

# 广发深证 100 指数分级证券投资基金

## 2015 年半年度报告

### 2015 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>41</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
8.4 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 .....	42
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>11 备查文件目录 .....</b>	<b>45</b>
11.1 备查文件目录 .....	45
11.2 存放地点 .....	46
11.3 查阅方式 .....	46

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发深证 100 指数分级证券投资基金		
基金简称	广发深证 100 指数分级		
场内简称	广发 100		
基金主代码	162714		
交易代码	162714		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日		
基金管理人	广发基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	42,866,339.65 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 6 月 12 日		
下属分级基金的基金简称	广发深证 100 指数分级 A	广发深证 100 指数分级 B	广发深证 100 指数分级
下属分级基金的场内简称	深证 100A	深证 100B	深 100 基
下属分级基金的交易代码	150083	150084	162714
报告期末下属分级基金的份额总额	12,369,956.00 份	12,369,957.00 份	18,126,426.65 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对深证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×深证 100 价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，广发深证 100 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；广发深证 100 B 份额具有高风险、高预

	期收益的特征。
--	---------

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	田青
	联系电话	020-83936666	010-67595096
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828, 020-83936999	010-67595096
传真		020-89899158	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510308	100033
法定代表人		王志伟	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## 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（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	25,464,462.46

本期利润	29,918,509.07
加权平均基金份额本期利润	0.4445
本期加权平均净值利润率	35.78%
本期基金份额净值增长率	36.71%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
期末可供分配利润	11,797,274.83
期末可供分配基金份额利润	0.2752
期末基金资产净值	59,962,301.99
期末基金份额净值	1.3988
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	53.96%

注：（1）上述基金业绩指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）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	-8.86%	3.47%	-7.67%	3.32%	-1.19%	0.15%
过去三个月	12.55%	2.60%	12.65%	2.51%	-0.10%	0.09%
过去六个月	36.71%	2.18%	37.97%	2.10%	-1.26%	0.08%
过去一年	90.55%	1.73%	95.95%	1.69%	-5.40%	0.04%
过去三年	62.59%	1.45%	65.53%	1.44%	-2.94%	0.01%
自基金合同生效起至今	53.96%	1.42%	50.01%	1.43%	3.95%	-0.01%

注：（1）本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

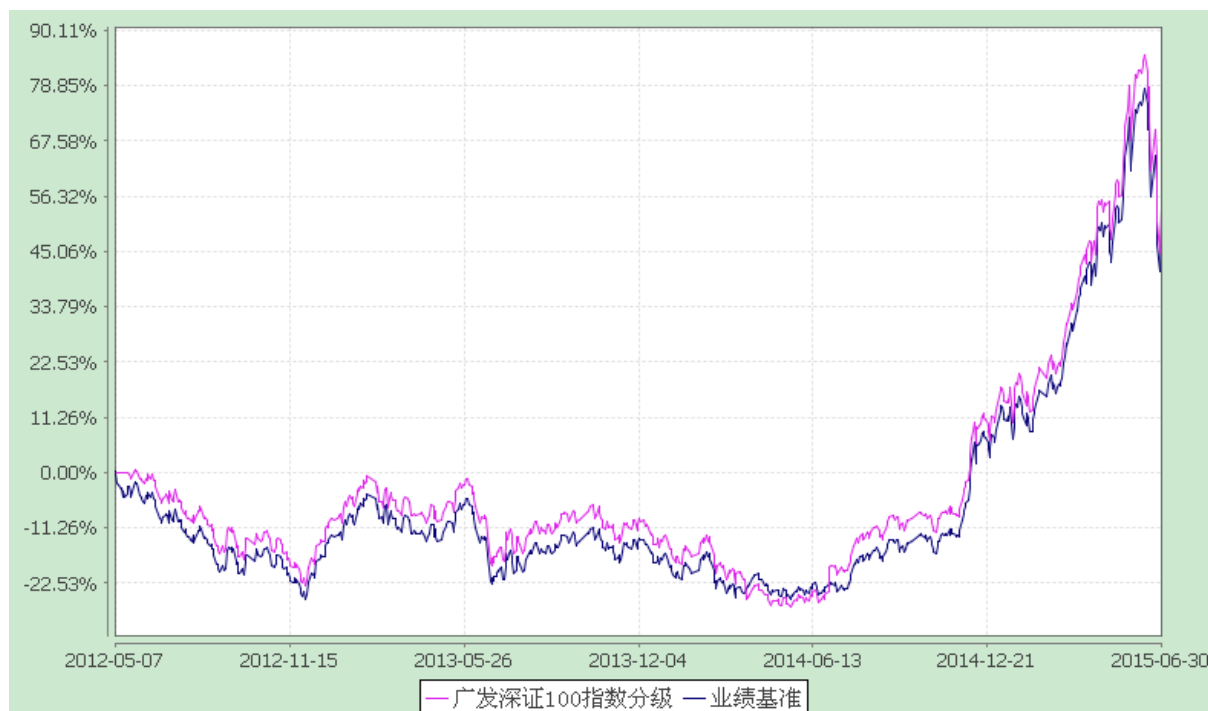
（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

