

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 年 12 月 31 日

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：二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发百发 100 指数	
基金主代码	000826	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	1,445,701,526.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
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	496,754,259.16 份	948,947,267.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序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%，年跟踪误差不超过 6%，实现对中证百度百发策略 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度百发策略 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：95%×中证百度百发策略 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	张志永
	联系电话	020-83936666	021-62677777-212004
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95561
传真		020-89899158	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年		2014 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日	
	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
本期已实现收益	348,975,616.71	487,401,576.63	170,763,289.93	209,330,673.58
本期利润	314,605,243.97	434,345,140.56	214,995,601.18	255,700,065.68
加权平均基金份额本期利润	0.4312	0.3715	0.1870	0.1805

本期加权平均净值利润率	34.11%	29.72%	17.30%	16.72%
本期基金份额净值增长率	27.06%	26.76%	17.30%	17.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	
	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
期末可供分配基金份额利润	-0.0405	-0.0425	0.1398	0.1395
期末基金资产净值	575,141,704.33	1,096,452,770.19	1,322,291,186.22	1,674,283,014.49
期末基金份额净值	1.158	1.155	1.173	1.173

注：（1）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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额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 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	39.35%	2.43%	35.05%	2.22%	4.30%	0.21%
过去六个月	-17.70%	3.86%	-10.74%	3.37%	-6.96%	0.49%
过去一年	27.06%	3.24%	44.68%	2.89%	-17.62%	0.35%

自基金合同生效起至今	49.04%	3.05%	73.89%	2.74%	-24.85%	0.31%
------------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

2. 广发百发 100 指数 E:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	39.32%	2.43%	35.05%	2.22%	4.27%	0.21%
过去六个月	-17.79%	3.85%	-10.74%	3.37%	-7.05%	0.48%
过去一年	26.76%	3.24%	44.68%	2.89%	-17.92%	0.35%
自基金合同生效起至今	48.69%	3.04%	73.89%	2.74%	-25.20%	0.30%

业绩比较基准：95%×中证百度百发策略 100 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

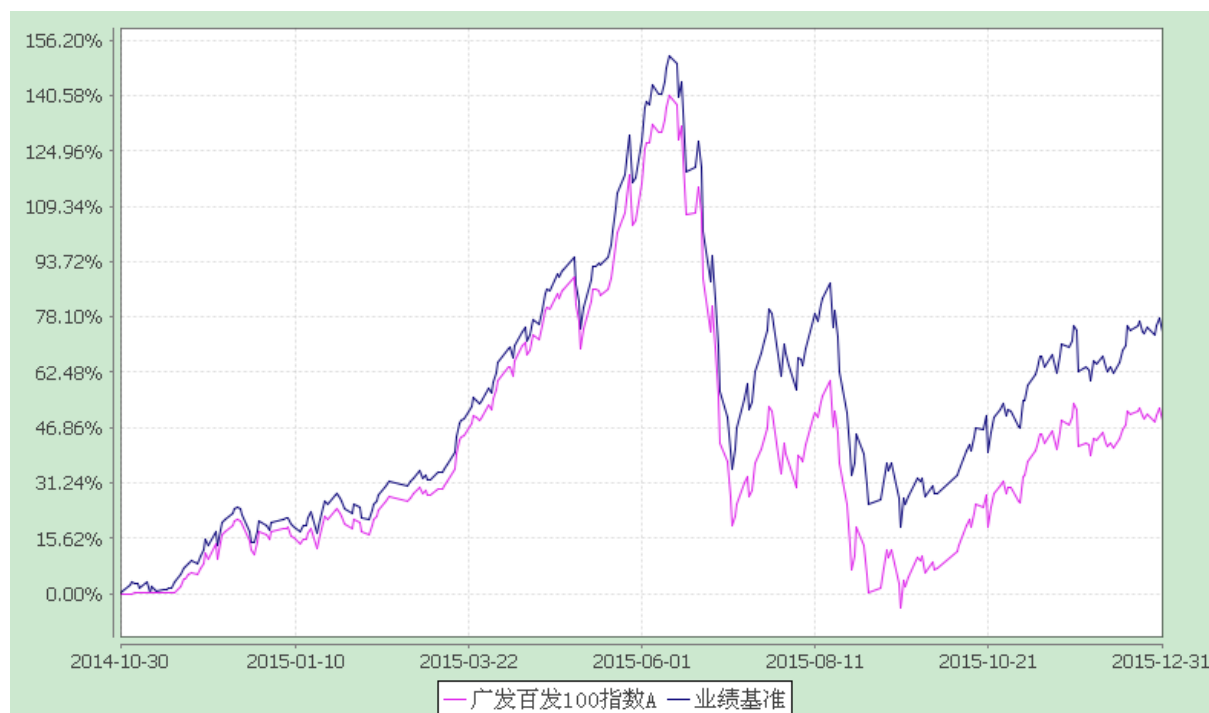
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

