广发大盘成长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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	广发大盘成长混合	
基金主代码	270007	
交易代码	270007(前端)	270017(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年6月13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	8,542,533,709.43份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过投资于成长性较好的大市值公司股票,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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。 本基金通过"自下而上"为主的股票分析流程,以成长性分析为重点,对大市值公司的基本面进行科学、全面的考察,挖掘投资机会,构建股票投资组合;通过利率预测、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析进行债券投资;同时严格遵守有关权证投资的比例限制。
业绩比较基准	75%★ 沪深300指数+25%★上证国债指数
风险收益特征	较高风险,较高收益

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	蒋松云
	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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	643,488,758.50	246,160,206.96	-2,951,572,740.31
本期利润	886,420,846.41	1,407,989,199.37	-269,053,873.88
加权平均基金份额本期利润	0.0908	0.1252	-0.0223
本期基金份额净值增长率	14.16%	22.01%	-3.95%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3132	-0.3791	-0.4288
期末基金资产净值	6,796,288,663.23	7,546,703,544.22	6,776,177,652.64
期末基金份额净值	0.7956	0.6969	0.5712

注:(1)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。

(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

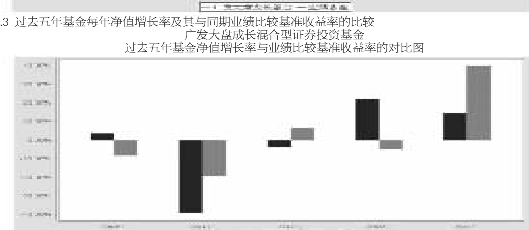
3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.44%	1.07%	33.49%	1.23%	-26.05%	-0.16%
过去六个月	20.88%	0.89%	48.05%	0.99%	-27.17%	-0.10%
过去一年	14.16%	0.91%	39.85%	0.91%	-25.69%	0.00%
过去三年	33.78%	1.15%	40.70%	0.97%	-6.92%	0.18%
过去五年	-15.39%	1.29%	3.89%	1.02%	-19.28%	0.27%
自基金合同生效起至今	-20.44%	1.52%	-1.32%	1.38%	-19.12%	0.14%

注:(1)业绩比较基准:75%×沪深300指数+25%×上证国债指数。

(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。

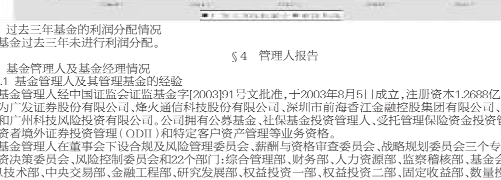
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发大盘成长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
(2007年6月13日至2014年12月31日)



3.2.3 过去五年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

广发大盘成长混合型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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		
冯永欢	本基金的基金经理;广发策略优选混合基金的基金经理;广发消费品精选股票基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2013-02-05	2014-12-08	11年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2004年2月28日至2007年3月28日先后任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究发展部总经理助理、广发稳健增长混合基金的基金经理助理,2007年3月29日至2010年12月30日任广发稳健增长混合基金的基金经理,2008年2月14日至2014年12月7日任广发策略优选混合基金的基金经理,2012年6月12日至2014年12月7日任广发消费品精选股票基金的基金经理,2013年2月5日至2014年12月7日任广发大盘成长混合基金的基金经理,2014年1月21日至2014年12月7日任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理。
程琨	本基金的基金经理;广发逆向策略混合基金的基金经理;广发消费品精选股票基金的基金经理	2013-02-05	-	8.5年	男,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书,2006年3月至2007年6月任第一上海证券有限公司研究员,2007年6月起先后任广发基金管理有限公司研究员、基金经理助理,2013年2月5日起任广发大盘成长混合基金的基金经理,2014年9月4日起任广发逆向策略混合基金的基金经理,2014年12月8日起任广发消费品精选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、《广发大盘成长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

1、市场表现

从经济基本面来看,2014年中国经济在小幅度反弹后出现了持续的下滑,经济增速也开始进入下行通道,但是与2014年年初市场对经济的预期相比,全年经济在通胀和债务问题上都好于预期。

