

广发策略优选混合型证券投资基金
【2012】年度报告摘要

我们认为,我获取的审计证据是充分适当的,为发表无保留意见提供了基础。 6.3.3 意见说明 我们认为,基金管理人选任符合基金合同约定,符合《证券投资基金法》和《证券投资基金销售管理办法》于2013年11月1日起施行的、《证券投资基金销售管理办法》的相关规定,充分反映了基金管理人选任符合《证券投资基金法》于2013年11月1日起施行的经营成果和基金净值变动情况。	<table> <tr> <th>项目</th><th>本期 2012年1月1日至2012年12月31日</th><th>上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日</th></tr> <tr> <td>当期发生的基金运作及管理费</td><td>132,400,627.98</td><td>157,945,624.21</td></tr> <tr> <td>其中:支付销售机构的客户维护费</td><td>17,223,261.41</td><td>20,492,391.14</td></tr> </table> 注:基金管理人计提的基金资产净值1.5%的营销费率计提,计算方法如下: $\text{Marketing Fee} = \text{基金资产净值} \times 1.5\%$ 为每日计提的营销费 基金管理人每月计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金营销费用计提数据,基金托管人复核后于次月首日起三个工作日向基金管理人一次性支付给基金管理人。若法定节假日、休息日等,支付日期顺延。 7.4.8.2.2 基金托管费	项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	当期发生的基金运作及管理费	132,400,627.98	157,945,624.21	其中:支付销售机构的客户维护费	17,223,261.41	20,492,391.14
项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日								
当期发生的基金运作及管理费	132,400,627.98	157,945,624.21								
其中:支付销售机构的客户维护费	17,223,261.41	20,492,391.14								

资产	本期 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日	单位:人民币元
货币资金			
银行存款	936,799,264.81	1,323,716,567.14	
其他货币资金	4,001,950.83	-	
存出保证金	4,904,151.84	4,552,413.21	
交易性金融资产	7,816,250,278.87	7,336,289,912.74	
其中:股票投资	6,071,704,278.87	7,336,289,912.74	
基金投资	-	-	

证券投资	1,744,546,000.00	-	-	-	-	-	单位:人民币元
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	14,861,697.74	-	-	-	-	-	
应收利息	39,493,147.84	266,280.75	-	-	-	-	
应收股利	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	604,375.45	1,183,570.11	-	-	-	-	
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	
银行间市场交易的 各对手方名称							本期 2012年1月1日至2012年12月31日
中国工商银行股份有限	50,655,350.00	540,119,300.00	-	-	-	-	债券交易金额 基金逆回购 基金正回购 基金卖出 交易金额 利息收入 交易金额 利息支出
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日							
银行间市场交易的 各对手方名称							本期 2011年1月1日至2011年12月31日
中国工商银行股份有限	50,655,350.00	540,119,300.00	-	-	-	-	债券交易金额 基金逆回购 基金正回购 基金卖出 交易金额 利息收入 交易金额 利息支出

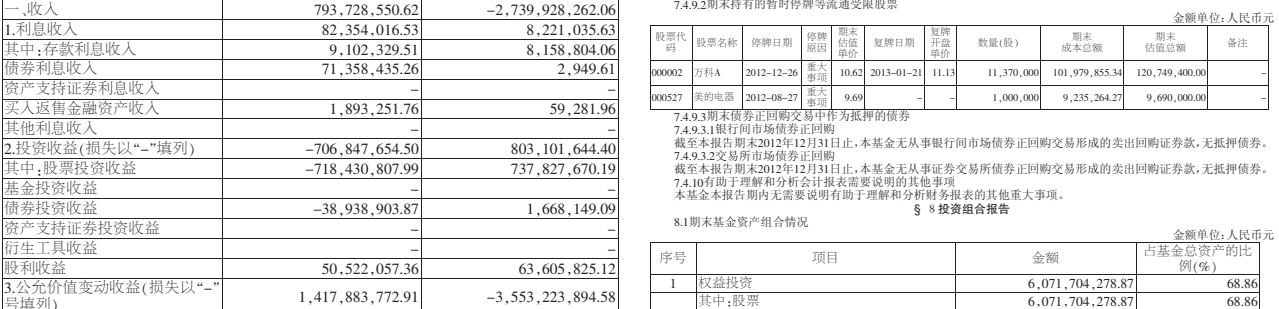
其他资产	-	-	合伙方名称	基金投入	基金支出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
资产总计	8,816,914,867.38	8,666,008,743.95							
负债和所有者权益	本期末	上年度末	7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况						
	2012年12月31日	2011年12月31日	7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况						

