

广发制造业精选股票型证券投资基金

2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 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：二〇一四年三月三十一日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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。

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 2014 年 3 月 25 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。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 广发制造业精选股票 |
| 基金主代码 | 270028 |
| 交易代码 | 270028 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 9 月 20 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 116,891,243.06 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过深入的研究，精选制造行业的优质上市公司进行投资，在严格控制风险的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金为股票型基金，本基金投资组合的比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、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%。本基金管理人将根据宏观经济研究员对宏观经济形势的研究，策略研究员对市场运行趋势的研究，以及行业研究员对行业与上市公司投资价值的研究，综合考虑基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例，并定期或不定期地进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 80%×申银万国制造业指数+20%×中证全债指数。 |
| 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、债券型基金和混合型基金。 |

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 | 赵会军 |
| | 联系电话 | 020-83936666 | 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 | | 020-89899158 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址 | http://www.gffunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2013 年 | 2012 年 | 2011 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|----------------|--|
| 本期已实现收益 | 43,047,756.45 | -8,482,601.61 | -3,214,434.83 |
| 本期利润 | 35,484,414.87 | 16,701,260.03 | -15,993,298.83 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2558 | 0.0511 | -0.0237 |
| 本期基金份额净值增长率 | 24.71% | 5.15% | -2.99% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013 年末 | 2012 年末 | 2011 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2691 | -0.0255 | -0.0300 |
| 期末基金资产净值 | 148,683,326.28 | 228,199,680.70 | 449,488,436.33 |

| | | | |
|----------|-------|-------|-------|
| 期末基金份额净值 | 1.272 | 1.020 | 0.970 |
|----------|-------|-------|-------|

注：（1）上述基金业绩指标不包括持有人认购或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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -4.93% | 1.57% | 1.90% | 1.22% | -6.83% | 0.35% |
| 过去六个月 | 5.65% | 1.60% | 16.38% | 1.21% | -10.73% | 0.39% |
| 过去一年 | 24.71% | 1.65% | 20.64% | 1.23% | 4.07% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.20% | 1.30% | -1.99% | 1.26% | 29.19% | 0.04% |

注：（1）业绩比较基准： $80\% \times$ 申银万国制造业指数 $+20\% \times$ 中证全债指数。

（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份额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

广发制造业精选股票型证券投资基金

份额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

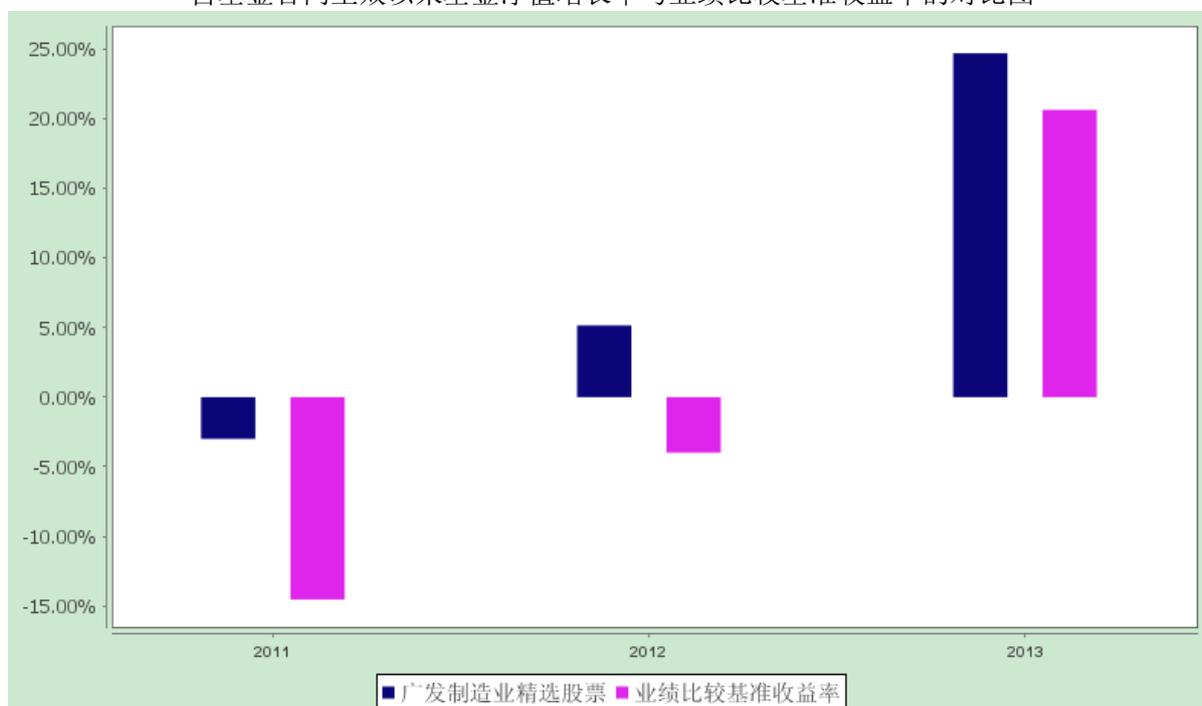
(2011 年 9 月 20 日至 2013 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发制造业精选股票型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年(2011 年)按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日 2011 年 9 月 20 日至报告期末未进行利润分配。

§ 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、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

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 19 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、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、量化投资部、机构理财部、市场拓展部、电商及客服部、国际业务部。此外，还设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司以及北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心。

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金管理人管理四十五只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、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、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太（除日本）精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票

型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金和广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 1204.01 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

