

广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金招募说明书[更新]摘要

要 [2016 年第 2 号]

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

时间：二〇一六年十一月

【重要提示】

本基金于 2014 年 9 月 15 日经中国证监会证监许可[2014] 958 号文注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金是指数基金，其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险等。

投资有风险，投资人拟认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》与《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2016 年 10 月 30 日，有关财务数据截止日为 2016 年 9 月 30 日，净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日。

第一部分 基金管理人

一、概况

- 1、名称：广发基金管理有限公司
- 2、住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
- 3、办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31—33楼
- 4、法定代表人：孙树明
- 5、设立时间：2003年8月5日
- 6、电话：020-83936666
- 全国统一客服热线：95105828
- 7、联系人：段西军
- 8、注册资本：1.2688亿元人民币
- 9、股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、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，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

孙树明：董事长，男，经济学博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中国注册会计师协会道德准则委员会委员，中国资产评估协会常务理事，上海证券交易所第三届理事会理事，上海证券交易所第一届上市咨询委员会委员，广东金融学会副会长，广东省预算腐败工作专家咨询委员会财政金融运行规范组成员，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。曾任财政部条法司副处长、处长，中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，中国银河证券有限公司监事会监事，中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传辉：副董事长，男，大学本科学历，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事长，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员、资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理。

孙晓燕：董事，女，硕士，现任广发证券副总裁、财务总监，兼任广发控股（香港）有限公司董事，证通股份有限公司监事，监事长。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理、广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俊：董事，男，管理学硕士，高级经济师，现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书，兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公

司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏征信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事；兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿：董事，女，工商管理硕士，现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人，深圳香江控股股份有限公司董事长，南方香江集团董事长，香江集团有限公司总裁。兼任全国政协委员，全国妇联常委，中国女企业家协会副会长，广东省妇联副主席，广东省工商联副主席，广东省女企业家协会会长，香江社会救助基金会主席，深圳市深商控股集团股份有限公司董事，广东南粤银行董事，深圳龙岗国安村镇银行董事。

许冬瑾：董事，女，工商管理硕士，主管药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理，兼任中国中药协会中药饮片专业委员会专家，全国中药标准化技术委员会委员，全国制药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员，国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工专业专家委员会副主任委员，广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云：独立董事，男，法学博士，教授，博士生导师，现任复旦大学教授，兼任宁波大学特聘教授，上海四维乐马律师事务所兼职律师，绍兴银行独立董事，海尔施生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系副主任，复旦大学法学院副院长。

姚海鑫：独立董事，男，经济学博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学新华国际商学院教授，兼任东北制药（集团）股份有限公司及沈阳化工股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记。

罗海平：独立董事，男，经济学博士，现任中华联合财产保险股份有限公司董事长，兼任中华联合保险控股股份有限公司常务副总裁。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理，太平保险湖北分公司总经理，太平保险公司总经理助理，太平保险公司副总经理兼纪委书记，民安保险（中国）有限公司副总裁，阳光财产保险股份有限公司总裁，阳光保险集团执行委员会委员，中华联合财产保险股份有限公司总裁。

2、监事会成员

符兵：监事会主席，男，西方经济学硕士，经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长，广东发展银行广州分行支行长、总行资金部处长，广发基金管理有限公司广州分公司总经理、市场拓展部副总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡丽军：监事，女，工商管理硕士，高级涉外秘书，现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任，广州屈臣氏公司行

政主管，广州市科达实业发展公司办公室主任、总经理，广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉：监事，男，工学硕士，现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理，兼任广发基金分工会主席。曾任广发证券电脑中心员工、副经理、经理。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉：总经理，男，大学本科学历，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事长，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理。

朱平：副总经理，男，硕士，经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理，易方达基金管理有限公司投资部研究负责人，广发基金管理有限公司总经理助理，中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。

易阳方：副总经理，男，经济学硕士，经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发聚丰混合型证券投资基金基金经理、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事，瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理、总经理助理，广发制造业精选混合型证券投资基金基金经理。

段西军：督察长，男，博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

邱春杨：副总经理，男，经济学博士，瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员，广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、产品总监、金融工程部总经理。

