

# 广发制造业精选股票型证券投资基金

## 2014 年半年度报告摘要

2014 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：二〇一四年八月二十九日

## 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。

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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 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	157,529,479.83 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

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	5,065,939.04
本期利润	13,326,527.37
加权平均基金份额本期利润	0.1016
本期基金份额净值增长率	8.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3150
期末基金资产净值	216,755,064.52
期末基金份额净值	1.376

注：1.所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
过去一个月	6.42%	1.18%	4.36%	0.88%	2.06%	0.30%
过去三个月	9.38%	1.27%	5.74%	0.91%	3.64%	0.36%
过去六个月	8.18%	1.55%	5.73%	1.12%	2.45%	0.43%
过去一年	14.29%	1.57%	23.04%	1.16%	-8.75%	0.41%
自基金合同生效起至今	37.60%	1.35%	3.62%	1.23%	33.98%	0.12%

注：1.本基金的业绩比较基准：80%×申银万国制造业指数+20%×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历史走势对比图

(2011 年 9 月 20 日至 2014 年 6 月 30 日)



## 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 1.2688 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 22 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、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、国际业务部、

营销服务部、互联网金融部（下辖深圳理财中心、杭州理财中心）、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外，还出资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。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人管理五十一只开放式基金---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、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置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、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金和广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为 1271.27 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	2011-09-20	-	9	男，中国籍，理学硕士，持有基金

	经理；广发核心精选股票基金的基金经理；广发策略优选混合基金的基金经理				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权益投资一部工作，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，2014 年 3 月 17 日起任广发策略优选混合基金的基金经理。
--	------------------------------------	--	--	--	--

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.基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3.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。监察稽核部风险控制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；稽核岗通过对投资、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，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

## 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

上半年，创业板指数和主板指数走势差异较大。创业板大幅波动，主板指数则整体呈窄幅波动态势。报告期内，上证综指、深证成指、创业板指和申万制造业指数涨幅分别为-3.20%、-9.59%、7.69%、5.74%。

报告期内，宏观经济在前 4 个月延续了去年四季度的回落趋势，PMI、投资增速、发电量增速、大宗材料价格等数据均显示宏观经济景气度不佳，得益于 3 月开始的稳增长措施，宏观数据在 5、6 月出现明显的企稳反弹。新一届领导层执政思路清晰，对当前社会经济存在的问题有清晰认识，稳增长措施以“微刺激”和“定向放松”为主，更强调加快改革与调结构，以改革促发展。主板指数则在经济下滑与中央政府稳增长、促改革的预期博弈中窄幅波动，涨跌幅度均有限。

创业板则是一幅完全不同的情景。在头两个月快速上涨并创出历史新高，时至 2 月底，随着 IPO 再次重启的时间窗口临近、季末资金面趋紧、美股科技股进入调整期，投资者对中小市值成长股的风险偏好突然下降，创业板指数在 3 至 5 月快速调整。之后，随着宏观经济企稳，IPO 节奏明确放缓、信用风险暴露时间点延后，市场主题投资热情再次被点燃，创业板也随之反弹。回顾创业板上半年的两次上涨，其大背景都是中国经济平稳回落的趋势难改，周期性板块难有趋势性机会，所以投资者对经济的转型与改革给予了很高的热情。新经济中的新产业、新技术、新商业模式被持续追捧，移动互联网、大数据与云计算、可穿戴设备、智能家居、新能源汽车、互联网彩票与教育等各类主题层出不穷，而这种热情往往在短期内快速释放，背后的原因可能是担心产能过剩、信用违约、地产泡沫破裂等中长期的系统性风险。