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（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------------------------------|-----------------|------------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李巍 | 本基金的基金经理；广发核心精选股票基金的基金经理 | 2011-09-20 | - | 8 | 男，中国籍，理学硕士，持有证券业执业资格证书，2005 年 7 月至 2010 年 6 月任职于广发证券股份有限公司，2010 年 7 月起在广发基金管理有限公司投资管理部工作，2011 年 9 月 20 日起任广发制造业精选股票基金的基金经理，2013 年 9 月 9 日起任广发核心精选股票基金的基金经理。 |
| 易阳方 | 本基金的基金经理；广发聚丰股票基金的基金经理；公司副总经理、投资总监 | 2011-09-20 | 2013-02-05 | 16 | 男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，1997 年 1 月至 2002 年 11 月任职于广发证券股份有限公司，2002 年 11 月至 2003 年 11 月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部人员，2003 年 12 月 3 日至 2007 年 3 月 28 日任广发聚富混合基金的基金经理，2005 年 5 月 13 日至 2011 年 1 月 5 日任广发基金管理有限公司投资管理部总经理，2005 年 12 月 23 日起任广发聚丰股票基金的基金经理，2006 年 9 月 4 日至 2008 年 4 月 16 日任广发基金管理有限公司总经理助理，2008 年 4 月 17 日起任广发基 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 金管理有限公司投资总监，2011年8月11日起任广发基金管理有限公司副总经理，2011年9月20日至2013年2月4日任广发制造业精选股票基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：（1）基金经理的“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

（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合规守信情况的说明

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、《广发制造业精选股票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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年，A 股市场出现明显结构性分化。上证综指和深证成指在年初小幅反弹后持续下跌，下半年虽有两次反弹，但幅度有限，全年跌幅仍分别达到 6.75% 和 10.91%；而创业板指数则始终保持强势，在前三季度持续创出年内新高，直到四季度才出现一定幅度调整，全年涨幅达到 82.73%。全年申万制造业指数涨幅为 26.07%。

年初，因投资者普遍预期中国经济将持续复苏，加上低估值的银行、地产继续强势，大盘指数延续了 2012 年 12 月的反弹之势。随着 3 月开工旺季到来，PMI、发电量、铁路货运量、中长期贷款及系列草根调研等证据纷纷表明，经济复苏程度其实并不强甚至非常微弱。主板指数在 2 月至 5 月反复调整，时至 6 月，市场因为担忧债务危机爆发、新一届管理层对经济下滑容忍度提升而导致经济失速下滑，主板指数再次快速下跌。与之形成鲜明对比的是创业板指数在上半年持续上涨，其背后的逻辑在于中国经济的转型与改革其实在 2008 年金融危机之后已经悄然开始，虽然过去两年宏观增速一路下滑，但那些符合转型方向的行业，如消费电子、环保、医药、能源装备、智慧城市、文化传媒等，始终保持较高的景气度，且诞生了很多龙头企业引领行业发展，创业板的持续强势正得益于有这样一批企业保持了业绩的持续快速增长。

三季度，创业板指数的强势得到延续，其市场表现依然远远领先于其它指数，市场主题投资热情很高。

整个四季度的宏观经济都较为平稳，虽然随着旺季结束，PMI、发电量增速、大宗原材料价格均出现一定幅度回落，但都属正常的季节性规律，宏观数据对二级市场的影响有限。真正对市场影响较大的是一些事件性因素：一方面，十八届三中全会的公告让市场对中国未来的改革与转型重新充

满希望，市场随之反弹；另一方面，QE 退出与整顿影子银行，地方债务审计与国债利率飙升，又不禁让市场对 2014 年的经济增速和流动性疑云重生；12 月初，IPO 重启与发行制度改革的消息则再次重击创业板。

报告期内，本基金因在年初对开工旺季经济复苏预期较高，配置了较多工程机械、重卡、水泥、焦煤等强周期性行业，在春节后的下跌中损失较大；所幸从 3 月开始及时调整策略，加大了对符合转型与改革方向的高景气度行业的配置，如消费电子、能源装备、安防设备、智能电网、led、环保设备等，在二季度取得了不错的效果；下半年，因持续看好的高景气度行业龙头大多因上半年涨幅较大而处于持续调整期，传媒、自贸区、去 IOE 等主题性机会虽有参与，但受制于基金契约限制，参与力度不大、收益有限，下半年整体表现一般，部分操作上相对谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

全年本基金净值增长率为 24.71%，比较基准增长率为 20.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2014 年，预计经济平稳缓慢减速的趋势仍会持续。短期看，主要是考虑到地产销售负增长、地方债务审计、融资利率飙升等因素会对投资产生较大拖累；长期看在全球经济再平衡、中国经济转型与改革的大背景下，受制于中国“去产能、去杠杆、去泡沫”的压力，增长减速难以避免。其实这种减速未尝不是好事，可为经济转型、调结构腾挪出更大的空间。当然，减速也不能成为失速，毕竟改革与转型需要一个稳定的宏观环境。11、12 月 CPI 持续低于预期，通缩预期抬头，对此需保持关注；但如果把目光放长远一些，中国受劳动力、土地、环境等要素成本上涨所带来的通胀压力不可小觑。

其实，近两年宏观数据对 A 股市场的影响日益趋弱，只要其变化不大幅超出预期即可，结构性机会有望继续演绎。我们仍需将注意力集中到那些会影响 2014 年全年乃至未来几年中国经济和资本市场的重要事件上来，譬如十八届三中全会的决议的落实、新股发行制度改革、QE 退出、地方债务风险化解等。从 2014 年全年来看，Q1 或许是获取收益比较好的阶段，本基金会采取较积极的操作，对 Q2 和 Q3 持相对谨慎的态度，因为一些重要的负面因素会在这个阶段发酵。

对强周期性行业，我们将采取谨慎回避的态度。对于符合经济转型方向、高景气度行业中的优质公司，仍是配置的主要方向，毕竟这些行业和公司代表了中国经济未来的发展方向。2014 年，我们将会加强对新产业、新技术、新商业模式的研究。

希望在 2014 年通过我们的努力，为持有人带来好的收益。

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、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

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对广发制造业精选股票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

