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:二〇一四年八月二十九日

# 广发大盘成长混合型证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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 | 广发大盘成长混合 | |
| 基金主代码 | 270007 | |
| 交易代码 | 270007(前端) | 270017(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2007年6月13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 | 9,862,534,828.47份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过投资于成长性较好的大市值公司股票,追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过“自下而上”为主的股票分析流程,以成长性分析为重点,对大市值公司的基本面进行科学、全面的考察,挖掘投资机会,构建股票投资组合;通过利率预测、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析进行债券投资;同时严格遵守有关权证投资的比例限制。 |
| 业绩比较基准 | 75%×沪深300指数+25%×上证国债指数 |
| 风险收益特征 | 较高风险,较高收益 |

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 | 赵会军 |
| | 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(2014年1月1日至2014年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 400,816,781.05 |
| 本期利润 | -399,240,367.89 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0390 |
| 本期基金份额净值增长率 | -5.55% |
| 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 | -0.3418 |
| 期末基金资产净值 | 6,491,431,846.93 |
| 期末基金份额净值 | 0.6582 |

注:(1)上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(不含公允价值变动损益)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 | 1.89% | 0.65% | 0.39% | 0.59% | 1.50% | 0.06% |
| 过去三个月 | 1.72% | 0.73% | 0.92% | 0.66% | 0.80% | 0.07% |
| 过去六个月 | -5.55% | 0.92% | -4.86% | 0.78% | -0.69% | 0.14% |
| 过去一年 | 10.49% | 0.97% | -0.50% | 0.88% | 10.99% | 0.09% |
| 过去三年 | -23.84% | 1.27% | -19.04% | 0.97% | -4.80% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | -34.18% | 1.56% | -27.58% | 1.40% | -6.60% | 0.16% |

注:1.业绩比较基准:75%×沪深300指数+25%×上证国债指数。

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

广发大盘成长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

(2007年6月13日至2014年6月30日)

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大盘成长混合型证券投资基金2014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:广发大盘成长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 | 1,492,015,742.63 | 1,589,845,119.87 |
| 结算备付金 | 1,817,389.37 | 2,295,522.03 |
| 存出保证金 | 917,876.14 | 1,196,944.16 |
| 交易性金融资产 | 4,702,122,825.00 | 5,499,446,147.11 |
| 其中:股票投资 | 4,702,122,825.00 | 5,499,446,147.11 |
| 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 | 299,900,849.85 | 895,752,011.23 |
| 应收证券清算款 | 19,851,296.71 | - |
| 应收利息 | 366,514.72 | 337,000.89 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 119,903.44 | 10,906,199.56 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 6,517,112,397.86 | 7,999,778,944.85 |

| 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 | 1,458,053.52 | 428,828,380.71 |
| 应付赎回款 | 9,898,066.04 | 7,220,503.85 |
| 应付管理人报酬 | 7,925,803.84 | 9,510,299.99 |
| 应付托管费 | 1,320,967.31 | 1,585,050.02 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 3,782,775.19 | 4,681,791.58 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,294,885.03 | 1,249,374.48 |
| 负债合计 | 25,680,550.93 | 453,075,400.63 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 9,862,534,828.47 | 10,828,240,653.08 |
| 未分配利润 | -3,371,102,981.54 | -3,281,537,108.86 |
| 所有者权益合计 | 6,491,431,846.93 | 7,546,703,544.22 |
| 负债和所有者权益总计 | 6,517,112,397.86 | 7,999,778,944.85 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值人民币0.6582元,基金份额总额9,862,534,828.47份。

6.2 利润表

会计主体:广发大盘成长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 | -333,456,220.19 | 377,406,065.22 |
| 1.利息收入 | 16,899,429.82 | 18,410,949.32 |
| 其中:存款利息收入 | 4,276,803.72 | 5,356,197.58 |
| 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 | 12,622,626.10 | 13,054,751.74 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 449,364,737.96 | -74,315,652.64 |
| 其中:股票投资收益 | 377,931,183.58 | -126,111,780.44 |
| 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 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 71,433,554.38 | 51,796,127.80 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -800,057,148.94 | 433,041,083.69 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 336,760.97 | 269,684.85 |
| 减:二、费用 | 65,784,147.70 | 75,791,972.57 |
| 1.管理人报酬 | 50,657,821.72 | 51,681,904.94 |
| 2.托管费 | 8,442,970.28 | 8,613,650.92 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 6,459,038.74 | 15,274,697.13 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 224,316.96 | 221,719.58 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -399,240,367.89 | 301,614,092.65 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -399,240,367.89 | 301,614,092.65 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发大盘成长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) | 10,828,240,653.08 | -3,281,537,108.86 | 7,546,703,544.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -399,240,367.89 | -399,240,367.89 |
| 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) | -965,705,824.61 | 309,674,495.21 | -656,031,329.40 |
| 其中:1.基金申购款 | 60,976,533.32 | -19,715,525.01 | 41,261,008.31 |
| 2.基金赎回款 | -1,026,682,357.93 | 329,390,020.22 | -697,292,337.71 |
| 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) | 9,862,534,828.47 | -3,371,102,981.54 | 6,491,431,846.93 |

