广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

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6月3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	广发中证全指可选消费ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,156,094.00份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的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。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	中证全指可选消费指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566
传真		020-89899158	010-66594942

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6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日
本期已实现收益	29,199,921.09
本期利润	31,325,003.29
加权平均基金份额本期利润	0.1929
本期基金份额净值增长率	25.51%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2551
期末基金资产净值	20,277,409.17
期末基金份额净值	1.2551

注:(1)本基金合同2014年6月3日生效,至披露时点未满一年。

(2)所述基金财务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。

(3)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。

(4)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)。

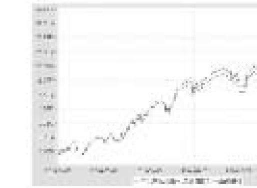
3.2 基金净值表现

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	4.99%	1.28%	6.48%	1.32%	-1.49%	-0.04%
过去六个月	22.01%	1.10%	25.17%	1.13%	-3.16%	-0.03%
自基金合同生效起至今	25.51%	1.03%	28.69%	1.11%	-3.18%	-0.08%

注:本基金业绩比较基准为中证全指可选消费指数。

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

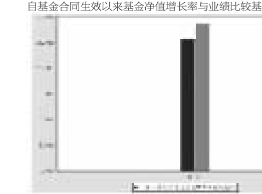


广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年6月3日至2014年12月31日)

注:(1)本基金合同生效日期为2014年6月3日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)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合同约定。

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



广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金每年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(2014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(2014年6月3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、广发活期宝货币市场基金、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		
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;广发深证100指数分级基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理;数量投资部总经理	2014-06-03	-	15.5年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,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,2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理。
季峰	本基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理	2014-10-21	-	5.5年	男,中国籍,管理学博士,持有基金业执业资格证书,2009年8月至2011年8月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作,2011年9月至2014年10月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员,2014年10月21日任广发中证全指可选消费ETF的基金经理,2014年11月24日起任广发百发100指数基金的基金经理。

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、《广发中证全指可选消费交易型开放式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);以上对不同投资组合的同时同向交易,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)报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金日均跟踪偏离度和年化跟踪误差分别为0.05%和1.04%,符合基金合同的约定。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要有两个:一是基金成份股调整因素,报告期内的两次成份股调整策略合理,较好的控制了该因素带来的误差;二是申购和赎回因素,由于本基金规模较小,容易形成较大比例的申购和赎回,但日常申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2)简要展望

作为ETF,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内基金净值增长率为25.51%,业绩基准收益率为28.69%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年,我们认为经济形势总体向好,A股市场存在一定市场的投资机会,粗略分为三条投资逻辑:

其一,资金利率逐渐宽松有利A股市场。从近期央行的工作会议看,未来央行将更加注重松紧适度,保持政策的连续性和稳定性,以提高货币政策实施效果、主动适应新常态。在货币政策实施上,既要加大改革又稳步推进,既保持稳定又力促发展,既助力发展又防范风险。在操作细则上,强调将继续实施定向调控,引导金融机构盘活存量、用好增量,建立存款保险制度,进一步降低融资成本,循序地推进金融改革。

其二,"一带一路"提升至国家战略的高度有利于相关产业和资本输出。从战略构想的提出看,随着经济全球化深入发展,区域经济一体化加快推进,全球增长和贸易、投资格局正在酝酿深刻调整,亚欧国家都处于经济转型升级的关键阶段,需要进一步激发域内发展活力与合作潜力。"一带一路"的进一步,是中国主动应对全球形势深刻变化、统筹国内国际两个大局作出的重大战略决策,对推进我国新一轮对外开放和沿线国家共同发展意义重大。

其三,从国企改制和产业扶持政策上看,2015年着力点重点依然在国企混改和新兴产业的细则方向进一步深化,可能会有一系列的政策出台,从而带来相应的投资机会。

随着注册制的临近,退市制度的日趋完善,资本市场将成为金融脱媒和解决中小企业融资难的重要渠道。2015年既是向全面复苏过渡的关键年份,也是中国经济社会转型,迈向新型增长方式的改革攻坚深化之年,经济结构性转变的重点将主要集中在财政和行政改革、国企改革、土地政策以及户籍制度等改革措施上,节奏上将继续循序渐进地推进。在我国经济新常态框架下,GDP增长目标将有所下调,从高速增长进入到中高速增长的"新常态"。

