

广发季季利理财债券型证券投资基金

2014 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年一月二十一日

§1 重要提示
基金管理人及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告期内中国证券投资基金业协会于2014年10月31日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	广发季季利债券
基金代码	000702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月29日
报告期末基金份额总额	一份
投资目标	在严格控制风险的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的资产增值。
投资策略	本基金采用“资产配置+行业轮动”的方式运作,在每个运作期内,本基金将严格按照持有到期策略构建投资组合,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的运作期限进行期限匹配,基本保持大类品种配置的比例恒定。 在运作期,根据市场环境适时可投资品种的市场容量,通过对市场容量分析,各类资产的收益率水平、信用品种的信用信用评级、协议存单交易对手的信用评级进行综合考量,确定对银行有存款、债券回购和短期融资券等各类资产的市场工具的配置比例,并在运作期内保持配置比例基本恒定和持有到期的投资策略。
业绩比较基准	在每个运作期,本基金的业绩比较基准为运作期起始日的银行三个月定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为短期理财债券型证券投资基金,属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种,其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金。
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
下属分级基金的基金简称	广发季季利债券A
下属分级基金的基金代码	000702
报告期末下分级基金份额总额	一份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	2,038,302.83
2.本期利润	2,038,302.83
3.期末基金资产净值	—

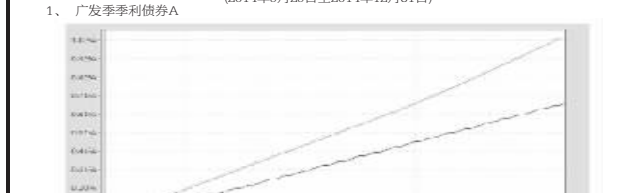
注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

§4 基金业绩比较基准

3.2.1 本报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1. 广发季季利债券A

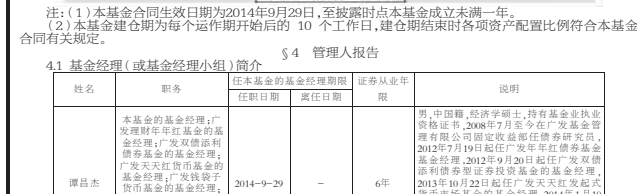
阶段	净值增长率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0026%	0.0015%	0.6572%	0.0000%	0.3448%	0.0015%

注:本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期间期末集中支付。
3.2.2 本基金合同生效以来基金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
1. 广发季季利债券A



阶段	净值增长率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0026%	0.0015%	0.6572%	0.0000%	0.3448%	0.0015%

注:本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期间期末集中支付。
3.2.2 本基金合同生效以来基金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
2. 广发季季利债券B



注:(1)本基金合同生效日期为2014年9月29日,至披露时点本基金成立未滿一年。
(2)本基金建仓期为每个运作期开始后的10个工作日,建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告	
姓名	职务
邵志杰	基金基金经理
邵志杰	基金基金经理

注:1、“任职日期”和“解聘日期”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。
3.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《广发季季利理财债券型证券投资基金合同》及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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资策略符合有关法律法规及基金合同的约定。

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,加强交易环节环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的评估、反馈,确保公平交易制度的有效执行。
在投资决策的内部控制方面,公司制定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经过严格的审批程序。
4.3.2 异常交易行为的监控
公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易环节环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的评估、反馈,确保公平交易制度的有效执行。
在投资决策的内部控制方面,公司制定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经过严格的审批程序。
4.3.3 异常交易行为的监控
公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易环节环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的评估、反馈,确保公平交易制度的有效执行。
在投资决策的内部控制方面,公司制定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经过严格的审批程序。

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:二〇一五年一月二十一日

基金管理人及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告期内中国证券投资基金业协会于2014年10月31日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	广发百发100指数
基金代码	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
报告期末基金份额总额	2,554,363,696.99份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资策略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%,跟踪误差是不超过6%,实现对中证百发策略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发策略100指数中的基准权重构建指数化投资组合(税后)。
业绩比较基准	95%×中证百发策略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。
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
下属分级基金的基金简称	广发百发100指数E
下属分级基金的基金代码	000826
报告期末下分级基金份额总额	1,127,030,649.31份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	170,763,289.93
2.本期利润	214,995,181.22
3.期末基金资产净值	1,322,291,186.22
4.期末基金资产净值	1,322,291,186.22

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滿一年。
(2)本基金建仓期为每个运作期开始后的10个工作日,建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 基金业绩比较基准