本报告期内，广发制造业精选股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发制造业精选股票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，广发制造业精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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制造业精选股票型证券投资基金 2013 年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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 郭新华 郭增光签字出具了德师报(审)字(14)第 P0465 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发制造业精选股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2013 年 12 月 31 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 19,058,745.34 | 46,738,175.45 |
| 结算备付金 | 1,168,594.06 | 640,073.54 |
| 存出保证金 | 307,224.04 | 1,159,847.50 |
| 交易性金融资产 | 125,390,522.88 | 183,588,005.88 |
| 其中：股票投资 | 125,390,522.88 | 183,588,005.88 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |

| | | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 8,988,822.40 | 15,276,309.11 |
| 应收利息 | 5,085.75 | 7,059.55 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 322,178.31 | 69,641.50 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 155,241,172.78 | 247,479,112.53 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2013年12月31日 | 2012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 | 3,989,538.56 | 17,153,999.24 |
| 应付赎回款 | 699,851.24 | 793,164.98 |
| 应付管理人报酬 | 189,319.55 | 273,020.33 |
| 应付托管费 | 31,553.26 | 45,503.40 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,421,311.08 | 922,408.01 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 226,272.81 | 91,335.87 |
| 负债合计 | 6,557,846.50 | 19,279,431.83 |
| 所有者权益: | - | - |

| | | |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 实收基金 | 116,891,243.06 | 223,774,935.75 |
| 未分配利润 | 31,792,083.22 | 4,424,744.95 |
| 所有者权益合计 | 148,683,326.28 | 228,199,680.70 |
| 负债和所有者权益总计 | 155,241,172.78 | 247,479,112.53 |

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.272 元，基金份额总额 116,891,243.06 份。

7.2 利润表

会计主体：广发制造业精选股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | 43,897,998.45 | 28,310,267.15 |
| 1. 利息收入 | 190,107.58 | 1,204,658.41 |
| 其中：存款利息收入 | 190,055.96 | 481,315.93 |
| 债券利息收入 | 51.62 | 47,074.40 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 676,268.08 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 50,784,687.88 | 1,626,103.97 |
| 其中：股票投资收益 | 49,698,910.83 | -393,034.26 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 48,466.18 | -233,096.78 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,037,310.87 | 2,252,235.01 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -7,563,341.58 | 25,183,861.64 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 486,544.57 | 295,643.13 |
| 减：二、费用 | 8,413,583.58 | 11,609,007.12 |
| 1. 管理人报酬 | 2,476,923.86 | 4,884,280.32 |
| 2. 托管费 | 412,820.71 | 814,046.75 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 5,157,288.40 | 5,501,663.84 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 366,550.61 | 409,016.21 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 35,484,414.87 | 16,701,260.03 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 35,484,414.87 | 16,701,260.03 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发制造业精选股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|--------------------------|----------------------------------|---------------|----------------|
| | 2013 年 1 月 1 日至 2013 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） | 223,774,935.75 | 4,424,744.95 | 228,199,680.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 35,484,414.87 | 35,484,414.87 |

| | | | |
|--|---|----------------|-----------------|
| 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） | -106,883,692.69 | -8,117,076.60 | -115,000,769.29 |
| 其中：1. 基金申购款 | 241,762,464.05 | 65,216,494.45 | 306,978,958.50 |
| 2. 基金赎回款 | -348,646,156.74 | -73,333,571.05 | -421,979,727.79 |
| 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） | 116,891,243.06 | 31,792,083.22 | 148,683,326.28 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 463,377,778.70 | -13,889,342.37 | 449,488,436.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 16,701,260.03 | 16,701,260.03 |
| 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） | -239,602,842.95 | 1,612,827.29 | -237,990,015.66 |
| 其中：1. 基金申购款 | 23,714,389.83 | -379,046.54 | 23,335,343.29 |
| 2. 基金赎回款 | -263,317,232.78 | 1,991,873.83 | -261,325,358.95 |
| 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） | 223,774,935.75 | 4,424,744.95 | 228,199,680.70 |
|-----------------|----------------|--------------|----------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王志伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发制造业精选股票型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2011]1137 号《关于核准广发制造业精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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《广发制造业精选股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2011 年 9 月 20 日募集成立。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。

本基金募集期为 2011 年 8 月 19 日至 2011 年 9 月 16 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 795,756,488.43 元，有效认购户数为 14,373 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 42,389.82 元，折合基金份额 42,389.82 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。

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》和基金合同等有关规定，本基金的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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准： $80\% \times$ 申银万国制造业指数 $+20\% \times$ 中证全债指数。

本基金的财务报表于 2014 年 3 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 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，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对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个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- 4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业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。

5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、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 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|----------------------------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构 |
| 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 |
| 广发证券股份有限公司 | 基金管理人股东、代销机构 |
| 深圳市前海香江金融控股集团有限公司 | 基金管理人股东 |
| 烽火通信科技股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 康美药业股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广州科技风险投资有限公司 | 基金管理人股东 |
| GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司) | 基金管理人全资子公司 |
| 瑞元资本管理有限公司(注) | 基金管理人控股子公司 |

注: 广发基金管理有限公司于 2013 年 6 月 14 日在珠海设立控股子公司瑞元资本管理有限公司。

除此之外, 本报告期内及上年度可比期间内不存在其他控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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 | 193,060,688.54 | 5.51% | 230,493,005.77 | 6.09% |

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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 | - | - | 6,974,500.00 | 28.52% |

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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 | - | - | 965,000,000.00 | 38.60% |

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31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 | 173,941.54 | 5.89% | 4,260.20 | 0.30% |

| | | | | |
|------------|-----------------------|----------------|-----------|------------------|
| 司 | | | | |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2012年1月1日至2012年12月31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 | 196,727.32 | 6.53% | 47,074.30 | 5.10% |