魏恒江：副总经理，男，工学硕士，高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗：副总经理，女，管理学硕士，兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国农业科学院助理研究员，中国证监会培训中心、监察局科员，基金监管部副处长及处长，私募基金监管部处长。

4、基金经理

季峰，男，中国籍，管理学博士，7年证券和基金从业经历，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 日至 2016 年 5 月 25 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 日至 2016 年
5 月 25 日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 日至 2016 年 5 月 25 日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。

历任基金经理：陆志明，任职时间为 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 27 日。

5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

主席：公司总经理林传辉；成员：公司副总经理易阳方，权益投资总监刘晓龙，权益投资
一部总经理李巍，研究发展部总经理孙迪，固定收益投资总监张芊。上述人员之间均不存
在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：190.52336751 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字【2005】74 号

联系人：林成

联系电话：021-52629999-212012

传真：021-62159217

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银
行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票
代码：601166），注册资本 190.52 亿元。

兴业银行主要经营范围包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结
算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政
府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；
资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；
提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资

信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理机构批准的其他业务。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务，坚持走差异化发展道路，经营实力不断增强。根据 2015 年业绩快报，截至 2015 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 5.30 万亿元，实现营业收入 1544.99 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 502.57 亿元。.

在 2015 年英国《银行家》杂志全球银行 1000 强排名中，兴业银行按一级资本排名列第 36 位；在 2015 年《福布斯》全球上市企业 2000 强排名中，兴业银行位居第 73 位；在 2015 年《财富》世界 500 强中，兴业银行排名第 271 位，稳居全球银行 50 强、全球上市企业 100 强、世界企业 500 强。同时，在国内外各种权威机构组织的评比中，先后荣获“最佳中资银行”、“最佳战略创新银行”、“最佳绿色银行”、“亚洲可持续银行奖冠军”、“年度金控集团”、“最佳普惠金融银行”、“中国上市公司卓越董事会（主板）”、“亚洲最佳股东回报银行”、“最具社会责任上市公司”、“中华慈善突出贡献（单位）奖”、“中国最佳雇主”等多项大奖。

二、基金托管部门及主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处和养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、基金托管业务经营情况

截至 2016 年 6 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 95 只，托管基金财产规模 3,451.64 亿元”更新为“截至 2016 年 9 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 106 只，托管基金财产规模 4118.21 亿元。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务：

（1）广州分公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东 3 号保利国际广场南塔 17 楼

直销中心电话：020-89899073 020-89899042

传真：020-89899069 020-89899070

（2）北京分公司

地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 11 层

电话：010-68083368

传真：010-68083078

(3) 上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路 166 号 905-10 室

电话：021-68885310

传真：021-68885200

(4) 网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：www.gffunds.com.cn

本公司网址：www.gffunds.com.cn

客服电话：95105828（免长途费）或 020-83936999

客服传真：020-34281105

(7) 投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2、代销机构

(1) 名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：赵会军

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

(2) 名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

传真：010-66594946

公司网站：www.boc.cn

(3) 名称：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

网址: www.bankcomm.com

(4) 名称: 招商银行股份有限公司

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 傅育宁

客服电话: 95555

公司网站: www.cmbchina.com

(5) 名称: 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 常振明

联系人: 廉赵峰

联系电话: 010-65557048

业务传真: 010-65550827

客服热线: 95558

公司网址: www.bank.ecitic.com

(6) 名称: 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人: 高建平

联系人: 刘玲

电话: 021-52629999

客服电话: 95561, 或拨打当地咨询电话

公司网站: www.cib.com.cn

(7) 名称: 上海银行股份有限公司

注册地址: 上海市银城中路 168 号

法定代表人: 宁黎明

联系人: 张萍

电话: 021-68475888:

传真: 021-68476111

客服电话: 021-962888

公司网站: www.bankofshanghai.com

(8) 名称: 广发银行股份有限公司

住所: 广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人: 董建岳

联系人: 詹全鑫、张大奕

电话: 020-38322222、0571-96000888

传真：020-87311780

客服电话：400-830-8003

公司网站：www.cgbchina.com.cn

（9）名称：广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦

法定代表人：王继康

联系人：黎超雄

联系电话：020-28019593

业务传真：020-28852692

客服热线：020-961111

公司网址：www.grcbank.com

（10）名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

业务传真：021-68596916

客服热线：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

（11）名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

（12）名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

（13）名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服电话：95548

公司网站：www.cs.ecitic.com

（14）名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务热线：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