3.2.1 本报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1. 广发百发100指数E

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	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.30%	1.61%	19.88%	1.72%	-2.58%	-0.11%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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
1. 广发百发100指数E



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:二〇一五年一月二十一日

§1 重要提示
基金管理人及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告期内中国证券投资基金业协会于2014年10月31日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	广发逆向策略混合
基金代码	000747
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月4日
报告期末基金份额总额	127,088,482.94份
投资目标	本基金通过逆向投资策略进行主动投资管理,在有效控制风险的前提下,力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析框架,定性分析和定量分析相结合的研究方法,关注宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素,研判宏观经济运行所处的经济周期及趋势,分析不同政策对各类资产的市场影响,评估股票、债券及货币市场工具等各类资产的估值水平和投资价值,根据大类的资产的风险收益特征进行灵活配置,确定合适的资产配置比例,并适时进行调整。
业绩比较基准	50%×沪深300指数+50%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险,预期收益高于股票型基金和货币市场基金。
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

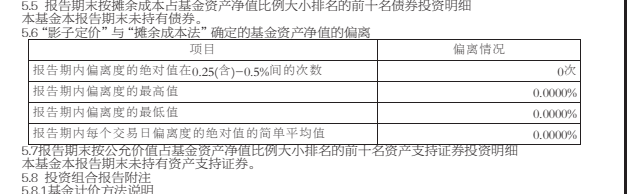
§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	11,578,110.45
2.本期利润	23,212,049.70
3.期末基金资产净值	141,736,659.95
4.期末基金资产净值	141,736,659.95

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。
3.2.1 本报告期内基金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	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.72%	1.04%	23.71%	0.83%	-12.99%	0.21%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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
1. 广发逆向策略混合



注:(1)本基金合同生效日期为2014年9月4日,至披露时点本基金成立未滿一年。
(2)本基金建仓期为每个运作期开始后的6个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
程航	基金基金经理	2014-09-04	8年	男,中国籍,金融学硕士,持有基金从业资格,2006年3月至2007年6月任上海证券有限公司研究员,2007年6月起先后任广发基金管理有限公司研究员,2013年2月5日起任广发大盘成长混合基金的基金经理,2014年9月4日起任广发逆向策略混合基金的基金经理,2014年12月8日起任广发消费品精选股票基金的基金经理。

