广发深证100指数分级证券投资基金之广发100A与广发100B上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2012年6月12日
公告日期：2012年6月7日

一、重要声明与提示

广发深证100指数分级证券投资基金之广发100A与广发100B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》以下简称“基金法”)、证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>)和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，广发深证100指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对广发深证100指数分级证券投资基金之广发100A与广发100B上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2012年3月22日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和广发基金管理有限公司网站(www.gffunds.com.cn)的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金简称：广发深证100指数分级证券投资基金
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、本基金的基金份额包括广发深证100指数分级证券投资基金之基础份额(简称“广发深证100份额”，场内简称“广发100”，基金代码：162714)、广发深证100指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(场内简称“广发100A”)与广发深证100指数分级证券投资基金之积极收益类份额(场内简称“广发100B”)。其中，广发100A份额、广发100B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。
5、本基金的存续期限为不定期。
6、广发100份额的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对广发100份额进行申购与赎回。广发100份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司(深圳)开放式基金账户办理广发100场外申购、赎回业务。广发100份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理广发100份额场内申购、赎回业务。广发100A份额与广发100B份额将不接受投资者的申购与赎回。
7、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的广发100份额与广发100A份额、广发100B份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每两份广发100份额的场内份额申请转换成一份广发100A份额与一份广发100B份额的行为；合并指基金份额持有人将其持有的每一份广发100A份额与一份广发100B份额申请转换成两份广发100份额的场内份额的行为。
8、定期份额折算
在广发100A份额、广发100份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金的广发100A份额、广发100份额进行定期份额折算。对于广发100A份额期末的约定应得收益，即广发100A份额每个会计年度12月31日基金份额参考净值超出本金1.0000元部分，将折算为场内广发100份额分配给广发100A份额持有人。广发100份额持有人持有的每2份广发100份额将按1份广发100A份额获得新增广发100份额的分配。持有场外广发100份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外广发100份额的分配；持有场内广发100份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内广发100份额的分配。经过上述份额折算，广发100A份额的基金份额参考净值和广发100份额的基金份额净值均调整为1元。
9、不定期份额折算
当广发100份额的基金份额净值达到2.0000元后，本基金将分别对广发100A份额、广发100B份额和广发100份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保广发100A份额和广发100B份额的比例为1:1，份额折算后广发100A份额、广发100B份额的基金份额参考净值和广发100份额的基金份额净值均调整为1元。
当广发100B份额的基金份额参考净值达到0.2500元后，本基金将分别对广发100A份额、广发100B份额和广发100份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保广发100A份额和广发100B份额的比例为1:1，份额折算后广发100份额的基金份额参考净值、广发100A份额和广发100B份额的基金份额参考净值均调整为1元。
10、基金份额总额：截至2012年6月5日，本基金的基金份额总额为567,698,320.60份，其中，广发100份额为346,516,015.60份，广发100A份额为110,591,152份，广发100B份额为110,591,153份。
11、基金份额净值：截至2012年6月5日，广发100份额的基金份额净值为0.9858元，广发100A份额的基金份额参考净值为1.0057元，广发100B份额的基金份额参考净值为0.9659元。
12、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：广发100A(基金代码：150083)；广发100B(基金代码：150084)。
13、本次上市交易的基金份额总额：广发100A 110,591,152份；广发100B 110,591,153份。
14、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
15、上市交易日期：2012年6月12日
16、基金管理人：广发基金管理有限公司
17、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
18、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可〔2012〕200号
2、基金运作方式：契约型开放式。
3、基金合同期限：不定期
4、发售日期：2012年3月27日至2012年4月26日
5、发售价格：1.00元人民币
6、发售方式：场外、场内认购
7、发售机构：
(1)场内发售机构：
本基金场内发售的机构为具有基金代销业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。
(2)场外发售机构：
1)直销机构
直销机构包括本公司广州、北京、上海设立的分公司、深圳理财中心、杭州理财中心及本公司网上交易系统。
2)代销机构
中国建设银行股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、华福证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、招商证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、财通证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、中航证券有限公司、长江证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、江海证券有限公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、厦门证券有限公司、南京证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、天风证券股份有限公司等代销机构。
8、验资机构名称：深圳市鹏城会计师事务所有限公司。
9、募集资金总额及入账情况：本次募集的有效净认购金额为567,583,565.44元人民币，折合基金份额567,583,565.44份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计115,509.75元人民币，折合基金份额114,755.16份(按招募说明书等法律文件的规定；场内有效认购款项在募集期间产生的利息计算结果保留至整数位(最小单位为1元)，小数点后部分舍去，舍去部分计入基金财产；场外利息计算结果保留至小数点后两位。按此规则，上述利息115,509.75元人民币折合基金份额114,755.16份，折算差额人民币754.59元计入基金财产)。本次募集所有资金567,698,320.60(包含利息)已于2012年5月4日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的广发深证100指数分级证券投资基金托管专户。
10、本基金募集备案情况：根据《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》等相关法律、法规的规定以及《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，广发基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2012年5月7日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。
11、基金合同生效日：2012年5月7日。
12、基金合同生效的基金份额总额：567,698,320.60份。
(二)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上〔2012〕157号
2、上市交易日期：2012年6月12日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基础份额简称及代码：广发深证100份额
场内简称：广发100，基金代码：162714
稳健收益类份额场内简称：广发100A，基金代码：150083
积极收益类份额场内简称：广发100B，基金代码：150084
5、本次上市交易份额：广发100A 110,591,152份；广发100B 110,591,153份。
6、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值
基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率T”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金公计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。
7、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的广发深证100份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为广发100A份额和广发100B份额即可上市流通；对于托管在场外的广发深证100份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为广发100A份额和广发100B份额即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