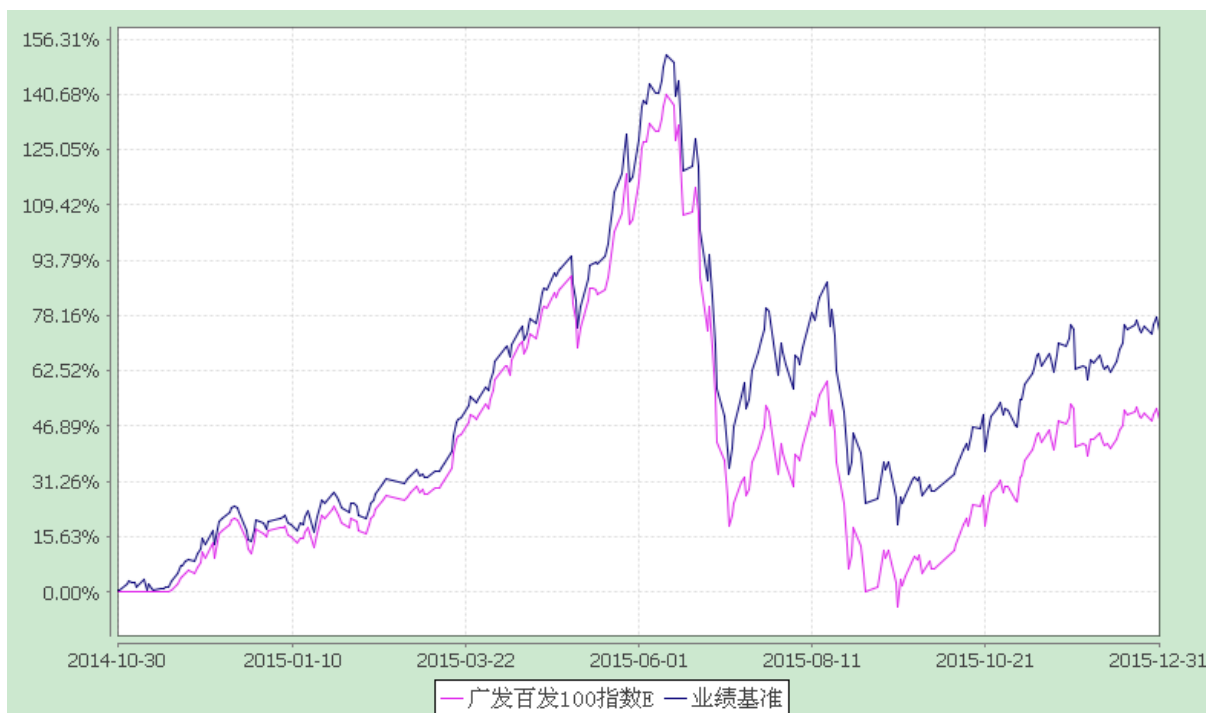
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 10 月 30 日至 2015 年 12 月 31 日)