随着中国经济的发展,经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动,这是大势所趋。而随着居民收入的提高,改善型消费品的需求旺盛,可选消费品增速明显高于必需消费品。由此可以预见,可选消费的发展速度应该高于全市场的发展速度。

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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金存在连续二十个工作日资产净值低于五千万的情形,具体时间为:2014年8月8日起至2014年9月30日连续34个工作日;2014年10月8日至2014年11月6日连续22个工作日;及2014年12月8日至2014年12月31日连续36个工作日。

§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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对广发中证全指可选消费广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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P0289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:广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
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
资产:	-
银行存款	268,511.05
结算备付金	3,542.11
存出保证金	473,037.42
交易性金融资产	19,788,123.18
其中:股票投资	19,788,123.18
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	-
应收利息	269.30
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	20,533,483.06
负债和所有者权益	本期末 2014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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	8,954.45
应付托管费	1,790.90
应付销售服务费	-
应付交易费用	25,328.54
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	220,000.00
负债合计	256,073.89
所有者权益:	-
实收基金	16,156,094.00
未分配利润	4,121,315.17
所有者权益合计	20,277,409.17
负债和所有者权益总计	20,533,483.06

注:1. 报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币1.2551元,基金份额总额16,156,094.00份。

2. 本会计期间为2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	33,127,049.62
1.利息收入	522,203.97
其中:存款利息收入	412,660.60
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	109,543.37
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	30,483,435.42
其中:股票投资收益	29,388,517.49
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	1,094,917.93
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,125,082.20
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-3,671.97
减:二、费用	1,802,046.33
1.管理人报酬	452,319.26
2.托管费	90,463.83
3.销售服务费	-
4.交易费用	910,067.62
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	349,195.62
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	31,325,003.29
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	31,325,003.29

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月3日(基金合同生效日)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)	838,156,094.00	-	838,156,094.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,325,003.29	31,325,003.29
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)	-822,000,000.00	-27,203,688.12	-849,203,688.12
其中:1.基金申购款	22,000,000.00	4,652,889.23	26,652,889.23
2.基金赎回款	-844,000,000.00	-31,856,577.35	-875,856,577.35
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)	16,156,094.00	4,121,315.17	20,277,409.17

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

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金("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]1265号《关于核准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由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《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2014年6月3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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2014年5月5日至2014年5月23日,本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币838,156,094.00元,有效认购户数为7,064户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币40,743.00元,折合基金份额40,743.00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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括:标的指数成份股、备选成份股。可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、权证、股指期货、货币市场工具及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的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。本基金的业绩比较基准:中证全指可选消费指数。

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日的财务状况以及2014年6月3日(基金合同生效日)起至2014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

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本会计期间为2014年6月3日(基金合同生效日)起至2014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。

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作为公允价值;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。申购及赎回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

损益平准金指申购及赎回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。

当本基金申购对价中包含可以现金替代时,在本基金补足可以现金替代成分股票(或采取强制退款)之前,该股票估值日与申购日估值的差额确认为公允价值变动收益,并于补入被替代股票的实际买入日或强制退款计算日转出计入其他收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率逐日计提。

3. 本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值×0.03%的年费率逐日计提。

4. 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。

5. 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.每一基金份额享有同等分配权;

2.若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

3.当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。在收益评价日,基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1 乘以100%;标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1 乘以100%;

4.本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合基金收益分配条件的前提下,本基金收益每年最多分配12次;

5.本基金的收益分配采取现金分红的方式;

6.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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

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)	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6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	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	378,221,918.22	43.39%

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	190,700,000.00	100.00%

7.4.8.1.5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6月3日(基金合同生效日)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	344,331.30	49.55%	571.30	2.26%

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6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	452,319.26
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.5%÷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5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6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	90,463.83

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.1%÷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5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

本基金本报告期内无与关联交易对手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

项目	本期 2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	268,511.05	395,742.55