(一)基金份额持有情况
截至2012年6月5日，广发100基金份额持有人户数为824户，平均每户持有的基金份额为420,529.15份；广发100A为1,240户，平均每户持有的基金份额为89,186.41份；广发100B为1,240户，平均每户持有的基金份额为89,186.41份。
机构投资者持有的本次上市交易的广发100A基金份额为33,153,354份，占本次广发100A上市交易基金份额比例为29.9783%；个人投资者持有的本次上市交易的广发100A基金份额为77,437,798份，占本次广发100A上市交易基金份额比例为70.0217%。
机构投资者持有的本次上市交易的广发100B基金份额为33,153,356份，占本次广发100B上市交易基金份额比例为29.9783%；个人投资者持有的本次上市交易的广发100B基金份额为77,437,797份，占本次广发100B上市交易基金份额比例为70.0217%。
(二)截止到2012年6月5日，基金份额前十名持有人情况：
1、广发100A前十名持有人情况表

序号	持有人名称	广发100A份额	占广发100A份额比例
1	红塔证券股份有限公司	10,000,972.00	9.04%
2	林锐鹏	5,800,063.00	5.24%
3	东方证券股份有限公司	5,000,486.00	4.52%
4	海通证券股份有限公司	5,000,486.00	4.52%
5	国信-招行-国信金理财收益互换(多策略)集合资产管理计划	5,000,486.00	4.52%
6	杨伟平	2,525,286.00	2.28%
7	梁来深	2,500,313.00	2.26%
8	国元农业保险股份有限公司-传统保险产品	2,500,278.00	2.26%
9	东吴证券-工行-东吴财富2号集合资产管理计划	2,500,277.00	2.26%
10	邵景福	2,500,243.00	2.26%
合计		43,328,890.00	39.18%

2、广发100B持有人情况表

序号	持有人名称	广发100B份额	占广发100B份额比例
1	红塔证券股份有限公司	10,000,972.00	9.04%
2	林锐鹏	5,800,064.00	5.24%
3	东方证券股份有限公司	5,000,486.00	4.52%
4	海通证券股份有限公司	5,000,486.00	4.52%
5	国信-招行-国信金理财收益互换(多策略)集合资产管理计划	5,000,486.00	4.52%
6	杨伟平	2,525,286.00	2.28%
7	梁来深	2,500,312.00	2.26%
8	东吴证券-工行-东吴财富2号集合资产管理计划	2,500,278.00	2.26%
9	国元农业保险股份有限公司-传统保险产品	2,500,277.00	2.26%
10	邵景福	2,500,243.00	2.26%
11	申银万国-中信-申银万国3号基金宝集合资产管理计划	2,500,243.00	2.26%
合计		45,829,133.00	41.44%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、公司概况
名称：广发基金管理有限公司
法定代表人：王志伟
总经理：林传辉
注册资本：1.2亿元人民币
注册地址：广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
设立批准文号：中国证监会证监基字〔2003〕91号
工商登记注册的法人营业执照文号：440000000011836
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
2、股东及其出资比例：广发证券股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、烽火通信科技股份有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司，分别持有本基金管理人48.33%、16.67%、16.67%、10%和8.33%的股权。
3、内部组织结构及职能