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
期初持有的基金份额	45,339,302.27	45,339,302.27
期间申购/买入总额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总额	-	-
期末持有的基金份额	45,339,302.27	45,339,302.27

应付托管费	1,760,819.01	1,910,430.37	期末持有的基金份额占基金总份额的比例	0.65%	0.62%
应付销售服务费			7.4.8.2 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		
应付交易费用	5,140,103.09	1,585,202.80	本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。		
应付交税			7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入		
应付利息					
应付利润					
递延所得税负债					

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	

[illegible]

4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-	2 固定收益投资	1,744,546,000.00	19.79
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-	其中:债券	1,744,546,000.00	19.79
减:费用	338,415.68	1,972,952.49	资产支持证券	-	-
1.管理费用	175,707,323.30	205,609,196.30	3 金融衍生品投资	-	-
2.托管费	132,400,627.98	157,945,624.21	4 买入返售金融资产	-	-
3.销售服务费	22,066,771.26	26,324,270.57	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
4.交易费用	20,815,830.95	20,915,343.16	5 银行存款和结算备付金合计	940,801,215.64	10.67
			6 其他各项资产	59,863,372.87	0.68
			7 合计	8,816,914,867.38	100.00

权益支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	424,093.11	423,958.36
七、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	618,021,227.32	-2,945,537,458.36
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	618,021,227.32	-2,945,537,458.36
7.所有者的权益：盈余公积/未分配		

8.2期末按行业分类的股权投资组合			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	37,858,774.94	0.43	
B	采掘业	-		
C	制造业	3,431,036,539.50	39.11	
C0	食品、饮料	1,425,876,951.67	16.25	
C1	纺织、服装、皮毛	541,992,981.35	6.18	

单位:人民币元			
项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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)	7,305,967,118.24	1,314,511,857.74	8,620,478,975.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期损益)		618,021,227.32	618,021,227.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动			
其中:基金申购款	272,262,122.68	24,361,222.68	296,623,345.36
基金赎回款	(1,011,100,000.00)	(101,100,000.00)	(1,112,200,000.00)
四、期末所有者权益(基金净值)	6,567,129,240.92	1,241,733,080.72	7,808,862,321.64

变动数(净值减少以“-”号填列)	-370,768,482.62	-94,001,081.94	-464,769,239.56	F 建筑业	995,483,867.37	11.35			
其中:1.基金申购款	264,894,350.09	63,226,137.16	328,120,487.25	E 交通运输、仓储业	-	-			
2.基金赎回款	-635,662,507.71	-157,227,219.10	-792,889,726.81	G 信息技术业	4,566,162.00	0.05			
四、本期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)	-	-	-	H 批发和零售贸易	641,766,377.77	7.31			
五、期末所有者权益(基金净值)	6,935,198,960.62	1,838,532,003.12	8,773,730,963.74	I 金融、保险业	99,638,000.00	1.14			
				J 房地产业	494,274,354.80	5.63			
				K 社会服务业	277,931,965.09	3.17			
项目		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	所有者权益合计	L 传播与文化产业	-	-			
	实收基金	未分配利润		M 综合类	89,148,231.20	1.02			
一、期初所有者权益(基金净值)	7,069,990,796.35	5,987,364,577.96	13,057,355,374.31	合计	6,071,704,278.87	69.20			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)	-	-2,945,537,458.36	-2,945,537,458.36	8.3 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					
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)	230,931,327.89	107,038,563.84	343,014,885.73	序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
其中:1.基金申购款	2,035,971,321.83	898,977,421.49	2,902,908,749.32	1	000294	洋河股份	4,885,784	456,185,652.08	5.20
				2	000051	格力电器	15,019,858	383,106,329.00	4.37