从市场整体来看,2014年全年股市的走势超出了大多数人的判断,年初在债务问题以及房地产问题的担忧下,资产质量相关型股票出现了大幅下跌,而小股票基于前景型预期,出现了持续的上升,而下半年随着通胀预期的下降以及政府刺激政策预期的加重,上半年出现深度低估的一线蓝筹出现了大幅反弹,也带领市场上升到了3400点左右,而相应的,小股票出现了持续下跌。

从市场表现来看,2014年市场上对风险和收益评估不匹配的状况在加剧,市场的评估时段变得越来越短,股票的价格风险基本被淡化,而相应的把股票与市场涨跌偏差风险当作股票风险评估的主要角度,这导致股票中长期的基本面风险和价格风险出现大幅偏差。客观来看,以创业板为代表的小股票出现了风险收益比持续恶化的趋势,而部分蓝筹公司则出现了风险收益比持续改善的状况。

2、投资操作

2014年全年本基金都坚持价值投资的理念,争取寻找到风险收益比最佳的值得长期持有的股票,在控制换手率,降低基金交易消耗的原则上,本基金仅将基本面发生问题的股票剔除出组合,同时将未来预期收益率更优的股票加入组合。由于组合没有持有金融地产类资产,因此年末大幅跑输比较基准。

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14.16%,同期业绩比较基准收益率为39.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管中国经济面临较大的中期压力,但是我们欣喜的看到,中国经济正在走向一条正确的道路,政府对垄断企业的控制,国企改革以及注册制的推进,都将有机会把中国经济从过去遗留的结构问题中拉出来。而在此基础上带来的经济主体决策的自由化,市场竞争的去行政垄断化,资本配置的公平公正化,都将成为中国未来提高生产效率走出中等收入陷阱的关键武器。

但是我们也要看到,在转型期,资本对投资选择的非理性化,对风险衡量的脱离产业化(类金融化),投资跨度的短期化,所带来的新兴产业泡沫,有可能会成为中国未来走出经济困境的阻力之一。因为我们相信,经济制度的调整才是推动创新的核心动力,而泡沫化只是带来阶段性资金成本的下降,但会导致中长期产业格局的恶化。

在2015年我们仍将维持基于价值的逆向投资,从产业选择上,一方面,我们将会选择未来有机会受益于制度改良的企业,例如有国企改革正向预期的企业以及在去行政化垄断后产业竞争格局获得改善的企业;另一方面,我们仍然相信在资本开支增速下降的趋势中,中国将有一批优秀的企业通过自身竞争能力的加强,将以往低效的竞争对手赶出现有行业。同时,我们认为,随着改革的推进以及股市注册制的推进,未来市场将会给予真正的蓝筹公司估值溢价。因此,我们的投资选择仍聚焦于现阶段被市场情绪低估的中长期优质企业,希望为投资者获取更多的回报。

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大盘成长混合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, 广发大盘成长混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发大盘成长混合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,广发大盘成长混合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大盘成长混合型证券投资基金2014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 王明静 洪锐明签字出具了德师报(审)字(15)第P0316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:广发大盘成长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	938,783,321.12	1,589,845,119.87
结算备付金	4,704,062.58	2,295,522.03
存出保证金	553,300.04	1,196,944.16
交易性金融资产	5,897,909,250.42	5,499,446,147.11
其中:股票投资	5,897,909,250.42	5,499,446,147.11
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	-	895,752,011.23
应收证券清算款	-	-
应收利息	188,311.49	337,000.89
应收股利	-	-
应收申购款	942,720.81	10,906,199.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,843,080,966.46	7,999,778,944.85
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	7,008,151.30	428,828,380.71
应付赎回款	24,254,038.89	7,220,503.85
应付管理人报酬	8,868,991.46	9,510,299.99
应付托管费	1,478,165.26	1,585,050.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,721,607.42	4,681,791.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,461,348.90	1,249,374.48
负债合计	46,792,303.23	453,075,400.63
所有者权益:	-	-
实收基金	8,542,533,709.43	10,828,240,653.08
未分配利润	-1,746,245,046.20	-3,281,537,108.86
所有者权益合计	6,796,288,663.23	7,546,703,544.22
负债和所有者权益总计	6,843,080,966.46	7,999,778,944.85