委员会名称	职责
投资决策委员会	决定公募基金的投资理念、投资准则；研判市场时机，审议公募基金经理提交的资产配置报告，确定公募基金资产配置比例；评估并审定公募基金投资策略及拟重点投资的证券；对委员会决议的执行情况进行监督等。
风险控制委员会	负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程，确保公司整体风险的识别、监控和管理；负责检查风险控制制度的落实情况，审阅公司各项风险与内控状况评价报告；针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况，组成危机处理小组，评估事件风险，制定危机处理方案并监督实施等。

部门名称	职能定位
投资管理部	负责公募股票类基金产品的投资管理。
研究发展部	负责宏观策略、行业与上市公司研究。
机构投资部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理。
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理。
国际业务部	负责QDII基金的投资管理。
数量投资部	负责公募指数型基金的管理、指数衍生产品(包括股指期货等)的研究和应用、量化选股的投资产品研究和管理。
金融工程部	负责产品开发、设计、报批工作，公司发展规划研究。
市场拓展部	负责公募基金、一对多专户理财产品的募集与持续销售、营销推广、客户服务工作，下设北京、上海、广州三个分公司及深圳理财中心。
机构理财部	负责企业年金、“一对一”专户理财业务、机构业务的市场开拓与服务。
综合管理部	负责行政管理与后勤保障。
财务部	负责公司财务管理工作。
人力资源部	负责人力资源管理。
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理，投资风险监控与业绩归因分析。
中央交易部	负责执行基金、组合交易指令，实施一线风险监控等。
信息技术部	负责公司信息化建设工作。
注册登记部	负责开放式基金和资产管理计划份额的登记存管和资金的清算管理。
基金会计部	负责开放式基金、年金资产和资产管理计划的核算及相关信息披露工作。
北京办事处	负责协调办理公司在京有关事项。

4、截止2012年5月31日，广发基金管理有限公司总人数246人，其中博士学位17人，硕士学位134人和学士学位81人。
5、本基金经理
陆志明，男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员，2001年5月至2010年8月就职于深圳证券信息有限公司，历任指数小组组长、指数部副总监、总监，2010年8月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300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011年6月9日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2012年5月7日起任广发深证100指数分级证券投资基金的基金经理。
(二)基金托管人
1、概况
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔1998〕12号
联系人：尹 东
联系电话：010)6759 5003
中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。
截至2011年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。
中国建设银行在中国内地设有1,3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在英斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。
中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。
中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海各份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。
2、主要人员情况
杨新丰，投资托管服务部副总经理(主持工作)，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、钉长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
3、基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。
(三)注册登记人
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：010-59378835
传真：010-59378907
联系人：任瑞新
(四)验资机构
名称：深圳市鹏城会计师事务所有限公司
办公地址：深圳市福田区滨河路与彩田路交汇处联合广场A栋塔楼
法人代表：饶永
电话：0755-83732888
传真：0755-82237549
经办注册会计师：杨克晶 栩文欣
联系人：杨克晶

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金2012年6月5日资产负债表如下：

资 产	2012年6月5日	负债和所有者权益	2012年6月5日
	余额		余额
资 产：		负债：	
银行存款	197,893,450.23	短期借款	
结算备付金	5,264,202.02	交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	356,681,406.69	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	356,681,406.69	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	77,514.34
基金投资		应付托管费	17,053.16
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	298,513.90
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	232,602.27	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	41,614.84
其他资产		负债合计	434,696.24
		所有者权益：	
		实收基金	567,698,320.60
		未分配利润	-8,061,355.63
		所有者权益合计	559,636,964.97
资产合计：	560,071,661.21	负债与持有人权益总计：	560,071,661.21