1、广发百发 100 指数 A



2、广发百发 100 指数 E



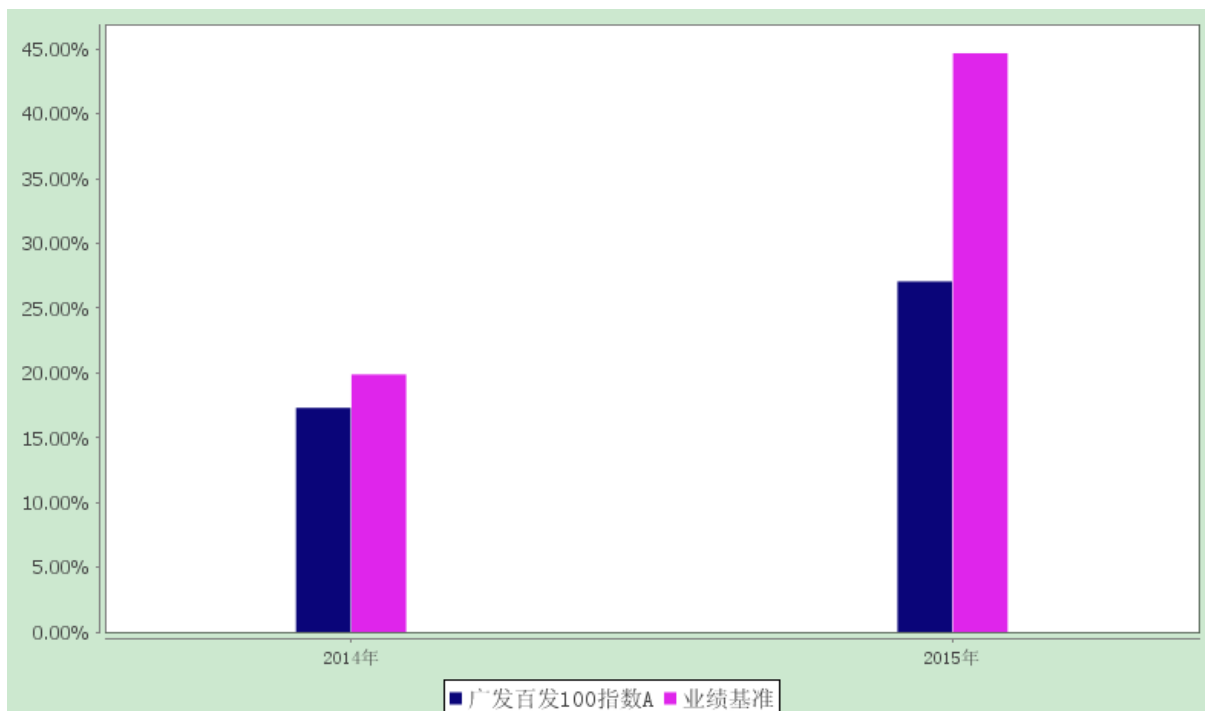
注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

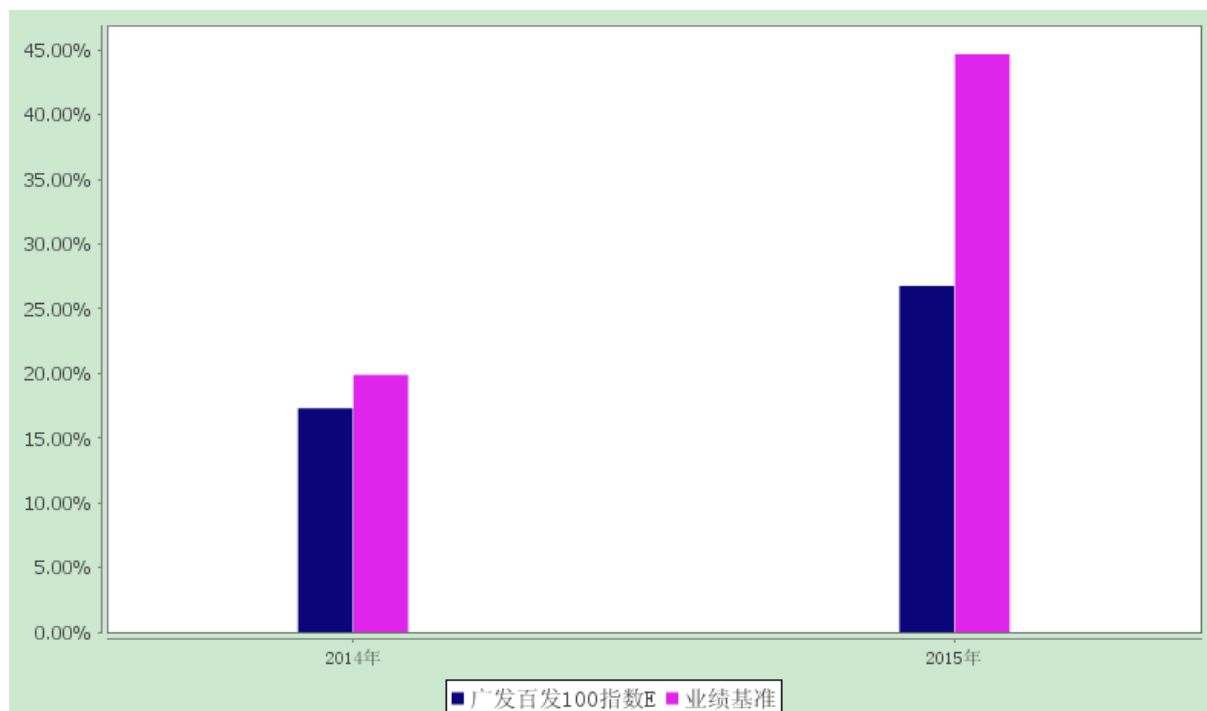
广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、广发百发 100 指数 A



2、广发百发 100 指数 E



注：合同生效当年(2014年)按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、广发百发 100 指数 A:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	3.600	140,172,056.59	130,348,159.39	270,520,215.98	-
合计	3.600	140,172,056.59	130,348,159.39	270,520,215.98	-

