

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基 金

2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

1 重要提示及目录

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。

基金托管人兴业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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
8 基金份额持有人信息	42

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	43
9	开放式基金份额变动	43
10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	45
11	备查文件目录	45
11.1	备查文件目录	45
11.2	存放地点	45
11.3	查阅方式	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金	
基金简称	广发百发 100 指数	
基金主代码	000826	
交易代码	000826	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 10 月 30 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,996,744,209.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
下属分级基金的交易代码	000826	000827
报告期末下属分级基金的份额总额	774,984,585.35 份	1,221,759,624.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略,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 0.50%,年跟踪误差不超过 6%,实现对中证百度百发策略 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证百度百发策略 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:95%×中证百度百发策略 100 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	张志永
	联系电话	020-83936666	021-62677777-212004
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95561
传真		020-89899158	021-62159217

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	福建省福州市湖东路154号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	上海市江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码	510308	200041
法定代表人	王志伟	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	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）	
	广发百发100指数A	广发百发100指数E
本期已实现收益	665,813,571.83	1,011,071,239.40
本期利润	540,567,737.23	771,223,715.28
加权平均基金份额本期利润	0.5909	0.5742
本期加权平均净值利润率	42.03%	40.55%
本期基金份额净值增长率	54.38%	54.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
	广发百发100指数A	广发百发100指数E
期末可供分配利润	315,211,193.56	495,156,759.67
期末可供分配基金份额利润	0.4067	0.4053
期末基金资产净值	1,090,195,778.91	1,716,916,383.68
期末基金份额净值	1.407	1.405
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	

	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
基金份额累计净值增长率	81.09%	80.86%

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

广发百发 100 指数 A

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	-11.73%	4.06%	-9.86%	3.68%	-1.87%	0.38%
过去三个月	19.22%	3.02%	24.17%	2.79%	-4.95%	0.23%
过去六个月	54.38%	2.43%	62.49%	2.26%	-8.11%	0.17%
自基金合同生效起至今	81.09%	2.23%	95.44%	2.12%	-14.35%	0.11%

广发百发 100 指数 E

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	-11.80%	4.05%	-9.86%	3.68%	-1.94%	0.37%
过去三个月	19.15%	3.02%	24.17%	2.79%	-5.02%	0.23%
过去六个月	54.19%	2.43%	62.49%	2.26%	-8.30%	0.17%
自基金合同生效起至今	80.86%	2.23%	95.44%	2.12%	-14.58%	0.11%

注：（1）业绩比较基准： $95\% \times \text{中证百度百发策略 100 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

（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。

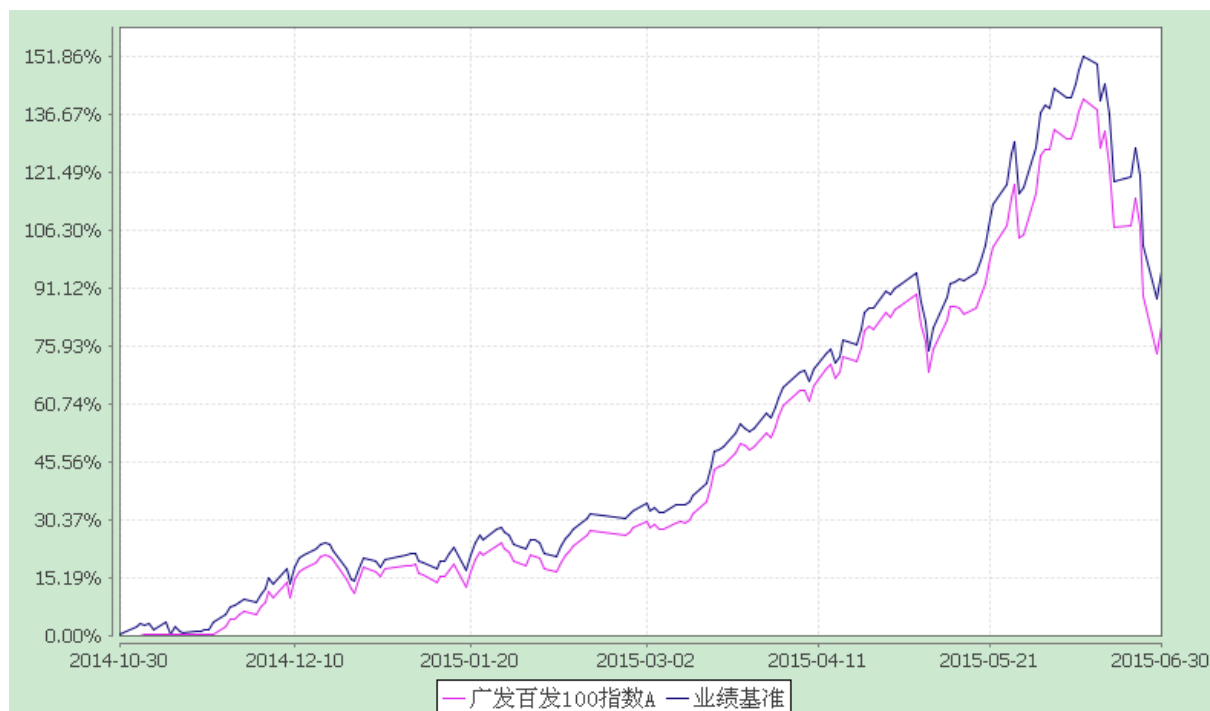
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