注:本基金的银行存款由基金托管人中国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

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证券。

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
000501	鄂武商A	2014-12-24	重大事项	15.82	2015-01-16	17.20	3,002.00	38,875.13	47,491.64	-
000533	万家乐	2014-10-15	重大事项	5.97	2015-01-08	5.37	5,400.00	21,718.15	32,238.00	-
000715	中兴商业	2014-08-19	重大事项	11.26	-	-	1,800.00	17,250.21	20,268.00	-
000719	大地传媒	2014-12-26	重大事项	16.55	-	-	1,700.00	24,602.36	28,135.00	-
000982	中银绒业	2014-08-25	重大事项	4.64	-	-	19,640.00	85,785.52	91,129.60	-
000996	中国中期	2014-12-08	重大事项	28.60	-	-	2,266.00	40,460.66	64,807.60	-
002044	江苏三友	2014-10-08	重大事项	10.04	-	-	2,775.00	17,173.69	27,861.00	-
002070	众和股份	2014-09-05	重大事项	9.49	2015-03-11	10.00	5,200.00	40,336.44	49,348.00	-
002071	长城影视	2014-12-09	重大事项	19.38	2015-02-16	21.32	1,500.00	30,530.61	29,070.00	-
002137	实益达	2014-12-26	重大事项	6.97	2015-01-14	7.60	2,700.00	21,492.00	18,819.00	-
002351	漫步者	2014-12-11	重大事项	18.89	2015-01-16	17.00	867.00	13,871.02	16,377.63	-
002425	凯撒股份	2014-12-31	重大事项	10.80	2015-01-08	11.88	1,225.00	14,462.62	13,230.00	-
002592	八菱科技	2014-11-03	重大事项	18.21	2015-02-02	18.90	900.00	10,879.65	16,389.00	-
002602	世纪华通	2014-12-05	重大事项	26.58	-	-	1,625.00	36,240.88	43,192.50	-
300081	恒信移动	2014-12-05	重大事项	25.45	2015-03-05	28.00	900.00	13,463.34	22,905.00	-
300144	宋城演艺	2014-12-19	重大事项	30.12	2015-03-18	33.13	3,296.00	84,552.69	99,275.52	-
300160	秀强股份	2014-10-13	重大事项	16.35	2015-01-05	14.72	1,075.00	10,004.54	17,576.25	-
300247	桑乐金	2014-12-23	重大事项	8.47	2015-03-16	9.32	1,800.00	17,316.00	15,246.00	-
600623	双钱股份	2014-12-01	重大事项	14.52	-	-	718.00	9,234.90	10,425.36	-
600704	物产中大	2014-10-13	重大事项	10.38	2015-02-13	11.42	7,700.00	63,889.37	79,926.00	-
600749	西藏旅游	2014-09-26	重大事项	12.18	-	-	2,350.00	20,202.30	28,623.00	-
600754	锦江股份	2014-11-10	重大事项	25.11	2015-01-19	27.00	1,900.00	39,707.50	47,709.00	-
603008	喜临门	2014-11-17	重大事项	14.58	2015-03-13	16.04	2,475.00	27,036.11	36,085.50	-

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18,931,994.58元,第二层级的余额为856,128.60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	19,788,123.18	96.37
	其中:股票	19,788,123.18	96.37
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	272,053.16	1.32
7	其他各项资产	473,306.72	2.31
8	合计	20,533,483.06	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而8.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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	121,208.00	0.60
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,009,942.83	59.23
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	2,877,212.74	14.19
G	交通运输、仓储和邮政业	43,845.81	0.22
H	住宿和餐饮业	185,312.25	0.91
I	信息传输、软件和信息技术服务业	930,317.54	4.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	47,950.00	0.24
L	租赁和商务服务业	1,186,442.18	5.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	752,934.39	3.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,275.00	0.15
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,601,682.44	7.90
S	综合	-	-
	合计	19,788,123.18	97.59

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	000651	格力电器	28,094	1,042,849.28	5.14
2	600104	上汽集团	38,527	827,174.69	4.08
3	000333	美的集团	19,648	539,141.12	2.66
4	002024	苏宁云商	51,400	462,600.00	2.28
5	000625	长安汽车	21,900	359,817.00	1.77
6	000069	华侨城A	42,500	350,625.00	1.73
7	600690	青岛海尔	18,463	342,673.28	1.69
8	000100	TCL 集团	87,900	334,020.00	1.65
9	600637	百视通	8,213	311,108.44	1.53
10	300027	华谊兄弟	10,458	275,777.46	1.36

