

# 广发制造业精选股票型证券投资基金

## 【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月二十一日

**1 重要提示**  
基金管理人的董事会及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责任。  
基金管理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7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。  
本报告期财务资料未经审计。  
本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

**2 基金产品概况**

基金简称	广发制造业精选股票
基金代码	270028
交易代码	270028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月26日
报告期末基金份额总额	331,479,355.36份
投资目标	通过深入的研究,精选制造业行业的优质上市公司进行投资,在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,本基金投资组合的比例为:股票资产占基金资产的60%-95%(债券、货币市场工具、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。本基金管理人将根据宏观经济发展状况及证券市场走势的研究,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与上市公司投资价值的评价,综合考虑基金的投资目标、市场发展状况、风险控制等因素,制定本基金资产配置、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例,并定期或不定期进行投资组合调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:80%沪深300指数收益率+20%中证全指指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、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、债券基金和混合型基金。
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

**3.1 主要财务指标**

**3.2 基金净值表现**

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。  
3.2 基金净值表现  
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准②	收益率差值③	①-③	②-④
过去三个月	18.98%	3.68%	21.00%	2.34%	-2.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

广发制造业精选股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图  
(2013年9月20日至2015年6月30日)

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

**4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**5.1 报告期末基金资产净值情况**

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	793,726,104.17	74.90
2	固定收益投资	793,726,104.17	74.90
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	183,970,634.58	17.36
7	其他各项资产	82,052,780.56	7.74
8	合计	1,659,749,499.25	100.00

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	-	-
B 采矿业	-	-
C 制造业	632,349,862.87	71.43
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,276,000.00	0.93
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	55,798,000.00	6.30
J 金融业	-	-
K 房地产业	28,721,000.00	3.24
L 租赁和商务服务业	68,581,241.36	7.75
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 其他	-	-
合计	793,726,104.17	89.66

**5.3 报告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**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002183	侨 兴 通	1,042,585	68,581,241.36	7.75
2	002039	顺 昌 港	2,500,718	68,024,368.96	7.68
3	300155	安居客	1,652,609	66,333,364.00	7.49
4	002256	彩虹股份	2,231,622	49,274,213.75	5.58
5	002339	航新航空	1,399,590	46,758,330.00	5.28
6	002402	和而泰	1,597,966	46,556,100.00	5.26
7	002319	银河电子	2,115,469	42,044,020.70	4.85
8	002518	科 士 达	1,197,217	37,185,560.02	4.20
9	600446	金 证 股 份	300,000	37,038,000.00	4.18
10	002053	德润电子	660,000	34,728,000.00	3.92

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

**5.5 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债券投资明细**

**5.6 报告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**

**5.7 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**

**5.8 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权证投资明细**

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.11 投资组合报告附注**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

**6.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002183	侨 兴 通	1,042,585	68,581,241.36	7.75
2	300155	安居客	1,652,609	66,333,364.00	7.49

**8.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**9.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**10.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**10.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**11.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**11.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**12.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**12.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**13.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**13.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**14.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**14.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**15.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**15.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**16.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**16.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**17.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**17.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**18.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**18.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

# 广发中债金融债指数证券投资基金

## 【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月二十一日

**1 重要提示**  
基金管理人的董事会及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责任。  
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7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。  
本报告期财务资料未经审计。  
本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

**2 基金产品概况**

基金简称	广发中债金融债指数	
基金代码	000348	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月27日	
报告期末基金份额总额	6,901,908.09份	
投资目标	本基金通过指数化投资,实现对标的指数的有效跟踪,追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为指数基金,主要采用优化抽样复制的方法,投资于标的指数中具有代表性及流动性的成份券和备选成份券,或选择成份券作为替代,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并依据本基金资产规模,日常申购赎回情况,市场流动性以及银行间债券交易特性,对标的指数的大额申购指标进行分配,追求复制标的指数,控制跟踪误差,降低交易成本的目的。	
业绩比较基准	本基金标的指数为金融债,95%中债-5年期金融债指数收益率+5%银行活期存款利率	
风险收益特征	本基金属债券型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基础费率	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类
报告期末下属分级基金的交易费用	000348	000349
报告期末下属分级基金的分红总额	3,569,455.11份	3,332,452.95份

**3.1 主要财务指标**

**3.2 基金净值表现**

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。  
3.2 基金净值表现  
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准②	收益率差值③	①-③	②-④
过去三个月	0.92%	0.15%	0.17%	-0.25%	-0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

广发中债金融债指数证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图  
(2015年11月27日至2015年6月30日)

**4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**5.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**5.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**6.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**7.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**8.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**9.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**10.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**10.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**11.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**11.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49

**12.1 基金业绩(或基金经理小组)简介**

**12.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。  
3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
3.2.1 本报告期基金管理人持有本基金份额变动情况

序号	姓名	期末持有基金份额(股)	期末持有基金份额占本基金总份额比例(%)
1	张维	68,581,241.36	7.75
2	安国富	66,333,364.00	7.49