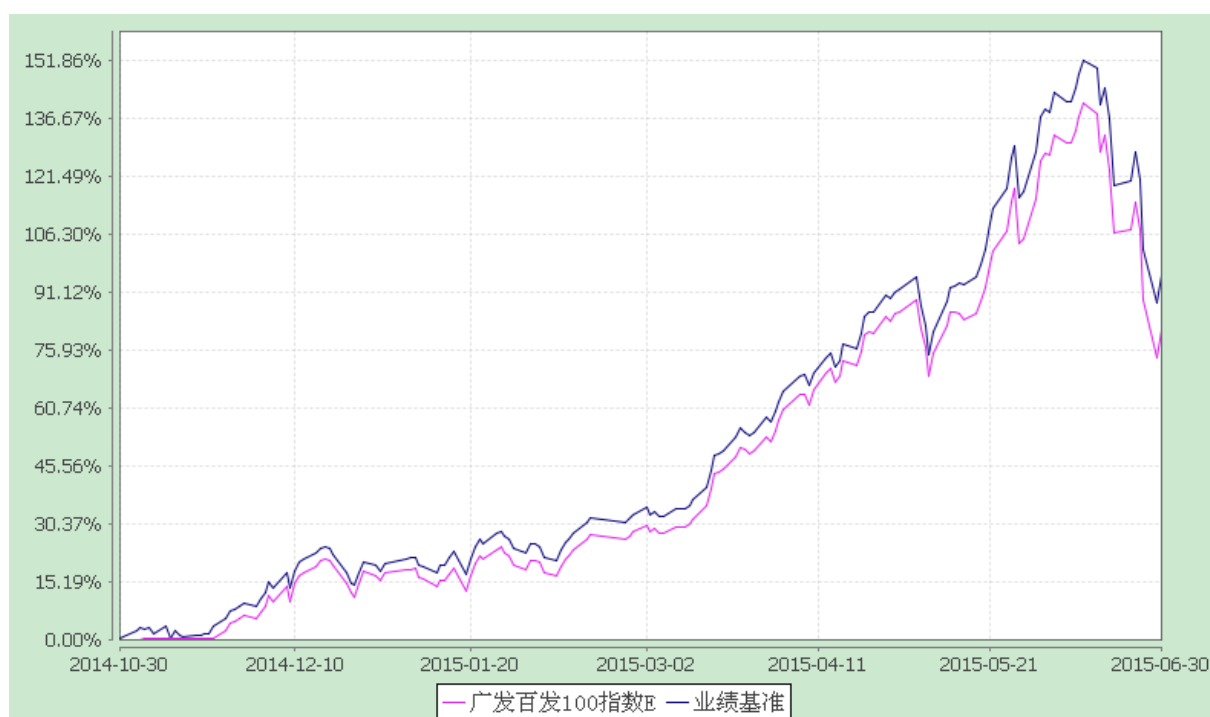
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014 年 10 月 30 日至 2015 年 6 月 30 日）

广发百发 100 指数 A



广发百发 100 指数 E



注：（1）本基金合同生效日期为 2014 年 10 月 30 日，至披露时点本基金成立未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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；广发深证 100 指数分级基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 及	2014-10-30	-	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，

	联接基金的基金经理；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 及联接基金的基金经理；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				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。
季峰	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；数据策略投资部副总经理	2014-11-24	-	6 年	男，中国籍，管理学博士，持有基金业执业资格证书，2009 年 8 月至 2011 年 8 月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作，2011 年 9 月至 2014 年 10 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员，2014 年 10 月 21 日任广发中证全指可选消费 ETF 的基金经理，2014 年 11 月 24 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2015 年 2 月 13 日起任广发养老指数基金的基金经理，2015 年 3 月 18 日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理，2015 年 3 月 25 日起任广发环保指数基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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、《广发中证百度百发策略 100 指数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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他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

2015 年的 6 月，国内 A 股市场经历了前所未有的急速下跌行情，市场信心遭受冲击，抛

盘压力。上证综指从 6 月 15 日至 7 月 8 日区间累计跌幅达到 32.11%，创业板指区间累计跌幅 39.38%，跌幅之大，速度之快，史无前例。随后监管陆续推出救市政策，投资者信心逐渐恢复，市场开始企稳。

股市大跌之前刚好赶上百发 100 更换样本股，本季度前几期样本中我们基本上保持了市场中性的风格，虽然今年主要的行情以创业板风格为主，但百发 100 通过稳健的选股模型，基本上以非小盘风格的组合跟上了小盘风格的收益，实属不易。但 6 月下旬市场的运行结果远远超出市场预期，由于样本股涵盖了四成场内两融股票，三周之内指数调整幅度超过 40%。