报告期内，本基金整体表现尚可。主要是积极参与了新能源汽车、智能家居、可穿戴设备、基因检测及细胞技术、移动互联网等主题性机会，取得了不错的收益，但在 3 至 5 月创业板快速调整时未能及时减仓，净值遭受了不小的损失。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上半年基金净值增长率为 8.18%，同期业绩比较基准收益率为 5.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计宏观经济平稳下滑趋势难改，考虑到去年三季度的高基数以及地产投资下滑的势头仍未止住，今年三季度的同比数据也许不会太好看。虽有政策对冲，但考虑到信贷总量平稳和影子银行收缩，可能亦难达到市场大部分投资者的预期，由此引发的信用违约以及市场风险偏好下降可能会对 A 股市场造成一定冲击，而且对成长股的冲击会大于主板蓝筹，对此需密切关注；不过从另外一个角度看，随着问题恶化，放松的力度会不断加大，系统性风险出现也是小概率事件。同时，市场上行的催化剂为：1) 政策放松力度超预期，配合外需拉动，进而推动中国经济进入一个较为持续的弱复苏周期；2) 沪港通快速推进，折价的 A 股蓝筹向港股靠拢拉动主板上涨。总体而言，主板指数依然维持窄幅波动的概率较大，纵有下跌也幅度有限。从中期看，A 股市场的投资机会主要仍在成长股和创业板。一方面，大部分传统的白马成长股依然处在快速增长阶段，在经过持续调整后，风险收益比已经非常有吸引力；另一方面，许多新兴成长股虽然目前估值水平仍不低，但未来拥有巨大成长空间，从长期来看仍具有了一定配置价值，我们所要做的是找到其中真正能够长大的优秀企业以及合适的买点。

对强周期性行业，我们依然采取谨慎回避的态度，可对部分在过去几年中有明显产能收缩的小金属、小化工品保持关注。对于符合经济转型方向、景气度高的行业，如环保装备、智能电网、消费电子及安防、油气装备、医疗器械等，尤其是其中的优质白马股，会作为基本配置。对于很多代表着新产业、新技术、新商业模式的公司，我们会紧密关注，去伪存真、积极参与。

在 2014 年下半年，本基金希望能为投资者带来较好的收益。

#### 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**

根据本基金合同中“基金的收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 2014 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：广发制造业精选股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	27,053,689.88	19,058,745.34
结算备付金	414,075.89	1,168,594.06
存出保证金	174,554.42	307,224.04
交易性金融资产	164,997,884.75	125,390,522.88
其中：股票投资	164,997,884.75	125,390,522.88
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	26,016,154.93	8,988,822.40
应收利息	6,501.63	5,085.75
应收股利	-	-
应收申购款	259,325.31	322,178.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>218,922,186.81</b>	<b>155,241,172.78</b>
负债和所有者权益	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>	-	-
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
应付赎回款	864,548.26	699,851.24
应付管理人报酬	254,655.12	189,319.55
应付托管费	42,442.51	31,553.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	709,981.29	1,421,311.08
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	295,495.11	226,272.81
<b>负债合计</b>	<b>2,167,122.29</b>	<b>6,557,846.50</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	157,529,479.83	116,891,243.06
未分配利润	59,225,584.69	31,792,083.22
<b>所有者权益合计</b>	<b>216,755,064.52</b>	<b>148,683,326.28</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>218,922,186.81</b>	<b>155,241,172.78</b>

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.376 元，基金份额总额 157,529,479.83 份。

## 6.2 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>16,526,626.24</b>	<b>24,949,700.25</b>
1.利息收入	81,733.07	100,145.63
其中：存款利息收入	81,733.07	100,145.63
债券利息收入	-	-
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）	8,065,798.31	29,768,840.11
其中：股票投资收益	7,503,572.32	28,984,044.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	562,225.99	784,795.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8,260,588.33	-5,115,498.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	118,506.53	196,212.76
<b>减：二、费用</b>	<b>3,200,098.87</b>	<b>4,087,789.01</b>
1. 管理人报酬	1,282,611.28	1,249,499.92
2. 托管费	213,768.55	208,250.04
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	1,503,112.55	2,440,621.01
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	200,606.49	189,418.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>13,326,527.37</b>	<b>20,861,911.24</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>13,326,527.37</b>	<b>20,861,911.24</b>

### 6.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	116,891,243.06	31,792,083.22	148,683,326.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,326,527.37	13,326,527.37
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）	40,638,236.77	14,106,974.10	54,745,210.87
其中：1.基金申购款	122,237,218.81	41,012,066.54	163,249,285.35
2.基金赎回款	-81,598,982.04	-26,905,092.44	-108,504,074.48
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）	157,529,479.83	59,225,584.69	216,755,064.52
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	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）	-	20,861,911.24	20,861,911.24
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）	-72,766,987.99	5,509,280.53	-67,257,707.46

其中：1.基金申购款	119,436,001.64	30,028,841.13	149,464,842.77
2.基金赎回款	-192,202,989.63	-24,519,560.60	-216,722,550.23
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）	151,007,947.76	30,795,936.72	181,803,884.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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： $80\% \times \text{申银万国制造业指数} + 20\% \times \text{中证全债指数}$ 。

