广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月三十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24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2014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	广发成长优选混合
基金主代码	000214
交易代码	000214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月11日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	209,153,607.22份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究的基础上,自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置,对股票、债券和货币市场工具等大类资产配置比例进行动态调整,在降低市场风险的同时追求更高收益。本基金将采用成长型股票优选策略,通过定量分析与定性分析,自下而上的精选A股市场中具有持续成长潜力且估值合理的上市公司进行投资。
业绩比较基准	50%×沪深300指数+50%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	汤嵩彦
	联系电话	020-83936666	95559
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95559
传真		020-89899158	021-62701216

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	2014年	2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	32,929,270.68	340,204.85
本期利润	56,889,847.71	2,201,516.39
加权平均基金份额本期利润	0.1231	0.0063
本期基金份额净值增长率	9.44%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1013	0.0010
期末基金资产净值	230,340,419.11	352,782,753.04
期末基金份额净值	1.101	1.006

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、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、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。

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

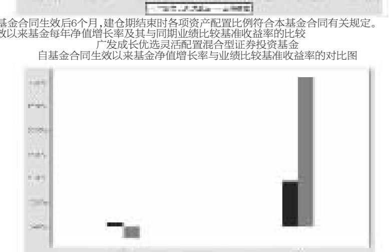
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.85%	1.82%	23.71%	0.83%	-30.56%	0.99%
过去六个月	2.80%	1.44%	34.04%	0.67%	-31.24%	0.77%
过去一年	9.44%	1.32%	31.24%	0.61%	-21.80%	0.71%
自基金合同生效起至今	10.10%	1.28%	27.42%	0.61%	-17.32%	0.67%

注:1、业绩比较基准:50%沪深300指数收益+50%中证全债指数收益。

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

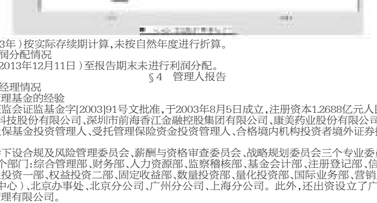
广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年12月11日至2014年12月31日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后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。

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

广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
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(2013年)按实际存续期计算,未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2013年12月11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1.2688亿元人民币。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12月31日,本基金管理人管理五十七只开放式基金——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、广发季季利理财债券型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金和广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金,管理资产规模为1334.68亿元。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		
朱纪刚	本基金的基金经理;广发核心精选股票基金的基金经理;广发轮动配置股票基金的基金经理;广发竞争优势混合基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2013-12-11	-	8.5年	男,中国籍,理学硕士,持有基金业执业资格证书,2006年7月至2006年12月任职于招商证券股份有限公司,2006年12月至2009年8月先后任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究小组组长、广发大盘成长混合基金的基金经理助理、研究发展部副总经理,2009年9月10日起任广发核心精选股票基金的基金经理,2011年3月15日至2012年10月22日任广发聚祥保本混合基金的基金经理,2013年5月28日任广发轮动配置股票基金的基金经理,2013年12月11日任广发成长优选混合基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理,2014年3月12日起任广发竞争优势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)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、《广发成长优选灵活配置混合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。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,存在2次成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。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

2014年,市场走出了久违的牛市,经过全年的跌宕起伏后,指数实现了大幅上涨,而且市场风格较之2010-2013年四年也发生了显著变化,大盘蓝筹首次跑赢中小盘股票。我们的比较基准上涨42%,沪深300指数上涨52%,与之相对,创业板只上涨13%,差距明显。行业方面,金融、交通运输、公用事业等涨幅居前,金融超过100%涨幅,农林牧业、文化体育涨幅较少,大小股票分化严重。

今年的行情可以分为三个阶段:

第一阶段:1-2月份。延续了2013年四季度以来的小盘股行情,这段时间投资者主线明显,市场机会也比较单一,主要集中在拥有成长空间的小盘股上,创业板尤其是讲故事讲空间类的股票继续突破估值界限上涨,以飞利信、卫宁软件等创业板新兴成长股为典型代表,创业板指数上涨了15%,从2013年底部上涨累计150%

第二阶段:3-7月份。这个阶段主要是以调整为主,是大行情的孕育期。创业板指数开始急剧下跌,后来虽然有所反弹,但是到7月份又掉到了低点。这个阶段主要是前期小股票上涨过多,大家做多的空间和动能开始衰竭,而大股票人气还在酝酿中,所以市场失去主线,但是仍然有部分热点行业有独立性行情,比如教育,互联网等。