反思这一过程，在突发的系统性风险出现以后，做为指数型基金，无奈受限于高仓位比例的限制，很难对于市场做出积极的应对。指数基金股票持仓的限制在流动性枯竭与大额赎回共振时又加剧了跟踪偏离度的幅度。同时本次市场急速下跌中，出现大面积股票停牌，以及恐慌性抛盘引起的大面积股票跌停，进而出现流动性危机。在极端行情下，我们通过控制持仓，较好的控制了跟踪误差，6 月 15 日至 7 月 10 日市场大幅波动期间，百发 100 跑赢标的指数 0.33%，偏离度较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发 100 指数基金 A 类净值增长率为 54.38%，E 类净值增长率为 54.19%，同期业绩比较基准收益率为 62.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场在国家政策救助的情况下，已经企稳。国内经济政策的调整也是不断积极向上，证券市场信心初步开始恢复。监管层将会进一步提振市场，盘活存量资金，稳定指数运行中枢，但短期内市场或将维持宽幅波动整理的行情模式。根据百发 100 运作的经验，市场风格振荡时，百发 100 选股模型优选股票会有比较良好的表现。在经历过这次大调整之后，我们对后续市场持谨慎乐观的态度，在市场企稳的前提下，预先布局后市，持续跟进新兴产业崛起的主线条，延伸多元化的题材，发挥大数据选股的优势，争取在修复行情中为投资者获取稳健收益。

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,2015 年 4 月 10 日广发百发 100 指数 A 类每 10 份基金份额分配 3.60 元,广发百发 100 指数 E 类每 10 份基金份额分配 3.60 元。截至 2015 年 6 月 30 日,广发百发 100 指数 A 类可供分配利润为 315,211,193.56 元,广发百发 100 指数 E 类可供分配利润为 495,156,759.67 元,上述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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、

投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	6.4.7.1	56,520,710.15	156,534,126.66
结算备付金		23,852,403.32	21,906,645.60
存出保证金		2,996,039.72	1,023,946.81
交易性金融资产	6.4.7.2	2,573,449,282.08	2,832,305,201.81
其中：股票投资		2,573,449,282.08	2,832,305,201.81
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		400,329,409.32	64,321,014.32
应收利息	6.4.7.5	78,454.13	85,794.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,057,226,298.72	3,076,176,729.33
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	43,603,210.74
应付赎回款		241,907,916.43	32,243,211.55
应付管理人报酬		1,600,619.84	1,336,757.35
应付托管费		320,123.95	267,351.48

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,444,735.49	1,834,340.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	840,740.42	317,657.48
负债合计		250,114,136.13	79,602,528.62
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,996,744,209.36	2,554,363,696.99
未分配利润	6.4.7.1 0	810,367,953.23	442,210,503.72
所有者权益合计		2,807,112,162.59	2,996,574,200.71
负债和所有者权益总计		3,057,226,298.72	3,076,176,729.33

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，广发百发 100 指数 A 基金份额净值人民币 1.407 元，基金份额总额 774,984,585.35 份；广发百发 100 指数 E 基金份额净值人民币 1.405 元，基金份额总额 1,221,759,624.01 份；总份额总额 1,996,744,209.36 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

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	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		1,342,681,531.48
1. 利息收入		1,156,703.40
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	1,156,703.40
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）		1,705,198,060.14
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	1,700,387,799.18
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.1	-

	4	
股利收益	6.4.7.1 5	4,810,260.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-365,093,358.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	1,420,126.66
减：二、费用		30,890,078.97
1. 管理人报酬		7,831,369.98
2. 托管费		1,566,273.95
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	20,970,257.06
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	522,177.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,311,791,452.51
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,311,791,452.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

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）	2,554,363,696.99	442,210,503.72	2,996,574,200.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,311,791,452.51	1,311,791,452.51
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）	-557,619,487.63	-287,318,120.65	-844,937,608.28
其中：1. 基金申购款	900,125,855.35	279,316,180.23	1,179,442,035.58
2. 基金赎回款	-1,457,745,342.98	-566,634,300.88	-2,024,379,643.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-656,315,882.35	-656,315,882.35

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1, 996, 744, 209. 36	810, 367, 953. 23	2, 807, 112, 162. 59

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

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2014]958 号《关于核准广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金募集的批复》核准，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《广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2014 年 10 月 30 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 10 月 20 日至 2014 年 10 月 28 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 2,396,102,218.41 元，有效认购户数为 56,929 户。其中广发百发 100 指数基金 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 1,057,619,727.17 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 165,295.16 元；广发百发 100 指数基金 E 类基金（“E 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 1,338,179,352.46 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 137,843.62 元。认购资金在募集期间产生的利息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（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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，以中证百度百发策略 100 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准：中证百度百发策略 100 指数。

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

为保证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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	56,520,710.15
定期存款	-
其他存款	-
合计	56,520,710.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2015 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,847,940,937.45	2,573,449,282.08	-274,491,655.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	2,847,940,937.45	2,573,449,282.08	-274,491,655.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	66,372.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,348.30
应收结算备付金利息	10,733.60
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	78,454.13

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,444,735.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,444,735.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	451,679.27
预提费用	208,439.10
应付指数使用费	180,622.05
合计	840,740.42

6.4.7.9 实收基金

广发百发 100 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,127,030,649.31	1,127,030,649.31
本期申购	325,017,023.50	325,017,023.50
本期赎回（以“-”号填列）	-677,063,087.46	-677,063,087.46
本期末	774,984,585.35	774,984,585.35

