广发行业领先股票型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

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	广发行业领先股票
基金主代码	270025
交易代码	270025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23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	1,947,926,429.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握宏观经济周期及行业生命周期的发展趋势,发掘发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业中的领先企业进行投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	(一)资产配置策略 1.大类资产配置 (1)研究部综合宏观经济研究员研究的宏观经济形势,策略研究员研究的市场运行趋势,行业研究员研究的行业投资价值形成(资产配置建议书)。(2)投资决策委员会定期与不定期相结合召开相关会议,根据(资产配置建议书),综合考虑基金投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,确定本基金股票、债券、现金等的比例。 2.行业配置策略 不同的行业在经济周期的不同阶段呈现出不同的运行态势。本基金将主要通过"广发领先行业评价体系",对行业进行定性、定量分析,同时,结合国内外宏观经济环境及国家相关政策的变化,选择发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业作为本基金行业配置的重点。 (二)股票投资策略 本基金股票投资采用备选库制度,本基金的备选库包括一级库和二级库。一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围,入选条件主要是根据广发企业价值评估体系,通过研究,筛选出基本面良好的股票进入一级库。二级股票库为本基金的风格库。本基金将根据行业配置阶段形成的行业配置范围,从行业地位、治理结构、经营业绩、竞争优势和创新等方面对领先行业内的股票进行定性分析,并结合(P/E)/G、预期主营业务收入增长率和预期主营业务利润率等定量指标,精选出各领先行业内估值相对合理的优质上市公司,构成本基金的二级库。 (三)债券投资策略 在债券投资上,坚持稳健投资的原则,控制债券投资风险。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。 (四)权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、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和债券型基金。

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
本期已实现收益	441,442,306.20	-451,853,612.28	-449,930,059.01
本期利润	461,580,347.38	297,925,963.04	-924,644,654.46
加权平均基金份额本期利润	0.1778	0.0898	-0.2431
本期基金份额净值增长率	20.50%	12.77%	-25.38%
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	-0.0911	-0.2582	-0.2563
期末基金资产净值	1,968,796,600.81	2,613,852,739.12	2,572,365,573.84
期末基金份额净值	1.011	0.839	0.744

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

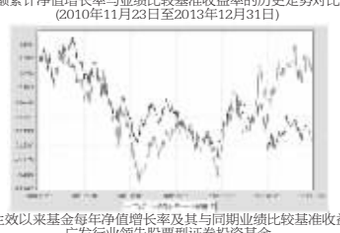
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.06%	1.44%	-3.09%	0.90%	6.15%	0.54%
过去六个月	16.61%	1.35%	4.02%	1.03%	12.59%	0.32%
过去一年	20.50%	1.43%	-6.33%	1.12%	26.83%	0.31%
过去三年	1.40%	1.28%	-18.73%	1.06%	20.13%	0.22%
自基金合同生效起至今	1.10%	1.26%	-19.42%	1.06%	20.52%	0.20%

注:(1)业绩比较基准:80%×沪深300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。

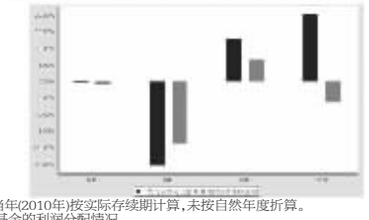
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发行业领先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
(2010年11月23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

广发行业领先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(2010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2010年11月23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		
刘晓龙	本基金的基金经理	2010-11-23	-	7	男,中国籍,工学硕士,持有证券业执业资格证书,2007年2月至2010年3月在广发基金管理有限公司研究发展部任行业研究员、研究小组主管,2010年3月11日至2011年3月10日任广发聚丰股票基金的基金经理助理,2010年11月23日起任广发行业领先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遵规守信情况的说明

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、《广发行业领先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年全球来看都是一个经济相对稳定的一年,在经济稳定的基础上,由智能手机、移动互联网技术、新能源及新能源汽车行业的技术进步引领的科技变革较为耀眼,国内虽然缺乏纯正的有创新力的企业,但是以传媒、手游为代表的新兴产业得到了市场热情的追捧。2013年是新兴产业的盛筵,是传统产业的滑铁卢,股票表现冰火两重天,市场再一次展示了趋势的威力和魅力。

本基金年初开没有配置较多的成长股及新兴产业股票,主要以低估值价值股为主,2季度开始逐渐认识到了市场的阶段性特点,开始布局以LED为代表的技术制造类股票,并适度参与了主题性的行情,表现中规中矩。进入4季度,市场对于业绩的确定性开始重视,本基金所持有的低估值股票开始表现,使得全年业绩有所回升,全年约处于同类型基金1/3分位。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期,本基金净值增长率为20.50%,比较基准增长率为-6.33%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年是一个改革年。

这也意味着2014年的经济不会太好。政府的表述已经非常明确,转变经济增长方式,政绩和GDP逐渐脱钩,所以政府层面的投资强度必然是下行的。而持续的高利率,已经开始抑制了房地产的需求,2014年上半年房地产销售下行确定性非常高,并最终会导致开工下滑,地产这个经济的引擎降速,将会导致很多行业增速放缓。经济很可能在2、3季度较差,然后会有一些弱对冲政策出台,使得经济相对稳定,经济长期看震荡下行。