八、基金投资组合
截止到2012年6月5日，本基金的投资组合如下：
(一)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	356,681,406.69	63.68
	其中：股票	356,681,406.69	63.68
2	固定收益投资	-	
	其中：债券	-	
	资产支持证券	-	
3	金融衍生品投资	-	
4	买入返售金融资产	-	
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	
5	银行存款和结算备付金合计	203,157,652.25	36.27
6	其他各项资产	232,602.27	0.04
7	合计	560,071,661.21	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

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	1,455,857.00	0.26
B	采掘业	27,428,575.16	4.90
C	制造业	215,558,643.23	38.52
C0	食品、饮料	49,344,539.96	8.82
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,283,159.48	2.19
C5	电子	12,792,565.00	2.29
C6	金属、非金属	47,167,603.80	8.43
C7	机械、设备、仪表	76,857,061.10	13.73
C8	医药、生物制品	17,113,713.89	3.06
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,831,980.00	0.33
E	建筑业	2,594,582.50	0.46
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	9,090,396.00	1.62
H	批发和零售贸易	12,470,481.00	2.23
I	金融、保险业	26,755,766.92	4.78
J	房地产业	39,818,186.65	7.12
K	社会服务业	6,000,114.88	1.07
L	传播与文化产业	4,275,560.75	0.76
M	综合类	9,401,262.60	1.68
	合计	356,681,406.69	63.73

(三)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	000002	万 科A	2,556,825	23,292,675.75	4.16
2	000858	五 粮 液	533,500	17,488,130.00	3.12
3	000651	格力电器	642,130	14,197,494.30	2.54
4	000157	中联重科	1,221,905	12,805,564.40	2.29
5	000001	深发展A	781,600	11,927,216.00	2.13
6	002024	苏宁电器	1,284,100	11,081,783.00	1.98
7	002304	洋河股份	67,412	9,383,750.40	1.68
8	000568	泸州老窖	206,931	8,204,814.15	1.47
9	000063	中兴通讯	556,100	8,091,255.00	1.45
10	000983	西山煤电	459,400	7,846,552.00	1.40

(四)按券种分类的债券投资组合
注：截至2012年6月5日，本基金未持有债券。
(五)按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细
注：截至2012年6月5日，本基金未持有债券。
(六)按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注：截至2012年6月5日，本基金未持有资产支持证券。
(七)按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：截至2012年6月5日，本基金未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1、截至2012年6月5日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。
2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	232,602.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,602.27

4、截至2012年6月5日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、截至2012年6月5日，本基金持有的前十名股票中未存在流通受限情况。
6、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会批准广发深证100指数分级证券投资基金募集的文件
(二)《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》
(三)《广发深证100指数分级证券投资基金托管协议》
(四)法律意见书
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照
(六)基金托管人业务资格批件、营业执照

广发基金管理有限公司
二○一二年六月七日

附件：广发深证100指数分级证券投资基金基金合同摘要

第一部分 基金合同当事人

(一)基金管理人
名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
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
邮政编码：510308
法定代表人：王志伟
成立时间：2003年8月5日
批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基字〔2003〕91号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币1.2亿元
存续期间：持续经营
(二)基金托管人
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔1998〕12号
经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；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；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间：持续经营
(三)基金份额持有人
投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

第二部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1.基金份额持有人的权利与义务
投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。
(1)基金份额持有人的权利
广发深证100A份额、广发深证100B份额、广发深证100份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：
1)分享基金财产收益；
2)参与分配清算后的剩余基金财产；
3)依法转让其持有的广发深证100A份额与广发深证100B份额，依法申请赎回其持有的广发深证100份额；
4)按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7)监督基金管理人的投资运作；
8)对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9)法律法规和基金合同规定的其他权利。
(2)基金份额持有人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：
1)遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2)交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3)在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4)不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5)执行生效的基金份额持有人大会决议；
6)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7)法律法规和基金合同规定的其他义务。
2.基金管理人的权利与义务
(1)基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：
1)依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2)监督基金管理人对本基金的投资运作；
3)自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4)在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5)根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6)依法召集基金份额持有人大会；
7)按规定取得基金份额持有人名册；
8)法律法规和基金合同规定的其他权利。
(2)基金托管人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：
1)安全保管基金财产；
2)设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3)对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保