第三阶段,9月份到年底,行情展开期。前期调整充分后,伴随着国家的一系列政策,比如沪港通、降息、各种自贸区、一带一路等,行情逐渐展开,大盘蓝筹依次上涨,我们认为上涨的逻辑在于国家之前的一系列改革,包括国企改革,反腐败等,使得大家对中国经济长远的前景变得乐观,有了做多的长期基础;短期管理层有让股市上涨的意愿,而其它投资渠道如房地产信托等的投资前景变差使得社会资金大量流入股市,而大盘蓝筹自从2009年高点后5年未涨,距离2007年高点非常遥远,也让投资者有做多的空间。非银金融、银行、地产、煤炭有色等行业依次展开行情。当然,符合国家政策主题的行业如军工、互联网金融、体育等表现也非常好,这里面也不乏小盘股,但整体以大盘为主。

在第一波的小市值股票行情中,我们的表现还算中规中矩,由于规模较小,我们用较大仓位参与了创业板的行情,投资的行业包括医疗、计算机软硬件、信息技术等,所以前三季度我们业绩还差强人意。但是9月下旬开始的互联网股票行情和10月下旬开始的大蓝筹带动指数的行情我们判断不够,在此期间基本上动作很少,还是持有原来的股票为主,导致第四季度业绩很差,拖累全年业绩。在此向持有人表示我们的歉意。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为9.44%,同期业绩比较基准收益率为31.24%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年,市场仍然会是经济短期下行的利空与投资者对长期信心的博弈,同时夹杂着短期经济刺激政策的预期。在这种心态下,预期市场整体波动性会较大,但整体趋势向好。

经济方面,我们与前几年的观点相似,整体持中性态度。2014年整体经济应该是呈现不温不火的态势,逐步下行的态势并未改变,4季度GDP增速到了7.4%,但是下行曲线比较平缓。整体来说,低于乐观者向上复苏的预期,但是也高于之前悲观者认为经济会硬着陆的预期。应该说,这是长期结构调整压力和国家政策综合作用的结果。

2015年,经济仍将处于结构调整和长期下降通道,目前并未看到新的强的增长点,所以较之2014年不会有特别强劲的复苏,但是2015年有很多对中国经济的积极因素,比如除了自身改革以外,国际上有欧版QE,油价大幅下跌等。所以我们可以对2015年经济稍微乐观一些。

在这种情况下,明年市场仍然会呈现长期和短期的博弈。长期来看,随着国家一系列改革和产业扶植的政策,诸如一带一路、信息安全、军工强国等,市场依然会对长期充满信心,会涌现出一批具有长期空间的明星行业和个股;同时原来担心长期崩盘而把估值压的很低的诸如银行地产等行业,随着长期担忧的减弱,也会有估值逐渐回升的过程;而白马成长股经历一年的调整,如果业绩不低于预期也可以赚时间成长的钱。所以会发现市场上有机会的行业有很多,当然如果短期涨多了又会因为短期经济不好而有所波动和调整。所以我们对2015年市场整体的判断是:大趋势向好,波动较大,热点较多,多数行业都有机会。比较持续且空间大的主题和行业包括互联网,军工,信息安全,医疗服务等。

我们期待新的一年净值会有好的表现,回报长期支持的持有人。

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

2014年度,基金托管人在广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2014年度,广发基金管理有限公司在广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2014年度,由广发基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 王明静 洪锐明签字出具了德师报(审)字(15)第P0299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:广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:	-	-
银行存款	28,925,209.32	291,411,281.76
结算备付金	560,048.10	-
存出保证金	510,034.75	-
交易性金融资产	207,591,037.16	64,211,920.03
其中:股票投资	207,591,037.16	64,211,920.03
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	60.51	-
应收利息	6,347.81	61,644.39
应收股利	-	-
应收申购款	838,462.23	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	238,431,199.88	355,684,846.18
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	-	2,510,117.25
应付赎回款	4,805,473.52	-
应付管理人报酬	355,193.08	289,334.78
应付托管费	59,198.88	48,222.47
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,580,147.50	54,418.64
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	290,767.79	-
负债合计	8,090,780.77	2,902,093.14
所有者权益:	-	-
实收基金	209,153,607.22	350,581,236.65
未分配利润	21,186,811.89	2,201,516.39
所有者权益合计	230,340,419.11	352,782,753.04
负债和所有者权益总计	238,431,199.88	355,684,846.18

注:(1)报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币1.101元,基金份额总额209,153,607.22份;2013年12月31日,基金份额净值人民币1.006元,基金份额总额350,581,236.65份。

