

广发深证100指数分级证券投资基金

[2016] 第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送达日期:二〇一六年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员已阅读并理解本报告,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。

本基金由广发基金管理有限公司根据基金合同规定,于2016年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合

报告等数据,保证复核结果与本公司根据基金合同规定编制的定期报告一致。

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未来表现。投资者应认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件。

本报告出自基金管理人2016年1月1日至2016年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发深证100指数
场内简称	深证100
基金代码	162214
交易代码	162214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月7日
报告期末基金份额总额	69,362,544.96份
报告期末基金资产净值	10,069.60元
报告期末基金份额净值	0.02元

6.2.1 指数化投资行业分类的股票型投资基金组合

行业类别 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

A 农、林、牧、渔业 324,139.00 0.00%

B 建筑业 - 0.00%

C 制造业 26,475,261.17 40.00%

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 394,077.20 0.00%

E 建筑安装业 339,364.00 0.00%

F 交通运输、仓储和邮政业 1,072,402.00 1.00%

G 通讯、广播、电影和电视业 - 0.00%

H 中间批发零售业 - 0.00%

I 信息传输、软件和信息技术服务业 6,442,224.74 11.21%

J 钢铁业 7,536,209.62 13.12%

K 石油、化学、塑胶、塑料业 5,342,356.96 9.30%

L 贸易、餐饮业 673,474.40 1.17%

M 科学研究、技术服务业 - 0.00%

N 水利、环境和公共设施管理业 1,399,016.52 2.42%

O 园林绿化、修缮和物业管理业 - 0.00%

P 教育 - 0.00%

Q 卫生、体育和社会工作 - 0.00%

R 文化、体育和娱乐业 1,214,803.48 2.11%

S 合计 51,076,501.09 90.29%

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期实现收益	-329,405.01
2.本期利润	-11,083,162.26
3.加权平均基金份额利润	-0.1683
4.期末基金份额净值	0.02元
5.期末基金净值	0.02元

注:本基金的利润指基金利润与红利再投资的利润之和。

3.2.2 本期因基金合同生效或变更基金合同而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.3 本期因基金合同终止或基金转换而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.4 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.5 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.6 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.7 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.8 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.9 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.10 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.11 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.12 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.13 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.14 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.15 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.16 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.17 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.18 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.19 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.20 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.21 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.22 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.23 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.24 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.25 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.26 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.27 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.28 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.29 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.30 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.31 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.32 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.33 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.34 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.35 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.36 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.37 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.38 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.39 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.40 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.41 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.42 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.43 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.44 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.45 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.46 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.47 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.48 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.49 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.50 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.51 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.52 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.53 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.54 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.55 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.56 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.57 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.58 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.59 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.60 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.61 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.62 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.63 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.64 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.65 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.66 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.67 本期因申购赎回费用而产生的基金费用,以及因基金合同而产生的其他费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2