广发行业领先股票型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	广发行业领先股票
基金主代码	270025
交易代码	270025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23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	2,432,360,882.17份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握宏观经济周期及行业生命周期的发展趋势,发掘发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业中的领先企业进行投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将80%以上的股票资产投资于发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业中的领先企业。不同的行业在经济周期的不同阶段呈现出不同的运行态势,本基金将主要通过"广发领先行业评价体系",对行业进行定性、定量分析,同时,结合国内外宏观经济环境及国家相关政策的变化,选择发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业作为本基金行业配置的重点。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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	1,537,733,175.33
本期利润	1,793,700,948.81
加权平均基金份额本期利润	0.9948
本期基金份额净值增长率	73.35%
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	1.1902
期末基金资产净值	6,266,964,169.44
期末基金份额净值	2.576

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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)。

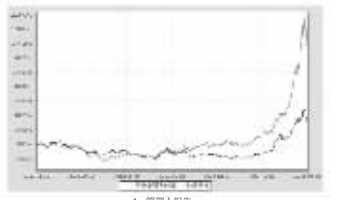
3.2 基金净值表现

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	-11.05%	3.43%	-5.99%	2.80%	-5.06%	0.63%
过去三个月	29.58%	2.79%	8.77%	2.09%	20.81%	0.70%
过去六个月	73.35%	2.27%	21.90%	1.81%	51.45%	0.46%
过去一年	152.30%	1.81%	86.91%	1.47%	65.39%	0.34%
过去三年	213.76%	1.50%	68.08%	1.20%	145.68%	0.30%
自基金合同生效起至今	157.58%	1.40%	37.76%	1.15%	119.82%	0.25%

注:1.本基金的业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。
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



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1.26889亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、偿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、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,数量策略投资部,国际业务部,产品管理部,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、广发深证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、广发聚丰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、广发新信用债券型证券投资基金、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、广发纯债债券型证券投资基金、广发纯债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、广发聚财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、广发证券公司债交易型开放式指数证券投资基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发天优长线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、广发纯债宝货币基金、广发定期宝货币基金、广发定期宝债券基金、广发可转债百发策略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、广发聚裕债券型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝债券型证券投资基金、广发集思灵活配置混合型证券投资基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安享回报混合型证券投资基金、广发聚赢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226247亿元。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		
刘晓龙	本基金的基金经理;广发新动力股票基金的基金经理;权益投资一部总经理	2010-11-23	-	8年	男,中国籍,工学硕士,持有基金业执业资格证书,2007年2月至2010年3月在广发基金管理有限公司研究发展部任行业研究员、研究小组主管,2010年3月11日至2011年3月10日任广发聚丰股票基金的基金经理助理,2010年11月23日起任广发行业领先股票基金的基金经理,2014年1月19日任广发新动力股票基金的基金经理,2015年1月14日起任广发基金有限公司权益投资一部总经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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《证券投资基金法》及其配套法规,《广发行业领先股票型证券投资基金合同》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,无损害基金份额持有人利益的行为。

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。监察稽核常风险控制沟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。稽核沟通过对投资、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,上证公平交易制度总体执行情况良好,不同投资组合交易了公平对待,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(完全股票有关指数的相应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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较小的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年,国内经济情况不温不火,但是在持续的宽松货币政策以及新兴产业和股市财富效应的多重刺激下,深圳等城市的房价出现局部上涨,全国房价出现企稳态势,国民消费有底端慢慢回升态势,但是比较温和,投资依然处于缓慢下滑状态,没有太多亮点。国外方面,美国经济复苏较好,欧元区的希腊债务危机重新爆发,总体上波澜不惊。

股票市场在1季度开始持续上涨,进入目我加强状态,进入6月,由于监管层对场外配资的突然叫停,导致资金面的搬家骤然减速,市场开始下跌,由于配资的强制平仓的逐级打击效应,导致场外配资产品大量平仓,引发了有史以来最严重的股灾,很多股票连续出现无量跌停,股市几乎失去交易功能,6月29日,政府开始救市,但是由于下跌已经形成恶性循环,所以直到7月9号,才开始扭转市场,本次下跌异常惨烈。

回顾上半年,本基金在2季度初期见到了23%左右的涨幅,但是忽视了杠杆的非理性作用,认为只是牛市中一个20%左右的中级回调,所以在6月被少了近长投配置,增加了航空板块配置,期望用较好的结构规避下跌。前两周的下跌的确对本基金造成了较大的负面影响,取得了大幅的超额收益,这样的表现也强化了基金经理的错误认知,结果市场的变化远超预期,直接终结了这轮牛市,一个月完成了2008年一年的跌幅,市场重新回到均衡状态。由于只是有限的降低了仓位,所以只是间接停止了赚钱,2014年以来首次出现大级别回撤,教训深刻!

