

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:二〇一五年十月二十六日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事及董事会、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的
真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2015年10月21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信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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2015年7月1日起至2015年9月30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
场内简称	全指能源
基金代码	169946
交易方式	场内封闭式
基金合同生效日	2014年10月30日
报告期末基金份额总额	1,472,520,476.00份
报告期	2015年7月1日至2015年9月30日止
报告期天数	93天
报告期开始日期	2015年7月1日
报告期结束日期	2015年9月30日
报告期投资运作说明	通过严格的资产配置和数量化风险控制手段，力求本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化，力争使得净值增长率在0.60%的基础上再增加10%左右，实现对中证百度百发策略100指数的超额回报。
报告期目标	本基金的业绩比较基准：风险中性策略指数×0.60%+中证百度百发策略100指数×0.40%。
报告期风险特征	本基金为股票型基金，风险等级为中高风险，适合风险承受能力较强的投资者。
报告期收益特征	本基金的业绩比较基准：风险中性策略指数×0.60%+中证百度百发策略100指数×0.40%。
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
下一报告期开始日期	2015年10月1日
报告期投资组合变动情况	报告期投资组合变动情况
报告期末基金资产的构成	报告期末基金资产的构成

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元		报告期
主要财务指标		(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	广发百发100指数	-349,746,479.03
2.本期利润	广发百发100指数	-400,897,404.63
3.期初至报告期平均基金份额累计净值	211,030.63	-0.59%
4.期末基金份额净值	210,636,390.73	-0.59%
5.报告期基金份额总额	0.0311	-0.59%
6.报告期末基金资产的构成	1,472,520,476.00份	-0.59%

§ 4 主要财务指标和基金净值表现

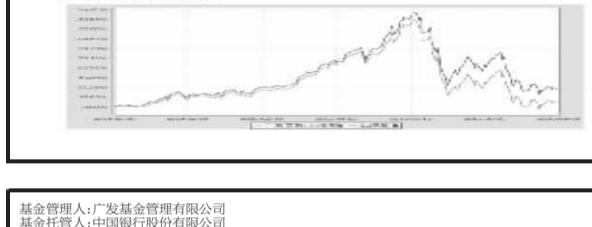
注:1) 所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金财务指标。

(2) 本期已实现收益指基金本期利润收入, 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。

3.22 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

广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金 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

(2014年10月30日至2015年9月30日)



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:二〇一五年十月二十六日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事及董事会、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的
真实性、准确性、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基金合同的规定，于2015年10月21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信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元		报告期
主要财务指标		(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,533,280.60	
2.本期利润	-80,418,323.92	
3.期初至报告期平均基金份额利润	-0.04547	
4.期末基金份额净值	109,228,000.00	
5.报告期末基金份额总额	0.0385	
报告期		
投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
本基金主要采取完全复制法, 以跟踪标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合, 并根据成份股的派息或送股进行相应的调整。本基金的申购赎回费用率为0.60%。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准: 风险中性策略指数×0.60%+中证百度百发策略100指数×0.40%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金, 风险收益特征高于股票型基金, 债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金, 通常会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	中国银行股份有限公司	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

注:1) 本报告期基金合同生效日为2015年6月25日, 至披露时点本基金未成立一年。

(2) 本基金在封闭期内基金合同生效后3个月, 建仓期结束后各项资产配置比例符合基金合同有关规定。

§ 4 管理人报告

3.1 主要财务指标

单位:人民币元		报告期
主要财务指标		(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,533,280.60	
2.本期利润	-80,418,323.92	
3.期初至报告期平均基金份额利润	-0.04547	
4.期末基金份额净值	109,228,000.00	
5.报告期末基金份额总额	0.0385	
报告期		
投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
本基金主要采取完全复制法, 以跟踪标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合。本基金的申购赎回费用率为0.60%。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准: 风险中性策略指数×0.60%+中证百度百发策略100指数×0.40%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金, 风险收益特征高于股票型基金, 债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金, 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	中国银行股份有限公司	

§ 5 报告期末基金资产组合情况

5.1 报告投资组合报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.4 管理人报告

3.22 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

广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金 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

(2014年10月30日至2015年9月30日)

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:二〇一五年十月二十六日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事及董事会、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的
真实性、准确性、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基金合同的规定，于2015年10月21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信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元		报告期
主要财务指标		(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,447,200.31	
2.本期利润	-13,020,027.95	
3.期初至报告期平均基金份额利润	-0.02761	
4.期末基金份额净值	37,273,217.97	
5.报告期末基金份额总额	0.07618	
报告期		
投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
本基金主要采取完全复制法, 并根据标的指数的构成及其权重构建指数化投资组合。本基金的申购赎回费用率为0.60%。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准: 风险中性策略指数×0.60%+中证百度百发策略100指数×0.40%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金, 风险收益特征高于股票型基金, 债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金, 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	中国银行股份有限公司	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

注:1) 本报告期基金合同生效日为2015年6月25日, 至披露时点本基金未成立一年。

(2) 本基金在封闭期内基金合同生效后3个月, 建仓期结束后各项资产配置比例符合基金合同有关规定。

§ 4 管理人报告

3.1 主要财务指标

单位:人民币元		报告期
主要财务指标		(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,447,200.31	
2.本期利润	-13,020,027.95	
3.期初至报告期平均基金份额利润	-0.02761	
4.期末基金份额净值	37,273,217.97	
5.报告期末基金份额总额	0.07618	
报告期		
投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
本基金主要采取完全复制法, 并根据标的指数的构成及其权重构建指数化投资组合。本基金的申购赎回费用率为0.60%。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准: 风险中性策略指数×0.60%+中证百度百发策略100指数×0.40%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金, 风险收益特征高于股票型基金, 债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金, 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	中国银行股份有限公司	

§ 5 报告期末基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1) 本报告期基金合同生效日为2015年6月25日, 至披露时点本基金未成立一年。

(2) 本基金在封闭期内基金合同生效后3个月, 建仓期结束后各项资产配置比例符合基金合同有关规定。