

[illegible]

§ 7 年度财务报表				关联方名称			
7.1 资产负债表				2012年1月1日至2012年12月31日			
会计主体：广发聚保混合型证券投资基金				2012年1月1日至2012年12月31日			
报告截止日：2012年12月31日				2012年1月1日至2012年12月31日			
单位：人民币元				成交金额			
资产				成交金额			
资产	2012年12月31日	2011年12月31日		成交金额	占成交总额的比例	成交金额	占成交总额的比例
银行存款	92,201,783.55	170,025,616.54		0.00	0.00%	4,050,100,000.00	60.73%
结算备付金	18,826.37	308,174.26					
存出保证金	504,488.44	786,453.01					
交易性金融资产	2,295,868,000.09	3,294,243,139.89					
应收利息							
应收股利							
其他资产							
资产总计							
负债和所有者权益				关联方名称			
负债和所有者权益				2012年1月1日至2012年12月31日			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息				占当期利息的比例			
当期利息							

基金投资		242,968,873.19			
债券投资					
资产支持证券投资	2,295,868,000.09	3,052,154,264.70			
衍生金融投资					
买入返售金融资产					
应收证券清算款	20,906,775.72				
应收利息	36,161,474.11	43,526,846.19			
应收股利					
应收申购款					
递延所得税资产					
其他资产					
资产总计	2,445,721,348.28	3,508,890,229.89			
负债和所有者权益					
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	1,713,521.88	401,073.44			
应付赎回款	8,470,799.65	7,141,327.49			
应付管理人报酬	2,528,384.69	3,620,509.48			
应付托管费	421,397.42	603,418.24			
应付赎回费					
其他负债					
所有者权益					
实收基金					
未分配利润					
所有者权益合计					
负债和所有者权益总计					

项目	本期	上年度可比期间
2012年1月1日至2012年12月31日	2011年3月15日至2011年12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	35,421,815.99	36,925,208.44
其中：支付销售机构的手续费	11,120,122.13	11,102,599.86

注：在本报告期内，基金管理人按前一日的基金资产净值1.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.2%÷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日起2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。

若截至本报告期末，本基金不符合基金托管条件，基金管理人将持有本基金份额转换为转型后的“广发聚利灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

7.4.2.2 基金托管费

项目	本期	上年度可比期间
2012年1月1日至2012年12月31日	2011年3月15日至2011年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	5,903,635.94	6,154,201.41

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%÷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日起2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。

应付交易费用	133,784.38	60,577.40
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	192,302.37	348,305.88
负债合计	13,460,190.39	12,175,211.93
所有者权益：		
实收资本	2,356,244,308.12	3,439,820,823.70
未分配利润	76,016,849.77	56,894,194.26
所有者权益合计	2,432,261,157.89	3,496,715,017.96
负债和所有者权益总计	2,445,721,348.28	3,508,890,229.89

注：2012年1月1日至2012年3月31日，基金份额净值为1.032元，基金份额总额为2,356,244,308.12份。

7.2.4附列：
会计主体：发展科保混合型证券投资基金
本报告期：2012年1月1日至2012年3月31日

单位：人民币元

单位：人民币元						
7.4.3与关联方进行银行间市场的债券、回购交易情况						
自报告期末起至下一报告期止，本基金管理人及关联方没有进行过银行间市场交易。在法定节假日、休息日和支付日期届满之日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。在法定节假日、休息日和支付日期届满之日						
2012年1月1日至2012年12月31日						
各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	基金金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	118,901,928.20	72,351,202.15	-	-	-	-
上年度可比期间						
2011年3月15日至2011年12月31日						
各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	基金金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	60,700,501.31	-	-	-	-

7.4.4关联方技术本基金的情况
7.4.4.1报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。
7.4.4.2报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期内及上年度末本基金基金管理人无之外的其他关联方投资本基金的情况。
7.4.5关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