#### 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

广发深证 100 指数分级证券投资基金

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

（2012 年 5 月 7 日至 2015 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金融创新投资控股有限公司。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24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、规划发展部、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、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、互联网金融部（下辖杭州理财中心）、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 2015 年 6 月 30 日, 本基金管理人管理七十五只开放式基金——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、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投

资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金和广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为 2262.47 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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中小板 300ETF 及联接基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理；广发百发 100 指数基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发中证全指信息技术 ETF 基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源 ETF 基金的基金经理；广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理；数量投资部总	2012-05-07	-	16 年	男，中国籍，经济学硕士，持有基金业执业资格证书，1999 年 5 月至 2001 年 5 月在大鹏证券有限公司任研究员，2001 年 5 月至 2010 年 8 月在深圳证券信息有限公司任部门总监，2010 年 8 月 9 日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日起任广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日起任广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日起任广发深证 100 指数分级基金的基金经理，2014 年 6 月 3 日起任广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理，2014 年 10 月 30 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2014 年 12 月 1 日起任广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 8 日起任广发中证全指信息技术 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 29 日起任广发中证全指信息技术 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 3 月 23 日起任广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理，2015 年 4 月 15 日起任广发可选消费联接基金的基金经理，2015 年 5 月 6 日起任广发医药卫生联接基金的基金经理，2015 年 6 月 25 日起任广发中证全指能源 ETF 和广发中证全指原材料 ETF 基金的基

	经理				金经理。
魏军	本基金的基金经理；广发中小板 300ETF 及联接基金的基金经理	2014-04-01	-	7 年	男，中国籍，数量经济学博士，持有基金业执业资格证书，2008 年 7 月至 2010 年 10 月任广发基金管理有限公司量化研究员，2010 年 3 月 11 日起至 2011 年 10 月 18 日任广发沪深 300 指数基金和广发中证 500 指数基金的基金经理助理，2011 年 10 月 19 日起任广发中小板 300ETF 及广发中小板 300 联接基金的基金经理，2014 年 4 月 1 日起任广发深证 100 指数分级基金的基金经理。

注：1. “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、《广发深证 100 指数分级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。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

#### 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

本季度内，本基金的申购赎回及本基金的分级份额的交易、分拆、合并运作正常，运作过程中未发生风险事件。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资，除法规限制投资的指数样本证券采用样本替代投资方法之外，其余指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为 36.71%，同期业绩比较基准收益率为 37.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，在经济改革等因素的预期下，市场走出了波澜壮阔的上涨行情，但在 2 季度末，受资金流动性并非很充裕，政府清场外配资，中小股票估值过高，希腊债务问题迟迟没有明朗等因素的影响，市场可谓内忧外患，出现了前所未有的快速深度回调，随着政府强有力的救市措施，市场逐渐企稳。展望下半年，政府会逐步落实经济改革的各项措施，未来经济有望健康持续发展。深证 100 指数由深市规模大、成交活跃的 100 只样本证券构成，包含了大量成长性好的股票，行业分布较为均匀。深证 100 指数是分享经济结构转型和恢复性增长的良好工具，也是进行长期投资的优秀标的。2015 年，预计深港通将会推出，作为深市 100 只权重股票的指数，未来深证 100 指数会有不错的表现。

