

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

[2015]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:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及董事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。
本基金的基金管理人和基金托管人于2016年1月15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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
基金代码	000461
交易代码	000461
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月10日
报告期末基金份额总额	10,959,393.64份
投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的被动跟踪。本基金将基于基金价值与行业属性比较基准之间的动态调整和适度的对冲机制(0.02%以内)，在行业配置比例调整时对标的指数的跟踪误差进行调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为0.6%+中证全指主要消费指数收益率+0.5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	风险收益特征：风险较高，收益较高，适合长期持有。
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

2.1 基金基本情况

基金名称 广发中证全指主要消费ETF

基金代码 000461

交易代码 000461

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年01月10日

报告期末基金份额总额 10,959,393.64份

投资目标 本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的被动跟踪。本基金将基于基金价值与行业属性比较基准之间的动态调整和适度的对冲机制(0.02%以内)，在行业配置比例调整时对标的指数的跟踪误差进行调整。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为0.6%+中证全指主要消费指数收益率+0.5%×银行活期存款利率(税后)。

风险收益特征 风险较高，收益较高，适合长期持有。

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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称 广发中证全指主要消费ETF

基金代码 000461

交易代码 000461

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年01月10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

2.1.2 目标基金产品说明

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。

投资策略 本基金主要通过投资于标的指数成份股及其权重的现金的组合，本基金管理人将持有的股票及现金的组合比例不低于基金资产净值的95%。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为中证全指主要消费指数收益率。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益高于货币型基金，风险收益低于股票型基金。本基金指定期权型基金，主要用定期定额法对标的指数的波动的表现，具有与指数的波动一致的收益和风险特征。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 467,851.98

2.本期利润 2,896,296.71

3.加权平均基金份额本期利润 0.1956

4.期末基金资产净值 17,906,826.08

5.期末基金份额净值 1.0000

注:1.本期的利润指报告期间内基金利润的累积数,即本报告期内已实现的收益扣除去期间费用后的余额。

2.本期已实现收益扣除非经常性损益后的金额,其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用外的日常收入。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.2 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.3 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.4 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.5 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.6 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.7 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.8 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.9 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.10 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.11 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.12 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.13 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.14 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.15 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.16 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.17 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.18 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.19 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.20 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.21 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.22 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.23 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.24 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年01月01日至2015年12月31日)

3.2.2.25 自基金额度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

广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金