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	46,108,756.60	227.39
2	600104	上汽集团	33,086,543.61	163.17
3	000333	美的集团	20,339,906.94	100.31
4	600690	青岛海尔	15,313,348.29	75.52
5	000625	长安汽车	15,051,827.50	74.23
6	002594	比亚迪	13,859,167.50	68.35
7	300027	华谊兄弟	13,857,539.51	68.34
8	002024	苏宁云商	12,415,811.40	61.23
9	000069	华侨城A	11,194,894.17	55.21
10	000100	TCL 集团	10,544,774.06	52.00
11	300058	蓝色光标	10,079,368.38	49.71
12	000581	威孚高科	9,866,441.21	48.66
13	000793	华闻传媒	8,265,598.31	40.76
14	600660	福耀玻璃	7,551,409.29	37.24
15	002400	省广股份	7,074,796.61	34.89
16	601888	中国国旅	6,700,383.70	33.04
17	600177	雅戈尔	6,669,763.90	32.89
18	601633	长城汽车	6,631,738.92	32.71
19	601098	中南传媒	6,471,141.08	31.91
20	000917	电广传媒	6,380,681.95	31.47
21	600741	华域汽车	6,254,026.87	30.84
22	600839	四川长虹	5,871,435.60	28.96
23	002190	成飞集成	5,577,434.62	27.51
24	000559	万向钱潮	5,466,659.92	26.96
25	600398	海澜之家	5,410,725.54	26.68
26	600166	福田汽车	5,398,212.97	26.62
27	600066	宇通客车	5,388,248.56	26.57
28	600694	大商股份	5,311,060.65	26.19
29	300133	华策影视	5,178,876.51	25.54
30	002005	德豪润达	5,133,056.42	25.31
31	000800	一汽轿车	4,920,954.42	24.27
32	600060	海信电器	4,902,811.62	24.18
33	300251	光线传媒	4,779,197.12	23.57
34	600655	豫园商城	4,643,636.94	22.90
35	002344	海宁皮城	4,511,291.13	22.25
36	601928	凤凰传媒	4,500,831.16	22.20
37	002292	奥飞动漫	4,455,348.83	21.97
38	600138	中青旅	4,395,408.63	21.68
39	600415	小商品城	4,362,953.50	21.52
40	600037	歌华有线	4,294,194.53	21.18
41	601118	海南橡胶	4,240,638.84	20.91
42	300144	宋城演艺	4,217,503.62	20.80
43	002048	宁波华翔	4,177,348.33	20.60
44	601238	广汽集团	4,086,999.13	20.16
45	300291	华录百纳	4,043,994.82	19.94
46	000839	中信国安	4,026,898.47	19.86
47	600261	阳光照明	3,809,654.68	18.79
48	600978	宜华木业	3,803,668.05	18.76
49	000550	江铃汽车	3,660,432.84	18.05
50	000887	中鼎股份	3,490,215.97	17.21
51	002508	老板电器	3,387,288.11	16.70
52	600699	均胜电子	3,197,323.48	15.77
53	000541	佛山照明	3,170,321.98	15.63
54	002429	兆驰股份	3,143,744.55	15.50
55	300043	互动娱乐	3,071,406.37	15.15
56	000851	高鸿股份	3,005,523.56	14.82
57	600373	中文传媒	2,924,740.73	14.42
58	600122	宏图高科	2,875,239.60	14.18
59	600704	物产中大	2,824,461.86	13.93
60	300005	探路者	2,764,637.60	13.63
61	601929	吉视传媒	2,685,178.39	13.24
62	600220	江苏阳光	2,680,170.80	13.22
63	600859	王府井	2,623,693.34	12.94
64	000829	天音控股	2,583,920.39	12.74
65	000982	中银绒业	2,483,785.67	12.25
66	600851	海欣股份	2,442,220.08	12.04
67	600729	重庆百货	2,429,434.66	11.98
68	600790	轻纺城	2,388,156.00	11.78
69	000572	海马汽车	2,366,415.88	11.67
70	600825	新华传媒	2,354,600.80	11.61
71	600633	浙报传媒	2,333,078.97	11.51
72	600824	益民集团	2,330,247.14	11.49
73	000801	四川九洲	2,282,401.37	11.26
74	600628	新世界	2,233,695.38	11.02
75	600086	东方金钰	2,232,132.57	11.01
76	002563	森马服饰	2,214,141.42	10.92
77	601311	骆驼股份	2,206,610.39	10.88
78	600661	新南洋	2,188,204.00	10.79
79	000587	金叶珠宝	2,185,679.08	10.78
80	000726	鲁泰A	2,174,743.67	10.72
81	000416	民生控股	2,149,350.99	10.60
82	001696	宗申动力	2,119,411.95	10.45
83	002574	明牌珠宝	2,112,806.24	10.42
84	601718	际华集团	2,090,521.63	10.31
85	002712	思美传媒	2,066,838.33	10.19
86	601258	庞大集团	2,043,846.64	10.08
87	600612	老凤祥	2,042,006.20	10.07
88	600482	风帆股份	2,012,119.02	9.92
89	000062	深圳华强	2,000,340.09	9.86
90	600551	时代出版	1,981,263.87	9.77
91	002070	众和股份	1,965,768.84	9.69
92	002277	友阿股份	1,952,088.56	9.63
93	002083	孚日股份	1,935,867.98	9.55
94	600754	锦江股份	1,927,077.11	9.50
95	600742	一汽富维	1,918,856.05	9.46
96	600831	广电网络	1,904,850.21	9.39
97	601058	赛轮金宇	1,899,786.26	9.37
98	000516	开元投资	1,865,683.04	9.20
99	002242	九阳股份	1,840,145.86	9.07
100	002555	顺荣股份	1,832,032.97	9.03
