广发深证100指数分级证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十八日

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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	广发深证100指数分级		
场内简称	深证100		
基金主代码	162714		
交易代码	162714		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年5月7日		
基金管理人	广发基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	42,866,339.65份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年6月12日		
下属分级基金的基金简称	广发深证100指数分级A	广发深证100指数分级B	广发深证100指数分级
下属分级基金的场内简称	深证100A	深证100B	深100基
下属分级基金的交易代码	150083	150084	162714
报告期末下属分级基金的份额总额	12,369,956.00份	12,369,957.00份	18,126,426.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对深证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,主要采用完全复制法,即按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,广发深证100 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;广发深证100 B份额具有高风险、高预期收益的特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	田青
	联系电话	020-83936666	010-67595096
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	010-67595096
传真		020-89899158	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	25,464,462.46
本期利润	29,918,509.07
加权平均基金份额本期利润	0.4445
本期基金份额净值增长率	36.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2752
期末基金资产净值	59,962,301.99
期末基金份额净值	1.3988

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.86%	3.47%	-7.67%	3.32%	-1.19%	0.15%
过去三个月	12.55%	2.60%	12.65%	2.51%	-0.10%	0.09%
过去六个月	36.71%	2.18%	37.97%	2.10%	-1.26%	0.08%
过去一年	90.55%	1.73%	95.95%	1.69%	-5.40%	0.04%
过去三年	62.59%	1.45%	65.53%	1.44%	-2.94%	0.01%
自基金合同生效起至今	53.96%	1.42%	50.01%	1.43%	3.95%	-0.01%

注:(1)本基金的业绩比较基准:95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

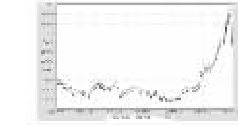
(2)业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发深证100指数分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年5月7日至2015年6月30日)



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金融创新投资控股有限公司。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24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、规划发展部、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、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、互联网金融部(下辖杭州理财中心)、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2015年6月30日,本基金管理人管理七十五只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发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、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金和广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金,管理资产规模为2262.47亿元。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;广发中证全指可选消费ETF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;广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理;广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理;广发可选消费联接基金的基金经理;广发医药卫生联接基金的基金经理;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发中证全指原材料ETF基金的基金经理;数量投资部总经理	2012-05-07	-	16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,2015年1月8日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理,2015年1月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年3月23日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年4月15日起任广发可选消费联接基金的基金经理,2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理,2015年6月25日起任广发中证全指能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理。
魏军	本基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理	2014-04-01	-	7年	男,中国籍,数量经济学博士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至2010年10月任广发基金管理有限公司量化研究员,2010年3月11日起至2011年10月18日任广发沪深300指数基金和广发中证500指数基金的基金经理助理,2011年10月19日起任广发中小板300ETF及广发中小板300联接基金的基金经理,2014年4月1日起任广发深证100指数分级基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金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 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4 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

本季度内,本基金的申购赎回及本基金的分级份额的交易、分拆、合并运作正常,运作过程中未发生风险事件。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资,除法规限制投资的指数样本证券采用样本替代投资方法之外,其余指数样本采用完全复制方法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为36.71%,同期业绩比较基准收益率为37.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年,在经济改革等因素的预期下,市场走出了波澜壮阔的上涨行情,但在2季度末,受资金流动性并非很充裕,政府清场外配资,中小股票估值过高,希腊债务问题迟迟没有明朗等因素的影响,市场可谓内忧外患,出现了前所未有的快速深度回调,随着政府强有力的救市措施,市场逐渐企稳。展望下半年,政府会逐步落实经济改革的各项措施,未来经济有望健康持续发展。深证100指数由深市规模大、成交活跃的100只样本证券构成,包含了大量成长性好的股票,行业分布较为均匀。深证100指数是分享经济结构转型和恢复性增长的良好工具,也是进行长期投资的优秀标的。2015年,预计深港通将会推出,作为深市100只权重股票的指数,未来深证100指数会有不错的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会,按照相关法律法规和证监会的相关规定,负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法,经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素,向估值委员会提出估值建议,确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查,确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体流程,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议,由其按合同约定提供相关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"基金收益分配原则"的相关规定,本基金本报告期内未进行利润分配,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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:广发深证100指数分级证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	4,263,706.81	8,365,419.03
结算备付金	-	-
存出保证金	23,975.82	6,211.25
交易性金融资产	57,385,291.11	87,639,808.69
其中:股票投资	57,385,291.11	87,639,808.69
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	-	3,870,517.49
应收利息	763.54	1,741.60
应收股利	-	-
应收申购款	657,636.97	114,532.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	62,331,374.25	99,998,230.78
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 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	1,915,167.54	6,643,851.74
应付管理人报酬	58,875.87	84,901.80
应付托管费	12,952.72	18,678.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	41,419.33	52,387.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	340,656.80	492,930.07
负债合计	2,369,072.26	7,292,749.29
所有者权益:	-	-
实收基金	38,987,836.21	82,317,034.01
未分配利润	20,974,465.78	10,388,447.48
所有者权益合计	59,962,301.99	92,705,481.49
负债和所有者权益总计	62,331,374.25	99,998,230.78