| 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) | 11,863,674,098.34 | -5,087,496,445.70 | 6,776,177,652.64 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 301,614,092.65 | 301,614,092.65 |
| 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) | -683,708,223.25 | 265,839,559.92 | -417,868,663.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 155,536,320.16 | -64,064,101.09 | 91,472,219.07 |
| 2.基金赎回款 | -839,244,543.41 | 329,903,661.01 | -509,340,882.40 |
| 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) | 11,179,965,875.09 | -4,520,042,793.13 | 6,659,923,081.96 |

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

广发大盘成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经证监基金字[2007]158号文《关于同意广发大盘成长混合型证券投资基金募集的批复》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《广发大盘成长混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2007年6月13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。本基金已向中国证券监督管理委员会备案,并获中国证监会基金部函[2007]153号《关于广发大盘成长混合型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2007年6月11日一天,本基金为契约型开放式混合型基金,存续期限不定,首次募集资金为人民币14,851,700,203.40元,有效认购户数为608,933户。其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币0元,利息结转的基金份额0份,按照基金合同的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于2007年6月13日生效,基金合同生效日的基金份额总额为14,851,700,203.40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》等有关规定和基金合同的有关规定,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。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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采用:75%×沪深300指数收益+25%×上证国债指数收益。

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

本报告期内不存在控制关系或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 |
|---|---|
| 中国工商银行股份有限公司 | 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 | 34,759,000.00 | 0.83% | 572,666,344.19 | 5.62% |

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 | 32,370.36 | 0.87% | 32,370.36 | 0.86% |

| 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 | 521,669.22 | 5.85% | 120,335.51 | 1.29% |

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 | 50,657,821.72 | 51,681,904.94 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 8,043,111.06 | 7,939,242.23 |

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2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。

6.4.8.2.2 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 | 8,442,970.28 | 8,613,650.92 |

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2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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,492,015,742.63 | 4,230,566.89 | 799,987,786.48 | 5,262,539.67 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002727 | 一心堂 | 2014-06-25 | 2014-07-02 | 新股流通受限 | 12.20 | 12.20 | 34,975.00 | 426,695.00 | 426,695.00 | - |
| 002321 | 华英农业 | 2013-07-04 | 2014-07-07 | 非公开发行流通受限 | 4.65 | 5.45 | 6,600,000.00 | 30,690,000.00 | 35,970,000.00 | - |

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和权证。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金无暂时停牌的流通受限股票。

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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 | 4,702,122,825.00 | 72.15 |
| | 其中:股票 | 4,702,122,825.00 | 72.15 |
| 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 | 299,900,849.85 | 4.60 |
| | 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 | 1,493,833,132.00 | 22.92 |
| 7 | 其他各项资产 | 21,255,591.01 | 0.33 |
| 8 | 合计 | 6,517,112,397.86 | 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 | 558,697,372.23 | 8.61 |
| B | 采矿业 | 440,833,503.69 | 6.79 |
| C | 制造业 | 3,590,696,254.08 | 55.31 |
| 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 | 1,690,695.00 | 0.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,456,000.00 | 0.02 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,755,000.00 | 0.03 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 105,156,000.00 | 1.62 |
| 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 | 1,838,000.00 | 0.03 |
| | 合计 | 4,702,122,825.00 | 72.44 |

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 | 002152 | 广电运通 | 28,200,640 | 480,538,905.60 | 7.40 |
| 2 | 000876 | 新希望 | 29,600,760 | 334,192,580.40 | 5.15 |
| 3 | 601808 | 中海油服 | 17,901,199 | 314,882,090.41 | 4.85 |
| 4 | 600309 | 万华化学 | 20,150,000 | 305,474,000.00 | 4.71 |
| 5 | 002470 | 金正大 | 15,028,635 | 288,399,505.65 | 4.44 |
| 6 | 002299 | 圣农发展 | 23,594,427 | 273,459,408.93 | 4.21 |
| 7 | 600066 | 宇通客车 | 16,101,726 | 259,881,857.64 | 4.00 |
| 8 | 600085 | 同仁堂 | 14,430,726 | 251,527,554.18 | 3.87 |
| 9 | 000729 | 燕京啤酒 | 37,201,463 | 241,809,509.50 | 3.73 |
| 10 | 600660 | 福耀玻璃 | 25,300,086 | 212,520,722.40 | 3.27 |