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币0.7956元,基金份额总额8,542,533,709.43份。

7.2 利润表

会计主体:广发大盘成长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1月1日至2013年12月31日
一、收入	1,017,177,078.67	1,553,983,849.44
1.利息收入	26,926,438.82	44,262,348.18
其中:存款利息收入	8,327,702.65	9,223,049.95
债券利息收入	7,542.77	2,663.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	18,591,193.40	35,036,634.28
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	746,905,444.09	347,315,752.52
其中:股票投资收益	662,144,960.18	281,987,461.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,636,233.43	2,525,426.65
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	82,124,250.48	62,802,864.47
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	242,932,087.91	1,161,828,992.41
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	413,107.85	576,756.33
减:二、费用	130,756,232.26	145,994,650.07
1.管理人报酬	102,090,703.80	105,479,580.75
2.托管费	17,015,117.32	17,579,930.19
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	11,198,567.33	22,480,217.28
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	451,843.81	454,921.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	886,420,846.41	1,407,989,199.37
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	886,420,846.41	1,407,989,199.37

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发大盘成长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)	10,828,240,653.08	-3,281,537,108.86	7,546,703,544.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	886,420,846.41	886,420,846.41
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)	-2,285,706,943.65	648,871,216.25	-1,636,835,727.40
其中:1.基金申购款	155,524,110.05	-43,478,960.50	112,045,149.55
2.基金赎回款	-2,441,231,053.70	692,350,176.75	-1,748,880,876.95
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)	8,542,533,709.43	-1,746,245,046.20	6,796,288,663.23

项目	上年度可比期间 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)	11,863,674,098.34	-5,087,496,445.70	6,776,177,652.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,407,989,199.37	1,407,989,199.37
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)	-1,035,433,445.26	397,970,137.47	-637,463,307.79
其中:1.基金申购款	582,423,877.76	-198,403,350.73	384,020,527.03
2.基金赎回款	-1,617,857,323.02	596,373,488.20	-1,021,483,834.82
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)	10,828,240,653.08	-3,281,537,108.86	7,546,703,544.22

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

广发大盘成长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")证监基金字[2007]158号文《关于同意广发大盘成长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》等有关规定和《广发大盘成长混合型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2007年6月13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。本基金已向中国证监会备案,并获中国证监会基金部函[2007]153号《关于广发大盘成长混合型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2007年6月11日一天,本基金为契约型开放式混合型基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币14,851,700,203.40元,有效认购户数为608,933户。其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币0元,利息结转的基金份额0份,按照基金合同的有关约定计入投资者基金账户。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2007年6月13日生效,基金合同生效日的基金份额总额为14,851,700,203.40份。

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。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准采用:75%×沪深300指数收益+25%×上证国债指数收益。

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日的财务状况以及2014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 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
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(注1)	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(注2)	基金管理人控股子公司

注:1、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。

2、广发基金管理有限公司公司于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。

除上述事项外,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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	34,759,000.00	0.47%	591,270,085.72	3.91%

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 2014年1月1日至2014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	32,370.36	0.51%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 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	538,606.10	4.10%	-	-

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	102,090,703.80	105,479,580.75
其中:支付销售机构的客户维护费	16,254,610.47	16,741,016.36

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

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1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,015,117.32	17,579,930.19

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。托管费的计算方法如下:

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

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	130,560,000.00	114,928.57	-	-

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1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
中国工商银行股份有限公司	938,783,321.12	8,248,846.07	1,589,845,119.87	9,075,858.71

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(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
002271	东方雨虹	2014-08-18	2015-08-20	非公开发行流通受限	22.63	26.62	1,200,000.00	27,156,000.00	31,944,000.00	-