项目	本期		上年度可比期间		单位:人民币元			
	2012年1月1日至2012年12月31日	2012年12月31日	2011年3月15日至2011年12月31日	2011年12月31日	上年度可比期间			
一、收入	97,845,116.57		103,054,447.11					
1.利息收入	105,786,913.63		107,753,189.83					
其中:存款利息收入	912,769.65		2,389,974.75					
债券利息收入	104,872,355.52		89,363,680.47					
资产支持证券利息收入	-		-					
买入返售金融资产收入	1,788.46		12,003,534.61					
其他利息收入	-		-					
2.投资收益(损失以“-”填列)	6,869,870.12		-15,377,569.28					
其中:股票投资收益	-31,460,528.42		-8,189,338.94					
基金投资收益	-		-					
债券投资收益	33,674,774.70		-7,188,230.34					
资产支持证券投资收益	-		-					
衍生工具收益	-		-					
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-19,504,874.70		11,315,156.35					
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-		-					
5.其他收入(损失以“-”号填列)	4,693,207.52		3,359,670.21					
二、费用	42,356,696.02		43,878,727.95					
1.管理人报酬	35,421,815.98		36,125,208.44					
2.托管费	5,903,635.94		6,154,201.41					
3.销售服务费	-		-					
4.交易费用	576,403.20		433,838.23					

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	2012年12月31日	2011年3月15日至2011年12月31日	2011年12月31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	92,201,783.55	910,994.93	170,025,616.54	2,346,802.11	

注:本基金银行有存款由本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。
74.8.6本基金在报告期内参与关联方承销证券的情况

本期		基金在承销期内买入	
2012年1月1日至2012年12月31日		数量(单位:股/张)	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式
-	-	-	-

本期		基金在承销期内买入	
2011年3月15日至2011年12月31日		数量(单位:股/张)	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式
广发证券股份有限公司	122065	一级市场承销团	100,000
122065	11上港01	一级市场承销团	100,000,000.00

74.9.4期末(2012年12月31日)本基金持有的通惠安债券证券
74.9.18以融资融券方式购入于报告期内持有的通惠安债券证券
截至本报告期末(2012年12月31日)止,本基金无认购前次新增发行证券而持有的证券。
74.9.2期末持有的所有暂时停牌等通惠安债券证券
截至本报告期末(2012年12月31日)止,本基金无暂时停牌等通惠安债券证券。
74.9.3期末公允价值变动中确认为减值的债券
74.9.3.1报告期内公允价值变动确认为减值的债券
截至本报告期末(2012年12月31日)止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。
74.9.4交易所市场债券正回购
截至本报告期末(2012年12月31日)止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。
74.10对于理解和分析会计报表需要说明的其他重要事项
本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他重大事项。

8.1 投资组合报告

8.1.1 本基金资产组合情况

		金额单位:人民币元	
--	--	-----------	--

5.利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6.其他费用	454,840.90	365,479.87	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	55,488,420.55	59,175,719.16	-
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	55,488,420.55	59,175,719.16	-

7.3所有者权益变动表

单位：人民币元

项目	本期		
	2012年1月1日至2012年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,439,820,823.70	56,894,194.26	3,496,715,017.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,488,420.55	55,488,420.55

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中：股票	-	-	-
2	固定收益投资	2,295,868,000.09	93.87
其中：债券	2,295,868,000.09	93.87	-
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	92,220,609.92	3.77
6	其他各项资产	57,632,738.27	2.36
7	合计	2,445,721,348.28	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4报告期内股权投资前10名公允价值变动

8.4.1报告期内买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

变动数(净值减少以“-”号填列)				-1,083,576,515.58	-36,365,765.04	-1,119,942,280.62		
其中:1.基金申购款				-	-	-		
2.基金赎回款				-1,083,576,515.58	-36,365,765.04	-1,119,942,280.62		
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)				2,356,244,308.12	76,016,849.77	2,432,261,157.89		
项目				2011年3月15日至2011年12月31日	上年度可比期间	所有者权益合计		
				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)				4,109,470,206.45	-	4,109,470,206.45		
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期损益)				-	59,175,719.16	59,175,719.16		
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)				-669,649,382.75	-2,281,524.90	-671,930,907.65		
其中:1.基金申购款				-	-	-		
2.基金赎回款				-669,649,382.75	-2,281,524.90	-671,930,907.65		
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)				-	-	-		

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300334	津滨科技	17,619,000.00	0.50
2	002701	奥瑞金	54,000.00	0.00
3	601800	中国交建	27,000.00	0.00
4	300337	银邦股份	20,000.00	0.00
5	300312	邦讯技术	10,000.00	0.00
6	603533	鼎胜机电	9,300.00	0.00
7	603993	泰和铝业	3,000.00	0.00