本基金的财务报表于 2014 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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

本基金本报告期不存在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。

### 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
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

## 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总



		额的比例		额的比例
广发证券股份有限公司	4,519,369.24	0.43%	160,601,679.05	9.75%

### 6.4.8.1.2 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。

### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	4,114.47	0.47%	1,023.31	0.14%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	144,391.01	10.34%	81,196.96	5.02%

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。

### 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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,282,611.28
其中：支付销售机构的客户维护费	288,512.70	328,394.87

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	213,768.55	208,250.04

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。

#### 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

本基金本报告期内及可比期间内未与关联交易对手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

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30 日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30 日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	22,640,754.72	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	22,640,754.72	-
期末持有的基金份额	14.37%	-

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 6.4.8.4 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。

#### 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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013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	27,053,689.88	72,828.03	26,625,072.63	86,302.86

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，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	600978	宜华木业	配股	120,000.00	483,600.00
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-

#### 6.4.9 期末（2014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

截止本报告期末 2014 年 6 月 30 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。

**6.4.9.2 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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300166	东方国信	2014-04-09	重大事项	18.71	2014-07-09	20.58	95,693.00	1,736,844.00	1,790,416.03	-
300323	华灿光电	2014-04-28	重大事项	20.06	2014-07-28	11.21	500,000.00	9,269,251.71	10,030,000.00	-

**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 2014 年 6 月 30 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。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 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。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

**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	164,997,884.75	75.37
	其中：股票	164,997,884.75	75.37
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	27,467,765.77	12.55
7	其他各项资产	26,456,536.29	12.08
8	合计	218,922,186.81	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	采矿业	-	-
C	制造业	138,712,140.40	63.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,372,000.00	1.09
E	建筑业	2,047,728.32	0.94
F	批发和零售业	-	-
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	21,866,016.03	10.09
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	-	-
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	-	-

	合计	164,997,884.75	76.12
--	----	----------------	-------

### 7.3 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	600,000	12,030,000.00	5.55
2	300207	欣旺达	399,853	11,675,707.60	5.39
3	002184	海得控制	899,815	10,437,854.00	4.82
4	300323	华灿光电	500,000	10,030,000.00	4.63
5	002138	顺络电子	440,000	9,178,400.00	4.23
6	002456	欧菲光	399,902	8,569,899.86	3.95
7	000625	长安汽车	660,000	8,124,600.00	3.75
8	300266	兴源过滤	250,000	7,555,000.00	3.49
9	300238	冠昊生物	130,000	6,611,800.00	3.05
10	300115	长盈精密	300,000	6,606,000.00	3.05

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	300323	华灿光电	14,805,625.54	9.96
2	300021	大禹节水	14,609,722.07	9.83
3	601519	大智慧	13,456,775.85	9.05
4	000625	长安汽车	12,805,483.74	8.61
5	002184	海得控制	12,393,630.48	8.34
6	300002	神州泰岳	12,156,273.13	8.18
7	300379	东方通	11,568,125.33	7.78
8	300266	兴源过滤	10,561,906.46	7.10
9	300226	上海钢联	10,419,472.81	7.01
10	300287	飞利信	10,297,908.00	6.93
11	002312	三泰电子	10,050,479.43	6.76
12	002030	达安基因	10,018,409.36	6.74
13	002456	欧菲光	9,968,494.58	6.70
14	600149	廊坊发展	9,713,064.99	6.53
15	300049	福瑞股份	9,317,625.71	6.27
16	300207	欣旺达	9,262,876.87	6.23

