广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金

2014 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:二〇一四年八月二十九日

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2014年8月25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2014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	广发内需增长混合
基金主代码	270022
交易代码	270022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月19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	1,309,220,017.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于受益于内需增长的行业中的优质上市公司,分享中国经济和行业持续增长带来的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	根据宏观经济研究员对宏观经济形势的研究,策略研究员对市场运行趋势的研究,以及行业研究员对行业投资价值的研究,综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例,并定期或不定期地进行调整。
业绩比较基准	55%×沪深300指数+45%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	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(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-152,056,344.77
本期利润	-125,525,395.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0854
本期基金份额净值增长率	-10.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4131
期末基金资产净值	781,239,871.74
期末基金份额净值	0.597

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

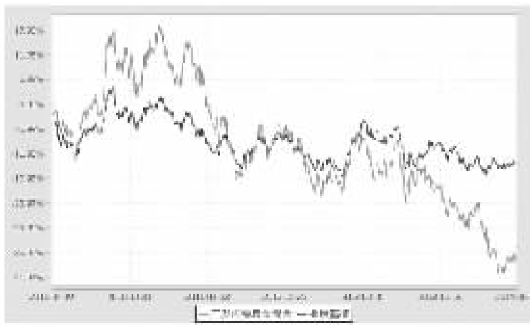
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.92%	1.26%	0.59%	0.42%	4.33%	0.84%
过去三个月	4.55%	1.11%	1.86%	0.48%	2.69%	0.63%
过去六个月	-10.90%	1.42%	-1.38%	0.57%	-9.52%	0.85%
过去一年	-16.39%	1.32%	0.45%	0.65%	-16.84%	0.67%
过去三年	-41.41%	1.31%	-11.01%	0.71%	-30.40%	0.60%
自基金合同生效起至今	-34.50%	1.31%	-14.13%	0.75%	-20.37%	0.56%

注:(1)本基金业绩比较基准:55%×沪深300指数+45%×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

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年4月19日至2014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6月30日,本基金管理人管理五十一只开放式基金---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,管理资产规模为1271.27亿元。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		
陈仕德	本基金的基金经理;广发小盘成长股票(LOF)基金的基金经理;投资总监、权益投资一部总经理	2010-04-19	-	20	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,1997年至2001年任职于广发证券股份有限公司,2001年至2003年8月参与筹建广发基金管理有限公司,2003年8月5日至2014年1月20日先后任广发基金管理有限公司投资管理部副总经理、投资管理部总经理,2005年2月2日起任广发小盘成长股票(LOF)基金的基金经理,2010年4月19日起任广发内需增长混合基金的基金经理,2012年7月11日起任广发基金管理有限公司投资总监,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司权益投资一部总经理。

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.基金经理助理的"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3.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、《广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,但成交较少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

1.市场回顾

本报告期内,整体市场呈现窄幅波动,上证指数下跌3.20%;创业板先扬后抑,期间上涨7.69%,波动较大。分行业来看,计算机、通信、医药等行业表现较好,传统行业如水泥、煤炭等表现较差。上半年,央行货币政策采取了定向宽松的手段,政府支持的铁路和保障房投资有加快迹象,经济呈现企稳的特点,但总体地产投资增速下滑依然明显。

2.基金运作回顾

本报告期内,我们增持了轻工制造、医药和通信等行业,减持了房地产、传媒、机械和消费品。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发内需增长基金本报告期内净值增长率为-10.90%,同期业绩比较基准收益率为-1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本报告期内,央行以定向宽松的方式释放流动性对经济进行微刺激,从各项数据看,经济逐渐呈企稳的态势。不过由于去年地产投资基数较高,加上今年地产销售情况恶化,地产投资增速下滑较快,对于微刺激能否对冲地产投资带来的下滑,仍然存在不确定性。行业基本面来看,TMT、大消费、先进制造业的基本面依然良好。市场在二季度的后半段表现活跃,从去IOE、干细胞治疗到在线和职业教育等主题投资轮番表现,尽管这些行业的进展可能低于预期,但是市场选择的方向大体应该是没有问题的。市场对于经济转型十分渴望,对于要转型的上市公司和行业已经给予了一定估值溢价。

展望下半年,我们可以对市场稍微乐观一些,政治形势稳定的大前提下,风险偏好提升带来的估值修复是值得期待的,当然这种估值修复取决于市场情绪,尽管这种修复的高度难以把握,但是值得参与。未来大的投资机会依然在新兴行业和国家欠缺发展的行业里面,这些行业集中在科技尤其是移动互联网、医药医疗服务、先进制造业和现代服务业等行业中,短期看这些行业可能估值过高,但未来行业存在较大的成长空间。我们需要关注的另一点就是部分行业可能已经失去了成长性的特征,例如其收入增速和利润增速已经放缓,或者行业的基本面发生部分不利变化,对于这些成长股需要严格甄别,尽量避免掉入估值陷阱。