回归到证券市场,市场大概率不如2013年,预期收益率需要降低。上半年,在经济下行的大背景下,周期类行业大概率会维持底部震荡趋势,难以形成持续的上涨,市场大概率还是在医药、环保、互联网等行业寻找机会,由于估值已高,突破估值的上题性投资将会占据重要的位置。环保、新能源、新能源汽车、移动互联网相关延伸行业等是主要的热点板块,但是以创业板为主的这批股票大多数已处于高位,风险已经逐渐积聚。与此同时,随着低估值板块的集体走弱,一批价值股出现了低估,具备了较好的投资价值,这类股票很可能在下半年季度报告逐渐正实后开始表现。从周期的角度,农业今年进入很好的布局阶段。下半年,预计随着季度报告的不断兑现,市场炒作热度将会下降,低估值价值股将会有较好表现。

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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按合同约定提供银行间同业市场交易的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"(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行业领先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,广发行业领先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行业领先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,广发行业领先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行业领先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P0462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:广发行业领先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	304,738,406.38	319,425,220.48
结算备付金	5,192,633.53	4,281,350.25
存出保证金	1,568,900.87	3,437,858.70
交易性金融资产	1,716,134,928.48	2,306,417,582.25
其中:股票投资	1,716,134,928.48	2,306,417,582.25
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	-	9,072,467.17
应收利息	76,465.84	46,357.40
应收股利	-	-
应收申购款	498,303.03	895,118.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,028,209,638.13	2,643,575,954.46

负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 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	43,425,135.12	18,746,249.42
应付赎回款	4,607,939.28	3,337,423.17
应付管理人报酬	2,496,828.93	3,037,909.61
应付托管费	416,138.16	506,318.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,221,499.59	4,009,022.92
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	245,496.24	86,291.96
负债合计	59,413,037.32	29,723,215.34
所有者权益:	-	-
实收基金	1,947,926,429.79	3,116,419,555.80
未分配利润	20,870,171.02	-502,566,816.68
所有者权益合计	1,968,796,600.81	2,613,852,739.12
负债和所有者权益总计	2,028,209,638.13	2,643,575,954.46

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值人民币1.011元,基金份额总额1,947,926,429.79份。

7.2 利润表

会计主体:广发行业领先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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	531,204,808.32	361,740,160.13
1.利息收入	2,677,326.34	3,879,574.21
其中:存款利息收入	2,572,530.87	2,541,968.13
债券利息收入	2,275.95	805,751.36
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	102,519.52	531,854.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	507,943,912.90	-392,295,623.11
其中:股票投资收益	485,719,450.29	-418,552,767.52
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,138,639.62	-275,900.00
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	20,085,822.99	26,533,044.41
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	20,138,041.18	749,779,575.32
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	445,527.90	376,633.71
减:二、费用	69,624,460.94	63,814,197.09
1.管理人报酬	35,668,431.27	39,112,557.20
2.托管费	5,944,738.52	6,518,759.51
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	27,587,351.78	17,772,286.96
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	423,939.37	410,593.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	461,580,347.38	297,925,963.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	461,580,347.38	297,925,963.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发行业领先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)	3,116,419,555.80	-502,566,816.68	2,613,852,739.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	461,580,347.38	461,580,347.38
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)	-1,168,493,126.01	61,856,640.32	-1,106,636,485.69
其中:1.基金申购款	210,905,313.66	-12,453,705.98	198,451,607.68
2.基金赎回款	-1,379,398,439.67	74,310,346.30	-1,305,088,093.37
四、本期向基金分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)	1,947,926,429.79	20,870,171.02	1,968,796,600.81
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
项目	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)	3,459,003,870.66	-886,638,296.82	2,572,365,573.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	297,925,963.04	297,925,963.04
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)	-342,584,314.86	86,145,517.10	-256,438,797.76
其中:1.基金申购款	248,793,005.01	-46,579,166.79	202,213,838.22
2.基金赎回款	-591,377,319.87	132,724,683.89	-458,652,635.98
四、本期向基金分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)	3,116,419,555.80	-502,566,816.68	2,613,852,739.12

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

广发行业领先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[2010]950号文《关于核准广发行业领先股票型证券投资基金募集的批复》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》等有关规定和《广发行业领先股票型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2010年11月23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。

本基金募集期间为2010年10月25日至2010年11月19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4,429,587,850.13元,有效认购户数为58,645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387,044.22元,折合基金份额387,044.22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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×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	625,771,736.59	3.45%	973,747,937.92	8.09%

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	569,600.09	3.60%	119,937.20	1.46%
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	855,758.41	8.78%	476,057.57	11.88%

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	35,668,431.27	39,112,557.20
其中:支付销售机构的客户维护费	9,776,380.61	10,148,399.36

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷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前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2基金托管费

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托管费	5,944,738.52	6,518,759.51

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

H=E×0.25%÷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前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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 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	
	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	304,738,406.38	2,425,646.69	319,425,220.48	2,468,329.44

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

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002341	新纶科技	2013-03-25	2014-03-27	非公开发行流通受限	8.68	14.78	1,640,000.00	14,235,200.00	24,239,200.00	2013年5月15日除权除息,比例:每10股派现金红利1.00元(含税)