#### 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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 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“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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## 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：广发深证 100 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,263,706.81	8,365,419.03
结算备付金		-	-
存出保证金		23,975.82	6,211.25
交易性金融资产	6.4.7.2	57,385,291.11	87,639,808.69
其中：股票投资		57,385,291.11	87,639,808.69
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,870,517.49
应收利息	6.4.7.5	763.54	1,741.60
应收股利		-	-
应收申购款		657,636.97	114,532.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>62,331,374.25</b>	<b>99,998,230.78</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,915,167.54	6,643,851.74
应付管理人报酬		58,875.87	84,901.80
应付托管费		12,952.72	18,678.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	41,419.33	52,387.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	340,656.80	492,930.07
负债合计		2,369,072.26	7,292,749.29
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	38,987,836.21	82,317,034.01
未分配利润	6.4.7.1 0	20,974,465.78	10,388,447.48
所有者权益合计		59,962,301.99	92,705,481.49
负债和所有者权益总计		62,331,374.25	99,998,230.78

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金广发深证 100 份额净值人民币 1.3988 元，基金广发深证 100A 份额参考净值人民币 1.0310 元，广发深证 100B 份额参考净值人民币 1.7666 元，基金份额总额 42,866,339.65 份，其中：广发深证 100 份额 18,126,426.65 份，广发深证 100A 份额 12,369,956.00 份，广发深证 100B 份额 12,369,957.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发深证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>30,872,198.89</b>	<b>-5,770,595.31</b>
1. 利息收入		21,166.93	19,922.02
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	21,166.93	19,922.02
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）		26,253,153.38	-2,981,934.58
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	25,913,107.82	-4,028,614.76

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	340,045.56	1,046,680.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	4,454,046.61	-2,834,584.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	143,831.97	26,001.93
<b>减：二、费用</b>		<b>953,689.82</b>	<b>922,550.04</b>
1. 管理人报酬		414,651.25	454,325.89
2. 托管费		91,223.32	99,951.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	161,305.62	60,824.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	286,509.63	307,448.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>29,918,509.07</b>	<b>-6,693,145.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>29,918,509.07</b>	<b>-6,693,145.35</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发深证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	82,317,034.01	10,388,447.48	92,705,481.49
二、本期经营活动产生的	-	29,918,509.07	29,918,509.07



基金净值变动数（本期利润）			
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）	-43,329,197.80	-19,332,490.77	-62,661,688.57
其中：1. 基金申购款	45,856,029.97	16,911,427.57	62,767,457.54
2. 基金赎回款	-89,185,227.77	-36,243,918.34	-125,429,146.11
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）	38,987,836.21	20,974,465.78	59,962,301.99
项目	上年度可比期间 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）	115,000,531.32	-14,966,885.38	100,033,645.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,693,145.35	-6,693,145.35
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）	-7,151,772.08	944,672.99	-6,207,099.09
其中：1. 基金申购款	20,331,555.70	-4,172,377.59	16,159,178.11
2. 基金赎回款	-27,483,327.78	5,117,050.58	-22,366,277.20
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）	107,848,759.24	-20,715,357.74	87,133,401.50

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

广发深证 100 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”) 证监许可字[2012]200 号文《关于同意广发深证 100 指数分级证券投资基金

设立的批复》的批准，由基金发起人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》、《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）和其他相关法律法规的规定发起，于 2012 年 5 月 7 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2012 年 3 月 27 日至 2012 年 4 月 26 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 567,698,320.60 元，有效认购户数为 2,064 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 115,509.75 元，折合基金份额 114,755.16 份，折算差额人民币 754.59 元计入基金资产，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。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2012 年 5 月 7 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 567,698,320.60 份。

本基金的基金份额包括广发深证 100 指数分级证券投资基金之基础份额（简称广发深证 100 份额，场内简称广发 100，基金代码：162714）、广发深证 100 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（场内简称广发 100 A 份额）与广发深证 100 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（场内简称广发 100 B 份额）。其中，广发 100 A 份额、广发 100 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