尽管仍然面临较多的不确定,我们相信通过深入的行业和公司基本面研究,一定能寻找到能穿越周期的投资标的,为持有人带来满意的回报。

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"基金的收益与分配"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:广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:	-	-
银行存款	55,758,827.10	177,168,805.39
结算备付金	4,634,708.86	2,058,527.65
存出保证金	1,057,225.86	966,011.16
交易性金融资产	662,629,487.11	1,220,395,438.40
其中:股票投资	563,159,487.11	1,073,380,438.40
基金投资	-	-
债券投资	99,470,000.00	147,015,000.00
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	65,796,750.87	9,036,386.45
应收利息	1,857,926.67	191,989.36
应收股利	-	-
应收申购款	546,793.13	129,892.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	792,281,719.60	1,409,947,050.51
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30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	-	18,694,576.79
应付赎回款	2,918,499.81	1,326,690.91
应付管理人报酬	929,687.04	1,873,383.13
应付托管费	154,947.87	312,230.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,737,233.77	2,897,156.63
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	301,479.37	245,023.21
负债合计	11,041,847.86	25,349,061.20
所有者权益:	-	-
实收基金	1,309,220,017.64	2,065,086,952.34
未分配利润	-527,980,145.90	-680,488,963.03
所有者权益合计	781,239,871.74	1,384,597,989.31
负债和所有者权益总计	792,281,719.60	1,409,947,050.51

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值人民币0.597元,基金份额总额1,309,220,017.64份。

6.2 利润表

会计主体:广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-107,456,318.88	-276,769,065.30
1.利息收入	2,692,645.20	5,967,320.45
其中:存款利息收入	451,818.33	938,361.55
债券利息收入	2,089,219.18	5,028,958.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	151,607.69	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-136,959,318.54	-128,457,033.42
其中:股票投资收益	-137,801,712.13	-135,953,273.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-753,800.00	-3,784,700.00
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	1,596,193.59	11,280,939.76
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	26,530,948.95	-155,209,834.32
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	279,405.51	930,481.99
减:二、费用	18,069,076.94	29,983,542.51
1.管理人报酬	6,707,704.78	17,562,755.62
2.托管费	1,117,950.90	2,927,125.95
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,037,601.40	9,284,715.24
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	205,819.86	208,945.70
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-125,525,395.82	-306,752,607.81
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-125,525,395.82	-306,752,607.81

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	2,065,086,952.34	-680,488,963.03	1,384,597,989.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-125,525,395.82	-125,525,395.82
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)	-755,866,934.70	278,034,212.95	-477,832,721.75
其中:1.基金申购款	36,917,360.85	-14,326,330.07	22,591,030.78
2.基金赎回款	-792,784,295.55	292,360,543.02	-500,423,752.53
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)	1,309,220,017.64	-527,980,145.90	781,239,871.74
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	3,886,326,449.91	-648,036,933.89	3,238,289,516.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-306,752,607.81	-306,752,607.81
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)	-1,616,646,059.80	305,706,465.12	-1,310,939,594.68
其中:1.基金申购款	805,783,077.78	-169,242,832.65	636,540,245.13
2.基金赎回款	-2,422,429,137.58	474,949,297.77	-1,947,479,839.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,269,680,390.11	-649,083,076.58	1,620,597,313.53

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

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2010]226号文《关于同意广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金设立的批复》的批准,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《广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2010年4月19日正式成立。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2010年3月16日至2010年4月15日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集资金总额为人民币4,226,246,853.18元,有效认购户数为57,357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300,716.30元,折合基金份额300,716.30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验资。基金合同于2010年4月19日生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,226,246,853.18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,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准采用:55%×沪深300指数+45%×中证全债指数。

本基金的财务报表于2014年8月25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2014年6月30日的财务状况以及2014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

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

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

本基金本报告期内不存在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。

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
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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	1,134,510,605.40	17.12%	3,349,919,722.39	55.73%

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 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	1,033,026.90	17.94%	598,376.37	8.88%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	3,023,479.26	59.70%	1,140,042.33	25.54%

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,707,704.78	17,562,755.62
其中:支付销售机构的客户维护费	1,305,673.81	2,144,150.57

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日,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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,117,950.90	2,927,125.95

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
期初持有的基金份额	54,720,264.22	54,720,264.22
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	43,731,779.00	-
期末持有的基金份额	10,988,485.22	54,720,264.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.84%	2.41%

注:基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	55,758,827.10	404,702.80	264,311,748.41	893,878.62

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(2014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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600594	益佰制药	2014-01-21	2015-01-19	非公开发行流通受限	31.35	35.62	350,800.00	10,997,580.00	12,495,496.00	2014年7月14日除权除息,比例:每10股派现金红利1.20元(含税)

