

广发深证100指数分级证券投资基金 [2013] 第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，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。

本报告中财务资料未经审计。

本基金报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
			其中:股票	债券
1	权益投资	121,598,410.57	90.06	
	其中:股票	121,598,410.57	90.06	
2	固定收益投资	-	-	-
	其中:债券	-	-	-
3	货币市场工具	-	-	-
4	买入返售金融资产	-	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	8,343,240.02	6.18	
6	其他各项资产	5,079,295.25	3.76	
7	合计	135,020,945.84	100.00	

§ 3 报告期末基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	658,876.94	0.50
B	采矿业	5,318,940.31	4.02
C	制造业	73,444,631.48	55.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	766,782.15	0.58
E	建筑业	2,199,168.18	1.66
F	批发和零售业	1,163,322.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传播、软件和信息技术服务业	3,084,210.55	2.33
J	金融业	10,717,679.35	8.10
K	房地产业	16,722,064.29	12.63
L	租赁和商务服务业	677,375.08	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,741,751.86	3.58
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	968,122.38	0.73
S	综合	1,135,486.00	0.86
5.3	报告期末按行业分类的股票投资组合	121,598,410.57	91.87

注:①本基金业绩比较基准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本公司实现收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

③基金申购费用已实现收益加上本期公允价值变动收益。

④本基金报告期无卖出回购金融资产。

⑤本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑥本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑦本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑧本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑨本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑩本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑪本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑫本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑬本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑭本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑮本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑯本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑰本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑱本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑲本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

⑳本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉑本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉒本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉓本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉔本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉕本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉖本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉗本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉘本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉙本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉚本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉛本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉜本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉝本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉞本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉟本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。

㉟本基金报告期无卖出回购金融资产的平均剩余期限。