在广发 100 A 份额、广发 100 份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，基金管理人将根据基金合同的规定对本基金的广发 100 A 份额、广发 100 份额进行定期份额折算。对于广发 100 A 份额期末的约定应得收益，即广发 100 A 份额每个会计年度 12 月 31 日基金份额参考净值超出本金 1.0000 元部分，将折算为场内广发 100 份额分配给广发 100 A 份额持有人。广发 100 份额持有人持有的每 2 份广发 100 份额将按 1 份广发 100 A 份额获得新增广发 100 份额的分配。持有场外广发 100 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外广发 100 份额的分配；持有场内广发 100 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内广发 100 份额的分配。经过上述份额折算，广发 100 A 份额的基金份额参考净值和广发 100 份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同的规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即当广发 100 份额的基金份额净值达到 2.0000 元后，本基金将分别对广发 100 A 份额、广发 100 B 份额和广发 100 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保广发 100 A 份额和广发 100 B 份额的比例为 1:1，份额折算后广发 100 A 份额、广发 100 B 份额的基金份额参考净值和广发 100 份额的基金份额净值均调整为 1 元；当广发 100 B 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 元后，本基金将分别对广发 100 A 份额、广发 100 B 份额和广发 100 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确

保广发 100 A 份额和广发 100 B 份额的比例为 1: 1, 份额折算后广发 100 份额、广发 100 A 份额和广发 100 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。

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, 本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具, 包括深证 100 指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、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)、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%, 其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准:  $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

本基金的财务报表于 2015 年 8 月 28 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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

除 6.4.5.2 所述会计估计变更外, 本基金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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性, 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”), 本基金自 2015 年 3 月 17 日起, 对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整, 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值, 估值处理标准另有规定的除外。于 2015 年 3 月 17 日, 相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

### 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，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	4,263,706.81
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,263,706.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	36,001,893.22	57,385,291.11	21,383,397.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	36,001,893.22	57,385,291.11	21,383,397.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	752.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	10.80
应收结算备付金利息	0.02
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	763.54

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期内无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	41,419.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,419.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,177.10
预提费用	283,479.70
应付指数使用费	50,000.00
合计	340,656.80

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,812,068.41	82,317,034.01
本期申购	26,252.87	24,609.43
本期赎回（以“-”号填列）	-1,976,463.52	-1,852,736.36
2015 年 1 月 5 日基金拆分/份额折算前	85,861,857.76	80,488,907.08
基金拆分/份额折算调整	2,634,163.49	-
本期申购	50,390,550.61	45,831,420.54
本期赎回（以“-”号填列）	-96,020,232.21	-87,332,491.41
本期末	42,866,339.65	38,987,836.21

注：1. 根据基金合同规定，投资者可申购、赎回广发 100 份额，广发 100A 份额和广发 100B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露广发 100A 份额和广发 100B 份额的情况；

2. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2015 年 1 月 5 日为份额折算基准日，对广发深证 100 份额的场内份额、场外份额以及广发深证 100A 份额进行了定期折算。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,679,071.57	23,067,519.05	10,388,447.48
本期利润	25,464,462.46	4,454,046.61	29,918,509.07
本期基金份额交易产生的变动数	-988,116.06	-18,344,374.71	-19,332,490.77

其中：基金申购款	-199,376.53	17,110,804.10	16,911,427.57
基金赎回款	-788,739.53	-35,455,178.81	-36,243,918.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,797,274.83	9,177,190.95	20,974,465.78

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
活期存款利息收入	20,231.18	
定期存款利息收入	0.00	
其他存款利息收入	159.39	
结算备付金利息收入	447.27	
其他	329.09	
合计	21,166.93	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
卖出股票成交总额	76,226,539.87	
减：卖出股票成本总额	50,313,432.05	
买卖股票差价收入	25,913,107.82	

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
股票投资产生的股利收益	340,045.56	
基金投资产生的股利收益	-	
合计	340,045.56	

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
1. 交易性金融资产	4,454,046.61	
——股票投资	4,454,046.61	
——债券投资	-	

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	4,454,046.61

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	143,779.68
手续费返还	-
基金转换费收入	52.29
印花税返还	-
其他	-
合计	143,831.97

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	161,305.62
银行间市场交易费用	-
合计	161,305.62

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	133,891.13
银行汇划费	3,029.93
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	286,509.63

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系



6.4.9.1 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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司	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、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	68,685,153.54	80.00%	37,841,972.66	100.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	62,531.58	80.00%	25,781.71	62.25%
关联方名称	上年度可比期间 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	34,451.90	100.00%	11,422.69	100.00%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	414,651.25	454,325.89
其中：支付销售机构的客户维护费	21,562.01	34,485.58

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	91,223.32	99,951.67

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。

#### 6.4.10.3 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无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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
中国建设银行股份有限公司	4,263,706.81	20,231.18	4,496,883.70	19,550.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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 2015 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。