注:截至本报告期末2014年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债券及权证。

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
002019	鑫富药业	2014-06-25	重大事项	23.76	2014-07-04	26.14	1,109,371.00	25,710,713.66	26,358,654.96	-
002602	世纪华通	2014-06-25	重大事项	24.68	2014-07-02	25.50	1,900,000.00	51,517,271.31	46,892,000.00	-
600071	凤凰光学	2014-06-30	重大事项	12.39	2014-07-01	12.81	3,428,027.00	31,844,151.84	42,473,254.53	-
600516	方大炭素	2014-06-30	重大事项	9.59	2014-07-02	9.05	3,000,000.00	26,782,053.96	28,770,000.00	-

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2014年6月30日止,本基金无从事交易所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2014年6月30日止,本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

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	563,159,487.11	71.08
	其中:股票	563,159,487.11	71.08
2	固定收益投资	99,470,000.00	12.55
	其中:债券	99,470,000.00	12.55
	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	60,393,535.96	7.62
7	其他各项资产	69,258,696.53	8.74
8	合计	792,281,719.60	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	436,684,746.25	55.90
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	10,704,050.80	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,770,690.06	14.82
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	563,159,487.11	72.09

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	002195	海隆软件	1,309,988	62,682,925.80	8.02
2	002602	世纪华通	1,900,000	46,892,000.00	6.00
3	300329	海伦钢琴	2,655,658	46,766,137.38	5.99
4	002354	科冕木业	1,020,000	44,880,000.00	5.74
5	600071	凤凰光学	3,428,027	42,473,254.53	5.44
6	000812	陕西金叶	5,291,424	39,685,680.00	5.08
7	300020	银江股份	1,215,334	37,189,220.40	4.76
8	000973	佛塑科技	6,047,988	31,933,376.64	4.09
9	600420	现代制药	1,708,930	31,700,651.50	4.06
10	002396	星网锐捷	1,052,495	29,459,335.05	3.77

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	002024	苏宁云商	98,651,210.50	7.12
2	002660	茂硕电源	91,578,590.30	6.61
3	600880	博瑞传播	82,817,852.21	5.98
4	300028	金亚科技	80,675,985.49	5.83
5	002396	星网锐捷	72,505,368.57	5.24
6	000001	平安银行	71,409,645.82	5.16
7	600048	保利地产	69,162,153.36	5.00
8	000024	招商地产	66,575,065.39	4.81
9	000977	浪潮信息	63,906,433.12	4.62
10	300269	联建光电	62,511,038.09	4.51
11	000938	紫光股份	61,616,335.04	4.45
12	002602	世纪华通	55,722,165.22	4.02
13	000661	长春高新	54,947,572.42	3.97
14	300165	天瑞仪器	54,558,269.09	3.94
15	002241	歌尔声学	52,892,357.76	3.82
16	300052	中青宝	52,836,936.67	3.82
17	002181	粤 传 媒	51,958,092.52	3.75
18	300285	国瓷材料	51,742,639.12	3.74
19	002195	海隆软件	50,705,999.75	3.66
20	002354	科冕木业	50,399,230.97	3.64
21	300078	中瑞思创	49,387,262.73	3.57
22	000656	金科股份	49,189,283.04	3.55
23	002285	世联行	49,177,132.23	3.55
24	300201	海伦哲	48,550,822.18	3.51
25	300183	东软载波	47,058,286.45	3.40
26	300178	腾邦国际	46,903,638.04	3.39
27	002577	雷柏科技	46,079,038.04	3.33
28	000961	中南建设	45,258,809.17	3.27
29	600519	贵州茅台	42,923,873.67	3.10
30	300216	千山药机	40,520,685.28	2.93
31	600804	鹏博士	38,653,993.72	2.79
32	300020	银江股份	38,108,225.68	2.75
33	300329	海伦钢琴	37,763,743.19	2.73
34	300056	三维丝	37,639,431.39	2.72
35	300148	天舟文化	37,360,225.85	2.70
36	002304	洋河股份	37,013,043.75	2.67
37	300133	华策影视	35,350,264.48	2.55
38	000812	陕西金叶	34,300,649.07	2.48
39	600149	廊坊发展	34,240,943.76	2.47
40	000651	格力电器	33,149,936.21	2.39
41	600640	号百控股	33,017,488.83	2.38
42	000973	佛塑科技	32,143,376.56	2.32
43	600071	凤凰光学	31,844,151.84	2.30
44	002146	荣盛发展	30,378,013.62	2.19
45	600718	东软集团	30,311,243.23	2.19
46	600794	保税科技	28,978,456.69	2.09
47	600420	现代制药	28,854,014.54	2.08
48	000511	烯碳新材	28,610,035.57	2.07
49	300049	福瑞股份	28,402,312.20	2.05
50	600340	华夏幸福	27,893,867.99	2.01
51	002550	千红制药	27,749,699.86	2.00