注:1、“任职日期”和“解聘日期”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。
3.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《广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金合同》及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,为基金份额持有人谋求最大利益,基金运作符合法律法规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资策略符合有关法律法规及基金合同的约定。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末基金资产组合情况
5.3 报告期末基金资产组合情况
5.4 报告期末基金资产组合情况
5.5 报告期末基金资产组合情况
5.6 报告期末基金资产组合情况
5.7 报告期末基金资产组合情况
5.8 报告期末基金资产组合情况
5.9 报告期末基金资产组合情况
5.10 报告期末基金资产组合情况
5.11 报告期末基金资产组合情况
5.12 报告期末基金资产组合情况
5.13 报告期末基金资产组合情况
5.14 报告期末基金资产组合情况
5.15 报告期末基金资产组合情况
5.16 报告期末基金资产组合情况
5.17 报告期末基金资产组合情况
5.18 报告期末基金资产组合情况
5.19 报告期末基金资产组合情况
5.20 报告期末基金资产组合情况
5.21 报告期末基金资产组合情况
5.22 报告期末基金资产组合情况
5.23 报告期末基金资产组合情况
5.24 报告期末基金资产组合情况
5.25 报告期末基金资产组合情况
5.26 报告期末基金资产组合情况
5.27 报告期末基金资产组合情况
5.28 报告期末基金资产组合情况
5.29 报告期末基金资产组合情况
5.30 报告期末基金资产组合情况
5.31 报告期末基金资产组合情况
5.32 报告期末基金资产组合情况
5.33 报告期末基金资产组合情况
5.34 报告期末基金资产组合情况
5.35 报告期末基金资产组合情况
5.36 报告期末基金资产组合情况
5.37 报告期末基金资产组合情况
5.38 报告期末基金资产组合情况
5.39 报告期末基金资产组合情况
5.40 报告期末基金资产组合情况
5.41 报告期末基金资产组合情况
5.42 报告期末基金资产组合情况
5.43 报告期末基金资产组合情况
5.44 报告期末基金资产组合情况
5.45 报告期末基金资产组合情况
5.46 报告期末基金资产组合情况
5.47 报告期末基金资产组合情况
5.48 报告期末基金资产组合情况
5.49 报告期末基金资产组合情况
5.50 报告期末基金资产组合情况
5.51 报告期末基金资产组合情况
5.52 报告期末基金资产组合情况
5.53 报告期末基金资产组合情况
5.54 报告期末基金资产组合情况
5.55 报告期末基金资产组合情况
5.56 报告期末基金资产组合情况
5.57 报告期末基金资产组合情况
5.58 报告期末基金资产组合情况
5.59 报告期末基金资产组合情况
5.60 报告期末基金资产组合情况
5.61 报告期末基金资产组合情况
5.62 报告期末基金资产组合情况
5.63 报告期末基金资产组合情况
5.64 报告期末基金资产组合情况
5.65 报告期末基金资产组合情况
5.66 报告期末基金资产组合情况
5.67 报告期末基金资产组合情况
5.68 报告期末基金资产组合情况
5.69 报告期末基金资产组合情况
5.70 报告期末基金资产组合情况
5.71 报告期末基金资产组合情况
5.72 报告期末基金资产组合情况
5.73 报告期末基金资产组合情况
5.74 报告期末基金资产组合情况
5.75 报告期末基金资产组合情况
5.76 报告期末基金资产组合情况
5.77 报告期末基金资产组合情况
5.78 报告期末基金资产组合情况
5.79 报告期末基金资产组合情况
5.80 报告期末基金资产组合情况
5.81 报告期末基金资产组合情况
5.82 报告期末基金资产组合情况
5.83 报告期末基金资产组合情况
5.84 报告期末基金资产组合情况
5.85 报告期末基金资产组合情况
5.86 报告期末基金资产组合情况
5.87 报告期末基金资产组合情况
5.88 报告期末基金资产组合情况
5.89 报告期末基金资产组合情况
5.90 报告期末基金资产组合情况
5.91 报告期末基金资产组合情况
5.92 报告期末基金资产组合情况
5.93 报告期末基金资产组合情况
5.94 报告期末基金资产组合情况
5.95 报告期末基金资产组合情况
5.96 报告期末基金资产组合情况
5.97 报告期末基金资产组合情况
5.98 报告期末基金资产组合情况
5.99 报告期末基金资产组合情况
5.100 报告期末基金资产组合情况

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:二〇一五年一月二十一日

基金管理人及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告期内中国证券投资基金业协会于2014年10月31日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金
基金代码	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
报告期末基金份额总额	2,554,363,696.99份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资策略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%,跟踪误差是不超过6%,实现对中证百发策略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发策略100指数中的基准权重构建指数化投资组合(税后)。
业绩比较基准	95%×中证百发策略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。
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
下属分级基金的基金简称	广发百发100指数E
下属分级基金的基金代码	000826
报告期末下分级基金份额总额	1,127,030,649.31份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	170,763,289.93
2.本期利润	214,995,181.22
3.期末基金资产净值	1,322,291,186.22
4.期末基金资产净值	1,322,291,186.22

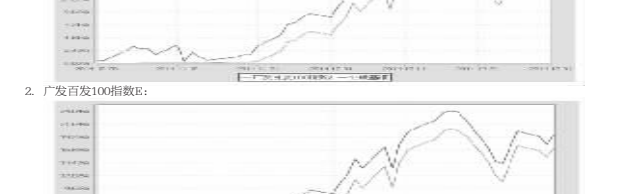
注:(1)本基金合同生效日期为2014年10月30日,至披露时点本基金成立未滿一年。
(2)本基金建仓期为每个运作期开始后的10个工作日,建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 基金业绩比较基准

3.2.1 本报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1. 广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金

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	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.30%	1.61%	19.88%	1.72%	-2.58%	-0.11%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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
1. 广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金