(2)上年度会计期间为2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	74,895,980.17	2,610,637.52
1.利息收入	1,029,329.65	135,967.27
其中:存款利息收入	1,029,329.65	135,967.27
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)	44,126,207.95	613,358.71
其中:股票投资收益	42,462,331.23	613,358.71
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	1,663,876.72	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	23,960,577.03	1,861,311.54
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,779,865.54	-
减:二、费用	18,006,132.46	409,121.13
1.管理人报酬	7,530,224.23	289,334.78
2.托管费	1,255,037.40	48,222.47
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	8,899,136.96	70,663.88
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	321,733.87	900.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	56,889,847.71	2,201,516.39
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	56,889,847.71	2,201,516.39

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	350,581,236.65	2,201,516.39	352,782,753.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	56,889,847.71	56,889,847.71
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)	-141,427,629.43	-37,904,552.21	-179,332,181.64
其中:1.基金申购款	878,605,048.35	108,231,382.82	986,836,431.17
2.基金赎回款	-1,020,032,677.78	-146,135,935.03	-1,166,168,612.81
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)	209,153,607.22	21,186,811.89	230,340,419.11
项目	上年度可比期间 2013年12月11日(基金合同生效日)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)	350,581,236.65	-	350,581,236.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,201,516.39	2,201,516.39
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	350,581,236.65	2,201,516.39	352,782,753.04

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

广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2013]745号文《关于核准广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2013年12月11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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金募集期为2013年11月11日至2013年12月6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350,581,236.65元,有效认购户数为2,905户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币73,329.92 元,折合基金份额73,329.92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(特殊普通合伙)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、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债券等)、权证、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金业绩比较基准为50%×沪深300指数+50%×中证全债指数。

本基金的财务报表于2015年3月23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业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2014年12月31日及2013年12月31日的财务状况以及2014年度及2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。可比期间的会计年度为2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益;应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价,于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本;股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账,相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。

具体投资品种的估值方法如下:

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会2008年9月12日发布的证监会公告[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定,若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,经基金管理人估值委员会同意,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法),调整最近交易市价,确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资,按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票,于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票,若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值;若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含债券应收利息后的净价为公允价值。未上市流通的债券按成本估值。

全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别确定公允价值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前,采用估值技术确定公允价值,如估值技术难以可靠计量,则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前,采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量,则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债,其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2.本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4.每一基金份额享有同等分配权;

5.法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》,同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2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。

7.4.5.3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。

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
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
交通银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司(注)	基金管理人母公司、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	基金管理人控股子公司

注:广发证券股份有限公司于2014年7月31日对广发基金管理有限公司进行增资,并对其实施控制,广发基金管理有限公司由此成为广发证券股份有限公司的子公司。

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

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股票交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,530,224.23	289,334.78
其中:支付销售机构的客户维护费	2,998,153.56	118,628.10

注:本基金的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×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、公休假等,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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,255,037.40	48,222.47

注:本基金的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×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。

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

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月11日(基金合同生效日)至2013年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	32,936,369.71	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	32,936,369.71	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.75%	-

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。

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年12月11日(基金合同生效日)至2013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
交通银行股份有限公司	28,925,209.32	843,950.94	291,411,281.76	135,967.27

注:本基金的银行存款由基金托管人交通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(2014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
600594	益佰制药	2014-01-21	2015-01-19	非公开发行流通受限	31.35	33.28	77,100.00	2,417,085.00	2,565,888.00	2014年7月14日除权除息,比例:每10股派现金红利1.20元(含税)

注:截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限的债券和权证。

7.4.9.2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
000411	英特集团	2014-11-28	重大事项	21.71	-	-	461,700.00	7,761,632.42	10,023,507.00	-
002009	天奇股份	2014-10-20	重大事项	17.87	2015-01-28	17.93	389,268.00	5,180,159.41	6,956,219.16	-
002184	海得控制	2014-11-27	重大事项	21.85	2015-01-26	20.00	737,952.00	10,507,294.60	16,124,251.20	-
002308	威创股份	2014-12-29	重大事项	8.25	2015-02-04	9.08	399,305.00	3,740,227.71	3,294,266.25	-
002329	皇氏集团	2014-12-01	重大事项	27.85	2015-01-30	27.61	198,457.00	3,287,425.93	5,527,027.45	-
300011	鼎汉技术	2014-11-24	重大事项	20.25	2015-02-03	18.98	188,452.00	1,955,754.67	3,816,153.00	-
300296	利亚德	2014-09-29	重大事项	22.74	2015-01-05	22.60	200,055.00	3,896,243.14	4,549,250.70	-
300359	全通教育	2014-09-22	重大事项	94.63	2015-01-28	96.97	99,995.00	9,312,923.48	9,462,526.85	-

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31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。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31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。

7.4.10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

(a)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。

(b)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附注7.4.4.5。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年12月31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145,271,947.55元,属于第二层级的余额为62,319,089.61元,无属于第三层级的余额(2013年12月31日:第一层级64,211,920.03元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(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。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值估值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1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	207,591,037.16	87.07
	其中:股票	207,591,037.16	87.07
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	29,485,257.42	12.37
7	其他各项资产	1,354,905.30	0.57
8	合计	238,431,199.88	100.00