2、广发百发 100 指数 E:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	3.600	131,982,718.84	253,812,947.53	385,795,666.37	-
合计	3.600	131,982,718.84	253,812,947.53	385,795,666.37	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 24 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人管理八十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱

袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 3300.24 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆志明	本基金的基金经理；广发中小板 300ETF	2014-10-30	-	16 年	男，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，1999 年 5 月至 2001 年 5 月在大鹏

	<p>及联接基金的基金经理；广发深证 100 指数分级基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 及联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理；广发中证全指信息技术 ETF 及联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源 ETF 基金的基金经理；广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理；广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理；广发能源联接基金的基金经理；广发金融地产联接基金的基金经理；广发医疗指数分级基金的基金经理；广发原材料联接基金的基金经理；广发主要消费联接基金的基金经理；数量投</p>				<p>证券有限公司任研究员，2001 年 5 月至 2010 年 8 月在深圳证券信息有限公司任部门总监，2010 年 8 月 9 日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日起任广发中小板 300ETF 基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日起任广发中小板 300ETF 联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日起任广发深证 100 指数分级基金的基金经理，2014 年 6 月 3 日起任广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理，2014 年 10 月 30 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2014 年 12 月 1 日起任广发中证全指医药卫生 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 8 日起任广发中证全指信息技术 ETF 基金的基金经理，2015 年 1 月 29 日起任广发中证全指信息技术 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 3 月 23 日起任广发中证全指金融地产 ETF 基金的基金经理，2015 年 4 月 15 日起任广发可选消费联接基金的基金经理，2015 年 5 月 6 日起任广发医药卫生联接基金的基金经理，2015 年 6 月 25 日起任广发中证全指能源 ETF 和广发中证全指原材料 ETF 基金的基金经理，2015 年 7 月 1 日起任广发中证全指主要消费 ETF 基金的基金经理，2015 年 7 月 9 日起任广发能源联接和广发金融地产联接基金的基金经理，2015 年 7 月 23 日起任广发医疗指数分级基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日起任广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

	资部总经理				
季峰	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；广发百发大数据精选混合基金的基金经理；广发百发大数据成长混合基金的基金经理；数据策略投资部副总经理	2014-11-24	-	6 年	男，中国籍，管理学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2009 年 8 月至 2011 年 8 月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作，2011 年 9 月至 2014 年 10 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员，2014 年 10 月 21 日任广发中证全指可选消费 ETF 的基金经理，2014 年 11 月 24 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2015 年 2 月 13 日起任广发养老指数基金的基金经理，2015 年 3 月 18 日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理，2015 年 3 月 25 日起任广发环保指数基金的基金经理，2015 年 9 月 14 日起任广发百发大数据精选混合基金的基金经理，2015 年 11 月 18 日起任广发百发大数据成长混合基金的基金经理。

注：1.“任职日期”和“离职日期”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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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、《广发中证百度百发策略 100 指数证券投资基金基金合同》和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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度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来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内

可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息,对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，是百发大数据策略落地以来走过的第一个完整年度，也是市场风起云涌、大开大合的一个不凡年度。

2014 年末，以沪港通为契机，券商带领金融蓝筹板块异军突起，为波澜壮阔的牛市拉开了序幕。适逢国内经济行至产业结构转型、置换驱动内核的分水岭，改革预期持续升温，代表新兴产业的成长股在 2015 年一季度接力领跑。随着增量资金推动行情扩张与逐利情绪蔓延，互联网金融、新能源汽车、国企改革、“一带一路”等热点概念轮番上阵，各宽基指数屡创今年新高。

6 月初，大盘表现滞涨，传媒、建筑、金融、轻工等行业热点轮动频繁、切换快速，后继无力的泡沫随后急剧坍塌。杠杆资金的集中出逃将市场带往恐慌的深渊，同时面对着个股大面积跌停、

停牌等极端状况。所幸监管层联合机构力挽狂澜，成功稳定市场，为缓和恐慌情绪争取了时间与空间。虽然，此后汇率异动引发市场二次探底，但杠杆水平处于低位的市场增强了纠偏和修复能力。2015 年的四季度，市场围绕锂电池、券商以及 TMT 等热点板块，促进风险偏好的局部回暖，以修复反弹为跌宕起伏的 2015 年行情写下句点。

百发大数据选股策略落地运行至今，一年有余，其间与投资者一道登峰涉谷、苦乐与共——在普涨行情中凭借大数据选股的优势抓住了国企改革、“一带一路”、金融互联等多个热点题材；在市场不稳定的阶段及时合理调整仓位，避免亏损扩大；在黎明前的黑暗中守候时机，布局后市，每一次俯身都为了更好地冲刺。