##### 6.4.12.2 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
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	36.50	-	-	39,555.00	692,536.71	1,443,757.50	-
000630	铜陵有色	2015-03-09	重大事项	10.32	-	-	50,696.00	447,824.11	523,182.72	-
000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项	7.00	2015-08-24	6.30	70,031.00	204,820.55	490,217.00	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	重大事项	12.96	-	-	43,332.00	213,426.14	561,582.72	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	16.88	-	-	25,676.00	243,146.88	433,410.88	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57	-	-	18,955.00	186,763.54	446,769.35	-
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	24.50	-	-	16,962.00	266,389.79	415,569.00	-
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项	30.82	-	-	25,153.00	405,815.36	775,215.46	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项	71.48	2015-08-05	69.20	4,663.00	257,698.74	333,311.24	-
002001	新和成	2015-06-30	重大事项	17.09	2015-07-13	18.49	10,048.00	140,223.10	171,720.32	-

002069	獐子岛	2015-06-01	重大事项	19.76	-	-	6,563.00	116,932.26	129,684.88	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事项	16.42	-	-	17,485.00	263,729.07	287,103.70	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	37.85	-	-	9,034.00	166,497.74	341,936.90	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项	44.35	-	-	9,290.00	404,172.29	412,011.50	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

#### 6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

<b>30 日</b>					
资产					
银行存款	4,263,706.81	-	-	-	4,263,706.81
存出保证金	23,975.82	-	-	-	23,975.82
交易性金融资产	-	-	-	57,385,291.11	57,385,291.11
应收利息	-	-	-	763.54	763.54
应收申购款	531,509.63	-	-	126,127.34	657,636.97
资产总计	4,819,192.26	-	-	57,512,181.99	62,331,374.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,915,167.54	1,915,167.54
应付管理人报酬	-	-	-	58,875.87	58,875.87
应付托管费	-	-	-	12,952.72	12,952.72
应付交易费用	-	-	-	41,419.33	41,419.33
其他负债	-	-	-	340,656.80	340,656.80
负债总计	-	-	-	2,369,072.26	2,369,072.26
利率敏感度缺口	4,819,192.26	-	-	55,143,109.73	59,962,301.99
<b>上年度末</b>					
<b>2014 年 12 月</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>31 日</b>					
资产					
银行存款	8,365,419.03	-	-	-	8,365,419.03
存出保证金	6,211.25	-	-	-	6,211.25
交易性金融资产	-	-	-	87,639,808.69	87,639,808.69
应收证券清算款	-	-	-	3,870,517.49	3,870,517.49
应收利息	-	-	-	1,741.60	1,741.60
应收申购款	53,655.50	-	-	60,877.22	114,532.72
资产总计	8,425,285.78	-	-	91,572,945.00	99,998,230.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,643,851.74	6,643,851.74
应付管理人报酬	-	-	-	84,901.80	84,901.80

应付托管费	-	-	-	18,678.40	18,678.40
应付交易费用	-	-	-	52,387.28	52,387.28
其他负债	-	-	-	492,930.07	492,930.07
负债总计	-	-	-	7,292,749.29	7,292,749.29
利率敏感度缺口	8,425,285.78	-	-	84,280,195.71	92,705,481.49

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	57,385,291.11	95.70	87,639,808.69	94.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,385,291.11	95.70	87,639,808.69	94.54

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	2,764,982.61	4,222,729.25
业绩比较基准下降 5%	-2,764,982.61	-4,222,729.25	

#### 6.4.14 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本基金最近一期年报。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 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 50,619,817.94 元，属于第二层级的余额为 6,765,473.17 元，无属于第三层级的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层级 83,199,264.27 元，第二层级 4,440,544.42 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。如附注 6.4.5.2 所述，本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

###### (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。



## 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	57,385,291.11	92.06
	其中：股票	57,385,291.11	92.06
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	4,263,706.81	6.84
7	其他各项资产	682,376.33	1.09
8	合计	62,331,374.25	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资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	129,684.88	0.22
B	采矿业	882,078.28	1.47
C	制造业	32,284,917.02	53.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	343,036.65	0.57
E	建筑业	612,004.90	1.02