8.2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	158,940,156.02	69.00
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	20,545,962.90	8.92
G	交通运输、仓储和邮政业	4,328,500.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,776,418.24	10.32
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	207,591,037.16	90.12

8.3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	002491	通鼎光电	856,106	17,550,173.00	7.62
2	300221	银禧科技	1,283,921	17,076,149.30	7.41
3	002184	海得控制	737,952	16,124,251.20	7.00
4	000153	丰原药业	1,133,212	13,995,168.20	6.08
5	000516	开元投资	861,790	10,522,455.90	4.57
6	000411	英特集团	461,700	10,023,507.00	4.35
7	002111	威海广泰	614,396	9,916,351.44	4.31
8	300359	全通教育	99,995	9,462,526.85	4.11
9	603766	隆鑫通用	612,772	8,235,655.68	3.58
10	002009	天奇股份	389,268	6,956,219.16	3.02

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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	002236	大华股份	64,095,214.47	18.17
2	300165	天瑞仪器	55,861,718.51	15.83
3	002312	三泰电子	53,599,054.21	15.19
4	002184	海得控制	45,523,234.44	12.90
5	600330	天通股份	41,773,392.06	11.84
6	002030	达安基因	38,507,251.65	10.92
7	600153	建发股份	37,846,264.37	10.73
8	000997	新大陆	37,385,589.80	10.60
9	300266	兴源过滤	36,211,094.15	10.26
10	002038	双鹭药业	36,063,243.73	10.22
11	002450	康得新	34,021,683.85	9.64
12	002583	海能达	33,089,451.40	9.38
13	002111	威海广泰	32,822,738.95	9.30
14	300226	上海钢联	31,571,020.17	8.95
15	300005	探路者	31,223,566.95	8.85
16	000625	长安汽车	30,280,891.61	8.58
17	601166	兴业银行	29,918,208.90	8.48
18	300150	世纪瑞尔	29,592,795.28	8.39
19	300007	汉威电子	28,940,481.70	8.20
20	300166	东方国信	28,760,592.87	8.15
21	603766	隆鑫通用	28,732,114.69	8.14
22	002491	通鼎光电	27,901,470.80	7.91
23	600016	民生银行	27,810,000.00	7.88
24	300238	冠昊生物	27,639,461.10	7.83
25	000001	平安银行	27,576,816.14	7.82
26	002382	蓝帆医疗	27,242,494.33	7.72
27	002060	粤水电	27,112,946.00	7.69
28	002341	新纶科技	26,146,818.87	7.41
29	002541	鸿路钢构	24,905,311.45	7.06
30	300070	碧水源	24,529,601.86	6.95
31	300310	宜通世纪	24,136,037.05	6.84
32	002519	银河电子	24,019,178.62	6.81
33	002520	日发精机	23,873,017.10	6.77
34	600887	伊利股份	23,408,901.20	6.64
35	002385	大北农	22,891,642.55	6.49
36	300235	方直科技	22,639,633.21	6.42
37	300078	中瑞思创	22,508,374.89	6.38
38	002717	岭南园林	22,320,000.00	6.33
39	600030	中信证券	22,165,524.59	6.28
40	300164	通源石油	22,103,288.02	6.27
41	300252	金信诺	22,054,479.94	6.25
42	300170	汉得信息	21,980,191.69	6.23
43	002198	嘉应制药	21,810,781.22	6.18
44	300008	上海佳豪	21,783,176.30	6.17
45	300178	腾邦国际	21,703,980.98	6.15
46	300221	银禧科技	21,623,995.75	6.13
47	300065	海兰信	21,597,671.23	6.12
48	600446	金证股份	21,364,830.23	6.06
49	000800	一汽轿车	21,334,476.11	6.05
50	002146	荣盛发展	20,534,043.16	5.82
51	600420	现代制药	20,394,364.00	5.78
52	002480	新筑股份	20,170,514.21	5.72
53	300028	金亚科技	20,026,155.81	5.68
54	600000	浦发银行	19,950,752.25	5.66
55	002527	新时达	19,171,262.30	5.43
56	300049	福瑞股份	19,098,708.21	5.41
57	300212	易华录	18,739,673.29	5.31
58	601222	林洋电子	18,641,048.31	5.28
59	300359	全通教育	18,627,226.53	5.28
60	002008	大族激光	18,445,727.67	5.23
61	300339	润和软件	18,335,023.22	5.20
62	000568	泸州老窖	18,332,874.19	5.20
63	300303	聚飞光电	18,332,298.26	5.20
64	300072	三聚环保	18,327,698.12	5.20
65	002437	誉衡药业	18,051,116.45	5.12
66	002292	奥飞动漫	18,031,086.73	5.11
67	002219	恒康医疗	17,779,434.20	5.04
68	600199	金种子酒	17,018,684.71	4.82
69	300300	汉鼎股份	16,404,594.43	4.65
70	300245	天玑科技	16,279,017.25	4.61
71	002477	雏鹰农牧	16,184,656.79	4.59
72	600240	华业地产	16,094,811.85	4.56
73	002329	皇氏集团	15,768,105.28	4.47
74	300011	鼎汉技术	15,660,811.81	4.44
75	603168	莎普爱思	15,555,664.68	4.41
76	002475	立讯精密	15,455,041.54	4.38
