广发全球精选股票型证券投资基金

2014 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球精选股票(QDII)	
基金主代码	270023	
交易代码	270023(前端)	–(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年8月18日	
报告期末基金份额总额	262,751,733.06份	
投资目标	通过在全球市场进行积极的资产配置和组合管理,有效分散基金的投资组合风险,实现基金资产的持续、稳健增值。	
投资策略	本基金将通过自上而下的资产配置策略和自下而上的个股精选策略进行基金资产的投资组合构建,注重国际宏观经济环境、政治形势、区域市场和证券市场走势的综合分析,并强调公司品质与成长性的结合,由此确定基金资产在国家与地区间的区域配置以及在股票、债券和现金等各类资产类别上的投资比例,并通过自下而上的个股精选,挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。	
业绩比较基准	60%×MSCI全球指数(MSCI World Index)+40%×恒生指数	
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。	
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	
境外资产托管人英文名称	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited	
境外资产托管人中文名称	渣打银行(香港)有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	10,625,662.23
2.本期利润	6,738,919.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0253
4.期末基金资产净值	371,392,063.89
5.期末基金份额净值	1.413

注:1、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。

2、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。

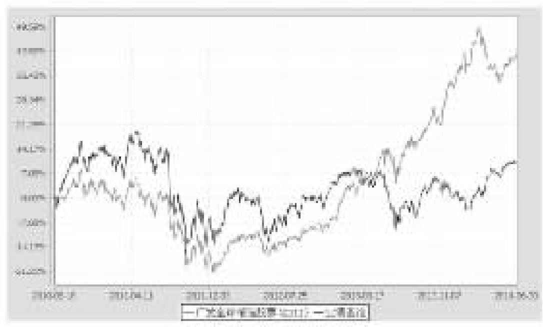
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	1.87%	0.56%	4.68%	0.39%	–2.81%	0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发全球精选股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年8月18日至2014年6月30日)



注:1、本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

2、本基金自2014年6月10日起,将基金业绩比较基准由"摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数"变更为"60%×MSCI全球指数(MSCI World Index)+40%×恒生指数"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
Ding Tom Liang(丁靓)	本基金的基金经理	2014–06–09	–	7	男,新西兰籍,金融学硕士,持有中国基金业执业证书,2007年5月至2009年7月在银华基金管理有限公司历任投资管理部研究员及海外投资部基金经理助理,2009年7月至2011年3月在交银国际资产管理有限公司历任研究员及投资经理,2011年3月28日至2012年4月5日在广发基金管理有限公司任国际业务部研究员,2012年4月6日至2014年6月8日任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理,2014年6月9日起任广发全球精选股票(QDII)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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发全球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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2014年二季度全球市场表现先弱后强。科技股的跌势从三月中延续到了四月中,去年涨幅居前的科技板块在风险得到释放之后,继续创出本轮新高。联储本季度继续稳定的消减量化宽松额度,市场的重心从对加息时点的争执转向对经济复苏的乐观。市场的风险偏好经历了急剧下降然后迅速回升的过程,美国主要指数不断创出新高,同时波动性指数处于历史低位。中国经济短期见底,得益于政府的微刺激政策支持和出口的逐步恢复。M2增速、制造业PMI和出口增速均逐月好转。政府实施定向的流动性刺激措施,以期在调整经济结构和银行资产负债表的同时,保证经济增长处于可接受范围内。2014年二季度,MSCI全球指数上涨4.16%,香港恒生指数上涨4.69%。

二季度全球各个市场中,标普500指数上涨4.69%,纳斯达克综合指数上涨4.98%,美国道琼斯工业平均指数上涨2.24%,富时100指数上涨2.21%,日经225指数上涨2.25%,多伦多300指数上涨5.66%,法国CAC40指数上涨0.71%;国内上证综合指数上涨0.74%,深证成份指数上涨2.14%,沪深300上涨0.88%。