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 | 600660 | 福耀玻璃 | 188,880,628.42 | 2.50 |
| 2 | 600309 | 万华化学 | 155,880,149.24 | 2.07 |
| 3 | 002250 | 联化科技 | 130,387,293.29 | 1.73 |
| 4 | 000513 | 丽珠集团 | 110,661,395.50 | 1.47 |
| 5 | 000729 | 燕京啤酒 | 103,252,662.41 | 1.37 |
| 6 | 601808 | 中海油服 | 99,476,101.82 | 1.32 |
| 7 | 002032 | 苏泊尔 | 97,319,583.80 | 1.29 |
| 8 | 601877 | 正泰电器 | 76,968,397.43 | 1.02 |
| 9 | 600085 | 同仁堂 | 76,549,177.38 | 1.01 |
| 10 | 000876 | 新希望 | 74,374,077.16 | 0.99 |
| 11 | 002666 | 德联集团 | 72,454,843.28 | 0.96 |
| 12 | 600066 | 宇通客车 | 71,483,424.38 | 0.95 |
| 13 | 600079 | 人福医药 | 65,520,856.01 | 0.87 |
| 14 | 600583 | 海油工程 | 61,740,562.04 | 0.82 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥 | 42,599,379.04 | 0.56 |
| 16 | 600050 | 中国联通 | 38,980,000.00 | 0.52 |
| 17 | 002299 | 圣农发展 | 34,851,567.32 | 0.46 |
| 18 | 002572 | 索菲亚 | 34,759,000.00 | 0.46 |
| 19 | 002477 | 雏鹰农牧 | 31,848,151.45 | 0.42 |
| 20 | 601100 | 恒立油缸 | 31,673,667.79 | 0.42 |

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 | 000333 | 美的集团 | 234,775,901.54 | 3.11 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 189,356,444.74 | 2.51 |
| 3 | 002065 | 东华软件 | 161,438,813.59 | 2.14 |
| 4 | 601117 | 中国化学 | 154,217,828.67 | 2.04 |
| 5 | 601965 | 中国汽研 | 152,144,451.93 | 2.02 |
| 6 | 002312 | 三泰电子 | 92,423,379.64 | 1.22 |
| 7 | 002470 | 金正大 | 91,393,932.62 | 1.21 |
| 8 | 600252 | 中恒集团 | 89,108,921.01 | 1.18 |
| 9 | 300015 | 爱尔眼科 | 84,877,412.35 | 1.12 |
| 10 | 601158 | 重庆水务 | 80,853,548.27 | 1.07 |
| 11 | 600332 | 白云山 | 72,216,351.25 | 0.96 |
| 12 | 002223 | 鱼跃医疗 | 65,895,616.52 | 0.87 |
| 13 | 002308 | 威创股份 | 63,164,466.43 | 0.84 |
| 14 | 300119 | 瑞普生物 | 56,664,913.99 | 0.75 |
| 15 | 601799 | 星宇股份 | 52,663,398.34 | 0.70 |
| 16 | 600315 | 上海家化 | 51,080,075.70 | 0.68 |
| 17 | 002324 | 普利特 | 49,106,348.89 | 0.65 |
| 18 | 600585 | 海螺水泥 | 41,130,152.04 | 0.55 |
| 19 | 300012 | 华测检测 | 40,609,414.14 | 0.54 |
| 20 | 300118 | 东方日升 | 37,870,412.40 | 0.50 |

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 | 1,896,741,129.64 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 2,271,938,486.39 |

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 | 917,876.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | 19,851,296.71 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 366,514.72 |
| 5 | 应收申购款 | 119,903.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,255,591.01 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 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 |
| 470,898 | 20,944.10 | 208,370,840.46 | 2.11% | 9,654,163,988.01 | 97.89% |

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 | 500,194.22 | 0.0051% |

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(2007年6月13日)基金份额总额 | 14,851,700,203.40 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,828,240,653.08 |
| 本报告期基金总申购份额 | 60,976,533.32 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,026,682,357.93 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 9,862,534,828.47 |

## 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。

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称“本行”)工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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