77	601098	中南传媒	15,178,601.57	4.30
78	002273	水晶光电	15,111,212.58	4.28
79	300118	东方日升	14,956,502.99	4.24
80	300207	欣旺达	14,811,563.04	4.20
81	002020	京新药业	14,690,437.67	4.16
82	000153	丰原药业	14,531,571.68	4.12
83	000738	中航动控	14,433,069.18	4.09
84	300296	利亚德	14,411,318.99	4.09
85	002532	新界泵业	14,226,810.13	4.03
86	300177	中海达	14,113,579.54	4.00
87	300124	汇川技术	14,084,294.29	3.99
88	300328	宜安科技	13,999,757.13	3.97
89	600869	智慧能源	13,763,898.12	3.90
90	002461	珠江啤酒	13,652,208.72	3.87
91	300379	东方通	13,485,481.55	3.82
92	300146	汤臣倍健	13,470,846.00	3.82
93	000876	新希望	13,440,463.49	3.81
94	002613	北玻股份	13,419,619.16	3.80
95	300352	北信源	13,363,318.90	3.79
96	002009	天奇股份	13,312,757.76	3.77
97	300232	洲明科技	13,289,815.34	3.77
98	002230	科大讯飞	13,245,085.41	3.75
99	300187	永清环保	13,205,618.78	3.74
100	002421	达实智能	13,158,379.13	3.73
101	600093	禾嘉股份	13,062,349.44	3.70
102	300043	互动娱乐	12,806,405.71	3.63
103	000681	视觉中国	12,499,318.88	3.54
104	002433	太安堂	12,454,632.37	3.53
105	002619	巨龙管业	12,313,984.48	3.49
106	300002	神州泰岳	12,298,353.88	3.49
107	000712	锦龙股份	12,284,583.48	3.48
108	002126	银轮股份	12,278,138.96	3.48
109	300012	华测检测	12,256,445.54	3.47
110	300295	三六五网	12,203,178.80	3.46
111	600530	交大昂立	12,186,064.61	3.45
112	002094	青岛金王	12,151,299.87	3.44
113	002508	老板电器	12,073,127.58	3.42
114	300271	华宇软件	11,971,330.42	3.39
115	002228	合兴包装	11,821,081.72	3.35
116	002402	和而泰	11,812,963.69	3.35
117	300335	迪森股份	11,718,451.49	3.32
118	300058	蓝色光标	11,671,699.72	3.31
119	600645	中源协和	11,505,434.32	3.26
120	600340	华夏幸福	11,445,269.95	3.24
121	600661	新南洋	11,222,783.54	3.18
122	002609	捷顺科技	11,214,716.80	3.18
123	002214	大立科技	10,981,587.37	3.11
124	601258	庞大集团	10,978,817.89	3.11
125	002595	豪迈科技	10,976,006.58	3.11
126	002019	亿帆鑫富	10,919,788.91	3.10
127	300183	东软载波	10,798,631.06	3.06
128	300054	鼎龙股份	10,758,250.10	3.05
129	002400	省广股份	10,689,877.87	3.03
130	300240	飞力达	10,679,276.80	3.03
131	000962	东方钽业	10,649,617.87	3.02
132	002023	海特高新	10,640,005.28	3.02
133	002229	鸿博股份	10,625,269.18	3.01
134	000049	德赛电池	10,585,576.14	3.00
135	300202	聚龙股份	10,493,753.50	2.97
136	601002	晋亿实业	10,374,476.06	2.94
137	002304	洋河股份	10,353,570.55	2.93
138	002441	众业达	10,318,860.32	2.92
139	300322	硕贝德	10,192,690.93	2.89
140	600850	华东电脑	10,167,950.92	2.88
141	600976	健民集团	10,110,018.78	2.87
142	002249	大洋电机	10,038,909.72	2.85
143	002577	雷柏科技	9,922,999.39	2.81
144	600078	澄星股份	9,877,755.45	2.80
145	000596	古井贡酒	9,586,317.25	2.72
146	300251	光线传媒	9,521,463.07	2.70
147	300262	巴安水务	9,487,510.92	2.69
148	300017	网宿科技	9,473,354.15	2.69
149	300274	阳光电源	9,454,180.30	2.68
150	002675	东诚药业	9,430,247.02	2.67
151	002308	威创股份	9,366,844.16	2.66
152	600580	卧龙电气	9,358,542.74	2.65
153	002516	江苏旷达	9,336,995.87	2.65
154	601519	大智慧	9,250,659.85	2.62
155	300172	中电环保	9,051,196.63	2.57
156	600192	长城电工	9,010,795.00	2.55
157	300036	超图软件	8,830,866.05	2.50
158	000516	开元投资	8,800,754.14	2.49
159	300133	华策影视	8,776,502.20	2.49
160	300246	宝莱特	8,637,637.91	2.45
161	600114	东睦股份	8,611,029.42	2.44
162	300097	智云股份	8,577,823.24	2.43
163	000411	英特集团	8,405,493.20	2.38
164	600809	山西汾酒	8,365,980.30	2.37
165	002472	双环传动	8,290,284.36	2.35
166	600583	海油工程	8,195,000.00	2.32
167	601231	环旭电子	8,104,492.32	2.30
168	600373	中文传媒	7,734,196.50	2.19
169	002358	森源电气	7,720,016.33	2.19
170	600499	科达洁能	7,708,221.04	2.18
171	300307	慈星股份	7,660,748.71	2.17
172	002614	蒙发利	7,435,565.90	2.11
173	002353	杰瑞股份	7,364,814.72	2.09
174	300059	东方财富	7,327,045.03	2.08
175	600158	中体产业	7,282,041.39	2.06
176	600835	上海机电	7,221,423.34	2.05
177	002684	猛狮科技	7,208,833.61	2.04
178	300175	朗源股份	7,142,898.84	2.02