注：1. 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）；

2. 本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3. 本基金对该类交易的佣金的计算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 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年12 月31日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,476,923.86 | 4,884,280.32 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 615,287.19 | 940,830.69 |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2013年1月1日至2013年12月31日 | 2012年1月1日至2012年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 412,820.71 | 814,046.75 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|--------------|-----------------------|------------|-----------------------|------------|
| | 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 2012年1月1日至2012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 | 19,058,745.34 | 160,213.66 | 46,738,175.45 | 394,653.33 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 | 复牌开盘价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|-------|--------------|--------------|--------------|----|
| 000625 | 长安汽车 | 2013-12-31 | 重大事项 | 11.45 | 2014-01-03 | 11.72 | 329,999.00 | 3,876,533.13 | 3,778,488.55 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 121,612,034.33 元，属于第二层级的余额为 3,778,488.55 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 178,278,005.88 元，第二层级 5,310,000.00 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 125,390,522.88 | 80.77 |
| | 其中：股票 | 125,390,522.88 | 80.77 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|----------------|--------|
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 20,227,339.40 | 13.03 |
| 7 | 其他各项资产 | 9,623,310.50 | 6.20 |
| 8 | 合计 | 155,241,172.78 | 100.00 |

8.2 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 | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 114,655,118.88 | 77.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 2,203,104.00 | 1.48 |
| F | 批发和零售业 | 3,827,000.00 | 2.57 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,279,200.00 | 2.21 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 1,426,100.00 | 0.96 |

| | | |
|----|----------------|-------|
| 合计 | 125,390,522.88 | 84.33 |
|----|----------------|-------|