基于中国经济数据见底回升和美国经济复苏前景乐观,本基金适当提高仓位,着重从下往上的个股选择。广发全球精选2014年一季度在国家区域配置方面,我们保持配置于香港和美国市场。在行业配置方面,我们主要关注科技和医药等。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期,本基金净值上涨1.87%,比较基准上涨4.68%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国社会体制和经济结构为危机之后的经济复苏奠定了良好的基础。回顾联储自金融危机以来的货币政策,先成功的阻止了流动性危机,再通过零利率支持资产价格,刺激了实体经济的投资冲动。管理人相信联储本轮危机处理到了应该政策退出的后期,美国经济处在健康的复苏过程中,短期虽然有一季度恶劣天气带来的短期波动,但证券市场仍将随着经济复苏稳步贡献收益。中国一季度孱弱的经济数据迫使政府再次祭出货币政策的宽松。但本轮宽松明确的指向性再次表明了政府拒绝走投资老路,政策目的只是为增长兜底。管理人认为中国旧经济颓势不改,市场波动围绕政府刺激和经济增速的互动,投资机会仍然来自于新经济。本基金预期将保持对香港和美国市场的配置,从下往上精选个股。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	327,768,482.88	85.58
	其中:普通股	311,976,706.40	81.46
	存托凭证	15,791,776.48	4.12
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
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	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	51,554,487.61	13.46
8	其他各项资产	3,664,700.55	0.96
9	合计	382,987,671.04	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	217,682,950.64	58.61
美国	110,085,532.24	29.64
合计	327,768,482.88	88.25

注:1、国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括注册地为开曼群岛在美国上市的ADR。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	15,419,509.61	4.15
材料	–	–
工业	17,343,256.53	4.67
非必须消费品	34,586,788.36	9.31
必须消费品	7,369,196.58	1.98
保健	82,021,086.16	22.08
金融	66,852,198.49	18.00
信息技术	56,679,995.93	15.26
电信服务	12,644,373.17	3.40
公共事业	34,852,078.05	9.38
合计	327,768,482.88	88.25

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港交易所	中国香港	664,000.00	20,528,597.50	5.53
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	700 HK	香港交易所	中国香港	210,000.00	19,702,462.50	5.31
3	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽约证券交易所	美国	50,000.00	16,169,558.40	4.35
4	BEIJING TONG REN TANG CHINES	北京同仁堂国药有限公司	8138 HK	香港交易所	中国香港	2,001,000.00	15,851,171.63	4.27
5	TONG REN TANG TECHNOLOGIES–H	北京同仁堂科技	1666 HK	香港交易所	中国香港	1,540,000.00	13,837,285.00	3.73
6	VERIZON COMMUNICA-TIONS INC	Verizon通讯股份有限公司	VZ US	纽约证券交易所	美国	42,000.00	12,644,373.17	3.40
7	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	香港交易所	中国香港	2,350,000.00	11,546,284.38	3.11
8	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中银香港	2388 HK	香港交易所	中国香港	600,000.00	10,691,812.50	2.88
9	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	长江基建集团	1038 HK	香港交易所	中国香港	240,000.00	10,182,225.00	2.74
10	500.COM LTD–CLASS A–ADR	–	WBAI US	纽约证券交易所	美国	40,000.00	9,106,144.00	2.45

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	2,222,034.54
3	应收股利	752,547.18
4	应收利息	9,081.85
5	应收申购款	681,036.98
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,664,700.55

5.10.4报告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。

5.10.5 报告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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	259,210,206.25
本报告期基金总申购份额	38,440,040.09
减:本报告期基金总赎回份额	34,898,513.28
本报告期基金拆分变动份额	–
报告期期末基金份额总额	262,751,733.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014–04–03	10,737,294.20	15,001,000.00	–
合计			10,737,294.20	15,001,000.00	

注:固定申购费用1000元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金于2014 年5月19日以现场方式召开了份额持有人大会,本次大会在基金托管人监督、公证机关公证和律师的见证下,经持有人投票表决通过了《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金变更投资范围等事项的议案》,同意将本基金的投资范围由修改前主要投资亚太地区(除日本)变更为投资于全球主要证券市场,同时基于上述投资范围的变更,相应地对《基金合同》中有关本基金的名称、基金的投资目标、投资理念、投资策略和业绩比较基准及其他部分条款,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改。相关表决结果详见2014年5月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和广发基金管理有限公司网站(http://www.gffunds.com.cn)上刊登的《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金份额持有人大会表决结果的公告》。

