# 广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

## 【2012】第三季度报告

**基金管理人:广发基金管理有限公司**
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一二年十月二十五日**

### §1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 广发中小板300ETF |
| 基金主代码 | 159907 |
| 交易代码 | 159907 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年6月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 866,598,847份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。<br>一般情形下,本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况,结合经验判断,综合考虑行业属性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。<br>在正常情况下,本基金力争控制投资组合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0.2%,年化跟踪误差不超过2%。 |
| 业绩比较基准 | 中小板300价格指数。 |
| 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中小板300价格指数的表现,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。 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -13,433,489.48 |
| 2.本期利润 | -39,619,214.45 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0457 |
| 4.期末基金资产净值 | 676,278,213.05 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7804 |

注:①所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本基金已于2011年7月25日进行了份额折算,基金份额折算比例为0.90854670。

④本基金本报告期末还原后基金份额净值为0.7090。

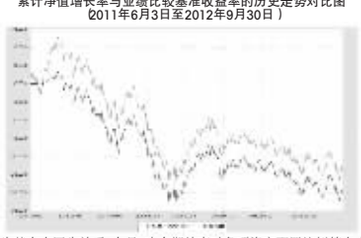
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -5.62% | 1.44% | -5.47% | 1.46% | -0.15% | -0.02% |

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

**广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金**
**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**
**(2011年6月3日至2012年9月30日)**



注:本基金建仓期为基金合同生效后3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。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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300联接基金的基金经理;广发深100指数分级基金的基金经理;数量投资部总经理 | 2011-6-3 | - | 13 | 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指数分级基金的基金经理。 |
| 魏军 | 本基金的基金经理;广发中小板300联接基金的基金经理 | 2011-10-19 | - | 4 | 男,中国籍,数量经济学博士,持有证券业执业资格证书,2008年7月至2010年10月任广发基金管理有限公司量化研究员,2010年3月11日起至2011年10月18日任广发沪深300指数基金和广发中证500指数基金的基金经理助理,2011年10月19日起任广发中小板300ETF及广发中小板300联接基金的基金经理。 |

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遵规守信情况的说明

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、《广发中小板300交易型开放式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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

按照指数结构完全复制指数进行运作。本季度内,基金交易和申购赎回正常,运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内严格按照基金合同约定规范运作,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。报告期内净值下跌5.62%,同期业绩基准下跌5.47%,相差0.15%。报告期内,基金资产的跟踪误差得到良好控制,日平均跟踪误差控制在0.3%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随市场对经济触底回升时点预期的不断修正,市场自年初以来维持震荡向下的走势。

我们注意到,中小板300指数在市场三季度震荡下行过程中不仅跑赢了中证800指数,而且分别跑赢大中市值指数(沪深300)和小市值指数(中证500),这和中小企业板聚焦了众多战略新兴产业公司是分不开的。

在经济寻底复苏的过程中,中小300指数成份股符合未来经济结构调整的方向,具备天然的成长优势,未来该指数有望延续三季度的优异表现,相对收益优势进一步得到彰显。

从收益的角度看,在经济寻底复苏背景下,可以看好中小板300指数良好的成长性,择机长期配置,分享相对超额收益。从历史波动情况来看,中小板300指数具备较强的弹性,亦适合波段操作,阶段性持有。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 674,036,584.39 | 99.47 |
| | 其中:股票 | 674,036,584.39 | 99.47 |
| 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 | 2,977,668.82 | 0.44 |
| 6 | 其他各项资产 | 594,849.80 | 0.09 |
| 7 | 合计 | 677,609,103.01 | 100.00 |

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末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 | 20,061,347.71 | 2.97 |
| B | 采掘业 | 23,011,880.54 | 3.40 |
| C | 制造业 | 436,184,840.20 | 64.50 |
| C0 | 食品、饮料 | 41,752,420.74 | 6.17 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 16,677,024.44 | 2.47 |
| C2 | 木材、家具 | 1,140,528.37 | 0.17 |
| C3 | 造纸、印刷 | 8,820,006.95 | 1.30 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 68,864,794.53 | 10.18 |
| C5 | 电子 | 87,915,670.35 | 13.00 |
| C6 | 金属、非金属 | 38,613,885.30 | 5.71 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 97,089,336.76 | 14.36 |
| C8 | 医药、生物制品 | 60,943,890.80 | 9.01 |
| C99 | 其他制造业 | 14,367,281.96 | 2.12 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 5,249,039.56 | 0.78 |
| E | 建筑业 | 36,933,146.93 | 5.46 |
| F | 交通运输、仓储业 | 2,820,668.90 | 0.42 |
| G | 信息技术业 | 53,681,188.21 | 7.94 |
| H | 批发和零售贸易 | 47,855,542.43 | 7.08 |
| I | 金融、保险业 | 15,733,054.38 | 2.33 |
| J | 房地产业 | 10,583,594.67 | 1.56 |
| K | 社会服务业 | 18,274,448.17 | 2.70 |
| L | 传播与文化产业 | 2,921,646.21 | 0.43 |
| M | 综合类 | 726,186.48 | 0.11 |
| | 合计 | 674,036,584.39 | 99.67 |