百发 100 指数基金虽然受限于仓位限制，在 6 月的极端市场环境中受到较大的冲击，导致跟踪误差扩大。但是，组合在市场低迷期间仍积极布局后市，把握修复行情蕴含的机会。维护市场稳健运行的监管导向与百发大数据选股环境需求契合，相信精细化管理和持续优化能让组合逐步提升客户体验。同时，组合也运用现金管理、新股申购、转债申购、仓位调控等多种策略增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发 100 指数基金 A 类净值增长率为 27.06%，E 类净值增长率为 26.76%，同期业绩比较基准收益率为 44.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新的一年已至，国内的经济转型与改革亦将步入深水区，多空因素交织下的行情云谲波诡。辨明相对确定的背景，绘制稳健、灵活、富弹性的策略线路，则能为这迷航寻找明灯，无远弗届。

立于国内经济转型迈进的起点，需要辨明三个基本背景。

其一，经济转型、产业结构调整以及产能替代是渐进交互的过程，或许漫长但不乏机会。国内经济的整体趋势始终以经济转型、调整结构为契机，“去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板”多管齐下，供需同调，可期迎来更为密集的施政窗口期。现阶段，孤立地观察汇率、股市、债市以及实体经济等多个市场层级和领域的应对措施，难以窥一斑而知全豹，成效显现需要一定时间。但在遏制经济下滑的既定方向上，可合理谨慎地布局新兴产业与转型机遇。一旦以点带面地初现转机，丰厚的利润回报是可期的。

其二，国内资本市场的供给端改革温和推进，流动性溢价短期内或可持续。国内资本市场短期内仍会维持供不应求的现状，热点主题的流动性溢价也将并存。在风险偏好没有显著提升之前，趋势性机会少于结构性机会，受追捧的热点主题将获得更高的安全边际。存量模式下的热点切换频繁，则赋予大数据选股模型更大的责任——精准识别当期热点，遴选业绩优良、题材稀缺、治理稳健的

优质新兴产业标的，辅以因应市场环境的仓位管理与持续优化择时策略，相信能够为投资者在改革的激流中披沙沥金。

其三，内外环境有待趋稳，提防事件冲击引发市场恐慌情绪。随着美国进入加息周期，美元与非美元阵营的分歧加剧，外汇市场波动扩大有待稳定。此外，还存在着信用风险、产能出清衍生风险、国际地缘冲突等多类潜在冲击。因此，组合将会更为重视仓位管理策略，依据市场具体的运行特点来调整仓位，同时开发多类策略对组合持仓进行持续监控和优化。

极端的行情不仅为百发大数据策略体系提供了难能可贵的运作经验，更启发了丰富内涵、扩充体系、持续优化的思路。在选股核心方面，组合未来的策略线路将一如既往地重视新兴产业格局的入口，如精准医疗、健康管理、智能制造、新能源与体验革新等领域。此外，综合运用多策略、多资产、多市场的管理思路，为组合建立可灵活切换、应对不同市场状况的可替代方案，譬如当市场处于系统系风险释放阶段组合将侧重于现金管理、新股、可转债申购以及择时对冲的缓冲策略。

期待百发大数据策略能够在新的市场阶段中，建立更为丰富、多元、互联的策略体系，以更为灵活、成熟、稳健的姿态为投资者构建可持续收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，2015 年 4 月 10

日广发百发 100 指数 A 类每 10 份基金份额分配 3.60 元, 广发百发 100 指数 E 类每 10 份基金份额分配 3.60 元, 上述利润分配符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内, 本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 诚信、尽责地履行了基金托管人义务, 不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内, 本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查, 未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为; 基金管理人在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容, 认为其真实、准确和完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第 P0769 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
资 产:	-	-
银行存款	78,623,971.67	156,534,126.66
结算备付金	9,033,927.45	21,906,645.60
存出保证金	2,077,942.93	1,023,946.81
交易性金融资产	1,591,584,395.33	2,832,305,201.81
其中: 股票投资	1,591,578,395.33	2,832,305,201.81
基金投资	-	-
债券投资	6,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	64,321,014.32
应收利息	45,584.12	85,794.13
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,681,365,821.50	3,076,176,729.33
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	43,603,210.74
应付赎回款	5,817,981.89	32,243,211.55

应付管理人报酬	693,522.36	1,336,757.35
应付托管费	138,704.47	267,351.48
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,614,693.62	1,834,340.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	506,444.64	317,657.48
负债合计	9,771,346.98	79,602,528.62
所有者权益：	-	-
实收基金	1,445,701,526.22	2,554,363,696.99
未分配利润	225,892,948.30	442,210,503.72
所有者权益合计	1,671,594,474.52	2,996,574,200.71
负债和所有者权益总计	1,681,365,821.50	3,076,176,729.33