注:报告截止日2015年6月30日,基金广发深证100份额净值人民币1.3988元,基金广发深证100A份额参考净值人民币1.0310元,广发深证100B份额参考净值人民币1.7666元,基金份额总额42,866,339.65份,其中:广发深证100份额18,126,426.65份,广发深证100A份额12,369,956.00份,广发深证100B份额12,369,957.00份。

6.2 利润表

会计主体:广发深证100指数分级证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	30,872,198.89	-5,770,595.31
1.利息收入	21,166.93	19,922.02
其中:存款利息收入	21,166.93	19,922.02
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)	26,253,153.38	-2,981,934.58
其中:股票投资收益	25,913,107.82	-4,028,614.76
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	340,045.56	1,046,680.18
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,454,046.61	-2,834,584.68
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	143,831.97	26,001.93
减:二、费用	953,689.82	922,550.04
1. 管理人报酬	414,651.25	454,325.89
2. 托管费	91,223.32	99,951.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	161,305.62	60,824.25
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	286,509.63	307,448.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	29,918,509.07	-6,693,145.35
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	29,918,509.07	-6,693,145.35

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发深证100指数分级证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	82,317,034.01	10,388,447.48	92,705,481.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,918,509.07	29,918,509.07
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)	-43,329,197.80	-19,332,490.77	-62,661,688.57
其中:1.基金申购款	45,856,029.97	16,911,427.57	62,767,457.54
2.基金赎回款	-89,185,227.77	-36,243,918.34	-125,429,146.11
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)	38,987,836.21	20,974,465.78	59,962,301.99
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	115,000,531.32	-14,966,885.38	100,033,645.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,693,145.35	-6,693,145.35
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)	-7,151,772.08	944,672.99	-6,207,099.09
其中:1.基金申购款	20,331,555.70	-4,172,377.59	16,159,178.11
2.基金赎回款	-27,483,327.78	5,117,050.58	-22,366,277.20
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)	107,848,759.24	-20,715,357.74	87,133,401.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发深证100指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可字[2012]200号文《关于同意广发深证100指数分级证券投资基金设立的批复》的批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称基金合同) 和其他相关法律法规的规定发起,于2012年5月7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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为2012年3 月27 日至2012 年4月26日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币567,698,320.60元,有效认购户数为2,064户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币115,509.75元,折合基金份额 114,755.16份,折算差额人民币754.59元计入基金资产,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。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于2012年5月7日生效,基金合同生效日的基金份额总额为567,698,320.60份。

本基金的基金份额包括广发深证100指数分级证券投资基金之基础份额(简称广发深证100份额,场内简称广发100,基金代码:162714)、广发深证100指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(场内简称广发100 A份额)与广发深证100指数分级证券投资基金之积极收益类份额(场内简称广发100 B份额)。其中,广发100 A份额、广发100 B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

在广发100 A份额、广发100份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,基金管理人将根据基金合同的规定对本基金的广发100 A份额、广发100份额进行定期份额折算。对于广发100 A份额期末的约定应得收益,即广发100 A份额每个会计年度12月31日基金份额参考净值超出本金1.0000元部分,将折算为场内广发100份额分配给广发100 A份额持有人。广发100份额持有人持有的每2份广发100份额将按1份广发100 A份额获得新增广发100份额的分配。持有场外广发100份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外广发100份额的分配;持有场内广发100份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内广发100份额的分配。经过上述份额折算,广发100 A份额的基金份额参考净值和广发100份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外,本基金根据基金合同的规定,还将在以下两种情况进行份额折算,即当广发100份额的基金份额净值达到2.0000元后,本基金将分别对广发100 A份额、广发100 B份额和广发100份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保广发100 A份额和广发100 B份额的比例为1:1,份额折算后广发100 A份额、广发100 B份额的基金份额参考净值和广发100份额的基金份额净值均调整为1元;当广发100 B份额的基金份额参考净值达到0.2500元后,本基金将分别对广发100 A份额、广发100 B份额和广发100份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保广发100 A份额和广发100 B份额的比例为1:1,份额折算后广发100份额、广发100 A份额和广发100 B份额的基金份额参考净值均调整为1元。

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,本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括深证100指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于深证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准:95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