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

广发百发 100 指数 E

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,427,333,047.68	1,427,333,047.68
本期申购	575,108,831.85	575,108,831.85
本期赎回（以“-”号填列）	-780,682,255.52	-780,682,255.52
本期末	1,221,759,624.01	1,221,759,624.01

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

广发百发 100 指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	157,540,719.54	37,719,817.37	195,260,536.91
本期利润	665,813,571.83	-125,245,834.60	540,567,737.23
本期基金份额交易产生的变动数	-162,821,300.79	12,724,436.19	-150,096,864.60
其中：基金申购款	1,221,710.62	101,350,436.86	102,572,147.48
基金赎回款	-164,043,011.41	-88,626,000.67	-252,669,012.08
本期已分配利润	-270,520,215.98	-	-270,520,215.98
本期末	390,012,774.60	-74,801,581.04	315,211,193.56

广发百发 100 指数 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	199,162,442.10	47,787,524.71	246,949,966.81
本期利润	1,011,071,239.40	-239,847,524.12	771,223,715.28
本期基金份额交易产生的变动数	-211,687,673.39	74,466,417.34	-137,221,256.05
其中：基金申购款	1,871,319.57	174,872,713.18	176,744,032.75
基金赎回款	-213,558,992.96	-100,406,295.84	-313,965,288.80
本期已分配利润	-385,795,666.37	-	-385,795,666.37
本期末	612,750,341.74	-117,593,582.07	495,156,759.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	967,507.65
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	22,444.77
结算备付金利息收入	166,682.22
其他	68.76
合计	1,156,703.40

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,965,030,345.13
减：卖出股票成本总额	11,264,642,545.95
买卖股票差价收入	1,700,387,799.18

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,810,260.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,810,260.96

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-365,093,358.72
——股票投资	-365,093,358.72
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-365,093,358.72

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,367,968.78
手续费返还	-
基金转换费收入	52,157.88
印花税返还	-
其他	-
合计	1,420,126.66

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	20,970,257.06
银行间市场交易费用	-
合计	20,970,257.06

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	20,484.09
指数使用费	313,254.79
合计	522,177.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
兴业银行股份有限公司	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、注册登记与过户机构、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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	7,831,369.98
其中：支付销售机构的客户维护费	1,166,350.68

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	1,566,273.95

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

广发百发 100 指数 A

份额单位：份

关联方名称	广发百发100指数A本期末 2015年6月30日		广发百发100指数A上年度末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
广发期货有限公司	995,071.78	0.13%	-	-

注：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。

广发百发 100 指数 E

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。

6.4.10.5 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	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	56,520,710.15	967,507.65

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

广发百发 100 指数 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2015-04-10	-	2015-04-10	3.600	140,172,056.59	130,348,159.39	270,520,215.98	-
合计				3.600	140,172,056.59	130,348,159.39	270,520,215.98	-

广发百发 100 指数 E

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2015-04-10	-	2015-04-10	3.600	131,982,718.84	253,812,947.53	385,795,666.37	-
合计				3.600	131,982,718.84	253,812,947.53	385,795,666.37	-

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
000510	*ST 金路	2015-01-19	重大事项	9.13	2015-06-24	6.09	4,407,200.00	25,675,560.92	40,237,736.00	注
000534	万泽股份	2015-04-14	重大事项	16.75	2015-07-17	14.36	2,495,738.00	24,536,332.31	41,803,611.50	-
000882	华联股份	2015-06-04	重大事项	8.78	-	-	4,876,300.00	31,482,198.67	42,813,914.00	-
000932	华菱钢铁	2015-05-14	重大事项	4.71	2015-07-16	4.24	1.00	3.80	4.71	-
002043	兔宝宝	2015-06-01	重大事项	11.51	-	-	3,424,400.00	28,854,723.73	39,414,844.00	-
002110	三钢闽光	2015-04-01	重大事项	9.61	-	-	2,718,542.00	23,630,430.04	26,125,188.62	-
002404	嘉欣丝绸	2015-06-10	重大事项	12.14	2015-07-23	12.93	2,968,700.00	32,884,325.32	36,040,018.00	-
002530	丰东股份	2015-06-08	重大事项	16.69	-	-	2,286,456.00	35,877,250.72	38,160,950.64	-
002632	道明光学	2015-06-30	重大事项	23.73	2015-07-14	24.75	53.00	1,137.50	1,257.69	-
600186	莲花味精	2015-05-21	重大事项	10.46	-	-	4,178,100.00	36,788,187.22	43,702,926.00	-
600202	哈空调	2015-06-15	重大事项	14.79	-	-	2,239,097.00	30,775,778.19	33,116,244.63	-
600212	江泉实业	2015-05-25	重大事项	12.24	-	-	3,443,978.00	33,803,252.69	42,154,290.72	-
600408	*ST 安泰	2015-04-24	重大事项	6.16	-	-	6,186,088.00	30,664,240.90	38,106,302.08	-
600654	中安消	2015-06-29	重大事项	30.91	-	-	1,023,997.00	42,263,293.47	31,651,747.27	-
601216	内蒙君正	2015-06-29	重大事项	24.07	2015-07-02	24.20	71.00	1,766.22	1,708.97	-
603118	共进股份	2015-06-30	重大事项	45.39	2015-07-13	45.39	664,345.00	37,137,816.12	30,154,619.55	-