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，广发百发 100 指数 A 基金份额净值人民币 1.158 元，基金份额总额 496,754,259.16 份；广发百发 100 指数 E 基金份额净值人民币 1.155 元，基金份额总额 948,947,267.06 份；总份额总额 1,445,701,526.22 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 10 月 30 日（基金 合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	793,429,858.52	479,809,195.11
1.利息收入	2,306,660.04	5,575,790.41
其中：存款利息收入	2,304,381.37	5,575,790.41

债券利息收入	0.92	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,277.75	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	876,330,534.07	382,949,904.56
其中：股票投资收益	869,832,492.05	382,949,904.56
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,498,042.02	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-87,426,808.81	90,601,703.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,219,473.22	681,796.79
减：二、费用	44,479,473.99	9,113,528.25
1. 管理人报酬	11,847,724.53	2,357,777.71
2. 托管费	2,369,544.89	471,555.53
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	29,372,852.91	6,064,268.91
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	889,351.66	219,926.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	748,950,384.53	470,695,666.86
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	748,950,384.53	470,695,666.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,554,363,696.99	442,210,503.72	2,996,574,200.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	748,950,384.53	748,950,384.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,108,662,170.77	-308,952,057.60	-1,417,614,228.37
其中：1.基金申购款	1,814,745,716.10	314,120,292.92	2,128,866,009.02
2.基金赎回款	-2,923,407,886.87	-623,072,350.52	-3,546,480,237.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-656,315,882.35	-656,315,882.35
五、期末所有者权益（基金净值）	1,445,701,526.22	225,892,948.30	1,671,594,474.52
项目	上年度可比期间 2014 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,396,102,218.41	-	2,396,102,218.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	470,695,666.86	470,695,666.86

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	158,261,478.58	-28,485,163.14	129,776,315.44
其中：1.基金申购款	770,811,599.23	40,853,006.23	811,664,605.46
2.基金赎回款	-612,550,120.65	-69,338,169.37	-681,888,290.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,554,363,696.99	442,210,503.72	2,996,574,200.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 王志伟, 主管会计工作负责人: 窦刚, 会计机构负责人: 张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2014]958 号《关于核准广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金募集的批复》核准, 由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起, 于 2014 年 10 月 30 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司, 基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 10 月 20 日至 2014 年 10 月 28 日, 本基金为交易型开放式基金, 存续期限不定, 募集资金总额为人民币 2,396,102,218.41 元, 有效认购户数为 56,929 户。其中广发百发 100 指数基金 A 类基金(“A 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 1,057,619,727.17 元, 认购资金在募集期间的利息为人民币 165,295.16 元; 广发百发 100 指数基金 E 类基金(“E 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额 1,338,179,352.46 元, 认购资金在募集期间的利息为人民币

137,843.62 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证百度百发策略 100 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准：中证百度百发策略 100 指数。

本基金的财务报表于 2016 年 3 月 23 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品

种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，估值处理标准另有规定的除外。于 2015 年 3 月 17 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1.以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2.对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3.对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- 4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5.对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- 6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度末无应付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年10月30日（基金合同 生效日）至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,847,724.53	2,357,777.71

其中：支付销售机构的客户维护费	1,696,924.23	372,058.21
-----------------	--------------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年10月30日（基金合同 生效日）至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,369,544.89	471,555.53

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发百发 100 指数 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发百发 100 指数 E

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年10月30日(基金合同生效日) 至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	78,623,971.67	2,015,427.95	156,534,126.66	978,834.08

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新债流通受限	100.00	100.00	60.00	6,000.00	6,000.00	-

