

广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金

2015 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: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
1.1 基金管理人和基金托管人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、完整性承担责任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。
基金管理人和基金托管人承诺根据本基金合同的规定，在开始发售前至少三个工作日内将基金招募说明书及其摘要、基金托管人入会公告、基金合同、基金托管协议、基金托管人报告等文件，通过报刊媒介公告，向公众披露。
基金托管人入会公告由基金托管人根据本基金合同的规定，在开始发售前至少三个工作日内将基金招募说明书及其摘要、基金托管人报告等文件，通过报刊媒介公告，向公众披露。
基金管理人和基金托管人根据本基金合同的规定，在开始发售前至少三个工作日内将基金招募说明书及其摘要、基金托管人报告等文件，通过报刊媒介公告，向公众披露。

本半年度报告摘要须摘录半年度报告正文，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2015年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

基金简称	广发百发100指数
基金代码	000626
交易代码	000626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1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
报告期末基金资产总额	1,906,744,203,078
基金份额的折算	不适用
下一级分类基金的基金简称	广发百发100指数A
下一级分类基金的交易代码	000626
报告期末下属分级基金的份额总额	1,221,759,630,401份

2.1 基金基本情况

基金简称	广发百发100指数
基金代码	000626
交易代码	000626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1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
报告期末基金资产总额	1,906,744,203,078
基金份额的折算	不适用

下一级分类基金的基金简称

广发百发100指数A

下一级分类基金的交易代码

000626

报告期末下属分级基金的份额总额

774,984,563,676份

2.2 基金产品说明

本基金是由被选为行业代表，通过行业投资评价方法和量化风险调整理论，力图在行业中寻找具有稳定增长潜力的股票，同时降低组合中的行业集中度，以实现较低的波动率。

投资目标

本基金为指数基金，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指数中的权重比例构建投资组合。

业绩比较基准

本基金业绩比较基准为90%×中证百度百发策略100指数收益率+10%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，风险收益特征高于混合型基金，债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要投资于标的指数的成份股，投资风格偏向于被动投资。

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

姓名 张光华

信息披露负责人 联系电话 020-83060666 021-62677777-12004

电子邮箱 dxy@fundsf.com.cn zhanglei@xyzq.com.cn

客户服务电话 95102828 029-83090999 95561

传真 020-8909158 021-62150217

2.4 信息披露方

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 http://www.gffund.com.cn

基金半年度报告披露地点 广州市海珠区隧道大道东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

金额单位:人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

广发百发100指数A 基金份额 666,813,571,933 1,011,071,239,40

本期已实现收益 540,567,716,232 771,223,716,28

加权平均基金份额本期利润 0.05909 0.05742

本期基金份额净值增长率 54.38% 54.19%

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减去费用。(3)未分配利润扣除非期初应付利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。(4)期间费用不包含利息收入。

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 每万份基金单位净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 -11.73% 4.06% -0.66% -1.87% 0.36%

过去三个月 10.22% 3.02% 24.17% 2.79% -4.96% 0.23%

过去六个月 54.38% 2.43% 62.40% 2.26% -8.11% 0.17%

自基金合同生效以来 81.09% 2.23% 95.44% 2.12% -14.35% 0.11%

注:(1)本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减去费用。(3)未分配利润扣除非期初应付利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。(4)期间费用不包含利息收入。

3.2.2 基金合同生效以来至最近一期的资产配置比例符合本基金合同规定的说明

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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C

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)