注：此停牌股票在期末虽已复牌但交易仍不活跃，因此未采用市价估值。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念, 在董事会下设立合规及风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息, 或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降, 将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险, 本基金主要投资于信用等级较高的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。但是, 随着短期资金市场的发展, 本基金的投资范围扩大以后, 可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司, 违约风险较小; 银行间同业市场主要通过对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资, 因此与债券相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求, 在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足, 导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险, 或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则, 在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 除附注 7.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外, 本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约约定到期日均为无固定期限且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上, 由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法, 由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标, 从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响, 导致基金收益水平变化而产生的风险, 反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲, 市场风险是开放式基金面临的重大风险, 也往往是众多风险中最基本和最常见的, 也是最难防范的风险, 其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率

风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	56,520,710.15	-	-	-	56,520,710.15
结算备付金	23,852,403.32	-	-	-	23,852,403.32
存出保证金	2,996,039.72	-	-	-	2,996,039.72
交易性金融资产	-	-	-	2,573,449,282.08	2,573,449,282.08
应收证券清算款	-	-	-	400,329,409.32	400,329,409.32
应收利息	-	-	-	78,454.13	78,454.13
资产总计	83,369,153.19	-	-	2,973,857,145.53	3,057,226,298.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	241,907,916.43	241,907,916.43
应付管理人报酬	-	-	-	1,600,619.84	1,600,619.84
应付托管费	-	-	-	320,123.95	320,123.95
应付交易费用	-	-	-	5,444,735.49	5,444,735.49
其他负债	-	-	-	840,740.42	840,740.42
负债总计	-	-	-	250,114,136.13	250,114,136.13
利率敏感度缺口	83,369,153.19	-	-	-2,723,743,009.40	2,807,112,166.59
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	156,534,126.66	-	-	-	156,534,126.66
结算备付金	21,906,645.60	-	-	-	21,906,645.60
存出保证金	1,023,946.81	-	-	-	1,023,946.81
交易性金融资产	-	-	-	2,832,305,201.81	2,832,305,201.81
应收证券清算款	-	-	-	64,321,014.32	64,321,014.32
应收利息	-	-	-	85,794.13	85,794.13
资产总计	179,464,719.07	-	-	2,896,712,010.26	3,076,176,729.33
负债					
应付证券清算款	-	-	-	43,603,210.74	43,603,210.74
应付赎回款	-	-	-	32,243,211.55	32,243,211.55
应付管理人报酬	-	-	-	1,336,757.35	1,336,757.35
应付托管费	-	-	-	267,351.48	267,351.48
应付交易费用	-	-	-	1,834,340.02	1,834,340.02
其他负债	-	-	-	317,657.48	317,657.48
负债总计	-	-	-	79,602,528.62	79,602,528.62
利率敏感度缺口	179,464,719.07	-	-	2,817,109,481.64	2,996,574,200.71

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2015 年 6 月 30 日		2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,573,449,282.08	91.68	2,832,305,201.81	94.52
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,573,449,282.08	91.68	2,832,305,201.81	94.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	122,820,188.01	135,174,320.24
	业绩比较基准下降 5%	-122,820,188.01	-135,174,320.24

6.4.14 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

2,089,963,917.70 元,属于第二层级的余额为 483,485,364.38 元,无属于第三层级的余额(2014 年 12 月 31 日:第一层级 2,807,605,810.35 元,第二层级 24,699,391.46 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	2,573,449,282.08	84.18
	其中:股票	2,573,449,282.08	84.18
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	80,373,113.47	2.63
7	其他各项资产	403,403,903.17	13.20

8	合计	3,057,226,298.72	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	18,013,235.34	0.64
B	采矿业	25,858,094.72	0.92
C	制造业	1,728,827,806.37	61.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	213,655,090.01	7.61
E	建筑业	41,403,562.75	1.47
F	批发和零售业	122,112,731.41	4.35
G	交通运输、仓储和邮政业	147,691,264.75	5.26
H	住宿和餐饮业	1,410.75	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,109,897.20	0.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	177,161,635.38	6.31
L	租赁和商务服务业	16,262,010.89	0.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,197,717.51	0.65
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	42,154,825.00	1.50
	合计	2,573,449,282.08	91.68