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

金额单位：人民币元

| 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(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 000400 | 许继电气 | 360,000 | 11,192,400.00 | 7.53 |
| 2 | 600703 | 三安光电 | 360,240 | 8,930,349.60 | 6.01 |
| 3 | 002456 | 欧菲光 | 149,876 | 7,206,038.08 | 4.85 |
| 4 | 300161 | 华中数控 | 320,000 | 6,857,600.00 | 4.61 |
| 5 | 600835 | 上海机电 | 330,000 | 5,824,500.00 | 3.92 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 160,000 | 5,612,800.00 | 3.78 |
| 7 | 300004 | 南风股份 | 130,000 | 4,706,000.00 | 3.17 |
| 8 | 300238 | 冠昊生物 | 150,000 | 4,425,000.00 | 2.98 |
| 9 | 300303 | 聚飞光电 | 219,938 | 4,400,959.38 | 2.96 |
| 10 | 300146 | 汤臣倍健 | 60,000 | 4,373,400.00 | 2.94 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 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 | 600383 | 金地集团 | 49,936,017.52 | 21.88 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 37,568,721.96 | 16.46 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 33,968,696.86 | 14.89 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 33,695,043.81 | 14.77 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 28,043,684.62 | 12.29 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 26,690,714.40 | 11.70 |
| 7 | 600880 | 博瑞传播 | 25,225,295.71 | 11.05 |
| 8 | 000400 | 许继电气 | 23,870,072.40 | 10.46 |
| 9 | 300146 | 汤臣倍健 | 23,127,768.93 | 10.13 |
| 10 | 300074 | 华平股份 | 23,127,275.45 | 10.13 |
| 11 | 600703 | 三安光电 | 22,931,784.73 | 10.05 |
| 12 | 600720 | 祁连山 | 22,914,203.16 | 10.04 |
| 13 | 002005 | 德豪润达 | 21,692,561.12 | 9.51 |
| 14 | 002375 | 亚厦股份 | 20,205,348.57 | 8.85 |
| 15 | 300088 | 长信科技 | 19,939,165.14 | 8.74 |
| 16 | 000024 | 招商地产 | 19,607,626.41 | 8.59 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 17 | 300303 | 聚飞光电 | 19,205,604.41 | 8.42 |
| 18 | 000002 | 万 科 A | 18,386,791.43 | 8.06 |
| 19 | 600835 | 上海机电 | 17,930,536.11 | 7.86 |
| 20 | 000625 | 长安汽车 | 17,757,932.17 | 7.78 |
| 21 | 600837 | 海通证券 | 17,527,062.95 | 7.68 |
| 22 | 600804 | 鹏博士 | 17,487,005.92 | 7.66 |
| 23 | 601901 | 方正证券 | 17,302,925.32 | 7.58 |
| 24 | 002570 | 贝因美 | 16,136,097.85 | 7.07 |
| 25 | 002385 | 大北农 | 15,540,240.66 | 6.81 |
| 26 | 600270 | 外运发展 | 15,491,248.71 | 6.79 |
| 27 | 002475 | 立讯精密 | 14,908,333.98 | 6.53 |
| 28 | 601012 | 隆基股份 | 14,837,510.68 | 6.50 |
| 29 | 600079 | 人福医药 | 14,639,038.15 | 6.42 |
| 30 | 601166 | 兴业银行 | 14,562,650.94 | 6.38 |
| 31 | 000001 | 平安银行 | 14,325,863.84 | 6.28 |
| 32 | 600000 | 浦发银行 | 14,099,751.15 | 6.18 |
| 33 | 600089 | 特变电工 | 14,056,583.75 | 6.16 |
| 34 | 002065 | 东华软件 | 13,951,098.07 | 6.11 |
| 35 | 002292 | 奥飞动漫 | 13,918,010.00 | 6.10 |
| 36 | 600486 | 扬农化工 | 13,588,910.91 | 5.95 |
| 37 | 600196 | 复星医药 | 12,979,781.33 | 5.69 |
| 38 | 600805 | 悦达投资 | 12,912,086.00 | 5.66 |
| 39 | 002364 | 中恒电气 | 12,857,370.54 | 5.63 |
| 40 | 300058 | 蓝色光标 | 12,819,651.86 | 5.62 |
| 41 | 600157 | 永泰能源 | 12,654,567.91 | 5.55 |
| 42 | 600418 | 江淮汽车 | 12,392,530.68 | 5.43 |
| 43 | 002236 | 大华股份 | 12,281,161.79 | 5.38 |
| 44 | 600104 | 上汽集团 | 12,222,610.74 | 5.36 |
| 45 | 002450 | 康得新 | 12,137,986.47 | 5.32 |
| 46 | 600388 | 龙净环保 | 12,088,915.42 | 5.30 |
| 47 | 002234 | 民和股份 | 11,792,773.70 | 5.17 |
| 48 | 600406 | 国电南瑞 | 11,744,445.48 | 5.15 |
| 49 | 601169 | 北京银行 | 11,501,518.16 | 5.04 |
| 50 | 002456 | 欧菲光 | 11,486,797.31 | 5.03 |
| 51 | 600801 | 华新水泥 | 11,081,953.06 | 4.86 |
| 52 | 002353 | 杰瑞股份 | 10,903,757.07 | 4.78 |
| 53 | 300207 | 欣旺达 | 10,701,358.88 | 4.69 |
| 54 | 300101 | 国腾电子 | 10,379,826.95 | 4.55 |
| 55 | 300059 | 东方财富 | 10,000,658.40 | 4.38 |
| 56 | 002035 | 华帝股份 | 9,033,448.75 | 3.96 |
| 57 | 000415 | 渤海租赁 | 8,959,233.13 | 3.93 |
| 58 | 600261 | 阳光照明 | 8,871,011.75 | 3.89 |
| 59 | 601688 | 华泰证券 | 8,485,028.58 | 3.72 |
| 60 | 300161 | 华中数控 | 8,391,324.59 | 3.68 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 61 | 300070 | 碧水源 | 8,385,272.30 | 3.67 |
| 62 | 002022 | 科华生物 | 8,216,902.95 | 3.60 |
| 63 | 600546 | 山煤国际 | 7,893,067.42 | 3.46 |
| 64 | 600702 | 沱牌舍得 | 7,704,411.76 | 3.38 |
| 65 | 600030 | 中信证券 | 7,681,607.29 | 3.37 |
| 66 | 002104 | 恒宝股份 | 7,680,375.09 | 3.37 |
| 67 | 002573 | 国电清新 | 7,672,331.50 | 3.36 |
| 68 | 600637 | 百视通 | 7,640,376.36 | 3.35 |
| 69 | 300238 | 冠昊生物 | 7,631,155.31 | 3.34 |
| 70 | 002482 | 广田股份 | 7,566,024.20 | 3.32 |
| 71 | 300229 | 拓尔思 | 7,421,539.69 | 3.25 |
| 72 | 600894 | 广日股份 | 7,319,845.09 | 3.21 |
| 73 | 600111 | 包钢稀土 | 7,272,610.20 | 3.19 |
| 74 | 600525 | 长园集团 | 7,236,150.50 | 3.17 |
| 75 | 600859 | 王府井 | 7,066,788.56 | 3.10 |
| 76 | 600389 | 江山股份 | 7,062,078.42 | 3.09 |
| 77 | 300083 | 劲胜股份 | 6,966,932.48 | 3.05 |
| 78 | 002439 | 启明星辰 | 6,928,635.27 | 3.04 |
| 79 | 000006 | 深振业A | 6,881,053.16 | 3.02 |
| 80 | 002396 | 星网锐捷 | 6,578,044.46 | 2.88 |
| 81 | 600166 | 福田汽车 | 6,565,657.97 | 2.88 |
| 82 | 000731 | 四川美丰 | 6,489,747.82 | 2.84 |
| 83 | 600312 | 平高电气 | 6,475,103.30 | 2.84 |
| 84 | 300205 | 天喻信息 | 6,447,356.49 | 2.83 |
| 85 | 300004 | 南风股份 | 6,421,887.45 | 2.81 |
| 86 | 300057 | 万顺股份 | 6,322,068.57 | 2.77 |
| 87 | 000423 | 东阿阿胶 | 6,311,181.11 | 2.77 |
| 88 | 000797 | 中国武夷 | 6,307,239.40 | 2.76 |
| 89 | 002630 | 华西能源 | 6,280,447.48 | 2.75 |
| 90 | 601788 | 光大证券 | 6,270,951.00 | 2.75 |
| 91 | 600123 | 兰花科创 | 6,263,000.00 | 2.74 |
| 92 | 300105 | 龙源技术 | 6,259,282.80 | 2.74 |
| 93 | 002638 | 勤上光电 | 6,170,392.12 | 2.70 |
| 94 | 002550 | 千红制药 | 6,096,876.00 | 2.67 |
| 95 | 002663 | 普邦园林 | 5,935,309.66 | 2.60 |
| 96 | 000049 | 德赛电池 | 5,919,641.62 | 2.59 |
| 97 | 601668 | 中国建筑 | 5,905,000.00 | 2.59 |
| 98 | 300090 | 盛运股份 | 5,887,941.20 | 2.58 |
| 99 | 002522 | 浙江众成 | 5,826,918.23 | 2.55 |
| 100 | 300198 | 纳川股份 | 5,810,595.25 | 2.55 |
| 101 | 000525 | 红太阳 | 5,680,034.77 | 2.49 |
| 102 | 002520 | 日发精机 | 5,631,732.91 | 2.47 |
| 103 | 601318 | 中国平安 | 5,531,521.00 | 2.42 |
| 104 | 600809 | 山西汾酒 | 5,511,023.40 | 2.42 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 105 | 601998 | 中信银行 | 5,489,700.98 | 2.41 |
| 106 | 002081 | 金螳螂 | 5,460,206.52 | 2.39 |
| 107 | 000338 | 潍柴动力 | 5,408,949.60 | 2.37 |
| 108 | 000783 | 长江证券 | 5,403,635.25 | 2.37 |
| 109 | 300014 | 亿纬锂能 | 5,359,329.68 | 2.35 |
| 110 | 000937 | 冀中能源 | 5,337,477.26 | 2.34 |
| 111 | 002635 | 安洁科技 | 5,251,607.96 | 2.30 |
| 112 | 300021 | 大禹节水 | 5,187,736.49 | 2.27 |
| 113 | 002258 | 利尔化学 | 5,067,098.12 | 2.22 |
| 114 | 002106 | 莱宝高科 | 5,008,213.27 | 2.19 |
| 115 | 000915 | 山大华特 | 5,003,497.71 | 2.19 |
| 116 | 000540 | 中天城投 | 4,866,017.86 | 2.13 |
| 117 | 000885 | 同力水泥 | 4,841,495.61 | 2.12 |
| 118 | 300104 | 乐视网 | 4,831,666.60 | 2.12 |