17	002180	万力达	9,138,592.20	6.15
18	002138	顺络电子	8,981,435.11	6.04
19	300017	网宿科技	8,872,564.50	5.97
20	002527	新时达	8,754,069.92	5.89
21	000712	锦龙股份	8,551,177.84	5.75
22	300104	乐视网	8,459,108.60	5.69
23	600201	金宇集团	8,146,170.41	5.48
24	300245	天玑科技	8,126,672.22	5.47
25	002520	日发精机	7,911,363.76	5.32
26	002207	准油股份	7,660,371.65	5.15
27	300165	天瑞仪器	7,639,479.41	5.14
28	300010	立思辰	7,608,019.44	5.12
29	300070	碧水源	7,480,001.97	5.03
30	300335	迪森股份	7,402,943.97	4.98
31	300115	长盈精密	7,385,019.33	4.97
32	002153	石基信息	7,280,120.74	4.90
33	300133	华策影视	6,632,266.60	4.46
34	300183	东软载波	6,372,958.60	4.29
35	300011	鼎汉技术	6,364,338.77	4.28
36	002236	大华股份	6,085,361.07	4.09
37	000541	佛山照明	5,913,329.54	3.98
38	000681	远东股份	5,878,471.90	3.95
39	300058	蓝色光标	5,752,201.58	3.87
40	300238	冠昊生物	5,719,216.94	3.85
41	601808	中海油服	5,674,588.78	3.82
42	300212	易华录	5,639,789.62	3.79
43	300235	方直科技	5,604,563.08	3.77
44	002353	杰瑞股份	5,239,232.48	3.52
45	002619	巨龙管业	5,030,630.60	3.38
46	002104	恒宝股份	4,746,884.98	3.19
47	600794	保税科技	4,726,263.36	3.18
48	600703	三安光电	4,546,728.43	3.06
49	002416	爱施德	4,338,585.80	2.92
50	300001	特锐德	4,269,253.32	2.87
51	002242	九阳股份	4,141,841.04	2.79
52	002465	海格通信	4,117,871.50	2.77
53	002229	鸿博股份	4,101,007.85	2.76
54	002094	青岛金王	4,035,448.00	2.71
55	300178	腾邦国际	3,943,400.00	2.65
56	300209	天泽信息	3,823,022.38	2.57
57	002276	万马股份	3,456,500.49	2.32
58	002373	联信永益	3,368,735.71	2.27
59	002234	*ST 民和	3,334,638.27	2.24
60	002271	东方雨虹	3,304,239.29	2.22

61	002441	众业达	3,294,127.67	2.22
62	002060	粤水电	3,273,808.92	2.20
63	300332	天壕节能	3,223,457.94	2.17
64	600978	宜华木业	3,118,521.75	2.10
65	002609	捷顺科技	3,073,649.84	2.07

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 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。

**7.4.2 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	300021	大禹节水	14,921,889.33	10.04
2	600149	廊坊发展	12,390,863.77	8.33
3	601519	大智慧	12,341,142.04	8.30
4	002030	达安基因	11,519,054.86	7.75
5	300002	神州泰岳	11,025,754.42	7.42
6	300379	东方通	10,605,971.11	7.13
7	002180	万力达	10,398,788.47	6.99
8	300070	碧水源	10,226,680.77	6.88
9	000625	长安汽车	9,542,107.38	6.42
10	002312	三泰电子	9,061,902.21	6.09
11	300049	福瑞股份	9,039,869.94	6.08
12	300010	立思辰	8,709,705.31	5.86
13	300266	兴源过滤	8,538,480.77	5.74
14	300238	冠昊生物	8,452,184.11	5.68
15	600703	三安光电	8,450,918.12	5.68
16	000712	锦龙股份	8,369,513.87	5.63
17	300104	乐视网	8,333,535.31	5.60
18	002236	大华股份	8,144,450.34	5.48
19	300245	天玑科技	7,428,470.52	5.00
20	002456	欧菲光	7,368,807.36	4.96
21	300161	华中数控	7,243,969.28	4.87
22	002241	歌尔声学	7,226,370.66	4.86
23	002207	准油股份	6,954,800.24	4.68
24	000541	佛山照明	6,826,237.87	4.59
25	300183	东软载波	6,793,067.41	4.57
26	000681	远东股份	6,779,572.72	4.56