注：截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限股票和权证。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000534	万泽股份	2015-08-06	重大事项	9.45	2016-03-01	9.45	810,592.00	9,441,362.63	7,660,094.40	
000833	贵糖股份	2015-10-19	重大事项	10.20	2016-01-19	9.18	1,153,500.00	17,004,945.04	11,765,700.00	
000925	众合科技	2015-11-03	重大事项	18.48	-	-	584,199.00	11,025,980.43	10,795,997.52	
002006	精功科技	2015-12-11	重大事项	14.70	-	-	960,900.00	13,368,931.50	14,125,230.00	
002049	同方国芯	2015-12-11	重大事项	60.15	2016-03-11	54.14	29,738.00	1,292,519.22	1,788,740.70	
002452	长高集团	2015-07-20	重大事项	9.14	2016-01-06	10.05	13.00	178.10	118.82	
002530	丰东股份	2015-06-08	重大事项	14.99	2016-01-25	21.34	2,286,456.00	35,877,250.72	34,273,975.44	
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事项	17.21	2016-01-19	15.49	433,200.00	7,510,509.88	7,455,372.00	
002698	博实股份	2015-12-28	重大事项	29.33	2016-01-05	26.40	444,800.00	13,555,624.66	13,045,984.00	
300025	华星创业	2015-11-26	重大事项	28.28	-	-	45,822.00	894,246.11	1,295,846.16	
300036	超图软件	2015-10-30	重大事项	43.18	2016-01-15	35.11	591,827.00	19,260,944.02	25,555,089.86	
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	15.80	-	-	109,278.00	1,890,287.02	1,726,592.40	
300049	福瑞股份	2015-11-30	重大事项	31.00	2016-01-04	30.95	22,747.00	803,645.02	705,157.00	
300088	长信科技	2015-12-14	重大事项	14.03	2016-02-29	12.63	9,124.00	167,883.15	128,009.72	
300092	科新机电	2015-11-19	重大事项	14.12	2016-01-13	12.71	846,600.00	11,931,627.50	11,953,992.00	
300323	华灿光电	2015-12-29	重大事项	10.18	2016-01-04	10.20	1,581,900.00	16,277,710.08	16,103,742.00	
600654	中安消	2015-12-14	重大事项	28.84	-	-	115,697.00	4,775,147.06	3,336,701.48	
60068	南京新	2015-07	重大事	32.98	2016-0	33.78	851,030.00	29,400,915.23	28,066,969.4	

2	百	-01	项		1-27				0
600759	洲际油气	2015-09-21	重大事项	7.85	-	-	90.00	984.97	706.50
601018	宁波港	2015-08-04	重大事项	8.16	2016-02-22	7.34	26.00	315.51	212.16

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,401,794,163.77 元，第二层级的余额为 189,784,231.56 元，第三层级的余额为 6,000.00 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的债券。(2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,807,605,810.35 元，第二层级的余额为 24,699,391.46 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

如附注 7.4.5.2 所述，本基金自 2015 年 3 月 17 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,591,578,395.33	94.66
	其中：股票	1,591,578,395.33	94.66
2	固定收益投资	6,000.00	0.00
	其中：债券	6,000.00	0.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	87,657,899.12	5.21
7	其他各项资产	2,123,527.05	0.13
8	合计	1,681,365,821.50	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	16,230,767.20	0.97
B	采矿业	706.50	0.00
C	制造业	1,138,941,197.32	68.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,842,204.04	1.85
E	建筑业	35,421,636.88	2.12
F	批发和零售业	73,887,629.36	4.42
G	交通运输、仓储和邮政业	1,736.67	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	211,621,617.29	12.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,035,064.27	1.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,707,992.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	69.08	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,514,909.12	0.87
R	文化、体育和娱乐业	17,912,356.00	1.07
S	综合	15,460,509.60	0.92
	合计	1,591,578,395.33	95.21

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例(%)
1	002530	丰东股份	2,286,456	34,273,975.44	2.05
2	600682	南京新百	851,030	28,066,969.40	1.68
3	300036	超图软件	591,827	25,555,089.86	1.53
4	002713	东易日盛	575,300	18,409,600.00	1.10
5	300146	汤臣倍健	473,393	18,225,630.50	1.09
6	300045	华力创通	741,027	18,125,520.42	1.08
7	002690	美亚光电	449,000	18,117,150.00	1.08
8	002380	科远股份	451,556	18,102,880.04	1.08
9	000802	北京文化	528,700	17,912,356.00	1.07
10	002446	盛路通信	478,320	17,745,672.00	1.06

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600317	营口港	98,068,921.01	3.27
2	600726	华电能源	84,617,759.99	2.82
3	600601	方正科技	83,867,227.75	2.80
4	300111	向日葵	82,006,436.88	2.74
5	601880	大连港	77,751,789.12	2.59
6	600863	内蒙华电	73,655,590.03	2.46
7	601018	宁波港	72,431,196.50	2.42
8	000572	海马汽车	68,541,467.74	2.29
9	000931	中关村	68,279,689.18	2.28
10	600812	华北制药	67,481,912.82	2.25
11	600321	国栋建设	67,086,261.41	2.24
12	600005	武钢股份	65,895,533.37	2.20
13	600653	申华控股	65,668,479.10	2.19
14	601008	连云港	65,393,999.77	2.18
15	600169	太原重工	65,372,639.21	2.18
16	000063	中兴通讯	64,855,554.93	2.16
17	002135	东南网架	63,319,109.00	2.11
18	002263	大东南	63,294,911.02	2.11
19	002698	博实股份	63,106,599.66	2.11
20	600236	桂冠电力	61,910,407.19	2.07
21	002337	赛象科技	60,796,970.47	2.03
22	002284	亚太股份	60,712,218.66	2.03