本基金的财务报表于2015年8月28日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4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

除6.4.5.2所述会计估计变更外,本基金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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1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。

6.4.5.2会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),本基金自2015年3月17日起,对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易 所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,估值处理标准另有规定的除外。于2015年3月17 日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

6.4.5.3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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司	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、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	68,685,153.54	80.00%	37,841,972.66	100.00%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30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	62,531.58	80.00%	25,781.71	62.25%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	34,451.90	100.00%	11,422.69	100.00%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	414,651.25	454,325.89
其中:支付销售机构的客户维护费	21,562.01	34,485.58

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	91,223.32	99,951.67

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.22%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.22%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,263,706.81	20,231.18	4,496,883.70	19,550.41

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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2015年6月30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。

6.4.9.2 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
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	36.50	-	-	39,555.00	692,536.71	1,443,757.50	-
000630	铜陵有色	2015-03-09	重大事项	10.32	-	-	50,696.00	447,824.11	523,182.72	-
000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项	7.00	2015-08-24	6.30	70,031.00	204,820.55	490,217.00	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	重大事项	12.96	-	-	43,332.00	213,426.14	561,582.72	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	16.88	-	-	25,676.00	243,146.88	433,410.88	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57	-	-	18,955.00	186,763.54	446,769.35	-
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	24.50	-	-	16,962.00	266,389.79	415,569.00	-
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项	30.82	-	-	25,153.00	405,815.36	775,215.46	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项	71.48	2015-08-05	69.20	4,663.00	257,698.74	333,311.24	-
002001	新 和 成	2015-06-30	重大事项	17.09	2015-07-13	18.49	10,048.00	140,223.10	171,720.32	-
002069	獐 子 岛	2015-06-01	重大事项	19.76	-	-	6,563.00	116,932.26	129,684.88	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事项	16.42	-	-	17,485.00	263,729.07	287,103.70	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	37.85	-	-	9,034.00	166,497.74	341,936.90	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项	44.35	-	-	9,290.00	404,172.29	412,011.50	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30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。

6.4.10 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本基金最近一期年报。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2015年6月30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50,619,817.94元,属于第二层级的余额为6,765,473.17元,无属于第三层级的余额(2014年12月31日:第一层级83,199,264.27元,第二层级4,440,544.42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。如附注6.4.5.2所述,本基金自2015年3月17日起,对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易 所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(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。

7 投资组合报告

7.1 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	57,385,291.11	92.06
	其中:股票	57,385,291.11	92.06
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,263,706.81	6.84
7	其他各项资产	682,376.33	1.09
8	合计	62,331,374.25	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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	129,684.88	0.22
B	采矿业	882,078.28	1.47
C	制造业	32,284,917.02	53.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	343,036.65	0.57
E	建筑业	612,004.90	1.02
F	批发和零售业	1,451,190.44	2.42
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,843,009.45	8.08
J	金融业	7,889,132.02	13.16
K	房地产业	4,927,789.87	8.22
L	租赁和商务服务业	932,382.58	1.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,648,292.20	2.75
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	1,041,171.78	1.74
S	综合	386,286.04	0.64
	合计	57,370,976.11	95.68

7.2.2 积极投资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	14,315.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	14,315.00	0.02

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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	000651	格力电器	44,261	2,828,277.90	4.72
2	000002	万 科A	164,666	2,390,950.32	3.99
3	000001	平安银行	117,841	1,713,408.14	2.86
4	000783	长江证券	112,692	1,572,053.40	2.62
5	000333	美的集团	40,592	1,513,269.76	2.52
6	000024	招商地产	39,555	1,443,757.50	2.41
7	002415	海康威视	25,881	1,159,468.80	1.93
8	002024	苏宁云商	73,064	1,117,879.20	1.86
9	000625	长安汽车	51,328	1,085,587.20	1.81
10	000166	申万宏源	65,524	1,064,765.00	1.78

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002746	仙坛股份	500	14,315.00	0.02

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000333	美的集团	1,398,303.48	1.51
2	000750	国海证券	619,064.22	0.67
3	000977	浪潮信息	508,661.00	0.55
4	000963	华东医药	508,009.00	0.55
5	002500	山西证券	481,547.00	0.52
6	002475	立讯精密	397,499.00	0.43
7	000002	万 科A	383,616.00	0.41
8	000166	申万宏源	380,676.00	0.41
9	000783	长江证券	341,448.00	0.37
10	002030	达安基因	339,840.00	0.37
11	000917	电广传媒	332,202.65	0.36
12	000651	格力电器	329,152.00	0.36
13	002594	比亚迪	313,038.00	0.34
14	000001	平安银行	274,298.00	0.30
15	000876	新 希 望	257,926.00	0.28
16	002415	海康威视	248,676.00	0.27
17	000425	徐工机械	247,122.00	0.27
18	002024	苏宁云商	180,144.00	0.19
19	000728	国元证券	170,450.00	0.18
20	000839	中信国安	156,804.00	0.17

