
4	002241	歌尔声学	24,635	619,816.60	0.01
5	002252	上海莱士	27,141	590,316.75	0.01
6	002249	大洋电机	29,830	533,957.00	0.01
7	002236	大华股份	12,573	389,637.27	0.01
8	002268	卫士通	11,179	169,473.64	0.00
9	002270	法因数控	10,000	84,000.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	357,464,000.00	8.50
2	央行票据	1,537,537,000.00	36.58
3	金融债券	1,278,657,500.00	30.42
	其中:政策性金融债	1,125,267,500.00	26.77
4	企业债券	1,064,472,312.60	25.32
5	企业短期融资券	272,309,000.00	6.48
6	可转债	71,832,006.56	1.71
7	其他	-	-
8	合计	4,582,271,819.16	109.02

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080216	08国开16	6,950,000	709,664,500.00	16.88
2	0801038	08央票38	5,000,000	506,350,000.00	12.05
3	0801047	08央票47	4,000,000	405,160,000.00	9.64
4	088037	08闽高速债	2,500,000	252,125,000.00	6.00
5	080214	08国开14	2,000,000	212,800,000.00	5.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末基金未持有资产支持证券

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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,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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,514,732.47
5	应收申购款	77,247,686.47
6	其他应收款	150,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	124,162,418.94

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125709	唐钢转债	42,576,757.86	1.01
2	110567	山鹰转债	17,525,948.70	0.42

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601766	中国南车	3,590,587.00	0.09	网下配售
2	002269	美邦服饰	1,096,653.00	0.03	网下配售
3	002268	卫士通	169,473.64	0.00	网下配售

§6 开放式基金份额变动 单位:份

报告期期初基金份额总额	4,336,083,085.70
报告期期间基金总申购份额	1,141,148,761.97
报告期期间基金总赎回份额	1,438,334,059.74
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	4,038,897,787.93

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发增强债券型证券投资基金募集的文件;

2.《广发增强债券型证券投资基金基金合同》;

3.《广发增强债券型证券投资基金托管协议》;

4.《广发增强债券型证券投资基金招募说明书》;

5.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值公告及其他公告。

7.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇〇八年十月二十四日

广发策略优选混合型证券投资基金

2008年第三季度报告

2008年9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:2008年10月24日

§1 重要提示

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。

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2008年10月20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。

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自2008年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	广发优选
交易代码:	270006(前端),270016(后端)
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
报告期末基金份额总额:	7,640,528,456.66份
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%*新华雷曼中国全债指数
风险收益特征:	较高风险,较高收益
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2008年7月1日-2008年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,232,921,188.41
2.本期利润	-1,861,710,586.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2488
4.期末基金资产净值	10,080,081,392.40
5.期末基金份额净值	1.3193

(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。

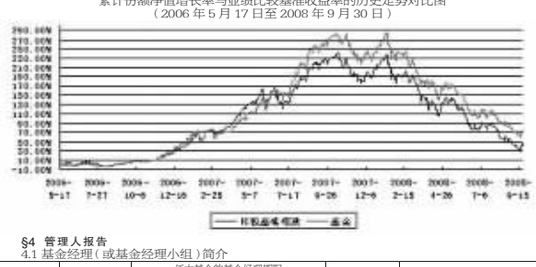
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	-15.16%	1.92%	-15.54%	2.20%	0.38%	-0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年5月17日至2008年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
冯永欢	本基金的基金经理、广发稳健增长开放式证券投资基金的基金经理	2008-02-14	-	4	冯永欢,男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,2004年2月至2007年3月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、广发稳健增长开放式证券投资基金的基金经理助理。2007年3月29日起任广发稳健增长开放式证券投资基金的基金经理,2008年2月14日起任本基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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。

投资决策的内部控制方面,投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,超过一定投资比例后必须来源于核心股票库,或通过投资决策委员会的审批;公司建立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,按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,不同投资组合经理下达的对同一证券的交易指令,由同一交易员执行。交易员通过投资交易系统,公平对待各投资组合。

督察长、监察稽核部以及绩效评估与风险管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控、准实时监控及预警,实现投资风险的事中和事后风险控制;金融工程部绩效评估与风险管理岗通过技术系统平台,及时有效地评估投资组合的绩效和风险状况,对投资风险进行事后的评估及管理。

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

本基金管理人为混合型基金,本公司旗下共有4只混合型基金,其他3只为:广发大盘基金、广发聚富基金及广发稳健增长基金。报告期内,本基金净值增长率与本公司旗下其他混合型基金净值增长率的差异均未超过5%。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

市场回顾:

今年,国际经济环境持续恶化,特别是第三季度,美国金融危机的恶劣程度超出预期,经济调整大势已定,对于经济的恐慌造成全球股市大跌,A股也不能幸免。从经济基本面来看,地产、汽车、家电以及外围经济恶化的影响逐步显现,越来越多的行业步入调整;与地产相关的工程机械、钢铁等需求萎缩,汽车、家电等可选消费品的销售明显下降,石油、煤炭等要素价格冲高回落。经济向下调整的过程(尤其是初期)是投资者最不愿见到的情形,因为未来预期发生转折性的变化,股价往往跌得非常惨,今年A股的调整就是这种情况。