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
002152	广电运通	2014-12-17	重大事项	20.80	2015-03-11	24.37	6,546,966.00	116,085,082.85	136,176,892.80	-

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

(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5,279,391,938.42元,属于第二层级的余额为618,517,312.00元,无属于第三层级的余额(2013年12月31日:第一层级5,239,015,895.66元,第二层级260,430,251.45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。

(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。

§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	5,897,909,250.42	86.19
	其中:股票	5,897,909,250.42	86.19
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	943,487,383.70	13.79
7	其他各项资产	1,684,332.34	0.02
8	合计	6,843,080,966.46	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	443,111,466.58	6.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,320,515,722.11	78.29
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	7,655,267.43	0.11
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	126,626,794.30	1.86
	合计	5,897,909,250.42	86.78

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

代码	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	002152	广电运通	28,200,640	586,573,312.00	8.63
2	600309	烟台万华	21,000,094	457,382,047.32	6.73
3	002470	金正大	15,608,553	419,870,075.70	6.18
4	000876	新希望	29,000,126	406,001,764.00	5.97
5	000729	燕京啤酒	49,000,904	391,517,222.96	5.76
6	600066	宇通客车	17,101,726	381,881,541.58	5.62
7	601311	骆驼股份	28,604,219	374,143,184.52	5.51
8	002299	圣农发展	29,003,846	366,898,651.90	5.40
9	600085	同仁堂	14,430,726	323,681,184.18	4.76
10	601877	正泰电器	10,516,649	319,180,297.15	4.70

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	601311	骆驼股份	386,615,262.83	5.12
2	002250	联化科技	253,696,735.67	3.36
3	000651	格力电器	195,131,565.00	2.59
4	000729	燕京啤酒	192,153,261.43	2.55
5	600660	福耀玻璃	188,880,628.42	2.50
6	600309	万华化学	174,000,663.66	2.31
7	600805	悦达投资	125,021,445.70	1.66
8	000513	丽珠集团	110,661,395.50	1.47
9	601877	正泰电器	106,255,143.60	1.41
10	002299	圣农发展	104,983,654.60	1.39
11	601808	中海油服	99,476,101.82	1.32
12	002032	苏泊尔	97,319,583.80	1.29
13	600066	宇通客车	89,700,604.84	1.19
14	600585	海螺水泥	84,942,799.80	1.13
15	600085	同仁堂	76,549,177.38	1.01
16	002666	德联集团	76,052,588.46	1.01
17	000876	新希望	74,374,077.16	0.99
18	002271	东方雨虹	71,583,428.94	0.95
19	600079	人福医药	65,520,856.01	0.87
20	600030	中信证券	64,934,937.49	0.86

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	601808	中海油服	311,515,742.58	4.13
2	600660	福耀玻璃	235,284,769.51	3.12
3	000333	美的集团	234,775,901.54	3.11
4	002065	东华软件	216,511,733.19	2.87
5	600887	伊利股份	189,356,444.74	2.51
6	601117	中国化学	154,217,828.67	2.04
7	601965	中国汽研	152,144,451.93	2.02
8	600583	海油工程	131,966,992.69	1.75
9	600600	青岛啤酒	107,155,570.14	1.42
10	000998	隆平高科	100,947,358.41	1.34
11	002312	三泰电子	92,423,379.64	1.22
12	002470	金正大	91,393,932.62	1.21
13	600252	中恒集团	89,108,921.01	1.18
14	600079	人福医药	88,864,395.13	1.18
15	600030	中信证券	88,103,065.89	1.17
16	300015	爱尔眼科	84,877,412.35	1.12
17	601158	重庆水务	80,853,548.27	1.07
18	600837	海通证券	73,922,474.09	0.98
19	600332	白云山	72,216,351.25	0.96
20	600050	中国联通	69,944,628.90	0.93

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

序号	3,452,838,589.08
卖出股票的收入(成交)总额	3,959,452,533.86

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	553,300.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	188,311.49
5	应收申购款	942,720.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,684,332.34