F	批发和零售业	1,451,190.44	2.42
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	4,843,009.45	8.08
J	金融业	7,889,132.02	13.16
K	房地产业	4,927,789.87	8.22
L	租赁和商务服务业	932,382.58	1.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,648,292.20	2.75
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	1,041,171.78	1.74
S	综合	386,286.04	0.64
	合计	57,370,976.11	95.68

### 7.2.2 积极投资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	14,315.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
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	14,315.00	0.02

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000651	格力电器	44,261	2,828,277.90	4.72
2	000002	万科A	164,666	2,390,950.32	3.99
3	000001	平安银行	117,841	1,713,408.14	2.86
4	000783	长江证券	112,692	1,572,053.40	2.62
5	000333	美的集团	40,592	1,513,269.76	2.52
6	000024	招商地产	39,555	1,443,757.50	2.41
7	002415	海康威视	25,881	1,159,468.80	1.93
8	002024	苏宁云商	73,064	1,117,879.20	1.86
9	000625	长安汽车	51,328	1,085,587.20	1.81
10	000166	申万宏源	65,524	1,064,765.00	1.78
11	000728	国元证券	27,347	1,038,639.06	1.73
12	000858	五粮液	32,348	1,025,431.60	1.71
13	000725	京东方A	179,057	929,305.83	1.55
14	000768	中航飞机	20,131	877,308.98	1.46
15	300104	乐视网	16,815	870,344.40	1.45
16	300024	机器人	10,655	823,205.30	1.37
17	000100	TCL 集团	144,767	817,933.55	1.36
18	000063	中兴通讯	33,730	803,111.30	1.34
19	000917	电广传媒	25,153	775,215.46	1.29
20	000069	华侨城A	58,936	764,989.28	1.28
21	000538	云南白药	8,556	738,126.12	1.23
22	000686	东北证券	37,249	725,238.03	1.21
23	002450	康得新	22,768	696,700.80	1.16
24	000338	潍柴动力	21,970	695,570.20	1.16
25	002500	山西证券	37,781	683,458.29	1.14

26	002230	科大讯飞	19,087	666,899.78	1.11
27	002594	比亚迪	11,548	637,796.04	1.06
28	002202	金风科技	31,515	613,597.05	1.02
29	000750	国海证券	36,505	613,284.00	1.02
30	002081	金螳螂	21,710	612,004.90	1.02
31	000157	中联重科	74,958	607,909.38	1.01
32	300027	华谊兄弟	15,935	607,760.90	1.01
33	000423	东阿阿胶	10,968	597,756.00	1.00
34	002241	歌尔声学	16,127	578,959.30	0.97
35	000778	新兴铸管	43,332	561,582.72	0.94
36	000039	中集集团	17,349	560,372.70	0.93
37	002405	四维图新	12,129	531,250.20	0.89
38	002065	东华软件	18,461	530,753.75	0.89
39	000630	铜陵有色	50,696	523,182.72	0.87
40	300070	碧水源	10,704	522,248.16	0.87
41	300017	网宿科技	10,971	509,273.82	0.85
42	000559	万向钱潮	23,209	507,348.74	0.85
43	002304	洋河股份	7,275	504,594.00	0.84
44	002008	大族激光	17,346	498,177.12	0.83
45	000709	河北钢铁	70,031	490,217.00	0.82
46	000402	金融街	34,315	484,870.95	0.81
47	002465	海格通信	15,049	484,427.31	0.81
48	000060	中金岭南	25,878	481,072.02	0.80
49	002142	宁波银行	22,614	478,286.10	0.80
50	002456	欧菲光	13,403	452,217.22	0.75
51	000839	中信国安	18,955	446,769.35	0.75
52	000629	攀钢钒钛	82,643	442,966.48	0.74
53	000793	华闻传媒	25,676	433,410.88	0.72
54	000568	泸州老窖	13,164	429,278.04	0.72
55	300124	汇川技术	8,733	419,184.00	0.70
56	000800	一汽轿车	16,783	417,561.04	0.70
57	000878	云南铜业	16,962	415,569.00	0.69
58	002353	杰瑞股份	9,290	412,011.50	0.69
59	002030	达安基因	9,136	404,724.80	0.67
60	000895	双汇发展	18,674	398,316.42	0.66
61	000009	中国宝安	23,684	386,286.04	0.64
62	000876	新希望	19,323	375,059.43	0.63
63	000012	南玻A	27,659	368,971.06	0.62
64	000425	徐工机械	27,685	367,379.95	0.61
65	000826	桑德环境	9,284	361,054.76	0.60
66	000792	盐湖股份	12,574	356,850.12	0.60
67	002236	大华股份	11,155	356,067.60	0.59
68	000581	威孚高科	11,405	353,440.95	0.59
69	300058	蓝色光标	22,155	350,270.55	0.58