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73.35%,同期业绩比较基准收益率为21.9%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的预测展望

这次下跌改变了很多历史经验,由于杠杆的存在,个股出现连续下跌70%而中途完全没有反弹。下跌有效的降低了市场的总体估值,但是和历史相比仍然处于较高位置。

由于急速杀跌,财富的蒸发特别快,特别是中产阶级以上人群,这批人是杠杆的主要使用者,是牛市主要的资金推手,也是这次股灾最大的受害者。资金损失之下,后续做多量大幅减弱,另外,市场信心受到极大打击,风险偏好下降,需要时间修复。市场预计需要1-2个月的时间重新完成股票估值体系的重塑,可以预见,对于互联网相关的股票来说,其估值会什将会大幅顺水,虽然很多股票经历了70%的跌幅,但是未来很可能会继续阴跌,完成价值回归。而一些蓝筹优秀、行业成长性稳定的优质公司,将会重新获得以往应公司,将会重新获得以往的估值溢价,但是个股的涨跌将会降低,总体涨幅是有大跌后的恢复性反弹。板块上,看好业绩既定的航空板块,周期反转初期的农业板块,军工板块可能会在政策性的事件驱动行情。其余将会是个股行情。

更长期的走势取决于过剩产能的化解和债务化解的处理,需要跟踪观察。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等有关情况的说明

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。估值委员会成员对估值政策和程序进行评价,凡发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况且及时修订估值方法,以保证持续适用。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账查,确保估值方法、估值程序的有效性及估值政策和程序的合规性及适用性情况且及时修订。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关公允的情况,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"(三)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

本报告期内,本基金托管人在对广发行业领先股票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,广发行业领先股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发行业领先股票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、基金费用计支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,存在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,广发行业领先股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对"广发基金管理有限公司编制和披露的广发行业领先股票型证券投资基金2015年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:广发行业领先股票型证券投资基金
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	1,123,004,493.56	250,608,269.22
结算备付金	34,845,243.93	6,064,933.54
存出保证金	2,398,316.30	1,051,557.23
交易性金融资产	5,519,983,023.87	1,549,074,968.82
其中:股票投资	5,519,983,023.87	1,549,074,968.82
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	217,926,985.42	-
应收利息	167,788.28	38,612.63
应收股利	-	-
应收申购款	54,578,907.81	24,403,939.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,952,904,759.17	1,831,242,280.65
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	213,930,962.12	32,581,131.51
应付赎回款	442,378,534.89	16,774,778.12
应付管理人报酬	9,436,979.25	2,064,656.03
应付托管费	1,572,829.86	344,109.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	16,983,543.32	5,186,724.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,637,740.29	472,043.54
负债合计	685,940,589.73	57,423,443.33
所有者权益:	-	-
实收基金	2,432,360,882.17	1,193,702,252.95
未分配利润	3,834,603,287.27	580,116,584.37
所有者权益合计	6,266,964,169.44	1,773,818,837.32
负债和所有者权益总计	6,952,904,759.17	1,831,242,280.65

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值人民币2.576元,基金份额总额2,432,360,882.17份。

6.2 利润表

会计主体:广发行业领先股票型证券投资基金
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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	1,861,175,678.06	55,573,230.12
1.利息收入	1,586,402.64	684,937.50
其中:存款利息收入	1,586,402.64	684,937.50
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)	1,597,004,946.55	236,683,357.39
其中:股票投资收益	1,589,586,945.79	228,043,132.92
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	-	-
衍生金融资产收益	-	-
股利收益	7,418,000.76	8,640,224.47
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	255,967,773.48	-181,895,858.45
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,616,555.39	100,793.68
减:二、费用	67,474,729.25	19,983,516.42
1. 管理人报酬	30,390,050.43	11,364,480.66
2. 托管费	5,065,008.34	1,894,080.14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	31,816,352.72	6,515,333.46
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	203,317.76	209,622.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,793,700,948.81	35,589,713.70
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,793,700,948.81	35,589,713.70

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发行业领先股票型证券投资基金
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)	1,193,702,252.95	580,116,584.37	1,773,818,837.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,793,700,948.81	1,793,700,948.81
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)	1,238,658,629.22	1,460,785,754.09	2,699,444,383.31
其中:1.基金申购款	3,341,478,995.19	4,652,243,513.69	7,993,722,508.88
2.基金赎回款	-2,102,820,365.97	-3,191,457,759.60	-5,294,278,125.57
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)	2,432,360,882.17	3,834,603,287.27	6,266,964,169.44

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)	1,947,926,429.79	20,870,171.02	1,968,796,600.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,589,713.70	35,589,713.70
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)	-513,110,025.77	-26,853,194.33	-539,963,220.10
其中:1.基金申购款	202,061,116.69	-1,278,960.27	200,782,156.42
2.基金赎回款	-715,171,142.46	-25,574,234.06	-740,745,376.52
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)	1,434,816,404.02	29,606,690.39	1,464,423,094.41

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

广发行业领先股票型证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2010]560号文《关于核准广发行业领先股票型证券投资基金募集的批复》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》等有关规定和《广发行业领先股票型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2010年11月23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。