（15）名称：中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

联系人：王霏霏

电话：0571-86078823

客服电话：95548

公司网站：www.bigsun.com.cn

（16）名称：中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层（266061）

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服电话：95548

公司网站: www.zxwt.com.cn

(17) 名称: 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系人: 刘晨

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客服电话: 4008888788, 10108998, 95525

公司网站: www.ebscn.com

(18) 名称: 广州证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人: 刘东

联系人: 林洁茹

电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

客服电话: 020-961303

公司网站: www.gzs.com.cn

(19) 名称: 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市自由大路 1138 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 矫正中

联系人: 安岩岩

联系电话: 0431-85096517

开放式基金咨询电话: 4006000686

开放式基金业务传真: 0431-85096795

公司网站: www.nesc.cn

(20) 名称: 平安证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层;

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层;

法定代表人: 谢永林

全国免费业务咨询电话: 95511-8

开放式基金业务传真: 0755-82400862

全国统一总机: 95511-8

网址: www.pingan.com

(21) 名称: 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人: 黄金琳

联系人: 张腾

电话: 0591-87383623

传真: 0591-87383610

公司网站: www.hfzq.com.cn

客服电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)

(22) 名称: 财通证券股份有限公司

注册地址: 杭州市解放路 111 号

法定代表人: 沈继宁

联系人: 徐轶青

电话: 0571-87822359

传真: 0571-87818329

客服电话: 95336 (浙江), 40086-96336 (全国)

公司网站: www.ctsec.com

(23) 名称: 中国中投证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人: 龙增来

联系人: 刘毅

电话: 0755-82023442

传真: 0755-82026539

开放式基金咨询电话: 95532、400-600-8008

公司网站: www.china-invs.cn

(24) 名称: 天风证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址: 湖北省武汉市江汉区唐家墩路 32 号国资大厦 B 座

法人代表: 余磊

联系人: 翟璟

联系电话: 027-87618882

客服电话: 4008005000

传真: 027-87618863

公司网址: www.tfzq.com

(25) 名称: 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址: 江苏省常州市延陵中路 668 号

办公地址: 江苏省常州市延陵中路 668 号

法人代表: 王国琛

联系人: 续志刚

联系电话: 0519-89995001

客服电话: 0519-96005

传真: 0519-89995001

网址: www.jnbank.cc

(26) 名称: 中国邮政储蓄银行

注册地址: 北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人: 李国华

联系人: 栗先生

电话: 010-68857763

传真: 010-68858859

客服电话: 95580

公司网址: www.psbc.com

(27) 名称: 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人: 燕斌

联系人: 凌秋艳

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

客服电话: 4000-466-788

公司网址: www.66zichan.com (28) 名称: 第一创业证券股份有限公司

通讯地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人: 刘学民

传真: 0755-23838750

联系人: 毛诗莉

客服电话: 4008881888

公司网站: www.fcsc.cn

(29) 名称: 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：张裕

联系电话：15801816961

客服热线：4000676266

公司网址：www.leadfund.com.cn

（30）名称：哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人：郭志文

联系人：王超

电话：0451-86779007

传真：0451-86779218

客服电话：95537

公司网站：www.hrbb.com.cn

（31）名称：开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：黄芳、袁伟涛

电话：029-63387256

传真：029-81887060

客服电话：400-860-8866

公司网址：www.kysec.cn

（32）名称：中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

联系电话：010-59355941

客服电话：40088-95618

公司网站：www.e5618.com

（33）名称：联讯证券有限责任公司

注册地址：广东省惠州市下埔路 14 号

法定代表人：徐刚

客服电话：400-8888-929

联系人：丁宁

电话：010-64408820

传真：010-64408252

公司网站：www.lxsec.com

（34）名称：平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号

办公地址：深圳市深南中路 1099 号

法定代表人：孙建一

联系人：蔡宇洲

电话：0755-22197874 25879591

传真：0755-22197701

客服电话：95511-3

公司网站：http://bank.pingan.com

（35）名称：厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：林松

联系人：李智磊

联系电话：0592-3122679

业务传真：0592-8060771

客服热线：0592-3122731

公司网址：www.xds.com.cn

（36）名称：北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

电话：13521165454

传真：010-67000988-6003

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

（37）名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

联系电话：021-38600735

业务传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（38）名称：鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼1701室