27	300004	南风股份	6,713,377.00	4.52
28	300165	天瑞仪器	6,704,776.95	4.51
29	600835	上海机电	6,603,280.13	4.44
30	300226	上海钢联	6,430,301.70	4.32
31	300212	易华录	6,357,831.37	4.28
32	300133	华策影视	6,298,292.33	4.24
33	300235	方直科技	6,016,345.30	4.05
34	002416	爱施德	5,856,749.28	3.94
35	300058	蓝色光标	5,838,016.21	3.93
36	300323	华灿光电	5,804,484.18	3.90
37	300287	飞利信	5,699,289.19	3.83
38	002527	新时达	5,698,712.36	3.83
39	300335	迪森股份	5,575,227.78	3.75
40	601808	中海油服	5,391,463.16	3.63
41	002520	日发精机	5,374,049.99	3.61
42	600794	保税科技	4,955,845.00	3.33
43	300017	网宿科技	4,877,010.68	3.28
44	300146	汤臣倍健	4,806,900.00	3.23
45	300178	腾邦国际	4,393,871.00	2.96
46	002094	青岛金王	4,323,680.36	2.91
47	600525	长园集团	4,319,644.74	2.91
48	600201	金宇集团	4,202,778.71	2.83
49	002353	杰瑞股份	4,083,964.24	2.75
50	300232	洲明科技	3,988,968.08	2.68
51	002276	万马股份	3,920,570.37	2.64
52	002229	鸿博股份	3,830,888.19	2.58
53	600323	瀚蓝环境	3,589,899.02	2.41
54	002609	捷顺科技	3,563,471.05	2.40
55	002465	海格通信	3,495,197.00	2.35
56	002242	九阳股份	3,448,137.13	2.32
57	002008	大族激光	3,443,835.96	2.32
58	300209	天泽信息	3,391,387.73	2.28
59	601633	长城汽车	3,373,515.62	2.27
60	300157	恒泰艾普	3,363,192.39	2.26
61	000063	中兴通讯	3,286,834.94	2.21
62	002271	东方雨虹	3,268,924.91	2.20
63	002005	德豪润达	3,245,640.24	2.18
64	002441	众业达	3,194,248.08	2.15
65	300332	天壕节能	3,182,771.73	2.14
66	300011	鼎汉技术	3,133,689.67	2.11
67	002060	粤水电	3,035,473.29	2.04

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	536,842,245.04
卖出股票的收入（成交）总额	512,999,043.82

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 7.6 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

本报告期末本基金未持有债券。

### 7.7 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

### 7.8 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。

### 7.9 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

本报告期末本基金未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

- (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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

- (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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期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。

#### 7.12.3 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	174,554.42

2	应收证券清算款	26,016,154.93
3	应收股利	-
4	应收利息	6,501.63
5	应收申购款	259,325.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,456,536.29

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	300323	华灿光电	10,030,000.00	4.63	重大事项

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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
6,277	25,096.30	22,641,042.40	14.37%	134,888,437.43	85.63%

#### 8.2 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	0.1293%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## 9 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	116,891,243.06
本报告期基金总申购份额	122,237,218.81
减：本报告期基金总赎回份额	81,598,982.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	157,529,479.83

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 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	
兴业证券	4	99,277,084.33	9.46%	90,381.89	10.40%	-
东兴证券	3	95,249,238.99	9.08%	67,665.18	7.78%	-
万联证券	2	94,074,885.97	8.97%	85,645.99	9.85%	-
光大证券	3	7,319,162.98	0.70%	6,663.30	0.77%	-
国都证券	1	7,289,419.33	0.69%	6,636.39	0.76%	-
齐鲁证券	3	59,815,601.00	5.70%	42,493.09	4.89%	-
银河证券	3	51,259,720.84	4.89%	46,666.80	5.37%	-
广发证券	7	4,519,369.24	0.43%	4,114.47	0.47%	-
德邦证券	1	4,512,482.71	0.43%	4,108.24	0.47%	-
宏源证券	3	43,530,402.79	4.15%	30,923.94	3.56%	-
招商证券	3	28,633,353.20	2.73%	26,067.73	3.00%	-
联讯证券	2	27,485,170.03	2.62%	25,022.67	2.88%	-
中信建投	4	26,311,204.05	2.51%	23,953.62	2.76%	-
川财证券	2	24,957,787.32	2.38%	17,730.04	2.04%	-
平安证券	4	187,557,362.65	17.87%	158,573.18	18.24%	-
中信证券	3	1,650,088.00	0.16%	1,502.23	0.17%	-
民生证券	2	15,392,003.22	1.47%	10,934.44	1.26%	新增 1 个
方正证券	3	152,215,232.71	14.51%	115,484.09	13.28%	-
上海证券	1	14,235,213.61	1.36%	10,112.61	1.16%	-
中天证券	1	103,988,145.89	9.91%	94,670.75	10.89%	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	4	-	-	-	-	-
申银万国	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	4	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
广州证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1.交易席位选择标准：

- (1)财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2)经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3)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；

(4)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；

(5)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；

(6)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。

广发基金管理有限公司

二〇一四年八月二十九日