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600726	华电能源	3,455,293	44,849,703.14	1.60
2	600186	莲花味精	4,178,100	43,702,926.00	1.56
3	000882	华联股份	4,876,300	42,813,914.00	1.53
4	600212	江泉实业	3,443,978	42,154,290.72	1.50
5	000534	万泽股份	2,495,738	41,803,611.50	1.49
6	000510	*ST 金路	4,407,200	40,237,736.00	1.43
7	002043	兔 宝 宝	3,424,400	39,414,844.00	1.40
8	002530	丰东股份	2,286,456	38,160,950.64	1.36
9	600408	安泰集团	6,186,088	38,106,302.08	1.36
10	000690	宝新能源	2,886,403	36,512,997.95	1.30
11	002404	嘉欣丝绸	2,968,700	36,040,018.00	1.28
12	600396	金山股份	2,830,100	36,027,173.00	1.28
13	600005	武钢股份	4,800,723	33,749,082.69	1.20
14	002284	亚太股份	1,322,225	33,227,514.25	1.18
15	600202	哈空调	2,239,097	33,116,244.63	1.18
16	600682	南京新百	851,030	31,939,155.90	1.14
17	600268	国电南自	2,157,919	31,656,671.73	1.13
18	600654	中安消	1,023,997	31,651,747.27	1.13
19	600236	桂冠电力	2,799,907	31,246,962.12	1.11
20	600812	华北制药	2,542,422	30,865,003.08	1.10
21	002132	恒星科技	2,728,069	30,718,056.94	1.09
22	603118	共进股份	664,345	30,154,619.55	1.07
23	000751	锌业股份	2,932,518	30,087,634.68	1.07
24	600298	安琪酵母	856,759	29,798,078.02	1.06
25	600448	华纺股份	2,340,559	28,976,120.42	1.03
26	600317	营口港	4,518,804	28,468,465.20	1.01
27	600963	岳阳林纸	2,837,300	28,401,373.00	1.01
28	600118	中国卫星	495,050	28,198,048.00	1.00
29	002540	亚太科技	1,891,359	27,424,705.50	0.98
30	600663	陆家嘴	550,866	27,400,074.84	0.98
31	600017	日照港	3,297,901	26,745,977.11	0.95
32	600628	新世界	1,586,811	26,579,084.25	0.95
33	000572	海马汽车	3,132,792	26,284,124.88	0.94
34	600684	珠江实业	1,819,500	26,164,410.00	0.93
35	002110	三钢闽光	2,718,542	26,125,188.62	0.93
36	002151	北斗星通	513,299	26,101,254.15	0.93
37	601880	大连港	3,614,642	26,025,422.40	0.93
38	600353	旭光股份	1,099,511	25,882,488.94	0.92
39	000682	东方电子	3,138,691	25,862,813.84	0.92
40	600157	永泰能源	3,758,183	25,856,299.04	0.92
41	300088	长信科技	931,812	25,624,830.00	0.91
42	002008	大族激光	885,139	25,421,192.08	0.91

43	002135	东南网架	2,081,976	25,400,107.20	0.90
44	600653	申华控股	3,156,545	25,378,621.80	0.90
45	600169	太原重工	2,821,666	25,112,827.40	0.89
46	600876	洛阳玻璃	1,250,756	24,952,582.20	0.89
47	002160	常铝股份	1,863,589	24,916,184.93	0.89
48	000027	深圳能源	2,015,769	24,894,747.15	0.89
49	300111	向日葵	3,128,200	24,775,344.00	0.88
50	600131	岷江水电	2,272,462	24,678,937.32	0.88
51	002300	太阳电缆	2,136,459	24,654,736.86	0.88
52	600460	士兰微	2,657,653	24,530,137.19	0.87
53	000755	山西三维	2,271,297	24,166,600.08	0.86
54	002339	积成电子	721,405	24,094,927.00	0.86
55	600601	方正科技	2,646,918	24,086,953.80	0.86
56	601018	宁波港	2,672,526	23,625,129.84	0.84
57	300049	福瑞股份	261,190	23,504,488.10	0.84
58	002161	远望谷	1,070,104	23,285,463.04	0.83
59	300132	青松股份	2,038,103	23,091,706.99	0.82
60	601008	连云港	2,436,266	23,071,439.02	0.82
61	600081	东风科技	1,084,031	22,992,297.51	0.82
62	002014	永新股份	949,033	22,985,579.26	0.82
63	002133	广宇集团	2,282,152	22,981,270.64	0.82
64	000880	潍柴重机	1,043,974	22,497,639.70	0.80
65	000529	广弘控股	1,407,924	22,484,546.28	0.80
66	002337	赛象科技	1,733,413	22,447,698.35	0.80
67	601106	中国一重	1,831,642	22,181,184.62	0.79
68	002642	荣之联	386,851	22,108,534.65	0.79
69	002342	巨力索具	2,292,311	21,708,185.17	0.77
70	002487	大金重工	1,634,856	21,580,099.20	0.77
71	002068	黑猫股份	2,149,987	21,112,872.34	0.75
72	600321	国栋建设	2,706,045	20,701,244.25	0.74
73	600117	西宁特钢	2,045,193	20,595,093.51	0.73
74	000753	漳州发展	2,531,347	20,579,851.11	0.73
75	000985	大庆华科	796,817	20,510,069.58	0.73
76	000636	风华高科	1,631,919	20,366,349.12	0.73
77	300201	海伦哲	1,264,716	20,108,984.40	0.72
78	600789	鲁抗医药	1,223,000	19,898,210.00	0.71
79	600834	申通地铁	939,250	19,752,427.50	0.70
80	002193	山东如意	814,315	19,380,697.00	0.69
81	600360	华微电子	1,926,250	18,607,575.00	0.66
82	002641	永高股份	1,942,436	18,569,688.16	0.66
83	600054	黄山旅游	818,569	18,196,788.87	0.65
84	002610	爱康科技	1,308,269	18,184,939.10	0.65
85	002442	龙星化工	1,423,089	18,115,922.97	0.65
86	600540	新赛股份	1,338,279	18,013,235.34	0.64

