

8.42累计卖出金额超出期初基金资产净值2%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	300059	东方财富	124,213,036.50	5.46
2	300168	万达信息	66,019,235.14	2.90
3	000540	中天城投	46,032,364.91	2.02
4	000319	宏江药业	30,189,390.96	1.33

5	300205	卫宁健康	77,196,290.27	163
6	300144	宋城演艺	77,168,239.26	164
7	000088	豫章不良	36,927,746.14	162
8	000097	新大陆	36,851,769.06	162
9	002030	达安基因	36,539,916.88	156
10	000012	南玻A	33,917,142.01	149
11	002424	贵州百灵	33,182,141.97	146
12	000616	海航机场	32,502,069.03	146
13	000712	顺络股份	32,480,586.22	143
14	002405	中航光电	31,476,525.04	136
15	000977	浪潮信息	30,509,511.11	136
16	601099	太平洋	30,232,606.40	133
17	002226	浙富控股	29,843,684.69	129

18	000002	科华生物	29,016,672.09	1.20
19	000286	世联行	28,491,170.00	1.20
20	000063	光环软件	28,336,136.02	1.20
8.2.2.2 大额长期股权投资及长期股权投资收益				单位：人民币元
买入长期股权的成本（或交易）总额				4,127,876,136.69
卖出长期股权的成本（或交易）总额				4,921,368,769.69
8.2.2.3 取得长期股权投资取得的投资收益				
基本成本报告期未持有或持有				
8.2.2.3.1 取得长期股权投资取得的投资收益比例大于或等于10%的长、名称和投资期间				
中期期末及公允价值计量成本报告期未持有或持有				
8.2.2.3.2 取得长期股权投资取得的投资收益比例大于或等于10%的长、名称和投资期间				
基本成本报告期未持有或持有				
8.2.2.3.3 取得长期股权投资取得的投资收益比例大于或等于10%的长、名称和投资期间				
基本成本报告期未持有或持有				

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
	公允价值变动已计入合计				
	股指期货投资资本利得收益			-62,067,160.00	
	股指期货投资资本公允价值变动				

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资于股指期货的投资政策

本基金根据对股指期货的投资目的不同,在构建股票投资组合的时候,通过卖出股指期货对市场下行风险,降低非系统风险损失,提高投资组合收益。本基金主要采用套期保值等符合规定的投资策略来管理股指期货。

8.11 股指期货的投资决策程序

(1) 基本要素报告期末未持有股指期货

(2) 基本要素报告期末未进行股指期货交易

8.12 股指期货的投资风险控制

8.12.1 股指期货的开户和交易限制

8.12.2 报告期末,本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,也未出现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

8.12.3 报告期末,本基金投资的前十名证券中未出现公司同意的备选股票清单的情况。

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	865,176.27
2	应收证券清算款	3,291,467.50
3	应收股利	
		51,592.52

5	应收账款			11,109.17
6	其他应收款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计			4,107,761.03

8.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券余额

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

8.12.6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	000018	华信国际	12,945,856.20	0.78	重大事项

2	000704	长城信息	12,170,387.68	0.73	重大事
3	000678	宜华木业	7,896,366.67	0.48	重大事
4	000066	长城电脑	7,652,032.20	0.46	重大事

9.1 期末基金份额持有人户数及持有结构

9.1.1 基金份额持有人户数及持有结构

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	占总体份额比例	持有份额	占总体份额比例
1,583	515,800.59	795,159,615.00	98.02%	15,878,704.00	1.98%

9.1.2 期末上列基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	762,915,117.00	95.24%
2	宏信证券股份有限公司融资产专用	10,000,000.00	1.25%
3	中国银河证券股份有限公司	1,903,557.29	0.26%
4	方正证券股份有限公司	1,256,321.00	0.16%
	中国银河证券股份有限公司客户		

5	信用类短期债券资产账户	679,000,000	0.08%
6	申银万国证券股份有限公司客户信用类短期债券资产账户	614,000,000	0.08%
7	华泰证券股份有限公司-分红-个人分红-01H1--PH002	1,660,651,100	0.21%
8	广发证券股份有限公司客户信用类短期债券资产账户	1,194,560,000	0.15%
9	华泰证券-工行-华泰紫金金融上海子集合资产管理计划	1,000,000,000	0.12%
10	光大证券股份有限公司客户信用类短期债券资产账户	623,000,000	0.08%

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	
	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、基金投资和相关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

单位:份	
基金合同生效至2013年4月11日基金份额总额	425,038,319.00
本报告期初基金份额总额	1,523,038,000.00
本报告期基金份额净增加额	3,004,000,000.00
截止本报告期末基金份额总额	3,727,000,000.00
本报告期基金份额变动额	3,727,000,000.00
本报告期末基金份额总额	801,038,319.00