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	002152	广电运通	586,573,312.00	8.63	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
413,645	20,651.85	204,280,096.31	2.39%	8,338,253,613.12	97.61%

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	627,916.39	0.0074%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年6月13日)基金份额总额	14,851,700,203.40
本报告期期初基金份额总额	10,828,240,653.08
本报告期基金总申购份额	155,524,110.05
减:本报告期基金总赎回份额	2,441,231,053.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,542,533,709.43

§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。

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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

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	
安信证券	5	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	42,058,277.84	0.57%	29,877.99	0.47%	-
财富证券	2	174,609,461.31	2.37%	158,965.01	2.48%	-
川财证券	2	90,803,825.01	1.23%	64,507.13	1.01%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	14,215,016.68	0.19%	10,098.37	0.16%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	退租一个
东兴证券	2	63,254,782.28	0.86%	44,936.04	0.70%	退租一个
方正证券	4	111,472,112.81	1.51%	79,190.16	1.24%	-
光大证券	3	209,294,379.72	2.84%	190,541.93	2.98%	-
广发证券	7	34,759,000.00	0.47%	32,370.36	0.51%	-
广州证券	2	155,978,990.64	2.12%	110,807.47	1.73%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国信证券	4	223,374,039.24	3.03%	203,359.97	3.18%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	81,696,860.15	1.11%	74,375.93	1.16%	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	125,800,210.23	1.71%	114,528.53	1.79%	-
华创证券	1	64,660,572.18	0.88%	58,866.85	0.92%	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	164,362,352.08	2.23%	149,636.14	2.34%	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	192,992,240.20	2.62%	175,699.08	2.75%	-
民生证券	2	384,261,697.69	5.21%	272,979.96	4.27%	新增一个
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	241,748,048.03	3.28%	218,032.43	3.41%	-
齐鲁证券	3	176,858,409.56	2.40%	125,640.79	1.96%	-
瑞银证券	1	1,108,906,592.04	15.05%	1,009,542.37	15.78%	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	0	-	-	-	-	退租一个
上海证券	1	30,371,055.95	0.41%	21,575.60	0.34%	-
申银万国	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	182,538,049.42	2.48%	166,183.05	2.60%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	103,268,797.06	1.40%	94,016.13	1.47%	-
湘财证券	1	160,352,154.71	2.18%	113,913.63	1.78%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	4	416,261,429.23	5.65%	378,964.80	5.92%	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	2	108,009,521.09	1.47%	76,730.07	1.20%	新增一个
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	43,588,374.20	0.59%	39,683.02	0.62%	-
招商证券	3	566,286,076.81	7.68%	515,548.88	8.06%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	0	-	-	-	-	退租一个
中金公司	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	102,788,955.13	1.39%	93,579.10	1.46%	-
中信建投	4	549,969,837.62	7.46%	500,693.43	7.83%	-
中信证券	3	722,288,689.84	9.80%	657,570.36	10.28%	-
中信证券(浙江)	1	511,610,262.30	6.94%	465,771.40	7.28%	-
中银国际	2	181,655,075.79	2.46%	129,047.12	2.02%	-
中原证券	2	29,860,330.98	0.41%	21,212.78	0.33%	-

注:(1)交易席位选择标准:

a 财务状况良好,在最近一年内无重大违规行为;

b 经营行为规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

c 具备基金运作所需的高效、安全、合规的席位资源,满足基金进行证券交易的需要;

d 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;

e 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;

f 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

a 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。

b 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	25,062,383.90	75.22%	-	-	-	-
华宝证券	-	-	400,000,000.00	11.30%	-	-
联讯证券	-	-	1,050,000,000.00	29.65%	-	-
湘财证券	-	-	1,390,900,000.00	39.28%	-	-
长江证券	-	-	200,000,000.00	5.65%	-	-
招商证券	8,255,392.30	24.78%	-	-	-	-
中信建投	-	-	200,000,000.00	5.65%	-	-
中银国际	-	-	300,000,000.00	8.47%	-	-

§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