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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 | 600383 | 金地集团 | 48,030,446.99 | 21.05 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 36,436,384.92 | 15.97 |
| 3 | 002241 | 歌尔声学 | 34,898,725.36 | 15.29 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 34,729,410.38 | 15.22 |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 33,579,820.54 | 14.72 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 28,849,186.05 | 12.64 |
| 7 | 600880 | 博瑞传播 | 27,287,517.77 | 11.96 |
| 8 | 300074 | 华平股份 | 25,800,156.35 | 11.31 |
| 9 | 300088 | 长信科技 | 25,129,515.84 | 11.01 |
| 10 | 000002 | 万科 A | 23,562,320.62 | 10.33 |
| 11 | 600805 | 悦达投资 | 23,304,820.51 | 10.21 |
| 12 | 600104 | 上汽集团 | 23,111,323.09 | 10.13 |
| 13 | 600720 | 祁连山 | 22,256,844.33 | 9.75 |
| 14 | 300146 | 汤臣倍健 | 22,196,579.88 | 9.73 |
| 15 | 300058 | 蓝色光标 | 21,548,044.49 | 9.44 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 16 | 002236 | 大华股份 | 21,349,587.14 | 9.36 |
| 17 | 002005 | 德豪润达 | 20,752,163.92 | 9.09 |
| 18 | 002385 | 大北农 | 20,520,236.66 | 8.99 |
| 19 | 600703 | 三安光电 | 20,384,707.24 | 8.93 |
| 20 | 000024 | 招商地产 | 19,646,590.99 | 8.61 |
| 21 | 002375 | 亚厦股份 | 19,402,253.91 | 8.50 |
| 22 | 000400 | 许继电气 | 18,616,752.19 | 8.16 |
| 23 | 601901 | 方正证券 | 18,517,869.06 | 8.11 |
| 24 | 002570 | 贝因美 | 17,668,885.62 | 7.74 |
| 25 | 600837 | 海通证券 | 17,645,664.49 | 7.73 |
| 26 | 600406 | 国电南瑞 | 17,462,146.86 | 7.65 |
| 27 | 600804 | 鹏博士 | 17,261,467.46 | 7.56 |
| 28 | 600418 | 江淮汽车 | 17,029,964.97 | 7.46 |
| 29 | 601012 | 隆基股份 | 15,906,183.78 | 6.97 |
| 30 | 600079 | 人福医药 | 15,798,227.81 | 6.92 |
| 31 | 600835 | 上海机电 | 15,659,384.24 | 6.86 |
| 32 | 002475 | 立讯精密 | 15,602,829.89 | 6.84 |
| 33 | 600270 | 外运发展 | 15,558,804.19 | 6.82 |
| 34 | 300303 | 聚飞光电 | 15,522,397.33 | 6.80 |
| 35 | 002292 | 奥飞动漫 | 14,904,487.98 | 6.53 |
| 36 | 000625 | 长安汽车 | 14,844,251.50 | 6.50 |
| 37 | 002065 | 东华软件 | 14,802,490.89 | 6.49 |
| 38 | 002353 | 杰瑞股份 | 14,649,674.05 | 6.42 |
| 39 | 600000 | 浦发银行 | 14,538,002.22 | 6.37 |
| 40 | 000001 | 平安银行 | 13,852,912.68 | 6.07 |
| 41 | 600486 | 扬农化工 | 13,836,986.68 | 6.06 |
| 42 | 601166 | 兴业银行 | 13,798,755.47 | 6.05 |
| 43 | 600388 | 龙净环保 | 13,678,420.52 | 5.99 |
| 44 | 002456 | 欧菲光 | 12,858,086.28 | 5.63 |
| 45 | 002364 | 中恒电气 | 12,694,686.32 | 5.56 |
| 46 | 600089 | 特变电工 | 12,638,171.66 | 5.54 |
| 47 | 600196 | 复星医药 | 12,637,737.65 | 5.54 |
| 48 | 000049 | 德赛电池 | 11,661,501.85 | 5.11 |
| 49 | 601169 | 北京银行 | 11,372,061.52 | 4.98 |
| 50 | 600801 | 华新水泥 | 10,867,170.67 | 4.76 |
| 51 | 002415 | 海康威视 | 10,811,883.98 | 4.74 |
| 52 | 300101 | 国腾电子 | 10,708,790.40 | 4.69 |
| 53 | 600157 | 永泰能源 | 10,400,218.18 | 4.56 |
| 54 | 002234 | 民和股份 | 10,332,150.48 | 4.53 |
| 55 | 002035 | 华帝股份 | 9,975,587.25 | 4.37 |
| 56 | 600166 | 福田汽车 | 9,929,403.57 | 4.35 |
| 57 | 300207 | 欣旺达 | 9,821,919.40 | 4.30 |
| 58 | 300059 | 东方财富 | 9,782,593.66 | 4.29 |
| 59 | 600261 | 阳光照明 | 9,455,186.02 | 4.14 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 60 | 002450 | 康得新 | 9,400,638.44 | 4.12 |
| 61 | 002266 | 浙富控股 | 9,292,377.50 | 4.07 |
| 62 | 002004 | 华邦颖泰 | 8,860,462.91 | 3.88 |
| 63 | 002396 | 星网锐捷 | 8,731,064.67 | 3.83 |
| 64 | 000415 | 渤海租赁 | 8,268,435.97 | 3.62 |
| 65 | 002022 | 科华生物 | 8,142,270.96 | 3.57 |
| 66 | 601688 | 华泰证券 | 8,055,371.41 | 3.53 |
| 67 | 002573 | 国电清新 | 7,956,480.98 | 3.49 |
| 68 | 600894 | 广日股份 | 7,602,256.31 | 3.33 |
| 69 | 002482 | 广田股份 | 7,409,168.99 | 3.25 |
| 70 | 002104 | 恒宝股份 | 7,399,548.15 | 3.24 |
| 71 | 300229 | 拓尔思 | 7,318,530.68 | 3.21 |
| 72 | 600030 | 中信证券 | 7,268,113.00 | 3.18 |
| 73 | 600637 | 百视通 | 7,266,818.90 | 3.18 |
| 74 | 600389 | 江山股份 | 7,239,250.00 | 3.17 |
| 75 | 600111 | 包钢稀土 | 7,147,100.72 | 3.13 |
| 76 | 600546 | 山煤国际 | 7,000,320.65 | 3.07 |
| 77 | 002503 | 搜于特 | 6,885,742.37 | 3.02 |
| 78 | 000006 | 深振业 A | 6,843,753.92 | 3.00 |
| 79 | 600859 | 王府井 | 6,819,433.18 | 2.99 |
| 80 | 000731 | 四川美丰 | 6,818,882.06 | 2.99 |
| 81 | 002439 | 启明星辰 | 6,810,541.90 | 2.98 |
| 82 | 002638 | 勤上光电 | 6,796,299.03 | 2.98 |
| 83 | 300136 | 信维通信 | 6,743,974.60 | 2.96 |
| 84 | 000423 | 东阿阿胶 | 6,565,240.88 | 2.88 |
| 85 | 300014 | 亿纬锂能 | 6,555,023.71 | 2.87 |
| 86 | 300057 | 万顺股份 | 6,535,824.45 | 2.86 |
| 87 | 300105 | 龙源技术 | 6,530,090.10 | 2.86 |
| 88 | 300205 | 天喻信息 | 6,528,915.23 | 2.86 |
| 89 | 600702 | 沱牌舍得 | 6,393,982.97 | 2.80 |
| 90 | 600123 | 兰花科创 | 6,305,225.00 | 2.76 |
| 91 | 000157 | 中联重科 | 6,277,369.25 | 2.75 |
| 92 | 600312 | 平高电气 | 6,241,733.30 | 2.74 |
| 93 | 002550 | 千红制药 | 6,098,124.51 | 2.67 |
| 94 | 300090 | 盛运股份 | 6,074,454.91 | 2.66 |
| 95 | 002522 | 浙江众成 | 6,035,601.36 | 2.64 |
| 96 | 600519 | 贵州茅台 | 6,019,027.28 | 2.64 |
| 97 | 300115 | 长盈精密 | 6,000,247.73 | 2.63 |
| 98 | 000797 | 中国武夷 | 5,972,891.79 | 2.62 |
| 99 | 601788 | 光大证券 | 5,923,669.00 | 2.60 |
| 100 | 000063 | 中兴通讯 | 5,895,536.45 | 2.58 |
| 101 | 000528 | 柳 工 | 5,824,513.37 | 2.55 |
| 102 | 601318 | 中国平安 | 5,818,277.13 | 2.55 |
| 103 | 000525 | 红 太 阳 | 5,770,400.26 | 2.53 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 104 | 002081 | 金螳螂 | 5,730,049.72 | 2.51 |
| 105 | 002635 | 安洁科技 | 5,674,376.62 | 2.49 |
| 106 | 002630 | 华西能源 | 5,638,497.70 | 2.47 |
| 107 | 601998 | 中信银行 | 5,619,653.04 | 2.46 |
| 108 | 601668 | 中国建筑 | 5,595,000.00 | 2.45 |
| 109 | 300198 | 纳川股份 | 5,566,780.32 | 2.44 |
| 110 | 000338 | 潍柴动力 | 5,566,128.78 | 2.44 |
| 111 | 300021 | 大禹节水 | 5,488,495.24 | 2.41 |
| 112 | 600690 | 青岛海尔 | 5,272,289.89 | 2.31 |
| 113 | 600741 | 华域汽车 | 5,270,508.49 | 2.31 |
| 114 | 000915 | 山大华特 | 5,210,435.87 | 2.28 |
| 115 | 002106 | 莱宝高科 | 5,183,312.80 | 2.27 |
| 116 | 002258 | 利尔化学 | 5,178,190.12 | 2.27 |
| 117 | 002308 | 威创股份 | 5,080,388.52 | 2.23 |
| 118 | 000783 | 长江证券 | 5,034,439.70 | 2.21 |
| 119 | 300070 | 碧水源 | 5,023,251.50 | 2.20 |
| 120 | 600809 | 山西汾酒 | 4,993,352.56 | 2.19 |
| 121 | 000540 | 中天城投 | 4,947,923.29 | 2.17 |
| 122 | 300104 | 乐视网 | 4,818,637.59 | 2.11 |
| 123 | 000937 | 冀中能源 | 4,730,764.45 | 2.07 |
| 124 | 002520 | 日发精机 | 4,704,666.45 | 2.06 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 1,700,618,714.88 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,800,951,767.13 |