70	002038	双鹭药业	6,165	349,247.25	0.58
71	000970	中科三环	16,925	348,824.25	0.58
72	000598	兴蓉环境	35,845	343,036.65	0.57
73	002292	奥飞动漫	9,034	341,936.90	0.57
74	000061	农产品	16,525	337,110.00	0.56
75	000963	华东医药	4,663	333,311.24	0.56
76	000825	太钢不锈	45,311	322,161.21	0.54
77	000400	许继电气	12,547	315,682.52	0.53
78	002475	立讯精密	9,254	312,877.74	0.52
79	000046	泛海控股	20,854	305,511.10	0.51
80	002146	荣盛发展	24,216	302,700.00	0.50
81	002385	大北农	22,314	301,685.28	0.50
82	000831	五矿稀土	11,652	298,058.16	0.50
83	000960	锡业股份	14,642	295,036.30	0.49
84	002106	莱宝高科	17,485	287,103.70	0.48
85	000983	西山煤电	29,691	281,470.68	0.47
86	300002	神州泰岳	18,241	277,992.84	0.46
87	002007	华兰生物	6,170	273,269.30	0.46
88	000977	浪潮信息	9,188	271,505.40	0.45
89	002073	软控股份	11,367	262,577.70	0.44
90	000729	燕京啤酒	23,615	245,596.00	0.41
91	002344	海宁皮城	12,481	245,002.03	0.41
92	002422	科伦药业	6,117	244,924.68	0.41
93	000999	华润三九	7,857	238,774.23	0.40
94	002570	贝因美	12,211	237,015.51	0.40
95	300315	掌趣科技	17,307	234,509.85	0.39
96	002001	新和成	10,048	171,720.32	0.29
97	000937	冀中能源	19,656	157,641.12	0.26
98	002069	獐子岛	6,563	129,684.88	0.22

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002746	仙坛股份	500	14,315.00	0.02

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	000333	美的集团	1,398,303.48	1.51
2	000750	国海证券	619,064.22	0.67
3	000977	浪潮信息	508,661.00	0.55
4	000963	华东医药	508,009.00	0.55
5	002500	山西证券	481,547.00	0.52
6	002475	立讯精密	397,499.00	0.43
7	000002	万 科 A	383,616.00	0.41
8	000166	申万宏源	380,676.00	0.41
9	000783	长江证券	341,448.00	0.37
10	002030	达安基因	339,840.00	0.37
11	000917	电广传媒	332,202.65	0.36
12	000651	格力电器	329,152.00	0.36
13	002594	比亚迪	313,038.00	0.34
14	000001	平安银行	274,298.00	0.30
15	000876	新 希 望	257,926.00	0.28
16	002415	海康威视	248,676.00	0.27
17	000425	徐工机械	247,122.00	0.27
18	002024	苏宁云商	180,144.00	0.19
19	000728	国元证券	170,450.00	0.18
20	000839	中信国安	156,804.00	0.17

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	000728	国元证券	3,882,308.68	4.19
2	000002	万 科 A	3,201,382.52	3.45
3	000651	格力电器	3,088,751.65	3.33
4	000001	平安银行	2,647,247.33	2.86
5	000166	申万宏源	2,482,126.20	2.68
6	000333	美的集团	2,260,876.56	2.44
7	002024	苏宁云商	1,641,914.86	1.77
8	000783	长江证券	1,364,256.73	1.47
9	000063	中兴通讯	1,343,750.58	1.45
10	000686	东北证券	1,335,830.58	1.44
11	000858	五 粮 液	1,288,708.35	1.39

12	000100	TCL 集团	1,270,349.68	1.37
13	000725	京东方 A	1,081,347.00	1.17
14	002415	海康威视	1,038,570.41	1.12
15	002500	山西证券	1,038,282.00	1.12
16	300104	乐视网	1,015,251.59	1.10
17	000768	中航飞机	985,421.50	1.06
18	000750	国海证券	959,880.32	1.04
19	300027	华谊兄弟	907,527.30	0.98
20	000157	中联重科	901,245.38	0.97

