

广发深证100指数分级证券投资基金

[2014] 第三季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

基金管理人的董事会及监事会在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的真实性、准确性和完整性个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同，于2014年10月23日将本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告等信息不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中的财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 广发深证100指数分级

场内简称 深证100

基金主代码 162714

交易代码 162714

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年7月10日

报告期末基金份额总额 97,458,311.13份

基金类型 主动管理的指数化投资方式，通过严控的投资纪律和较低的风险管理水平，力争在扣除一定的管理费用后，实现基金资产的长期稳定增值。

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过严控的投资纪律和较低的风险管理水平，力争在扣除一定的管理费用后，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金为指数基金，主要采用完全复制法，即按照所跟踪指数的构成比例及其权重，投资于股票、债券等金融工具，以确保基金净值与所跟踪指数的表现相一致。

投资风格 本基金为指数基金，主要采用完全复制法，即按照所跟踪指数的构成比例及其权重，投资于股票、债券等金融工具，以确保基金净值与所跟踪指数的表现相一致。

业绩比较基准 95%×深证100指数+5%×银行活期存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为指数基金，主要采用完全复制法，即按照所跟踪指数的构成比例及其权重，投资于股票、债券等金融工具，以确保基金净值与所跟踪指数的表现相一致。

基金管理人 广发基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

下属二级基金的基金简称 广发深证100指数分级A 广发深证100指数分级B 广发深证100指数分级C

场内简称 深证100A 深证100B 深证100C

交易代码 150083 150084 162714

基金份额总额 31,827,541.00份 33,803,230.53份

报告期末下属二级基金的份额总额 31,827,541.00份 33,803,230.53份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 -655,258.15

2.本期利润 10,096,797.38

3.加权平均基金份额本期利润 0.0937

4.期末基金资产净值 82,840,696.80

5.期末基金份额净值 0.8560

注: (1) 所述基金业绩效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示的数字。

(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, 本期利润指根据有关规定计算的本期利润加上本期公允价值变动收益。

3.2.基金净值表现

3.2.1本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的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 12.23% 0.02% 11.76% 0.02% 0.47% 0.00%

注: (1) 本基金的业绩比较基准:95%×深证100指数+5%×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确定的。

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

累计单位净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比图(2012年7月日至2014年9月30日)

3.3.主要财务指标

3.3.1主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 -655,258.15

2.本期利润 10,096,797.38

3.加权平均基金份额本期利润 0.0937

4.期末基金资产净值 82,840,696.80

5.期末基金份额净值 0.8560

注: (1) 所述基金业绩效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示的数字。

(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, 本期利润指根据有关规定计算的本期利润加上本期公允价值变动收益。

3.3.2基金净值表现

3.3.2.1本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的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 12.23% 0.02% 11.76% 0.02% 0.47% 0.00%

注: (1) 本基金的业绩比较基准:95%×深证100指数+5%×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确定的。

3.3.2.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

累计单位净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比图(2012年7月日至2014年9月30日)

3.4.基金管理人简介

4.1基金管理人(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

陈志明 基金经理 2012-05-07 - 15 中国籍, 经济学硕士, 持有证券业执业资格证书, 2009年7月至2010年7月任广发基金管理有限公司研究员, 2010年7月至2011年1月任广发基金管理有限公司基金经理助理, 2011年8月至2012年1月任广发基金管理有限公司基金经理, 2012年1月起任广发深证100指数分级基金经理, 2013年6月1日起任广发中证500ETF基金经理, 2014年1月27日起任广发深证100指数分级基金经理, 2014年9月10日起任广发深证100指数分级基金经理, 2014年10月27日起任广发深证100指数分级基金经理。

詹建军 基金经理 2014-04-01 - 6 中国籍, 教育经济学硕士, 持有基金业执业资格证书, 2008年7月至2010年7月任广发基金管理有限公司研究员, 2010年7月至2011年1月任广发基金管理有限公司基金经理助理, 2011年8月至2012年1月任广发基金管理有限公司基金经理, 2012年1月起任广发深证100指数分级基金经理, 2013年6月1日起任广发中证500ETF基金经理, 2014年1月27日起任广发深证100指数分级基金经理, 2014年9月10日起任广发深证100指数分级基金经理, 2014年10月27日起任广发深证100指数分级基金经理。

注: 1) “任职日期”和“离任日期”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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3) 本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 本基金运作过程中, 将严格遵守基金合同, 并接受基金监管部门的监督。

4) 本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

4.2.公平交易制度的执行情况

4.2.1公平交易制度的执行体系, 加强交易分配环节的内部控制, 并通过实时的行政监控及及时的分析评估, 保证公平交易制度的严格执行。

4.2.2公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.3公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.4公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.5公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.6公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.7公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.8公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.9公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.10公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.11公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.12公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.13公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.14公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.15公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.16公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.17公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.18公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.19公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.20公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.21公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.22公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.23公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.24公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.25公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.26公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.27公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.28公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.29公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.30公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.31公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.32公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.33公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.34公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.35公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.36公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.37公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.38公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.39公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.40公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.41公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.42公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.43公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.44公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.45公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.46公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.47公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.48公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层

4.2.49公平交易制度的执行情况, 包括但不限于同日反向交易的, 则需经公司领导层