操作回顾:

第三季度,本基金出于谨慎的考虑,对于一些没有充分反应经济周期调整的行业和个股进行了适当减持,如银行、煤炭、以及消费类个别股票等,减少了损失。同时,与经济的下滑相伴随的应该是降息周期,所以在第三季度增加了对债券类资产的配置。尽管如此,基金净值仍然下跌15.16%。

未来展望:

中国经济处于世界经济的链条之中,虽然我们受次贷危机的直接影响有限,但势必受到外围经济恶化的拖累。目前的形势是:美欧等国家的金融危机对实体经济的影响还没有完全看到,经济会下滑到什么程度、何时到底看不太清楚。就中国经济而言,经济已经开始下行,下游可选消费已经受到明显抑制:地产行业已经调整一年,汽车、家电、高端服务等需求萎缩也已经5-9个月;中游行业的需求受下游的拖累也已经调整一段时间;上游要素价格最近2个月也开始回落。经济还没有见底,在未来一段时间,投资需谨慎,切实考察上市公司的周期阶段,在估值与周期阶段相结合仍然有吸引力的可以投资,或者受宏观经济影响很小的行业和公司可以投资。毕竟股市往往领先于实体经济见底,在各行业下滑一段时间之后,可以考虑增持优秀的上市公司。

§5 投资组合报告

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	5,160,314,767.37	50.87
	其中:股票	5,160,314,767.37	50.87
2	固定收益投资	3,384,464,866.84	33.36
	其中:债券	3,384,464,866.84	33.36
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	609,001,633.50	6.00
	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	950,307,138.26	9.37
6	其他资产	40,361,023.67	0.40
7	合计	10,144,449,429.64	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	-	-
B	采掘业	411,893,784.23	4.09
C	制造业	1,837,315,883.06	18.23
C0	食品、饮料	353,534,178.47	3.51
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,783,030.44	0.04
C5	电子	273,694,502.40	2.72
C6	金属、非金属	220,962,552.91	2.19
C7	机械、设备、仪表	830,022,919.85	8.23
C8	医药、生物制品	155,318,698.99	1.54
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,829,461.53	0.20
F	交通运输、仓储业	103,462,380.45	1.03
G	信息技术业	59,673,558.00	0.59
H	批发和零售贸易	383,571,819.43	3.81
I	金融、保险业	1,084,036,623.93	10.75
J	房地产业	1,102,306,290.00	10.94
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	158,224,966.74	1.57
	合计	5,160,314,767.37	51.19

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600048	保利地产	39,862,513	591,958,318.05	5.87
2	600000	浦发银行	30,771,875	480,656,687.50	4.77
3	600519	贵州茅台	2,680,523	353,534,178.47	3.51
4	000157	中联重科	22,257,198	327,403,382.58	3.25
5	601166	兴业银行	16,458,398	270,411,479.14	2.68
6	600383	金地集团	41,571,026	251,504,707.30	2.50
7	002008	大族激光	25,048,320	245,974,502.40	2.44
8	000001	深发展A	15,567,295	233,353,752.05	2.31
9	002024	苏宁电器	12,759,600	222,017,040.00	2.20
10	600858	银座股份	8,924,138	158,224,966.74	1.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	2,586,904,000.00	25.66
3	金融债券	477,556,000.00	4.74
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	18,516,866.84	0.18
5	企业短期融资券	301,488,000.00	2.99
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,384,464,866.84	33.58

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801098	08央行票据98	10,000,000	961,600,000.00	9.54
2	0801016	08央行票据16	3,000,000	288,630,000.00	2.86
3	0801106	08央行票据106	3,000,000	288,480,000.00	2.86
4	0801043	08央行票据43	3,000,000	288,450,000.00	2.86
5	0801034	08央行票据34	2,900,000	278,864,000.00	2.77

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券.

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证.

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 报告期内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%。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,738,770.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,464,389.08
5	应收申购款	3,157,863.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,361,023.67

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有的处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002024	苏宁电器	69,600,000.00	0.69	非公开发行

§6 开放式基金份额变动 单位:份

报告期期初基金份额总额	7,322,208,964.82
报告期期间基金总申购份额	1,075,956,381.83
报告期期间基金总赎回份额	757,636,889.99
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	7,640,528,456.66

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发策略优选混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发策略优选混合型证券投资基金托管协议》;

4.《广发策略优选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

5.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值公告及其他公告。

7.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇〇八年十月二十四日

东方金账簿货币市场证券投资基金

2008年第三季度报告

2008年9月30日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2008年10月24日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年10月20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。

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自2008年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	东方金账簿货币基金
交易代码:	400005
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2006年8月2日
报告期末基金份额总额:	124,351,336.80份
投资目标:	在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下,追求稳定的当期收益。
投资策略:	本基金以价值分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,把握宏观经济走向与微观经济脉搏,通过以剩余期限为核心的资产配置,充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准:	自基金成立至2008年8月26日采用银行6个月定期存款税后收益率,自2008年8月27日起更改为银行税后活期利率。
风险收益特征:	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人:	东方基金管理有限责任公司
基金托管人:	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2008年7月1日-2008年9月