[illegible][illegible]

本财务报表编制符合企业会计准则和中国注册会计师审计准则于2012年1月1日执行的。 财务报告编制符合中国会计准则和中国注册会计师审计准则于2012年1月1日执行的财务报表于2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和现金流量变动情况。 7.4.4本报告期内所采用的会计政策、会计估计与上年度报告各期一致。 7.4.5会计差错更正的说明 本年度无会计差错更正。	10 002146 宇通客车 11 600066 平安发展 12 002102 金正大 13 600079 人福医药 14 601136 新华保险 15 601888 中国国航 16 000002 万科A 17 601669 中国水电 18 000096 青岛啤酒	120,110,693.01 117,988,672.76 100,987,655.20 109,169,105.20 107,690,200.24 106,914,178.67 103,102,418.32 96,928,918.43 86,658,214.02
---	---	---

1) 发行以基金资产为资金来源, 不属于资产证券化融资, 不缴纳增值税。	19	002293	罗莱家纺	88,359,477.15	1.02
2) 向特定对象发行股票, 不构成发行, 包括大宗交易、债券的折价发行、股权的股息、红利收入、债券的利息及公允价值变动损益等, 不缴纳增值税。	20	601318	中国平安	87,389,786.45	1.01
3) 对基金管理人收取的管理费, 由上市公司支付给基金管理人, 计入管理人收入, 不缴纳增值税。					
4) 对基金托管人收取的托管费, 由上市公司支付给基金管理人, 计入管理人收入, 不缴纳增值税。					
5) 对基金投资者的销售服务费, 由发行股票的上市公司支付给上述认购或申购20%的个人投资者, 上市公司在扣除销售服务费后, 将基金净收入向基金资产支付上述认购或申购80%的个人投资者, 不缴纳企业所得税。					
6) 对于基金管理人从基金资产, 以2008年9月19日起, 出让其发行10%的利率摊余成本债券(票据)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税, 卖出交易印花税。					
7) 对于基金管理人从基金资产在股权支付取得过程中收到由非流通股股东支付的股票、现金等对价, 暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。					
7.4.7.4 关联方关系					

				金额单位: 人民币元	
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)	
1	001068	泸州老窖	496,173,756.81	5.76	

关联方名称	关联关系类型	2008年末	2009年末
中国工商银行股份有限公司	金托管人、代销机构	2 000858	五 粮 液 378,088,059.24
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	3 608089	山西汾酒 324,624,840.10
广发证券股份有限公司	基金管理人、代销机构	4 002596	吉开普德 280,748,877.56
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人、代销机构	5 002081	金 蝶 娜 271,946,194.93
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人、代销机构	6 606660	青岛啤酒 245,741,887.39
康美药业股份有限公司	基金管理人、代销机构	7 002422	烟台张裕 245,295,454.59
广州科技风险投资有限公司	基金管理人、代销机构	8 601117	中国化学 226,767,072.49
	基金管理人、代销机构	9 600519	贵州茅台 221,079,091.70
	基金管理人、代销机构	10 600016	民生银行 220,741,126.50

[illegible]

		成交金额	占当期股票 买卖总金额的 比例	成交金额	占当期股票 买卖总金额的 比例	19	113,955,069.92	1.32			
						20	000028	国药一致	113,468,947.88	1.32	
						8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额				1.32	
广发证券股份有限公司		1,367,465,159.12	10.21%	1,827,361,301.36	13.11%	单位：人民币元					
7.4.1.2 权益交易						买入股票的成本(成交总额)		5,720,023,474.62			
7.4.1.3 权益交易						卖出股票的收入(成交总额)		7,714,067,579.67			
7.4.1.3.1 应支付关联方佣金						8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合					
						单位：人民币元					
关联方名称	本期					单位：人民币元					
	2012年1月1日至2012年12月31日						基金资产净值				
	当期	占当期佣金总 额占当期佣金总 额的比例	占当期佣金总 额占当期佣金总 额的比例	占当期佣金总 额占当期佣金总 额的比例	占当期佣金总 额占当期佣金总 额的比例	序号	债券品种	公允价值	比例(%)		