根据《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金变更投资范围等事项的议案》及《<广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同>修改说明》的规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,基金管理人已将《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》、《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金托管协议》修订为《广发全球精选股票型证券投资基金基金合同》、《广发全球精选股票型证券投资基金托管协议》,并据此更新了《广发全球精选股票型证券投资基金招募说明书》,上述文件已经报中国证监会审核。修订后的文件将自中国证监会备案确认本次持有人大会决议生效之日起生效,原《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》、《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金托管协议》失效。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金募集的文件;
2.《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》;
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
4.《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金托管协议》;
5.《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;
6.《关于广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金份额持有人大会表决结果的公告》;
7.中国证监会批准广发全球精选股票型证券投资基金募集的文件;
8.《广发全球精选股票型证券投资基金基金合同》;
9.《广发全球精选股票型证券投资基金招募说明书》;
10.《广发全球精选股票型证券投资基金托管协议》;
11.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;
12.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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。

广发基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

广发全球医疗保健指数证券投资基金

2014 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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球医疗保健(QDII)
基金主代码	000369
交易代码	000369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月10日
报告期末基金份额总额	137,457,009.51份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金以实现对标的指数的有效跟踪为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。 (二)权益类资产投资策略 1、股票组合构建原则 本基金主要采用完全复制法来跟踪标普全球1200医疗保健指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。 2、股票组合构建方法 本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 3、股票组合调整 (1)定期调整 本基金股票组合根据所跟踪的标普全球1200医疗保健指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 (2)不定期调整 1)与指数相关的调整:当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。 2)申购赎回调整:根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。 3)其他调整:对于标的指数成份股,若因其出现停牌限制、存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大的不利的司法诉讼、或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选股、甚至现金来代替,也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。 4、目标基金投资策略 本基金基于控制投资组合跟踪误差与流动性管理的需要,可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以标普全球1200医疗保健指数为投资标的的指数基金(包括ETF)。 (三)固定收益类资产投资策略 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。 (四)衍生品投资策略 本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略,对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险,以及利用金融衍生产品的杠杆作用,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。
业绩比较基准	人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Citibank N.A
境外资产托管人中文名称	美国花旗银行有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	918,234.64
2.本期利润	5,709,857.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0437
4.期末基金资产净值	152,267,532.22
5.期末基金份额净值	1.108

注:1、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。

2、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。

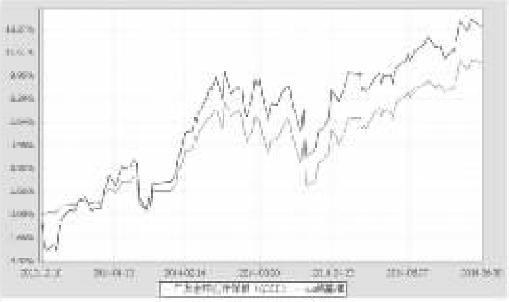
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	4.23%	0.60%	4.13%	0.65%	0.10%	–0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发全球医疗保健指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年12月10日至2014年6月30日)



注:本基金合同生效日期为2013年12月10日,建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理;广发标普全球农业指数(QDII)基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;国际业务部副总经理	2013–12–10	–	7	男,中国籍,统计学博士,持有基金业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理,2013年8月9日起任广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理,2013年11月28日起任广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年12月10日起任广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司国际业务部副总经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发全球医疗保健指数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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

标普全球医疗指数二季度是一个创新高的走势,季度初受到成长股三月初开始的调整影响,但由于医疗保健行业的稳健性使得指数早于美股大盘企稳,并不断小幅度创新高。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值上涨4.23%,比较基准收益率上涨4.13%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前来看三季度,医疗保健指数将继续保持强势,稳中有升的趋势将有望得到保持,究其最根本的原因,还是日益发达的生物科技以及新型医疗器械技术对人类生活质量的不断改善。整个行业经过过去不断的投入研发,许多新技术开始不断呈现到公众面前,许多新型特效药以及新的基因测序技术,口服胰岛素技术的进展等等新产品新技术都使得医疗保健行业将进入一个新的高速发展阶段。例如吉列德科学去年12月份获得美国FDA批准的治疗丙肝的特效药,仅仅今年第一季度就销售了超过20亿美元,并在今年有望成为有史以来最卖座的药。虽然一个12周疗程的费用高达8万多美元,但是从治疗效果来看确实是成功的,这也是首季度能创下超高销售额的根本原因。