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 307,224.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,988,822.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,085.75 |
| 5 | 应收申购款 | 322,178.31 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,623,310.50 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|--------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 5,523 | 21,164.45 | 8,155,791.19 | 6.98% | 108,735,451.87 | 93.02% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 203,637.91 | 0.1742% |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；
本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2011年9月20日)基金份额总额 | 795,756,488.43 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 223,774,935.75 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 241,762,464.05 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 348,646,156.74 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 116,891,243.06 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，因业务发展需要，广发基金管理有限公司第四届董事会第二十六次会议表决方案（五）通过关于聘请 2013 年度基金审计机构的议案，本基金改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期，本基金应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 40,000.00 元。该事务所为本基金提供审计服务 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东兴证券 | 3 | 279,211,496.78 | 7.97% | 198,352.21 | 6.72% | - |
| 中信建投 | 4 | 235,427,211.14 | 6.72% | 214,332.11 | 7.26% | - |
| 广发证券 | 7 | 193,060,688.54 | 5.51% | 173,941.54 | 5.89% | - |
| 平安证券 | 4 | 182,881,689.52 | 5.22% | 129,043.49 | 4.37% | - |
| 招商证券 | 3 | 168,274,112.43 | 4.81% | 153,195.71 | 5.19% | - |
| 中投证券 | 3 | 151,839,433.15 | 4.34% | 138,234.34 | 4.68% | - |
| 兴业证券 | 4 | 139,498,816.08 | 3.98% | 124,058.14 | 4.20% | - |
| 华福证券 | 2 | 131,794,675.29 | 3.76% | 119,985.97 | 4.06% | - |
| 民生证券 | 1 | 119,941,260.40 | 3.43% | 82,517.77 | 2.79% | - |