注:本基金及附类2、3、4、3.4.3的买入包括基金一级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、派股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场主动的卖出;换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,“买入金额”或“卖出金额”或“买入股票成本”及“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交价款乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

3.4.2.2卖出股票占期初基金资产净值2.9%或前20名卖出股票

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	000858	五粮液	82,935,522.80	2.37
2	000568	泸州老窖	72,706,092.04	2.08
3	300334	津滨科技	32,958,714.47	0.94

5、期末所有者权益(基金净值)	3,439,820,823.70	56,894,194.26	3,496,715,017.96	4	002646	青青稞酒	29,741,837.48	0.88
附注附注为财务报表的重要组成部分				5	600519	贵州茅台	27,079,773.52	0.77
6、所有者权益(基金净值)				6	002639	雪人股份	11,975,695.94	0.34
7、所有者权益(基金净值)				7	601555	东吴证券	7,830,381.40	0.22
8、所有者权益(基金净值)				8	600785	新华百货	5,047,604.00	0.14
9、所有者权益(基金净值)				9	601336	新华保险	1,912,582.86	0.05
10、所有者权益(基金净值)				10	002701	奥瑞金	60,121.00	0.00
11、所有者权益(基金净值)				11	601800	中国交建	28,350.00	0.00
12、所有者权益(基金净值)				12	300537	蓝润股份	16,450.00	0.00
13、所有者权益(基金净值)				13	601333	振业地产	3,828.00	0.00
14、所有者权益(基金净值)				14	603333	利源光电	9,000.00	0.00
15、所有者权益(基金净值)				15	603993	洛钼钼业	8,700.00	0.00
16、所有者权益(基金净值)						8.3元大股票的成本总额及买入股票的收入总额		
17、所有者权益(基金净值)						买入股票的成本(或交)	17,742,300.00	
18、所有者权益(基金净值)						卖出股票收入(或交)	2,700.00	
19、所有者权益(基金净值)						8.3元大股票溢价部分计入权益投资损益	22,932,168.56	
20、所有者权益(基金净值)								
21、所有者权益(基金净值)								
22、所有者权益(基金净值)								
23、所有者权益(基金净值)								
24、所有者权益(基金净值)								
25、所有者权益(基金净值)								
26、所有者权益(基金净值)								
27、所有者权益(基金净值)								
28、所有者权益(基金净值)								
29、所有者权益(基金净值)								
30、所有者权益(基金净值)								
31、所有者权益(基金净值)								
32、所有者权益(基金净值)								
33、所有者权益(基金净值)								
34、所有者权益(基金净值)								
35、所有者权益(基金净值)								
36、所有者权益(基金净值)								
37、所有者权益(基金净值)								
38、所有者权益(基金净值)								
39、所有者权益(基金净值)								
40、所有者权益(基金净值)								
41、所有者权益(基金净值)								
42、所有者权益(基金净值)								
43、所有者权益(基金净值)								
44、所有者权益(基金净值)								
45、所有者权益(基金净值)								
46、所有者权益(基金净值)								
47、								

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	89,112,548.00	3.66
2	央行票据	-	-
3	金融债	1,428,448,000.00	58.73
4	其中:政策性金融债	1,428,448,000.00	58.73
5	企业债券	280,120,007.00	11.52
6	企业中期票据	-	-
7	中期票据	342,102,000.00	14.11
8	可转换债	155,085,445.09	6.38
9	其他	-	-
9	合计	2,295,868,000.09	94.39

8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	占基金资产净值比例(%)
1	110318	11年国开18	2,200,000	220,462,000.00	9.06
2	110315	11年国开15	1,600,000	162,640,000.00	6.69

1. 以发行基金方式募集资金,不属于企业所得税征收范围,不缴纳所得税。				
2. 基金管理人运用基金财产进行投资取得收入,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。	4	123008	123008	1,300,000
3. 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暂不缴纳企业所得税。	5	1280175	1280000	1,510,000
4. 基金取得的债券利息收入,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,暂不缴纳企业所得税。	6			
5. 基金投资于从境外A股上市,在2008年9月19日起,由出让方按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。	7			
6. 基金投资于境内股票在二级市场买卖过程中收到由非流通股股东支付的股票、基金等价对,暂免予缴纳印花税,企业所得归上市公司和持有人。	8			
7. 47. 基金管理人	9			

中原证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

广发基金管理有限公司
二〇一三年三月二十七日