

## 广发深证100指数分级证券投资基金

[2013]第四季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人因建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:广发深证100指数分级

基金主代码:162714

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年5月7日

报告期末基金份额总额:117,984,610.82份

投资目标:本基金采用指数化投资方式，通过严格的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差度小于0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对深证100指数的有效复制。

投资策略:本基金为指数型基金，主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股的构成及其权重构造指数化投资组合，并定期根据标的指数成份股及其权重的变动情况进行相应的调整。当成股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以实现对跟踪误差的有效控制。

业绩比较基准:95%×深证100价格收益指数+5%×银行活期存款利率(税后)。

风险收益特征:本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险，较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，广发深证100 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；广发深证100 B份额具有高风险、高预期收益的特征。

基金管理人:广发基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

下属三级基金的基金简称:广发深证100指数分级

下属三级基金的交易代码:A 150083 B 150084

报告期末下属三级基金的份额总额:39,516,369.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -2,586,145.36

2.本期利润 -3,682,981.62

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0298

4.期末基金份额净值 100,033,645.94

5.期末基金份额净值 0.8479

注: (1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金的业绩表现。

3.2.1 本基金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变动的比

较

阶段 净值增长率① 净值增长基准收益率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 -3.63% 1.09% -3.01% 1.10% -0.62% -0.01%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

广发深证100指数分级证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年5月7日至2013年12月31日)

注:本基金建仓期为基金合同生效后3个月内，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

300TF及人民币债券基金基金经理

姓名:陆明 职务:基金经理助理 任职日期:2012-5-7 离任日期: - 说明: 男,中国籍,经济学硕士,持有证券业从业资格证书,2007年1月-2009年1月任国泰君安证券有限公司研究所助理研究员,2009年1月-2010年8月任国泰君安证券有限公司研究员,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.2 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.3 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.4 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.5 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.6 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.7 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.8 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.9 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.10 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.11 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.12 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.13 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.14 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.15 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.16 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.17 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.18 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.19 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.20 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.21 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.22 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.23 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.24 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.25 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.26 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.27 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.28 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.29 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.30 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.31 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.32 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.33 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.34 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.35 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.36 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.37 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.38 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.39 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。

4.40 本基金的基金经理:广发基金管理有限公司基金经理,2010年8月10日至2011年8月10日任基金经理,2011年8月11日至2012年5月7日任基金经理,2012年5月7日起任基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金经理。