101	002345	潮宏基	1,825,050.66	9.00
102	600335	国机汽车	1,819,739.47	8.97
103	600088	中视传媒	1,806,824.80	8.91
104	002126	银轮股份	1,802,986.00	8.89
105	603766	隆鑫通用	1,795,155.52	8.85
106	000016	深康佳A	1,787,735.31	8.82
107	600630	龙头股份	1,782,119.18	8.79
108	002029	七匹狼	1,775,971.73	8.76
109	002416	爱施德	1,764,872.17	8.70
110	000417	合肥百货	1,756,960.18	8.66
111	002085	万丰奥威	1,750,968.83	8.64
112	000921	海信科龙	1,738,107.69	8.57
113	002269	美邦服饰	1,736,838.78	8.57
114	002071	长城影视	1,717,181.69	8.47
115	002510	天汽模	1,714,542.64	8.46
116	002328	新朋股份	1,713,460.37	8.45
117	002293	罗莱家纺	1,691,689.43	8.34
118	600686	金龙汽车	1,689,666.64	8.33
119	603366	日出东方	1,657,870.93	8.18
120	600676	交运股份	1,625,489.41	8.02
121	000418	小天鹅A	1,612,140.51	7.95
122	600983	惠而浦	1,610,974.96	7.94
123	600858	银座股份	1,610,973.08	7.94
124	002561	徐家汇	1,609,630.42	7.94
125	601801	皖新传媒	1,602,843.04	7.90
126	002454	松芝股份	1,591,728.49	7.85
127	600830	香溢融通	1,582,547.56	7.80
128	000521	美菱电器	1,569,595.75	7.74
129	600006	东风汽车	1,562,297.22	7.70
130	300148	天舟文化	1,554,695.83	7.67
131	600135	乐凯胶片	1,547,778.43	7.63
132	600857	工大首创	1,539,870.54	7.59
133	000957	中通客车	1,536,449.25	7.58
134	000030	富奥股份	1,516,356.79	7.48
135	002448	中原内配	1,494,579.89	7.37
136	002426	胜利精密	1,493,931.69	7.37
137	002186	全聚德	1,484,394.03	7.32
138	600818	中路股份	1,473,964.06	7.27
139	600697	欧亚集团	1,471,102.17	7.25
140	601965	中国汽研	1,447,586.98	7.14
141	600651	飞乐音响	1,446,802.48	7.14
142	600337	美克家居	1,439,336.48	7.10
143	000996	中国中期	1,435,385.18	7.08
144	000428	华天酒店	1,434,358.79	7.07
145	600838	上海九百	1,430,645.95	7.06
146	002154	报喜鸟	1,427,430.20	7.04
147	002614	蒙发利	1,416,599.45	6.99
148	600469	风神股份	1,415,824.18	6.98
149	002327	富安娜	1,412,690.40	6.97
150	000158	常山股份	1,411,359.00	6.96
151	002572	索菲亚	1,378,994.47	6.80
152	000700	模塑科技	1,376,691.72	6.79
153	002144	宏达高科	1,372,200.35	6.77
154	300375	鹏翎股份	1,365,669.97	6.73
155	000760	斯太尔	1,355,549.18	6.69
156	002362	汉王科技	1,351,161.65	6.66
157	000888	峨眉山A	1,351,044.10	6.66
158	601566	九牧王	1,348,347.38	6.65
159	601339	百隆东方	1,348,169.74	6.65
160	300342	天银机电	1,347,424.98	6.64
161	300304	云意电气	1,329,590.37	6.56
162	002283	天润曲轴	1,323,990.86	6.53
163	002224	三力士	1,316,619.85	6.49
164	600418	江淮汽车	1,292,923.00	6.38
165	300178	腾邦国际	1,291,427.49	6.37
166	600480	凌云股份	1,285,314.43	6.34
167	002664	信质电机	1,270,150.69	6.26
168	002181	粤传媒	1,267,177.59	6.25
169	000589	黔轮胎A	1,266,723.08	6.25
170	002540	亚太科技	1,249,481.54	6.16
171	002035	华帝股份	1,241,634.06	6.12
172	600723	首商股份	1,225,623.03	6.04
173	002725	跃岭股份	1,216,320.29	6.00
174	603008	喜临门	1,214,742.10	5.99
175	000156	华数传媒	1,209,408.12	5.96
176	002489	浙江永强	1,197,056.34	5.90
177	600336	澳柯玛	1,196,486.17	5.90
178	600861	北京城乡	1,192,879.82	5.88
179	600854	春兰股份	1,192,727.01	5.88
180	002723	金莱特	1,186,315.84	5.85
181	600515	海岛建设	1,181,912.98	5.83
182	002251	步步高	1,177,915.19	5.81
183	002602	世纪华通	1,176,864.00	5.80
184	601007	金陵饭店	1,173,146.20	5.79
185	300336	新文化	1,163,831.06	5.74
186	601999	出版传媒	1,162,819.43	5.73
187	000599	青岛双星	1,161,818.25	5.73
188	002419	天虹商场	1,160,842.41	5.72
189	603001	奥康国际	1,157,793.47	5.71
190	002678	珠江钢琴	1,153,955.70	5.69
191	300295	三六五网	1,153,187.00	5.69
192	600987	航民股份	1,151,516.83	5.68
193	002042	华孚色纺	1,142,885.54	5.64
194	000715	中兴商业	1,137,676.50	5.61
195	000987	广州友谊	1,137,572.41	5.61
196	000757	浩物股份	1,130,893.58	5.58
197	002032	苏泊尔	1,126,874.63	5.56
198	600081	东风科技	1,123,962.10	5.54
199	002045	国光电器	1,122,858.03	5.54
200	002348	高乐股份	1,122,561.10	5.54
201	000927	一汽夏利	1,111,816.00	5.48