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滿一年。
(2)本基金建仓期为每个运作期开始后的10个工作日,建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末基金资产组合情况
5.3 报告期末基金资产组合情况
5.4 报告期末基金资产组合情况
5.5 报告期末基金资产组合情况
5.6 报告期末基金资产组合情况
5.7 报告期末基金资产组合情况
5.8 报告期末基金资产组合情况
5.9 报告期末基金资产组合情况
5.10 报告期末基金资产组合情况
5.11 报告期末基金资产组合情况
5.12 报告期末基金资产组合情况
5.13 报告期末基金资产组合情况
5.14 报告期末基金资产组合情况
5.15 报告期末基金资产组合情况
5.16 报告期末基金资产组合情况
5.17 报告期末基金资产组合情况
5.18 报告期末基金资产组合情况
5.19 报告期末基金资产组合情况
5.20 报告期末基金资产组合情况
5.21 报告期末基金资产组合情况
5.22 报告期末基金资产组合情况
5.23 报告期末基金资产组合情况
5.24 报告期末基金资产组合情况
5.25 报告期末基金资产组合情况
5.26 报告期末基金资产组合情况
5.27 报告期末基金资产组合情况
5.28 报告期末基金资产组合情况
5.29 报告期末基金资产组合情况
5.30 报告期末基金资产组合情况
5.31 报告期末基金资产组合情况
5.32 报告期末基金资产组合情况
5.33 报告期末基金资产组合情况
5.34 报告期末基金资产组合情况
5.35 报告期末基金资产组合情况
5.36 报告期末基金资产组合情况
5.37 报告期末基金资产组合情况
5.38 报告期末基金资产组合情况
5.39 报告期末基金资产组合情况
5.40 报告期末基金资产组合情况
5.41 报告期末基金资产组合情况
5.42 报告期末基金资产组合情况
5.43 报告期末基金资产组合情况
5.44 报告期末基金资产组合情况
5.45 报告期末基金资产组合情况
5.46 报告期末基金资产组合情况
5.47 报告期末基金资产组合情况
5.48 报告期末基金资产组合情况
5.49 报告期末基金资产组合情况
5.50 报告期末基金资产组合情况
5.51 报告期末基金资产组合情况
5.52 报告期末基金资产组合情况
5.53 报告期末基金资产组合情况
5.54 报告期末基金资产组合情况
5.55 报告期末基金资产组合情况
5.56 报告期末基金资产组合情况
5.57 报告期末基金资产组合情况
5.58 报告期末基金资产组合情况
5.59 报告期末基金资产组合情况
5.60 报告期末基金资产组合情况
5.61 报告期末基金资产组合情况
5.62 报告期末基金资产组合情况
5.63 报告期末基金资产组合情况
5.64 报告期末基金资产组合情况
5.65 报告期末基金资产组合情况
5.66 报告期末基金资产组合情况
5.67 报告期末基金资产组合情况
5.68 报告期末基金资产组合情况
5.69 报告期末基金资产组合情况
5.70 报告期末基金资产组合情况
5.71 报告期末基金资产组合情况
5.72 报告期末基金资产组合情况
5.73 报告期末基金资产组合情况
5.74 报告期末基金资产组合情况
5.75 报告期末基金资产组合情况
5.76 报告期末基金资产组合情况
5.77 报告期末基金资产组合情况
5.78 报告期末基金资产组合情况
5.79 报告期末基金资产组合情况
5.80 报告期末基金资产组合情况
5.81 报告期末基金资产组合情况
5.82 报告期末基金资产组合情况
5.83 报告期末基金资产组合情况
5.84 报告期末基金资产组合情况
5.85 报告期末基金资产组合情况
5.86 报告期末基金资产组合情况
5.87 报告期末基金资产组合情况
5.88 报告期末基金资产组合情况
5.89 报告期末基金资产组合情况
5.90 报告期末基金资产组合情况
5.91 报告期末基金资产组合情况
5.92 报告期末基金资产组合情况
5.93 报告期末基金资产组合情况
5.94 报告期末基金资产组合情况
5.95 报告期末基金资产组合情况
5.96 报告期末基金资产组合情况
5.97 报告期末基金资产组合情况
5.98 报告期末基金资产组合情况
5.99 报告期末基金资产组合情况
5.100 报告期末基金资产组合情况

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:二〇一五年一月二十一日

基金管理人及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、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。
本报告期内中国证券投资基金业协会于2014年10月31日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金
基金代码	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
报告期末基金份额总额	2,554,363,696.99份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资策略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%,跟踪误差是不超过6%,实现对中证百发策略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发策略100指数中的基准权重构建指数化投资组合(税后)。
业绩比较基准	95%×中证百发策略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。
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
下属分级基金的基金简称	广发百发100指数E
下属分级基金的基金代码	000826
报告期末下分级基金份额总额	1,127,030,649.31份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	170,763,289.93
2.本期利润	214,995,181.22
3.期末基金资产净值	1,322,291,186.22
4.期末基金资产净值	1,322,291,186.22

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滿一年。
(2)本基金建仓期为每个运作期开始后的10个工作日,建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 基金业绩比较基准

3.2.1 本报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1. 广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金

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	业绩比较基准标准差④	
----	--------	-----------	------------	------------	--