注:本项及下项8.4.2、8.4.3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。

8.4.2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	002236	大华股份	70,158,978.59	19.89
2	002312	三泰电子	56,575,064.35	16.04
3	300165	天瑞仪器	54,222,976.90	15.37
4	002717	岭南园林	46,718,874.09	13.24
5	002030	达安基因	42,671,261.23	12.10
6	300266	兴源过滤	40,130,898.51	11.38
7	600330	天通股份	39,647,408.22	11.24
8	000997	新大陆	38,823,141.52	11.00
9	002450	康得新	37,617,025.71	10.66
10	002038	双鹭药业	35,792,677.21	10.15
11	600153	建发股份	34,246,762.11	9.71
12	002184	海得控制	34,140,610.88	9.68
13	300005	探路者	33,792,900.52	9.58
14	300226	上海钢联	32,320,700.62	9.16
15	002583	海能达	32,111,575.98	9.10
16	000625	长安汽车	31,937,281.68	9.05
17	300212	易华录	31,050,668.22	8.80
18	002382	蓝帆医疗	30,915,969.40	8.76
19	300070	碧水源	30,016,460.33	8.51
20	601166	兴业银行	29,949,403.09	8.49
21	300238	冠昊生物	28,633,731.97	8.12
22	002111	威海广泰	27,897,707.70	7.91
23	603766	隆鑫通用	27,848,346.02	7.89
24	000001	平安银行	27,442,897.06	7.78
25	600016	民生银行	27,239,791.84	7.72
26	002520	日发精机	26,829,949.84	7.61
27	300166	东方国信	26,453,991.58	7.50
28	002060	粤水电	25,577,820.09	7.25
29	300007	汉威电子	25,438,193.17	7.21
30	002341	新纶科技	25,278,633.16	7.17
31	002385	大北农	25,065,466.10	7.11
32	300150	世纪瑞尔	24,919,012.34	7.06
33	002541	鸿路钢构	24,874,554.19	7.05
34	002519	银河电子	23,774,199.51	6.74
35	600030	中信证券	22,578,652.22	6.40
36	300310	宜通世纪	22,556,926.23	6.39
37	000800	一汽轿车	22,273,954.96	6.31
38	002146	荣盛发展	21,773,280.66	6.17
39	600446	金证股份	21,763,448.49	6.17
40	002198	嘉应制药	21,422,321.70	6.07
41	300339	润和软件	20,870,706.63	5.92
42	300008	上海佳豪	20,671,005.46	5.86
43	300170	汉得信息	20,523,008.09	5.82
44	300078	中瑞思创	20,443,190.19	5.79
45	600420	现代制药	20,342,864.80	5.77
46	300235	方直科技	20,131,783.13	5.71
47	300164	通源石油	19,840,179.86	5.62
48	002219	恒康医疗	19,814,463.14	5.62
49	300178	腾邦国际	19,436,485.51	5.51
50	600887	伊利股份	19,381,060.48	5.49
51	600000	浦发银行	19,361,012.70	5.49
52	002480	新筑股份	19,305,353.46	5.47
53	300065	海兰信	19,126,995.16	5.42
54	002008	大族激光	19,097,176.60	5.41
55	300028	金亚科技	19,011,080.32	5.39
56	601222	林洋电子	18,904,018.69	5.36
57	300352	北信源	18,814,369.07	5.33
58	002437	誉衡药业	18,201,622.12	5.16
59	000568	泸州老窖	18,098,964.72	5.13
60	300303	聚飞光电	17,883,625.36	5.07
61	300252	金信诺	17,503,480.54	4.96
62	002527	新时达	17,482,704.10	4.96
63	300300	汉鼎股份	17,258,281.46	4.89
64	600199	金种子酒	16,606,187.14	4.71
65	603168	莎普爱思	16,506,793.11	4.68
66	300072	三聚环保	16,455,789.45	4.66
67	002292	奥飞动漫	16,217,750.79	4.60
68	002228	合兴包装	15,768,947.49	4.47
69	600240	华业地产	15,718,629.86	4.46
70	002475	立讯精密	15,540,541.32	4.41
71	300177	中海达	15,503,136.86	4.39
72	002477	雏鹰农牧	15,497,960.93	4.39
73	300207	欣旺达	15,094,022.78	4.28
74	300011	鼎汉技术	15,059,913.66	4.27
75	002421	达实智能	15,054,203.59	4.27
76	300245	天玑科技	14,964,111.26	4.24
77	300328	宜安科技	14,917,129.66	4.23
78	300049	福瑞股份	14,908,976.92	4.23
79	601098	中南传媒	14,707,820.24	4.17
80	000738	中航动控	14,405,521.35	4.08
81	300146	汤臣倍健	14,333,843.12	4.06
82	002433	太安堂	14,298,273.72	4.05
83	002273	水晶光电	14,212,595.43	4.03
84	000876	新希望	13,925,434.68	3.95
85	002461	珠江啤酒	13,894,224.15	3.94
86	300118	东方日升	13,861,035.49	3.93