87	002291	星期六	1,047,552	17,965,516.80	0.64
88	601116	三江购物	1,267,174	17,626,390.34	0.63
89	600129	太极集团	624,168	16,989,852.96	0.61
90	002452	长高集团	1,611,613	16,744,659.07	0.60
91	600488	天药股份	1,713,497	16,603,785.93	0.59
92	600178	东安动力	1,372,125	16,520,385.00	0.59
93	300045	华力创通	888,936	16,338,643.68	0.58
94	600057	象屿股份	1,147,577	16,261,166.09	0.58
95	002293	罗莱家纺	896,230	16,212,800.70	0.58
96	002314	雅致股份	1,248,143	16,001,193.26	0.57
97	002305	南国置业	1,965,370	15,998,111.80	0.57
98	601700	风范股份	1,463,188	15,714,639.12	0.56
99	600758	红阳能源	954,328	15,441,027.04	0.55
100	002115	三维通信	1,006,656	15,089,773.44	0.54
101	002548	金新农	933,239	14,791,838.15	0.53
102	600573	惠泉啤酒	1,062,578	14,631,699.06	0.52
103	002640	跨境通	51	3,541.44	0.00
104	002616	长青集团	117	3,474.90	0.00
105	600827	百联股份	134	2,788.54	0.00
106	600276	恒瑞医药	60	2,672.40	0.00
107	000410	沈阳机床	105	2,654.40	0.00
108	002256	彩虹精化	119	2,627.52	0.00
109	600836	界龙实业	94	2,290.78	0.00
110	600227	赤天化	174	2,032.32	0.00
111	000603	盛达矿业	72	1,795.68	0.00
112	601216	内蒙君正	71	1,708.97	0.00
113	600021	上海电力	80	1,688.00	0.00
114	002324	普利特	46	1,596.20	0.00
115	000419	通程控股	145	1,592.10	0.00
116	600093	禾嘉股份	84	1,537.20	0.00
117	600818	中路股份	20	1,455.60	0.00
118	002652	扬子新材	94	1,452.30	0.00
119	000800	一汽轿车	53	1,318.64	0.00
120	002421	达实智能	64	1,281.92	0.00
121	002632	道明光学	53	1,257.69	0.00
122	000876	新希望	59	1,145.19	0.00
123	002491	通鼎互联	63	1,144.08	0.00
124	002062	宏润建设	95	1,085.85	0.00
125	600853	龙建股份	97	989.40	0.00
126	002532	新界泵业	50	982.50	0.00
127	600898	三联商社	54	953.64	0.00
128	000721	西安饮食	67	874.35	0.00
129	600138	中青旅	40	844.80	0.00
130	000875	吉电股份	65	825.50	0.00

131	600749	西藏旅游	43	816.57	0.00
132	600125	铁龙物流	52	802.36	0.00
133	601010	文峰股份	77	752.29	0.00
134	600242	中昌海运	59	729.24	0.00
135	002495	佳隆股份	69	719.67	0.00
136	601991	大唐发电	90	718.20	0.00
137	600896	中海海盛	44	708.84	0.00
138	002451	摩恩电气	40	625.60	0.00
139	002263	大东南	56	607.60	0.00
140	600754	锦江股份	18	536.40	0.00
141	000931	中关村	38	534.28	0.00
142	600022	山东钢铁	76	441.56	0.00
143	002087	新野纺织	47	399.03	0.00
144	600105	永鼎股份	16	364.16	0.00
145	600303	曙光股份	40	356.80	0.00
146	600617	国新能源	17	310.59	0.00
147	600006	东风汽车	22	278.96	0.00
148	600215	长春经开	20	217.40	0.00
149	600512	腾达建设	28	187.04	0.00
150	600808	马钢股份	34	180.88	0.00
151	600156	华升股份	14	165.20	0.00
152	600020	中原高速	22	163.24	0.00
153	600851	海欣股份	9	113.94	0.00
154	300172	中电环保	7	112.07	0.00
155	000063	中兴通讯	4	95.24	0.00
156	600050	中国联通	11	80.63	0.00
157	002130	沃尔核材	3	59.94	0.00
158	002318	久立特材	1	52.38	0.00
159	000540	中天城投	2	25.20	0.00
160	000932	华菱钢铁	1	4.71	0.00

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	600317	营口港	98,068,921.01	3.27
2	600726	华电能源	74,022,184.99	2.47
3	601018	宁波港	72,431,196.50	2.42
4	000931	中关村	68,279,689.18	2.28
5	000572	海马汽车	67,830,436.74	2.26