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	600048	保利地产	129,505,791.76	9.35
2	000024	招商地产	129,341,911.23	9.34
3	000651	格力电器	109,358,324.86	7.90
4	000001	平安银行	102,031,709.86	7.37
5	002024	苏宁云商	96,284,062.76	6.95
6	600880	博瑞传播	84,741,840.41	6.12
7	002146	荣盛发展	84,565,724.36	6.11
8	000729	燕京啤酒	83,816,751.62	6.05
9	002660	茂硕电源	82,365,741.23	5.95
10	300028	金亚科技	74,735,792.92	5.40
11	000961	中南建设	73,484,277.64	5.31
12	600887	伊利股份	72,814,661.47	5.26
13	000977	浪潮信息	70,711,380.40	5.11
14	300269	联建光电	62,525,362.59	4.52
15	300079	数码视讯	62,495,887.99	4.51
16	600383	金地集团	59,684,884.57	4.31
17	600585	海螺水泥	58,823,020.81	4.25
18	000938	紫光股份	58,247,860.26	4.21
19	300104	乐视网	54,170,050.76	3.91
20	002181	粤 传 媒	53,429,489.23	3.86
21	002396	星网锐捷	53,064,425.22	3.83
22	300052	中青宝	51,648,121.49	3.73
23	000661	长春高新	51,576,119.57	3.72
24	002241	歌尔声学	51,107,980.32	3.69
25	300251	光线传媒	50,511,070.53	3.65
26	300216	千山药机	49,644,554.15	3.59
27	002344	海宁皮城	48,930,860.58	3.53
28	002037	久联发展	47,709,921.95	3.45
29	300183	东软载波	46,772,459.67	3.38
30	000656	金科股份	43,850,368.74	3.17
31	002577	雷柏科技	43,586,446.30	3.15
32	002285	世联行	43,471,007.84	3.14
33	300201	海伦哲	41,978,309.09	3.03
34	300285	国瓷材料	39,860,197.66	2.88
35	300178	腾邦国际	39,366,838.53	2.84
36	000069	华侨城A	39,309,746.34	2.84
37	300133	华策影视	38,508,661.60	2.78
38	300078	中瑞思创	37,729,773.97	2.72
39	600149	廊坊发展	37,645,707.37	2.72
40	300148	天舟文化	37,360,077.11	2.70
41	600519	贵州茅台	36,525,812.46	2.64
42	002304	洋河股份	35,586,779.24	2.57
43	300165	天瑞仪器	35,521,580.62	2.57
44	600804	鹏博士	35,422,135.79	2.56
45	000002	万 科A	34,374,130.48	2.48
46	600640	号百控股	30,311,243.39	2.19
47	002550	千红制药	29,331,032.27	2.12
48	600340	华夏幸福	28,898,129.82	2.09
49	600718	东软集团	28,424,169.65	2.05
50	000511	烯碳新材	28,328,786.02	2.05
51	000596	古井贡酒	27,989,775.63	2.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	3,121,289,144.05
卖出股票的收入(成交)总额	3,517,784,332.16

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,470,000.00	12.73
	其中:政策性金融债	99,470,000.00	12.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	99,470,000.00	12.73

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110261	11国开61	1,000,000	99,470,000.00	12.73

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

(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

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

(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本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2本报告期本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。

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	1,057,225.86
2	应收证券清算款	65,796,750.87
3	应收股利	-
4	应收利息	1,857,926.67
5	应收申购款	546,793.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,258,696.53

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期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

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	002602	世纪华通	46,892,000.00	6.00	重大事项
2	600071	凤凰光学	42,473,254.53	5.44	重大事项

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

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
31,389	41,709.52	230,845,528.58	17.63%	1,078,374,489.06	82.37%

8.2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	3,055,099.45	0.2334%

8.3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	0

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年4月19日)基金份额总额	4,226,246,853.18
本报告期期初基金份额总额	2,065,086,952.34
本报告期基金总申购份额	36,917,360.85
减:本报告期基金总赎回份额	792,784,295.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,309,220,017.64

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

本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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	
申银万国	1	4,111,491,228.35	62.03%	3,743,107.32	65.01%	-
东方证券	1	1,382,074,062.46	20.85%	981,828.15	17.05%	-
广发证券	2	1,134,510,605.40	17.12%	1,033,026.90	17.94%	-
中航证券	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。

10.7.2 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
申银万国	-	-	55,000,000.00	14.64%	-	-
东方证券	-	-	320,800,000.00	85.36%	-	-

广发基金管理有限公司
二〇一四年八月二十九日