序号	交易对方名称	交易金额		交易性质		应付未付的利息		备注
		成交金额	占当期损益的比例	占当期损益已交回的比例	利息	占当期损益已交回的比例		
1	中国建设	472,739,500.00	88.6%		799,546.00	10.12%		
2	工商银行	763,838,020.00	142.6%		649,220.00	8.22%		一部分已
3	方正证券	709,388,980.92	73.2%		519,432.38	6.67%		全额已付
4	招商证券	557,589,933.88	53.8%		503,545.29	6.26%		

国信证券	4	4,568,000,114.21	50.00%	4,184,314,016	52.31%	-
华泰证券	5	403,152,107.46	5.01%	231,200,004	4.22%	-
长江证券	3	420,649,338.32	4.65%	352,951,169	4.88%	-
联讯证券	2	35,132,651.45	0.39%	31,956.05	0.41%	-
广发证券	7	287,799,400.99	3.18%	266,034,653	3.41%	-
招商证券	3	24,804,957.90	0.27%	22,729.25	0.29%	-
宏源证券	3	212,616,500.34	2.35%	151,097.15	1.93%	-
华融证券	2	14,278,055.46	0.16%	12,906.61	0.17%	-
安信证券	4	120,893,022.22	1.34%	111,359,000	1.42%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增个
国金证券	5	-	-	-	-	新增个

华泰证券	3	--	--	--	新增2个
中天证券	1	--	--	--	--
国联证券	3	--	--	--	--
恒泰证券	2	--	--	--	--
国盛证券	2	--	--	--	--
源泰证券	1	--	--	--	--
中信证券	4	--	--	--	新增1个
普华永道	5	--	--	--	--
新瑞兴证券	1	--	--	--	--
东商证券	1	--	--	--	--

国际证券	3	--	--	--	--	--
非货币性	1	--	--	--	--	--
国际证券	3	--	--	--	--	--
华通证券	2	--	--	--	--	--
光大证券	3	--	--	--	--	--
融通证券	2	--	--	--	--	--
万联证券	4	--	--	--	--	新增2个
东方证券	2	--	--	--	--	--
湘财证券	1	--	--	--	--	--
东吴证券	2	--	--	--	--	--
华泰证券	3	--	--	--	--	--

中欧证券	3	--	--	--	--	--
信达证券	3	--	--	--	--	--
天风证券	3	--	--	--	--	新增1个
东兴证券	3	--	--	--	--	--
国海证券	3	--	--	--	--	--
西部证券	3	--	--	--	--	--
国金证券	3	--	--	--	--	--
北京证券	3	--	--	--	--	--
第一创业证券	3	--	--	--	--	--
长江国际证券	0	--	--	--	--	减少2个
郑国国际	3	--	--	--	--	新增2个

美元证券	3	--	--	--	--	--
中国国债	3	--	--	--	--	--
欧元证券	3	--	--	--	--	--
阿根廷证券	3	--	--	--	--	--
印度尼西亚	3	--	--	--	--	--
广州证券	3	--	--	--	--	--
川阳证券	3	--	--	--	--	--
上海证券	3	--	--	--	--	--
太平洋证券	3	--	--	--	--	--
中金公司	3	--	--	--	--	--
国际证券	3	--	--	--	--	--

江海证券	2	--	--	--	--	--
华融证券	1	--	--	--	--	--
民生证券	2	--	--	--	--	--
光大证券	2	--	--	--	--	--
渤海证券	1	--	--	--	--	--
中信证券(浙江)	0	--	--	--	--	减少1个
西南证券	2	--	--	--	--	新增1个
民生证券	8	--	--	--	--	--
瑞信证券	1	--	--	--	--	--
华宝证券	1	--	--	--	--	--
德邦证券	1	--	--	--	--	--

世纪证券	--	--	--	--
长城证券	--	--	--	--

注1、交易佣金选择标准:

- (1) 财务状况良好,且过去一年无重大违法违规行为;
- (2) 经营行为规范,无损害投资者合法权益行为;
- (3) 具备具备业务开展所需资质、安全、合规的运营保障,满足投资者自行交易的要求;
- (4) 具有完善的信息披露制度,且能及时向公司披露有关交易、交易数据、业绩、市场及一般的信息质量报告,并能根据基金投资的特点,提供有针对性的研究报告;
- (5) 能配合公司完善业务办理流程,提供及时的信息交流和客户服务;
- (6) 能履行基金业协会和交易所自律公约;
- (7) 能配合公司风控管理。

基金管理人将根据上述研究评价标准,本基金管理人拟根据人员从依据交易所交易单元佣金选择标准对交易所交易单元选择的股票交易质量和研究实力进行综合评价,确定使用交易所单元的名单。

(8) 协议要求成为受托管理人,基金管理人将被选择的券商签订交易所单元租约协议,并通知基金托管人。

广发基金管理有限公司
二〇一六年三月二十八日