办公地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室

法定代表人：齐凌峰

联系人：阮志凌

电话：010-82151989

传真：010-82158631

客服电话：400-158-5050

公司网址：www.9ifund.com

（39）名称：徽商银行股份有限公司

住所：安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座

法定代表人：王晓昕

联系人：叶卓伟

电话：0551-2667635

传真：0551-2667684

客服电话：4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)

公司网站：www.hsbank.com.cn

（40）名称：德州银行股份有限公司

注册地址：山东省德州市三八东路1266号

办公地址：山东省德州市三八东路1266号法定代表人：申健

联系人：王方震

电话：0534-2297326

传真：0534-2297327

客服电话：40084-96588

公司网址：www.dzbchina.com

（41）名称：天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路15号

办公地址：天津市河西区友谊路15号

法定代表人：王金龙

联系人：杨森

电话：022-28405330

传真：022-28405631

客服电话：4006-960296

公司网站: www.bank-of-tianjin.com

(42) 名称: 首创证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址: 北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人: 吴涛

联系人: 刘宇

联系电话: 010-59366070

业务传真: 010-59366055

客服热线: 400-620-0620

公司网址: www.sczq.com.cn

(43) 名称: 华泰证券股份有限公司

住所: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人: 周易

电话: 0755-82492193

传真: 0755-82492962

联系人: 庞晓芸

客服电话: 95597

公司网站: www.htsc.com.cn

(44) 名称: 富滇银行股份有限公司

注册地址: 云南省昆明市拓东路 41 号

办公地址: 云南省昆明市拓东路 41 号

法定代表人: 夏 蜀

联系人: 戴秋娟

联系电话: 0871-63140324

业务传真: 0871-63194471

客服热线: 4008896533

公司网址: www.fudian-bank.com

(45) 名称: 宁波银行股份有限公司

住所: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

联系人: 胡技勋

联系方式: 0574-89068340

传真: 0574-87050024

客服电话: 96528, 上海、北京地区 962528

公司网站: www.nbcb.com.cn

3、其他代销机构

本基金发售期间，若新增代销机构或代销机构新增营业网点，则另行公告。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

二、注册登记人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室

法定代表人：孙树明

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31—33楼

电话：020-89188970

传真：020-89899175

联系人：李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市盈科（广州）律师事务所

住所：广东省广州市广州大道中289号南方传媒大厦15-18层

负责人：牟晋军

电话：020-66857288

传真：020-366857289

经办律师：刘智、陈琛

联系人：牟晋军

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼

法人代表：卢伯卿

电话：021-61418888

传真：021-63350003

经办注册会计师：王明静、吴迪

第四部分 基金的名称

广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金

第五部分 基金的类型

股票型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

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。

第七部分 基金的投资方向

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略

一、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。

（一）资产配置策略

本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

（二）股票投资策略

1、股票组合构建原则

本基金采用完全复制法跟踪中证百度百发策略 100 指数，按照个股在标的指数中证百度百发策略 100 指数中的基准权重构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，

降低跟踪误差。

如出现股票停牌、股票流动性较差或其他影响指数复制的因素，使基金管理人无法依指数权重购买成份股时，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。

3、股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的中证百度百发策略 100 指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1) 与指数相关的调整

根据指数编制规则，当中证百度百发策略 100 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重重调整时，本基金将进行相应调整。

2) 申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3) 其它调整

根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（三）债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

（四）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

（五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于提高基金资产的投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

二、投资决策依据和投资程序

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整等决策。

3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：数量投资部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）绩效评估：绩效评估与风险管理组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为：中证百度百发策略 100 指数。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金投资组合报告

本基金管理人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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 28 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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
----	----	-------	--------------

1	权益投资	1,060,880,196.11	94.01
---	------	------------------	-------

其中：股票	1,060,880,196.11	94.01
-------	------------------	-------

2	固定收益投资	-	-
---	--------	---	---

其中：债券	-	-
-------	---	---

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	65,996,642.11	5.85
---	--------------	---------------	------