从标普全球医疗保健指数本身来看,长期的历史数据显示指数的稳定性以及低波动性都成为了长期业绩的保证。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	141,647,952.17	86.75
	其中:普通股	141,647,952.17	86.75
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	2,644,273.35	1.62
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
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	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	15,246,571.10	9.34
8	其他各项资产	3,751,281.09	2.30
9	合计	163,290,077.71	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	87,814,986.07	57.67
瑞士	18,073,678.26	11.87
英国	10,782,812.65	7.08
德国	6,331,390.34	4.16
法国	5,739,333.45	3.77
日本	5,147,807.32	3.38
丹麦	4,014,289.35	2.64
加拿大	1,842,085.58	1.21
澳大利亚	1,500,352.68	0.99
比利时	401,216.47	0.26
合计	141,647,952.17	93.03

注:国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	–	–
材料	–	–
工业	–	–
非必须消费品	–	–
必须消费品	–	–
保健	141,647,952.17	93.03
金融	–	–
信息技术	–	–
电信服务	–	–
公共事业	–	–
合计	141,647,952.17	93.03

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	17,425.00	11,216,575.93	7.37
2	NOVARTIS AG–REG	诺华	NOVN VX	瑞士证券交易所	瑞士	16,703.00	9,306,922.90	6.11
3	ROCHE HOLDING AG–GENUSSCHEIN	罗氏	ROG VX	瑞士证券交易所	瑞士	4,340.00	7,965,471.64	5.23
4	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	39,295.00	7,175,860.51	4.71
5	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	17,987.00	6,402,283.43	4.20
6	GLAXOSMITHKLINE PLC	葛兰素史克公司	GSK LN	伦敦证券交易所	英国	29,892.00	4,907,835.72	3.22
7	SANOFI	赛诺菲安万特公司	SAN FP	巴黎证券交易所	法国	7,475.00	4,868,116.68	3.20
8	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	9,466.00	4,828,877.78	3.17
9	BAYER AG–REG	拜耳股份有限公司	BAYN GR	德国证券交易所	德国	5,096.00	4,412,641.64	2.90
10	NOVO NORDISK A/S–B	诺和诺德公司	NOVOB DC	哥本哈根证券交易所	丹麦	12,693.00	3,594,217.13	2.36

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	2,644,273.35	1.74
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	149,022.89
4	应收利息	1,448.09
5	应收申购款	2,553,692.91
6	其他应收款	971,345.77
7	待摊费用	75,771.43
8	其他	–
9	合计	3,751,281.09

5.10.4报告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。

5.10.5 报告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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	136,830,379.68
本报告期基金总申购份额	39,543,122.88
减:本报告期基金总赎回份额	38,916,493.05
本报告期基金拆分变动份额	–
报告期期末基金份额总额	137,457,009.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2014年5月5日,托管人发布公告,禄金山先生不再担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理,任命寻卫国先生担任资产托管部总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发全球医疗保健指数证券投资基金募集的文件;
2.《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》;
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
4.《广发全球医疗保健指数证券投资基金托管协议》;
5.法律意见书;
6.基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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

9.3 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。

广发基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

广发深证100指数分级证券投资基金

2014 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:二〇一四年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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规定,于2014年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发深证100指数分级		
基金主代码	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		
报告期末基金份额总额	115,047,563.63份		
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。		
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		
下属三级基金的基金简称	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
下属三级基金的交易代码	150083	150084	162714
报告期末下属三级基金的份额总额	37,594,339.00份	37,594,340.00份	39,858,884.63份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	–1,841,943.76
2.本期利润	2,786,133.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0229
4.期末基金资产净值	87,133,401.50
5.期末基金份额净值	0.7574