202	002394	联发股份	1,110,947.11	5.48
203	601010	文峰股份	1,098,222.27	5.42
204	000533	万家乐	1,091,182.90	5.38
205	002486	嘉麟杰	1,090,510.00	5.38
206	000978	桂林旅游	1,088,707.90	5.37
207	600687	刚泰控股	1,080,177.43	5.33
208	002187	广百股份	1,062,416.44	5.24
209	600523	贵航股份	1,061,526.23	5.24
210	002238	天威视讯	1,052,200.85	5.19
211	000419	通程控股	1,050,521.00	5.18
212	600128	弘业股份	1,049,330.26	5.17
213	600107	美尔雅	1,038,510.77	5.12
214	002033	丽江旅游	1,029,833.45	5.08
215	000665	湖北广电	1,024,655.22	5.05
216	601599	鹿港科技	1,015,296.86	5.01
217	600640	号百控股	1,011,905.68	4.99
218	600303	曙光股份	1,002,272.44	4.94
219	600865	百大集团	998,891.83	4.93
220	603555	贵人鸟	998,722.20	4.93
221	000611	内蒙发展	997,727.77	4.92
222	600093	禾嘉股份	996,576.49	4.91
223	000913	钱江摩托	994,865.80	4.91
224	002674	兴业科技	988,199.94	4.87
225	600778	友好集团	986,678.07	4.87
226	600891	秋林集团	981,359.88	4.84
227	000719	大地传媒	981,260.39	4.84
228	002662	京威股份	962,647.45	4.75
229	002355	兴民钢圈	959,075.74	4.73
230	002003	伟星股份	952,411.38	4.70
231	000501	鄂武商A	952,218.90	4.70
232	002473	圣莱达	950,750.20	4.69
233	300272	开能环保	939,431.76	4.63
234	002434	万里扬	936,740.69	4.62
235	600821	津劝业	933,482.98	4.60
236	300022	吉峰农机	931,372.54	4.59
237	002516	江苏旷达	931,024.62	4.59
238	002239	金飞达	926,017.85	4.57
239	600327	大东方	916,093.73	4.52
240	600280	中央商场	913,928.52	4.51
241	000058	深赛格	901,990.00	4.45
242	002087	新野纺织	889,905.00	4.39
243	002605	姚记扑克	887,189.00	4.38
244	600738	兰州民百	887,113.80	4.37
245	600785	新华百货	879,122.52	4.34
246	002703	浙江世宝	873,136.91	4.31
247	002213	特尔佳	870,552.88	4.29
248	002615	哈尔斯	848,972.98	4.19
249	002536	西泵股份	846,735.30	4.18
250	002543	万和电气	836,851.06	4.13
251	002284	亚太股份	834,734.49	4.12
252	300217	东方电热	825,019.15	4.07
253	002612	朗姿股份	814,602.98	4.02
254	002670	华声股份	814,103.29	4.01
255	600483	福能股份	813,158.12	4.01
256	600273	嘉化能源	802,699.89	3.96
257	000753	漳州发展	802,270.30	3.96
258	600258	首旅酒店	795,310.00	3.92
259	002406	远东传动	788,777.05	3.89
260	002699	美盛文化	777,307.20	3.83
261	002044	江苏三友	748,473.29	3.69
262	002403	爱仕达	736,835.39	3.63
263	002668	奥马电器	733,804.76	3.62
264	600233	大杨创世	725,047.78	3.58
265	002306	中科云网	721,212.10	3.56
266	002503	搜于特	714,820.05	3.53
267	002404	嘉欣丝绸	707,399.59	3.49
268	002397	梦洁家纺	695,715.56	3.43
269	000622	恒立实业	691,081.68	3.41
270	000008	宝利来	685,680.04	3.38
271	000678	襄阳轴承	684,475.76	3.38
272	000430	张家界	682,424.50	3.37
273	002708	光洋股份	666,494.32	3.29
274	002705	新宝股份	658,903.56	3.25
275	000026	飞亚达A	657,826.60	3.24
276	600811	东方集团	651,751.56	3.21
277	002687	乔治白	650,148.52	3.21
278	600749	西藏旅游	648,214.36	3.20
279	002616	长青集团	634,932.17	3.13
280	002084	海鸥卫浴	633,030.24	3.12
281	000721	西安饮食	632,776.29	3.12
282	600400	红豆股份	632,384.26	3.12
283	002260	伊立浦	627,466.00	3.09
284	600156	华升股份	624,347.68	3.08
285	300258	精锻科技	613,719.03	3.03
286	600232	金鹰股份	611,507.49	3.02
287	002656	卡奴迪路	599,882.06	2.96
288	000593	大通燃气	595,327.98	2.94
289	002036	宜科科技	587,013.45	2.89
290	300320	海达股份	575,089.15	2.84
291	600682	南京新百	555,300.53	2.74
292	002420	毅昌股份	550,550.28	2.72
293	002494	华斯股份	543,266.99	2.68
294	002488	金固股份	542,104.83	2.67
295	600706	曲江文旅	530,189.82	2.61
296	300081	恒信移动	525,017.00	2.59
297	002607	亚夏汽车	522,376.16	2.58
298	600054	黄山旅游	504,634.46	2.49
299	002592	八菱科技	503,716.25	2.48
300	601799	星宇股份	498,531.72	2.46
301	002677	浙江美大	487,273.75	2.40
302	002571	德力股份	478,627.65	2.36
303	002425	凯撒股份	477,663.50	2.36
304	601777	力帆股份	471,901.57	2.33
305	600386	北巴传媒	466,939.00	2.30
306	600609	金杯汽车	463,085.79	2.28
307	002681	奋达科技	443,358.20	2.19
308	603123	翠微股份	425,602.71	2.10