注:本项及下项7.4.2、7.4.3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。

7.4.2 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	000728	国元证券	3,882,308.68	4.19
2	000002	万 科A	3,201,382.52	3.45
3	000651	格力电器	3,088,751.65	3.33
4	000001	平安银行	2,647,247.33	2.86
5	000166	申万宏源	2,482,126.20	2.68
6	000333	美的集团	2,260,876.56	2.44
7	002024	苏宁云商	1,641,914.86	1.77
8	000783	长江证券	1,364,256.73	1.47
9	000063	中兴通讯	1,343,750.58	1.45
10	000686	东北证券	1,335,830.58	1.44
11	000858	五 粮 液	1,288,708.35	1.39
12	000100	TCL 集团	1,270,349.68	1.37
13	000725	京东方A	1,081,347.00	1.17
14	002415	海康威视	1,038,570.41	1.12
15	002500	山西证券	1,038,282.00	1.12
16	300104	乐视网	1,015,251.59	1.10
17	000768	中航飞机	985,421.50	1.06
18	000750	国海证券	959,880.32	1.04
19	300027	华谊兄弟	907,527.30	0.98
20	000157	中联重科	901,245.38	0.97

7.4.3 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	15,604,867.86
卖出股票的收入(成交)总额	76,226,539.87

7.5 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。

7.6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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3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	23,975.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	763.54
5	应收申购款	657,636.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	682,376.33

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资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	000024	招商地产	1,443,757.50	2.41	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
广发深证100指数分级A	278	44,496.24	7,531,597.00	60.89%	4,838,359.00	39.11%
广发深证100指数分级B	560	22,089.21	5,065,858.00	40.95%	7,304,099.00	59.05%
广发深证100指数分级	1,316	13,773.88	1,714,265.59	9.46%	16,412,161.06	90.54%
合计	2,154	19,900.81	14,311,720.59	33.39%	28,554,619.06	66.61%

8.2 期末上市基金前十名持有人

广发深证100指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001	4,550,382.00	36.79%
2	许金泉	1,379,710.00	11.15%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	1,077,783.00	8.71%
4	泰康人寿保险股份有限公司(个人分红)	964,391.00	7.80%
5	华宝信托有限责任公司-宝钢1号单一资金信托	922,900.00	7.46%
6	谭惠玲	250,024.00	2.02%
7	符立成	200,019.00	1.62%
8	黄贤民	156,448.00	1.26%
9	洪伟连	123,000.00	0.99%
10	邬良忠	105,740.00	0.85%

广发深证100指数分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司(个人分红)	3,139,817.00	25.38%
2	林德达	900,000.00	7.28%
3	中信证券-中信-中信证券基金精选集合资产管理计划	715,100.00	5.78%
4	桐乡市濮院丝业有限公司	618,789.00	5.00%
5	国信证券股份有限公司	414,609.00	3.35%
6	谭惠玲	250,024.00	2.02%
7	黄川秀	200,100.00	1.62%
8	张本衡	182,600.00	1.48%
9	尤泽彤	150,000.00	1.21%
10	涂慧萍	141,600.00	1.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发深证100指数分级A	-	-
	广发深证100指数分级B	-	-
	广发深证100指数分级	4,000.00	0.0221%
	合计	4,000.00	0.0093%

8.4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	份额级别	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	广发深证100指数分级A	0
	广发深证100指数分级B	0
	广发深证100指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发深证100指数分级A	0
	广发深证100指数分级B	0
	广发深证100指数分级	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发深证100指数分级A	广发深证100指数分级B	广发深证100指数分级
基金合同生效日(2012年5月7日)基金份额总额	110,591,152.00	110,591,153.00	346,516,015.60
本报告期期初基金份额总额	29,551,862.00	29,551,863.00	28,708,343.41
本报告期基金总申购份额	-	-	50,416,803.48
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	97,996,695.73
本报告期基金拆分变动份额	-17,181,906.00	-17,181,906.00	36,997,975.49
本报告期期末基金份额总额	12,369,956.00	12,369,957.00	18,126,426.65

注:拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额及份额折算所得份额。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2015年4月30日,包林生不再担任本基金管理人的副总经理。2015年5月23日,肖雯不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

2015年1月4日,基金托管人发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广发证券	2	68,685,153.54	80.00%	62,531.58	80.00%	-
申银万国	1	17,176,513.17	20.00%	15,637.62	20.00%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

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。

广发基金管理有限公司
二〇一五年八月二十八日