

广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金

[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

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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行托管人职责,但不就基金的投资收益或损失承担责任。
本报告经基金托管人复核无误。
本报告期基金财务报告未经审计。
本报告期基金合同生效日: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,内容完整、不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本基金的基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告期基金财务报告未经审计。
本报告期基金合同生效日: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,内容完整、不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本基金的基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告期基金合同生效日:2016年1月15日至12月31日。

1.2 基本产品概况

基金简称	广发百度100指数
基金主代码	000826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月31日
报告期末基金份额总额	1,446,701,702,396.33
投资目标	本基金采用主动投资策略,通过严格的投资程序和数量化风险管理手段,力争在控制本基金的净值增长与业绩比较基准之间的均值距离偏度小于0.025%,年度跟踪误差不超过0.5%,实现对中百度百发策略100指数的时效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,根据上证指数全复权组合,按照成份股在中百度百发策略100指数中的基准权重加权综合指数化投资策略。
业绩比较基准	99%×中证百度百发100指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为指数型基金,风险与收益高于货币基金,风险与货币基金与货币市场基金,本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数一致的风险收益特征。
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	广发百度100指数A 广发百度100指数C
下属分级基金的交易代码	000826 000827
报告期末下属分级基金的份额总额	496,701,261.06 948,047,267.06
§ 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546

3.4 期末基金份额净值 0.3546

3.5 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(2015年10月01日-2015年12月31日)

广发百度100指数A 32,908,534.01 62,753,211.24

广发百度100指数C 169,249,570.29 304,018,909.33

本期利润 0.3546 0.3546

利润总额 676,141,704.31 1,096,462,270.19

期末基金资产净值 1,156,000,000.00 1,156,000,000.00

注:本基金的申购赎回费用不包括申购和赎回交易过程中发生的银行手续费、税款等其他费用,该费用由投资人承担,从申购、赎回的基金份额中扣除。

(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利润。

3.2 本期利润金额折合单位净值增长率为-0.025%,业绩比较基准收益率的比较

3.3 期末基金资产净值 0.3546