#### 7.4.3 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	15,604,867.86
卖出股票的收入（成交）总额	76,226,539.87

#### 7.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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

- (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 根据公开市场信息，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	23,975.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	763.54
5	应收申购款	657,636.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	682,376.33

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资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	000024	招商地产	1,443,757.50	2.41	重大事项

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明



本基金本报告末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

## 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

份额级别	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
广发深证 100 指数分级 A	278	44,496.24	7,531,597.00	60.89%	4,838,359.00	39.11%
广发深证 100 指数分级 B	560	22,089.21	5,065,858.00	40.95%	7,304,099.00	59.05%
广发深证 100 指数分级	1,316	13,773.88	1,714,265.59	9.46%	16,412,161.06	90.54%
合计	2,154	19,900.81	14,311,720.59	33.39%	28,554,619.06	66.61%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

广发深证 100 指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G-ZY001	4,550,382.00	36.79%
2	许金泉	1,379,710.00	11.15%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	1,077,783.00	8.71%
4	泰康人寿保险股份有限公司	964,391.00	7.80%

司（个人分红）			
5	华宝信托有限责任公司—宝钢 1 号单一资金信托	922,900.00	7.46%
6	谭惠玲	250,024.00	2.02%
7	符立成	200,019.00	1.62%
8	黄贤民	156,448.00	1.26%
9	洪伟连	123,000.00	0.99%
10	邬良忠	105,740.00	0.85%

广发深证100指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司（个人分红）	3,139,817.00	25.38%
2	林德达	900,000.00	7.28%
3	中信证券—中信—中信证券基金精选集合资产管理计划	715,100.00	5.78%
4	桐乡市濮院丝业有限公司	618,789.00	5.00%
5	国信证券股份有限公司	414,609.00	3.35%
6	谭惠玲	250,024.00	2.02%
7	黄川秀	200,100.00	1.62%
8	张本衡	182,600.00	1.48%
9	尤泽彤	150,000.00	1.21%
10	涂慧萍	141,600.00	1.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发深证 100 指数分级 A	-	-
	广发深证 100 指数分级 B	-	-
	广发深证 100 指数分级	4,000.00	0.0221%
	合计	4,000.00	0.0093%

8.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	广发深证 100 指数分级 A	0

	广发深证 100 指数分级 B	0
	广发深证 100 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发深证 100 指数分级 A	0
	广发深证 100 指数分级 B	0
	广发深证 100 指数分级	0
	合计	0

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发深证 100 指数 分级 A	广发深证 100 指数 分级 B	广发深证 100 指数 分级
基金合同生效日（2012 年 5 月 7 日）基金份额总额	110,591,152.00	110,591,153.00	346,516,015.60
本报告期初基金份额总额	29,551,862.00	29,551,863.00	28,708,343.41
本报告期基金总申购份额	-	-	50,416,803.48
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	97,996,695.73
本报告期基金拆分变动份额	-17,181,906.00	-17,181,906.00	36,997,975.49
本报告期末基金份额总额	12,369,956.00	12,369,957.00	18,126,426.65

注：拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额及份额折算所得份额。

### 10 重大事件揭示

#### 10.1 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。

#### 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

2015 年 4 月 30 日，包林生不再担任本基金管理人的副总经理。2015 年 5 月 23 日，肖雯不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

2015 年 1 月 4 日，基金托管人发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

### 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

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

### 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	
广发证券	2	68,685,153.54	80.00%	62,531.58	80.00%	-
申银万国	1	17,176,513.17	20.00%	15,637.62	20.00%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于广发深证 100 指数分级证券投资基金变更基金场内简称的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-29
2	广发基金管理有限公司关于增加展恒基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-07
3	广发基金管理有限公司关于增加中信建投期货为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-29
4	广发基金管理有限公司关于增加海银基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-29
5	广发基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-21
6	广发基金管理有限公司关于广发深证 100 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-07
7	广发基金管理有限公司关于广发深证 100 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-01-06

注: 无

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发深证 100 指数分级证券投资基金募集的文件
2. 《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
3. 《广发深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照

### 11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 11.3 查阅方式

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

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

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

广发基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日