7	其他各项资产	1,545,214.76	0.14
---	--------	--------------	------

8	合计	1,128,422,052.98	100.00
---	----	------------------	--------

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
---	----------	---	---

B	采矿业	-	-
---	-----	---	---

-			
---	--	--	--

C	制造业	456,710,000.98	40.70
---	-----	----------------	-------

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,632,063.00	3.71
---	------------------	---------------	------

E	建筑业	40,353,684.48	3.60
---	-----	---------------	------

F 批发和零售业 77,076,871.18 6.87

G 交通运输、仓储和邮政业 40,810,262.16 3.64

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 104,913,229.27 9.35

J 金融业 62,457,966.69 5.57

K 房地产业 142,146,505.58 12.67

L 租赁和商务服务业 31,814,199.17 2.84

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 32,198,605.00 2.87

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 --

R 文化、体育和娱乐业 20,594,261.60 1.84

S 综合 10,172,547.00 0.91

合计 1,060,880,196.11 94.54

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。

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000656	金科股份	2,485,200	13,544,340.00	1.21
2	300300	汉鼎宇佑	377,500	12,317,825.00	1.10
3	600747	大连控股	2,388,200	12,036,528.00	1.07
4	600246	万通地产	2,011,100	11,805,157.00	1.05
5	000610	西安旅游	748,300	11,576,201.00	1.03
6	002251	步步高	809,868	11,564,915.04	1.03
7	600367	红星发展	735,624	11,527,228.08	1.03
8	002590	万安科技	467,384	11,474,277.20	1.02
9	600159	大龙地产	2,013,154	11,374,320.10	1.01
10	002663	普邦园林	1,659,200	11,299,152.00	1.01

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告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。

7、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、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

10、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。

11、投资组合报告附注

1) 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2) 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3) 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 448,206.27

2 应收证券清算款 63,499.59

3 应收股利 -

4 应收利息 29,272.54

5 应收申购款 1,004,236.36

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,545,214.76

4) 报告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。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 000656 金科股份 13,544,340.00 1.21 重大事项停牌

2 300300 汉鼎宇佑 12,317,825.00 1.10 重大事项停牌

3 600246 万通地产 11,805,157.00 1.05 重大事项停牌

第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2016 年 6 月 30 日。

1. 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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

2014.10.30-2014.12.31 17.30% 1.61% 19.88% 1.72% -2.58% -0.11%

2015.1.1-2015.12.31 27.06% 3.24% 44.68% 2.89% -17.62% 0.35%

2016.1.1-2016.6.30 -19.43% 2.89% -17.79% 2.82% -1.64% 0.07%

自基金合同生效起至今 20.08% 3.00% 42.27% 2.76% -22.19% 0.24%

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

2014.10.30-2014.12.31 17.30% 1.60% 19.88% 1.72% -2.58% -0.12%

2015.1.1-2015.12.31 26.76% 3.24% 44.68% 2.89% -17.92% 0.35%

2016.1.1-2016.6.30 -19.39% 2.90% -17.79% 2.82% -1.60% 0.08%

自基金合同生效起至今 19.86% 3.00% 42.27% 2.76% -22.41% 0.24%

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)。

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

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 2016 年 6 月 30 日)

1. 广发百发 100 指数 A:

2. 广发百发 100 指数 E:

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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。

2、基金托管人的托管费

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。

3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费

本基金《基金合同》生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E\times 0.02\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。本基金标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元。

标的指数许可使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后

的费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金》（2016年1号）进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。
2. 在“第四部分 基金托管人”部分，根据基金托管人人员变动及业务经营情况对基金托管人信息进行了相应更新。
3. 在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了相关的代销机构，对原有销售机构的资料进行更新。
4. 在“第九部分 基金的投资”部分，更新了截至2016年9月30日的基金投资组合报告。
5. 在“第十部分 基金的业绩”部分，更新了截至2016年6月30日的基金业绩。
6. 根据最新公告，对“第二十二部分 其他应披露事项”内容进行了更新。

广发基金管理有限公司

二〇一六年十一月十二日