23	600033	福建高速	60,652,576.78	2.02
----	--------	------	---------------	------

注：本项及下项8.4.2、8.4.3的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600105	永鼎股份	94,959,017.89	3.17
2	600726	华电能源	90,766,075.70	3.03
3	002318	久立特材	90,637,558.06	3.02
4	600317	营口港	88,537,572.91	2.95
5	002263	大东南	84,930,115.33	2.83
6	600853	龙建股份	84,637,286.52	2.82
7	002421	达实智能	81,471,277.67	2.72
8	601390	中国中铁	81,192,796.10	2.71
9	002062	宏润建设	80,901,208.37	2.70
10	000410	沈阳机床	79,038,918.51	2.64
11	002451	摩恩电气	78,324,335.31	2.61
12	601880	大连港	77,030,484.45	2.57
13	600863	内蒙华电	76,900,098.36	2.57
14	000709	河北钢铁	76,093,055.90	2.54
15	601186	中国铁建	75,122,423.68	2.51
16	600876	洛阳玻璃	74,957,630.13	2.50
17	000931	中关村	73,877,421.86	2.47
18	601106	中国一重	73,492,777.17	2.45
19	600118	中国卫星	72,168,862.52	2.41
20	600125	铁龙物流	71,139,600.05	2.37
21	600808	马钢股份	70,918,136.06	2.37
22	600104	上汽集团	69,391,762.53	2.32
23	002135	东南网架	69,383,364.93	2.32
24	600236	桂冠电力	69,004,761.65	2.30
25	600016	民生银行	67,609,744.52	2.26
26	002284	亚太股份	66,283,880.56	2.21
27	000533	万家乐	66,000,639.98	2.20
28	000876	新希望	65,708,177.06	2.19

29	000875	吉电股份	64,539,932.61	2.15
30	601018	宁波港	64,232,009.60	2.14
31	600601	方正科技	63,050,197.08	2.10
32	002642	荣之联	62,635,520.68	2.09
33	300111	向日葵	62,343,661.81	2.08
34	002698	博实股份	62,010,275.20	2.07
35	600012	皖通高速	61,130,633.68	2.04
36	600005	武钢股份	60,634,027.51	2.02
37	600020	中原高速	60,612,895.39	2.02
38	600106	重庆路桥	60,511,917.47	2.02
39	000063	中兴通讯	60,340,166.77	2.01
40	600308	华泰股份	59,985,014.95	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	16,139,583,176.42
卖出股票的收入（成交）总额	18,162,715,666.14

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,000.00	0.00

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	60	6,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,077,942.93
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	45,584.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,123,527.05

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002530	丰东股份	34,273,975.44	2.05	重大事项
2	600682	南京新百	28,066,969.40	1.68	重大事项
3	300036	超图软件	25,555,089.86	1.53	重大事项

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发百发 100 指数 A	21,539	23,063.01	11,994,146.84	2.41%	484,760,112.32	97.59%
广发百发 100 指	40,626	23,358.13	80,994,104.31	8.54%	867,953,162.75	91.46%

数 E						
合计	62,165	23,255.88	92,988,251.15	6.43%	1,352,713,275.07	93.57%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发百发 100 指数 A	24,814.80	0.0050%
	广发百发 100 指数 E	5,905,726.98	0.6223%
	合计	5,930,541.78	0.4102%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发百发 100 指数 A	0
	广发百发 100 指数 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发百发 100 指数 A	0
	广发百发 100 指数 E	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发百发 100 指数 A	广发百发 100 指数 E
基金合同生效日（2014 年 10 月 30 日）基金份额总额	1,057,785,022.33	1,338,317,196.08
本报告期期初基金份额总额	1,127,030,649.31	1,427,333,047.68
本报告期基金总申购份额	552,021,760.15	1,262,723,955.95
减：本报告期基金总赎回份额	1,182,298,150.30	1,741,109,736.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	496,754,259.16	948,947,267.06

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 4 月 30 日，包林生不再担任本基金管理人的副总经理。2015 年 5 月 23 日，肖雯不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
兴业证券	2	8,618,386,701.67	25.12%	1,846,667.28	25.01%	-
中投证券	2	7,759,091,950.89	22.62%	1,696,642.63	22.97%	-
东北证券	2	6,711,052,757.73	19.56%	1,442,516.03	19.53%	-
中信证券	2	11,213,740,992.27	32.69%	2,398,921.03	32.48%	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 能积极为公司投资业务的开展, 提供良好的信息交流和客户服务;

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程:

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估, 确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议, 并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	16,200,000.00	100.00%	-	-

广发基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日