广发证券股份有限公司	佣金	量的比例	期末应付佣金余额	总额的比例	1	国家债券	-	-
	1,192,981.04	10.90%	\$42,537.96	10.57%	2	央行票据	30,423,000.00	0.35
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日				3	金融债券	1,714,123,000.00	19.54
	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		其中：政策性金融债	1,714,123,000.00	19.54
广发证券股份有限公司	1,528,080.82	14.75%	131,462.65	8.29%	4	企业债券	-	-
					5	企业短期融资券	-	-
					6	中期票据	-	-
					7	可转换债	-	-

2.本基金与关联方交易均在正常业务范围按一般商业条款订立			
3.本基金与该类交易的佣金支付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			
7.4.8.2 关联方交易			
7.4.8.2.1 基金管理费			
8.6 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			
	8	其他	-
	9	合计	1,744,546,000.00
			19.88

单位：人民币元

金额单位：人民币元

序号		名称	金额	单位：人民币元
1	存出保证金		4,904,151.84	
2	应收证券清算款		14,861,697.74	
3	应收股利		-	
4	应收利息		39,493,147.84	
5	应收申购款		604,373.45	
6	其他应收款		-	
7	待摊费用		-	
8	其他		-	
9	合计		59,863,372.87	
8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
本基金本报告期末未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				

259,784	26,696.02	538,160,876.12	7.76%	6,397,038,084.50	92.24%			
9.20 本基金管理人管理的其他基金持有本基金基金份额的情况								
		持有基金份额(份)	占基金份额比例(%)					
基金管理人持有以上从人持有本基金开放式		4,985,932.92	0.0719%					
注:本公司高级管理人员、基金投资和研究人员在持有本基金基金份额的数量区间为100万(含)以上,且其持有的基金份额中有部分基金份额属于通过二级市场买入本基金基金份额的情况。								
§ 10 开放式基金估值变动								
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						
本报告期初基金份额总额		7,305,967,118.24						
本报告期间基金份额净增加额		264,894,350.09						
减:本报告期间基金申购份额		635,662,507.71						
减:本报告期间基金拆分变动份额		0						
本报告期末基金份额总额		7,935,198,960.62						

截至2023年12月31日证券公司交易单元分布情况						金额单位:人民币元	
券商名称	交易单元数量	股票交易		固定收益证券交易		备注	
		成交金额	占当期股票成交金额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例		
安信证券	4	244,498,987.80	1.83%	106,890.78	1.80%		
华泰证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%	新增1个席位	
招商证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
东方财富	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
国信证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
长城证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
光大证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%	新增1个席位	
中信证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
方正证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
东方证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		
国泰君安	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%	新增1个席位	
海通证券	1	188,877,380.58	1.41%	160,545.74	1.47%		

地区	2009年	2008年	2007年	2006年	2005年
天津	360.38	760.20	2.69%	307.625	2.81%
北京	505.112	591.17	3.77%	546.025	3.16%
上海	347.980	661.97	2.60%	316.802	2.89%
广东	260.467	978.86	2.09%	239.045	3.00%
福建	106.043	696.99	0.79%	89.873	0.82%
浙江	197.387	982.70	1.47%	127.795	1.17%
江苏	201.881	464.68	1.47%	178.028	1.50%
江西	215.772	924.78	1.61%	190.937	1.74%
湖北	199.646	357.43	1.49%	122.284	1.12%
湖南					
安徽					
山东	464.320	876.20	3.47%	393.595	3.66%
山西	66.840	859.29	0.50%	59.120	0.54%
内蒙古	14.878	050.03	0.11%	13.544	0.12%

[illegible][illegible]

华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
耿讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-
华金公司	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-
申银证券	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-
中信证券(浙江)	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-

广发基金管理有限公司
二〇一三年三月二十七