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600386	北巴传媒	20,326,140.79	100.24
2	601929	吉视传媒	11,576,967.78	57.09
3	002351	漫步者	7,861,733.16	38.77
4	002173	千足珍珠	6,801,987.54	33.54
5	002181	粤传媒	6,413,338.39	31.63
6	002024	苏宁云商	6,033,862.99	29.76
7	600640	号百控股	5,097,202.98	25.14
8	002664	信质电机	4,327,861.46	21.34
9	600679	金山开发	4,238,094.11	20.90
10	600651	飞乐音响	3,487,010.40	17.20
11	600609	金杯汽车	2,924,264.16	14.42
12	600742	一汽富维	1,953,850.57	9.64
13	002015	*ST霞客	1,773,278.37	8.75
14	002605	姚记扑克	1,494,292.28	7.37
15	000100	TCL 集团	1,418,423.00	7.00
16	000851	高鸿股份	1,284,694.85	6.34
17	600066	宇通客车	1,102,923.00	5.44
18	002251	步步高	1,096,908.38	5.41
19	600839	四川长虹	1,032,628.91	5.09
20	000501	鄂武商A	1,007,236.70	4.97
21	002260	伊立浦	922,815.68	4.55
22	600811	东方集团	771,424.74	3.80
23	002355	兴民钢圈	542,400.53	2.67
24	000417	合肥百货	534,175.00	2.63
25	000593	大通燃气	470,654.70	2.32
26	600686	金龙汽车	452,503.24	2.23
27	000779	*ST派神	434,587.00	2.14
28	300295	三六五网	421,347.58	2.08