87	300232	洲明科技	13,831,652.03	3.92
88	300271	华宇软件	13,604,342.13	3.86
89	002230	科大讯飞	13,567,654.60	3.85
90	300124	汇川技术	13,492,992.77	3.82
91	300335	迪森股份	13,412,062.91	3.80
92	300187	永清环保	13,333,031.65	3.78
93	002532	新界泵业	13,281,607.38	3.76
94	002020	京新药业	13,262,904.32	3.76
95	002613	北玻股份	13,199,490.11	3.74
96	300379	东方通	13,125,457.00	3.72
97	002491	通鼎光电	13,113,896.54	3.72
98	002126	银轮股份	12,896,927.18	3.66
99	600869	智慧能源	12,893,546.92	3.65
100	002595	豪迈科技	12,819,174.98	3.63
101	002402	和而泰	12,708,661.15	3.60
102	002329	皇氏集团	12,708,069.36	3.60
103	300202	聚龙股份	12,483,110.31	3.54
104	600645	中源协和	12,354,332.71	3.50
105	300021	大禹节水	12,317,976.32	3.49
106	600976	健民集团	12,070,044.06	3.42
107	002619	巨龙管业	12,068,480.71	3.42
108	300043	互动娱乐	11,732,476.50	3.33
109	300183	东软载波	11,642,511.54	3.30
110	002094	青岛金王	11,562,068.37	3.28
111	300002	神州泰岳	11,541,934.13	3.27
112	002214	大立科技	11,447,507.55	3.24
113	000962	东方钽业	11,333,155.99	3.21
114	300240	飞力达	11,310,574.97	3.21
115	600093	禾嘉股份	11,241,112.30	3.19
116	300296	利亚德	11,187,188.83	3.17
117	002229	鸿博股份	11,143,324.05	3.16
118	300295	三六五网	11,090,810.36	3.14
119	000681	视觉中国	11,007,369.95	3.12
120	000712	锦龙股份	10,866,732.60	3.08
121	002019	亿帆鑫富	10,828,020.24	3.07
122	002508	老板电器	10,803,622.62	3.06
123	300058	蓝色光标	10,803,371.50	3.06
124	300133	华策影视	10,671,278.10	3.02
125	600340	华夏幸福	10,667,690.40	3.02
126	300322	硕贝德	10,654,911.31	3.02
127	000049	德赛电池	10,568,530.82	3.00
128	601258	庞大集团	10,463,197.53	2.97
129	600661	新南洋	10,448,643.27	2.96
130	002304	洋河股份	10,416,899.83	2.95
131	300359	全通教育	10,413,057.46	2.95
132	002577	雷柏科技	10,385,832.38	2.94
133	300012	华测检测	10,123,890.53	2.87
134	300054	鼎龙股份	10,106,993.40	2.86
135	601002	晋亿实业	10,059,665.16	2.85
136	002249	大洋电机	10,033,451.71	2.84
137	300251	光线传媒	10,019,646.77	2.84
138	300172	中电环保	9,983,788.29	2.83
139	300262	巴安水务	9,878,340.00	2.80
140	300274	阳光电源	9,865,018.96	2.80
141	002609	捷顺科技	9,812,400.35	2.78
142	002400	省广股份	9,782,766.29	2.77
143	601519	大智慧	9,732,295.80	2.76
144	300017	网宿科技	9,691,583.01	2.75
145	000596	古井贡酒	9,625,165.49	2.73
146	002441	众业达	9,539,829.65	2.70
147	300188	美亚柏科	9,397,308.82	2.66
148	002456	欧菲光	9,251,551.70	2.62
149	600580	卧龙电气	9,239,709.81	2.62
150	002516	江苏旷达	9,100,667.82	2.58
151	600530	交大昂立	9,080,841.74	2.57
152	300036	超图软件	8,697,880.53	2.47
153	002675	东诚药业	8,524,496.81	2.42
154	600583	海油工程	8,519,235.00	2.41
155	600078	澄星股份	8,393,725.58	2.38
156	601231	环旭电子	8,318,165.90	2.36
157	300307	慈星股份	8,247,232.04	2.34
158	600809	山西汾酒	8,180,280.51	2.32
159	600114	东睦股份	8,125,800.25	2.30
160	600192	长城电工	8,022,622.90	2.27
161	300175	朗源股份	7,896,395.57	2.24
162	300059	东方财富	7,849,599.81	2.23
163	002009	天奇股份	7,843,913.36	2.22
164	002174	游族网络	7,811,820.08	2.21
165	002153	石基信息	7,784,831.27	2.21
166	300246	宝莱特	7,626,264.26	2.16
167	600373	中文传媒	7,462,873.97	2.12
168	002439	启明星辰	7,403,560.09	2.10
169	002638	勤上光电	7,335,141.50	2.08
170	600499	科达洁能	7,302,229.90	2.07
171	002614	蒙发利	7,195,170.16	2.04
172	002299	圣农发展	7,138,766.28	2.02
173	002023	海特高新	7,076,756.62	2.01
174	600158	中体产业	7,057,464.44	2.00