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。

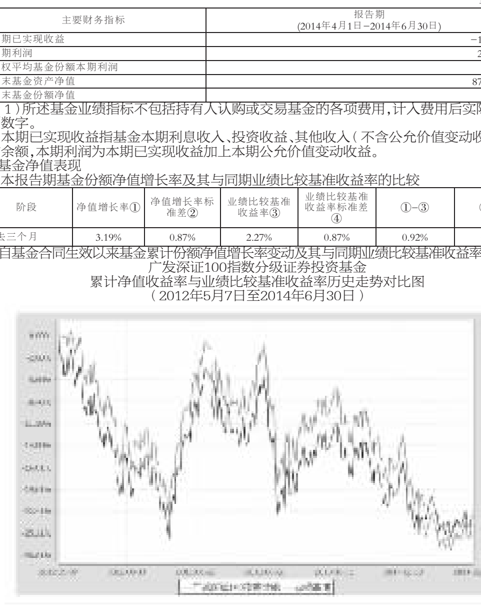
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	3.19%	0.87%	2.27%	0.87%	0.92%	0.00%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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
累计净值收益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2014年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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;数量投资部总经理	2012–05–07	–	14	男,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业资格证书,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。
陈盛业	本基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理;广发中证500ETF及联接(LOF)基金的基金经理	2013–09–09	–	7	男,中国籍,经济学博士,持有证券业执业证书,2007年3月至2009年9月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管,2009年9月至2010年8月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理,2010年8月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作,2010年12月1日起任广发沪深300指数基金,2010年12月1日至2013年10月9日任广发中证500指数(LOF)基金的基金经理,2013年4月11日起任广发中证500ETF基金的基金经理,2013年9月9日起任广发深证100指数分级基金的基金经理,2013年10月10日起任广发中证500ETF联接(LOF)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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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2只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

报告期内,本基金净值增长率为3.19%,基金业绩基准为2.27%,日均偏离度绝对值为0.08%,符合要求。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	81,978,886.86	93.53
	其中:股票	81,978,886.86	93.53
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	4,496,883.70	5.13
7	其他各项资产	1,175,039.22	1.34
8	合计	87,650,809.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	244,636.02	0.28
B	采矿业	2,058,338.48	2.36
C	制造业	49,558,005.07	56.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	796,306.59	0.91
E	建筑业	795,961.92	0.91
F	批发和零售业	1,741,811.20	2.00
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	4,408,846.28	5.06
J	金融业	8,882,937.27	10.19
K	房地产业	6,769,271.06	7.77
L	租赁和商务服务业	1,124,894.83	1.29
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,753,251.62	3.16
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	2,124,954.25	2.44
S	综合	719,672.27	0.83
	合计	81,978,886.86	94.08

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	546,588	4,520,282.76	5.19
2	000651	格力电器	151,525	4,462,411.25	5.12
3	000001	平安银行	325,759	3,228,271.69	3.70
4	000333	美的集团	118,643	2,292,182.76	2.63
5	000858	五 粮 液	117,979	2,115,363.47	2.43
6	002024	苏宁云商	265,520	1,741,811.20	2.00
7	000063	中兴通讯	119,869	1,572,681.28	1.80
8	000783	长江证券	156,406	1,501,497.60	1.72
9	000895	双汇发展	41,207	1,474,798.53	1.69
10	000538	云南白药	27,491	1,435,030.20	1.65

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告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。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

(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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

(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。

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,055.23
2	应收证券清算款	1,114,792.07
3	应收股利	–
4	应收利息	896.43
5	应收申购款	22,048.33
6	其他应收款	–
7	待摊费用	30,247.16
8	其他	–
9	合计	1,175,039.22

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告末前十名股票不存在流通受限情况。

§6 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
基金合同生效日的基金份额总额	110,591,152.00	110,591,153.00	346,516,015.60
本报告期期初基金份额总额	41,137,065.00	41,137,066.00	46,163,469.90
本报告期基金总申购份额	1,202,718.60	–	–
减:本报告期基金总赎回份额	14,592,755.87	–	–
本报告期基金拆分变动份额	–	–	–
本报告期期末基金份额总额	37,594,339.00	37,594,340.00	39,858,884.63

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 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。

广发基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日