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	760,068,469.05
卖出股票的收入(成交)总额	111,684,403.56

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	473,037.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	269.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	473,306.72

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§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

9.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	季静	1,998,597.00	12.37%
2	中国人寿保险股份有限公司	1,530,305.00	9.47%
3	赵昱	1,262,150.00	7.81%
4	解希伦	1,047,638.00	6.48%
5	王浩	900,019.00	5.57%
6	华润深国投信托有限公司-礼一避险一号结构式证券投资集合资金信	474,941.00	2.94%
7	考连辉	276,112.00	1.71%
8	金程	1,000,000.00	6.19%
9	胡定夫	920,100.00	5.70%
10	王惠东	300,017.00	1.86%

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

序号	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	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年6月3日)基金份额总额	838,156,094.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	22,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	844,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	16,156,094.00

§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。

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

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	1	487,416,157.20	55.91%	346,265.66	49.83%	增加1席位
广发证券	2	378,221,918.22	43.39%	344,331.30	49.55%	增加2席位
东莞证券	1	2,850,668.00	0.33%	2,025.06	0.29%	增加1席位
招商证券	1	1,825,435.93	0.21%	1,296.74	0.19%	增加1席位
银河证券	2	1,414,288.26	0.16%	1,005.06	0.14%	增加2席位
海通证券	1	-	-	-	-	增加1席位

注:1、交易席位选择标准:

(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。

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

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
331	48,809.95	2,032,666.00	12.58%	14,123,428.00	87.42%

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
广发证券	-	-	190,700,000.00	100.00%	-	-

§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》。

本报告期内,本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

广发基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日