8.4.3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	3,418,798,631.38
卖出股票的收入(成交)总额	3,341,842,422.51

8.5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。

8.6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。

8.7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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9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。

8.10 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。

8.11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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2本报告期内,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。

8.12.3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	510,034.75
2	应收证券清算款	60.51
3	应收股利	-
4	应收利息	6,347.81
5	应收申购款	838,462.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,354,905.30

8.12.4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。

8.12.5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	002184	海得控制	16,124,251.20	7.00	重大事项
2	000411	英特集团	10,023,507.00	4.35	重大事项
3	300359	全通教育	9,462,526.85	4.11	重大事项
4	002009	天奇股份	6,956,219.16	3.02	重大事项

§9基金份额持有人信息

9.1 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
6,574	31,815.27	44,247,773.65	21.16%	164,905,833.57	78.84%

9.2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	1,205,937.24	0.5766%

9.3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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年12月11日)基金份额总额	350,581,236.65
本报告期期初基金份额总额	350,581,236.65
本报告期基金总申购份额	878,605,048.35
减:本报告期基金总赎回份额	1,020,032,677.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	209,153,607.22

§11重大事件揭示

11.1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。

11.2 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

2014年8月8日,陈伯军因工作调动不再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日,本基金管理人聘任包林生为公司副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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

注:1、交易席位选择标准:

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	2	3,631,951,918.22	53.95%	2,580,147.50	53.95%	新增2个
华福证券	2	3,099,692,149.97	46.05%	2,202,022.74	46.05%	新增2个

(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。

§12影响投资者决策的其他重要信息

根据广发基金管理有限公司2014年度股东会第四次会议决议,公司的注册资本由人民币12000万元增加至人民币12688万元,公司股东广发证券股份有限公司认购全部新增注册资本688万元。自此,广发证券股份有限公司的持股比例由原来的48.33%增加至51.13%,其他股东的持股比例相应调整。详见2014年8月15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《广发基金管理有限公司关于注册资本及股东出资比例变更的公告》。

广发基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日