6	600601	方正科技	67,659,758.15	2.26
7	600812	华北制药	67,481,912.82	2.25
8	601880	大连港	66,885,876.78	2.23
9	600005	武钢股份	65,895,533.37	2.20
10	601008	连云港	65,393,999.77	2.18
11	600169	太原重工	65,372,639.21	2.18
12	600653	申华控股	65,190,743.10	2.18
13	000063	中兴通讯	64,855,554.93	2.16
14	300111	向日葵	64,788,108.45	2.16
15	002263	大东南	62,381,329.02	2.08
16	600236	桂冠电力	61,478,371.19	2.05
17	002135	东南网架	61,123,661.00	2.04
18	600321	国栋建设	60,870,157.71	2.03
19	002284	亚太股份	60,712,218.66	2.03
20	600033	福建高速	60,652,576.78	2.02

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	002318	久立特材	90,637,509.65	3.02
2	600853	龙建股份	84,636,520.22	2.82
3	002263	大东南	83,943,892.81	2.80
4	600105	永鼎股份	82,615,365.25	2.76
5	002062	宏润建设	80,900,291.59	2.70
6	601390	中国中铁	77,344,283.10	2.58
7	000709	河北钢铁	76,093,055.90	2.54
8	000931	中关村	73,877,112.43	2.47
9	601186	中国铁建	71,299,943.68	2.38
10	600808	马钢股份	70,918,003.12	2.37
11	600016	民生银行	67,609,744.52	2.26
12	600317	营口港	66,079,313.77	2.21
13	000876	新希望	65,707,053.55	2.19
14	002421	达实智能	65,668,388.24	2.19
15	002451	摩恩电气	65,426,326.97	2.18
16	600104	上汽集团	65,068,634.88	2.17
17	000533	万家乐	64,872,356.58	2.16

18	600863	内蒙华电	64,811,935.22	2.16
19	000875	吉电股份	64,539,175.72	2.15
20	002698	博实股份	62,010,275.20	2.07
21	600012	皖通高速	61,130,633.68	2.04
22	600020	中原高速	60,612,762.95	2.02
23	600106	重庆路桥	60,511,917.47	2.02
24	000063	中兴通讯	60,340,058.57	2.01
25	600308	华泰股份	59,985,014.95	2.00

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

买入股票的成本（成交）总额	11,370,879,984.94
卖出股票的收入（成交）总额	12,965,030,345.13

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所有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 山西安泰集团股份有限公司（股票代码：600408）于 2015 年 5 月 19 日收到中国证券监督管理委员会山西监管局的调查通知书，因公司涉嫌信息披露违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对公司立案调查。

本基金投资该公司的主要原因是：1、公司对上游焦煤行业的积极延伸，预计将是未来公司走出困境的在公司层面的关键。通过向焦煤资源延伸，一方面有利于保障 公司焦煤供应，另一方面将会给公司带来可观的投资收益；2、我们认为焦炭行业将会逐步走出谷底，核心理由是 我们预计山西省今年将明显加大焦炭行业的整合力度。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

7.12.2 本报告期内，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	2,996,039.72
2	应收证券清算款	400,329,409.32
3	应收股利	-
4	应收利息	78,454.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	403,403,903.17

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	600186	莲花味精	43,702,926.00	1.56	重大事项
2	000882	华联股份	42,813,914.00	1.53	重大事项
3	600212	江泉实业	42,154,290.72	1.50	重大事项
4	000534	万泽股份	41,803,611.50	1.49	重大事项
5	000510	*ST 金路	40,237,736.00	1.43	重大事项 (注)
6	002043	兔宝宝	39,414,844.00	1.40	重大事项
7	002530	丰东股份	38,160,950.64	1.36	重大事项
8	600408	*ST 安泰	38,106,302.08	1.36	重大事项

注：此停牌股票在期末虽已复牌但交易仍不活跃，因此未采用市价估值。

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
广发百发 100 指数 A	27,231	28,459.64	28,514,786.99	3.68%	746,469,798.36	96.32%
广发百发 100 指数 E	50,033	24,419.08	84,722,884.06	6.93%	1,137,036,739.95	93.07%
合计	77,264	25,843.14	113,237,671.05	5.67%	1,883,506,538.31	94.33%

8.2 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	广发百发 100 指数 A	224,828.18	0.0290%
	广发百发 100 指数 E	7,932,550.08	0.6493%
	合计	8,157,378.26	0.4085%

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	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	广发百发 100 指数 A	0
	广发百发 100 指数 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发百发 100 指数 A	0
	广发百发 100 指数 E	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
基金合同生效日（2014 年 10 月 30 日）基金份额总额	1,057,785,022.33	1,338,317,196.08
本报告期期初基金份额总额	1,127,030,649.31	1,427,333,047.68
本报告期基金总申购份额	325,017,023.50	575,108,831.85
减：本报告期基金总赎回份额	677,063,087.46	780,682,255.52
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	774,984,585.35	1,221,759,624.01

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。

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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

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	
中信证券	2	8,095,702,468.83	33.27%	1,703,314.20	33.27%	-
兴业证券	2	7,022,529,713.28	28.86%	1,477,540.68	28.86%	-
东北证券	2	5,251,712,879.23	21.58%	1,104,967.85	21.58%	-
中投证券	2	3,965,938,828.73	16.30%	834,439.67	16.30%	-

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 and 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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金 A 类份额比例配售的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-16
2	广发基金管理有限公司关于广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金 E 类份额比例配售的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-15
3	广发基金管理有限公司关于广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金恢复申购公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-08
4	广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2015-04-08

注：无

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日