| | | | | | | |
|----------|---|----------------|-------|-----------|-------|--------|
| 广州证券 | 2 | 107,694,571.47 | 3.08% | 76,506.28 | 2.59% | 新增 1 个 |
| 华创证券 | 1 | 102,277,941.22 | 2.92% | 93,113.66 | 3.15% | - |
| 国泰君安 | 4 | 101,525,424.99 | 2.90% | 92,428.85 | 3.13% | - |
| 信达证券 | 2 | 98,566,327.15 | 2.81% | 69,385.17 | 2.35% | - |
| 方正证券 | 4 | 97,074,261.62 | 2.77% | 70,379.42 | 2.38% | 新增 1 个 |
| 东北证券 | 2 | 90,243,408.39 | 2.58% | 81,978.56 | 2.78% | - |
| 北京高华 | 1 | 73,280,556.48 | 2.09% | 66,714.38 | 2.26% | - |
| 上海证券 | 1 | 72,994,051.56 | 2.08% | 51,854.95 | 1.76% | 新增 1 个 |
| 国海证券 | 1 | 70,897,828.46 | 2.02% | 62,791.57 | 2.13% | - |
| 中信证券 | 3 | 67,618,241.86 | 1.93% | 61,558.95 | 2.08% | - |
| 长江证券 | 3 | 64,125,921.03 | 1.83% | 58,379.98 | 1.98% | - |
| 光大证券 | 3 | 60,819,604.55 | 1.74% | 55,370.48 | 1.87% | - |
| 联讯证券 | 2 | 55,735,254.81 | 1.59% | 49,710.23 | 1.68% | - |
| 海通证券 | 2 | 55,654,669.29 | 1.59% | 50,668.13 | 1.72% | - |
| 中信证券（浙江） | 1 | 55,243,397.16 | 1.58% | 50,074.00 | 1.70% | - |
| 华宝证券 | 1 | 54,936,651.72 | 1.57% | 50,013.60 | 1.69% | - |
| 英大证券 | 1 | 52,115,114.10 | 1.49% | 37,022.51 | 1.25% | - |
| 长城证券 | 1 | 51,321,867.59 | 1.47% | 46,723.49 | 1.58% | - |
| 西部证券 | 1 | 50,440,864.26 | 1.44% | 45,921.72 | 1.55% | - |
| 山西证券 | 1 | 45,739,992.72 | 1.31% | 41,641.76 | 1.41% | - |
| 宏源证券 | 3 | 45,106,465.06 | 1.29% | 32,043.27 | 1.08% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 44,410,932.90 | 1.27% | 40,431.86 | 1.37% | - |
| 安信证券 | 5 | 43,090,785.88 | 1.23% | 39,230.01 | 1.33% | 新增 1 个 |
| 国金证券 | 1 | 42,063,084.37 | 1.20% | 38,294.29 | 1.30% | - |
| 银河证券 | 3 | 39,370,224.63 | 1.12% | 35,842.65 | 1.21% | - |
| 万联证券 | 2 | 39,105,901.16 | 1.12% | 35,603.71 | 1.21% | 新增 1 个 |
| 川财证券 | 2 | 37,834,619.55 | 1.08% | 26,877.84 | 0.91% | 新增 2 个 |
| 东莞证券 | 1 | 33,216,119.55 | 0.95% | 30,239.72 | 1.02% | - |
| 红塔证券 | 0 | 30,264,424.65 | 0.86% | 26,781.13 | 0.91% | 减少 1 个 |
| 财富证券 | 2 | 26,499,353.71 | 0.76% | 24,124.98 | 0.82% | 新增 1 个 |
| 齐鲁证券 | 3 | 23,780,764.88 | 0.68% | 21,649.85 | 0.73% | - |
| 厦门证券 | 1 | 20,918,168.87 | 0.60% | 14,860.35 | 0.50% | - |
| 申银万国 | 3 | 18,739,826.31 | 0.54% | 17,061.07 | 0.58% | - |
| 国都证券 | 1 | 14,655,819.36 | 0.42% | 13,342.64 | 0.45% | - |
| 东方证券 | 2 | 8,789,879.76 | 0.25% | 8,002.38 | 0.27% | - |
| 国信证券 | 2 | 3,488,777.61 | 0.10% | 3,176.16 | 0.11% | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 |

| | | | | | | | 个、减少 1 个 |
|--------|---|---|---|---|---|---|-------------|
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 2 | - | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 财富里昂 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 2 | - | - | - | - | - | 新增 2 个 |
| 民族证券 | 1 | - | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 首创证券 | 1 | - | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 中原证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - | 新增 2 个 |

注：（1）交易席位选择标准：

- （一）财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- （三）具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- （四）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- （五）能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- （六）能提供其他基金运作和管理所需的服务。

（2）交易席位选择流程：

- 1、对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- 2、协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中投证券 | 236,917.80 | 100.00% | - | - | - | - |

广发基金管理有限公司

二〇一四年三月三十一日