本基金募集期间为2010年10月25日至2010年11月19日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币4,429,587,850.13元,有效认购户数为8015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307,044.22元,折合基金份额307,044.22份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金份额中。本基金募集资金经瑞华会计师事务所有限公司验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金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。本基金资产比例基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。

经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,本基金于2015年6月17日变更为"广发行业领先混合型证券投资基金。

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颁发于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,同时在其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相一致。

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

本基金在本报告期内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,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。

6.4.6 除公允价值估值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	5,519,983,023.87	79.39
	其中:股票	5,519,983,023.87	79.39
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	1,157,849,737.49	16.65
7	其他各项资产	275,071,997.81	3.96
8	合计	6,952,904,759.17	100.00

7.2 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	47,217,355.68	0.75
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,780,849,350.76	44.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	244,804,119.25	3.91
E	建筑业	187,550,506.64	2.99
F	批发和零售业	114,113,129.90	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	789,417,218.62	12.60
H	住宿和餐饮业	38,802,970.25	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,028,388,213.49	16.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	214,170,043.20	3.42
L	租赁和商务服务业	14,128,178.08	0.23
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	60,541,938.00	0.97
S	综合	-	-
	合计	5,519,983,023.87	88.08

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

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	601021	春秋航空	3,313,329	396,042,215.37	6.32
2	600703	三安光电	12,500,000	391,250,000.00	6.24
3	002331	皖通科技	12,700,000	373,126,000.00	5.95
4	603678	火炬电子	3,389,403	365,648,795.64	5.83
5	000901	航天科技	3,644,513	239,626,729.75	3.82
6	000958	东方能源	7,532,905	232,390,119.25	3.71
7	002481	双塔食品	5,500,000	228,965,000.00	3.65
8	600029	南方航空	12,500,000	181,750,000.00	2.90
9	300155	安居宝	4,500,000	180,630,000.00	2.88
10	600115	东方航空	14,022,839	172,761,376.48	2.76

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。

7.4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	002331	皖通科技	514,272,484.62	28.99
2	600703	三安光电	371,813,308.22	20.96
3	600029	南方航空	346,791,060.23	19.55
4	600570	恒生电子	320,387,955.46	18.06
5	600048	保利地产	300,265,917.66	16.93
6	600115	东方航空	299,723,058.54	16.90
7	601021	春秋航空	285,942,559.04	16.12
8	600804	鹏博士	264,780,031.07	14.93
9	000958	东方能源	261,531,766.26	14.74
10	000901	航天科技	245,427,139.79	13.84
11	601288	农业银行	244,513,043.04	13.78
12	000839	中信国安	200,935,560.57	11.33
13	603678	火炬电子	187,984,605.58	10.60
14	300096	易联众	185,464,296.28	10.46
15	600958	东方证券	181,226,075.44	10.22
16	300059	东方财富	180,270,687.94	10.16
17	300427	红相电力	178,018,329.34	10.04
18	002481	双塔食品	170,980,932.30	9.64
19	300155	安居宝	169,120,562.70	9.53
20	000948	南天信息	164,453,046.76	9.27
21	600525	长园集团	163,762,957.90	9.23
22	002375	亚厦股份	163,034,021.95	9.19
23	600993	马应龙	160,495,642.04	9.05
24	300170	汉得信息	159,701,801.27	9.00
25	300146	汤臣倍健	154,667,857.90	8.72
26	600446	金证股份	152,931,509.62	8.62
27	002146	荣盛发展	151,024,255.63	8.51
28	002260	德奥通航	148,792,968.85	8.39
29	002366	丹甫股份	138,556,440.10	7.81
30	600466	蓝光发展	137,297,503.70	7.74
31	601233	桐昆股份	135,967,285.37	7.66
32	601688	华泰证券	134,478,495.52	7.58
33	603030	全筑股份	133,335,249.64	7.52
34	601318	中国平安	132,113,649.80	7.45
35	300013	新宁物流	126,012,415.17	7.10
36	002280	联络互动	120,378,630.00	6.79
37	300253	卫宁软件	119,475,444.78	6.74
38	300033	同花顺	114,867,214.32	6.48
39	601988	中国银行	111,566,807.62	6.29
40	002376	新北洋	109,183,356.60	6.16
41	600271	航天信息	102,005,800.12	5.75
42	300056	三维丝	101,849,531.47	5.74
43	001696	宗申动力	97,446,635.75	5.49
44	002315	焦点科技	96,708,004.62	5.45
45	300380	安硕信息	96,605,180.53	5.45
46	002251	步步高	92,387,794.36	5.21
47	000712	锦龙股份	92,002,011.82	5.19
48	000400	许继电气	91,198,214.59	5.14
49	600325	华发股份	90,183,700.75	5.08
50	600596	新安股份	88,668,759.29	5.00
51	600831	广电网络	88,558,962.69	4.99
52	002303	美盈森	86,435,126.61	4.87
53