5.3 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 | 002304 | 洋河股份 | 217,474 | 27,184,250.00 | 4.02 |
| 2 | 002024 | 苏宁电器 | 3,849,928 | 26,718,500.32 | 3.95 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 388,514 | 10,769,608.08 | 1.59 |
| 4 | 002155 | 辰州矿业 | 481,986 | 10,541,033.82 | 1.56 |
| 5 | 002142 | 宁波银行 | 1,089,402 | 9,859,088.10 | 1.46 |
| 6 | 002422 | 科伦药业 | 195,053 | 9,733,144.70 | 1.44 |
| 7 | 002241 | 歌尔声学 | 242,337 | 9,036,746.73 | 1.34 |
| 8 | 002236 | 大华股份 | 210,543 | 8,632,263.00 | 1.28 |
| 9 | 002230 | 科大讯飞 | 280,108 | 7,960,669.36 | 1.18 |
| 10 | 002202 | 金风科技 | 1,387,339 | 7,921,705.69 | 1.17 |

5.4 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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 594,168.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 142.48 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 538.83 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 594,849.80 |

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 900,598,847 |
| 本报告期基金总申购份额 | 22,000,000 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 56,000,000 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 866,598,847 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金合同》;

3.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新版;

5.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

**广发基金管理有限公司**
**二〇一二年十月二十五日**

# 广发中证500指数证券投资基金(LOF)

## 【2012】第三季度报告

**基金管理人:广发基金管理有限公司**
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一二年十月二十五日**

### §1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 广发中证500指数(LOF) |
| 基金主代码 | 162711 |
| 交易代码 | 162711 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年11月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,432,330,614.87份 |
| 投资目标 | 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0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证500指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 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。<br>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。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证500指数收益率+5%×银行同业存款收益率。 |
| 风险收益特征 | 较高风险、较高预期收益,风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -78,132,956.38 |
| 2.本期利润 | -239,519,024.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0545 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,203,424,843.20 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.723 |

注:①所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。

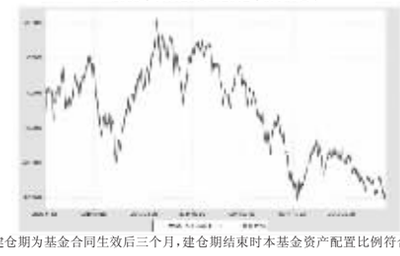
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -6.95% | 1.38% | -7.41% | 1.42% | 0.46% | -0.04% |

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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500指数证券投资基金(LOF)**
**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**
**(2009年11月26日至2012年9月30日)**



注:本基金建仓期为基金合同生效后三个月,建仓期结束时本基金资产配置比例符合本基金合同有关规定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈盛业 | 本基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理 | 2010-12-1 | - | 5 | 男,中国籍,经济学博士,持有证券业执业证书,2007年3月至2009年9月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管,2009年9月至2010年8月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理,2010年8月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作,2010年12月1日起任广发沪深300指数基金及广发中证500指数(lof)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遵规守信情况的说明

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500指数证券投资基金(LOF)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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共有6次,原因是本投资组合调仓。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1)报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.07%,符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过0.35%的要求。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要有两个:一是基金成份股调整因素,本基金结合标的指数成分股调整面积较大的实际情况,分批对成份股进行调整,较好的控制了成分股调整的冲击成本;二是申购和赎回因素,本基金规模较大,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2)简要展望

作为指数基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-6.95%,业绩比较基准收益率为-7.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济从目前来看仍然处于下行通道,从三季报预告来看,仍然有不少企业的业绩低于预期,特别是传统工业类企业。但是以医药、TMT和消费等未来具体发展前景的行业,却出现不少超预期的公司,而中证500的成份股有相当比例是在这些行业中的。在可预见的未来一段时间,中国的经济政策仍将是坚持适度放松和结构转型,中证500指数可以长期关注。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 3,005,295,937.17 | 93.67 |
| | 其中:股票 | 3,005,295,937.17 | 93.67 |
| 2 | 固定收益投资 | 106,370,000.00 | 3.32 |
| | 其中:债券 | 106,370,000.00 | 3.32 |
| | 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 | 91,981,586.51 | 2.87 |
| 6 | 其他各项资产 | 4,729,915.00 | 0.15 |
| 7 | 合计 | 3,208,377,438.68 | 100.00 |

5.2 报告期末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 | 56,684,536.51 | 1.77 |
| B | 采掘业 | 54,563,832.53 | 1.70 |
| C | 制造业 | 1,732,990,581.75 | 54.10 |
| C0 | 食品、饮料 | 193,411,437.22 | 6.04 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 85,500,588.73 | 2.67 |
| C2 | 木材、家具 | 11,375,655.67 | 0.36 |
| C3 | 造纸、印刷 | 46,305,115.88 | 1.45 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 288,323,128.19 | 9.00 |
| C5 | 电子 | 180,606,965.59 | 5.64 |
| C6 | 金属、非金属 | 181,376,577.27 | 5.66 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 432,903,127.48 | 13.51 |
| C8 | 医药、生物制品 | 272,418,526.38 | 8.50 |
| C99 | 其他制造业 | 40,769,459.34 | 1.27 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 117,507,350.86 | 3.67 |
| E | 建筑业 | 64,275,886.23 | 2.01 |
| F | 交通运输、仓储业 | 115,132,792.90 | 3.59 |
| G | 信息技术业 | 157,599,380.91 | 4.92 |
| H | 批发和零售贸易 | 171,846,880.71 | 5.36 |
| I | 金融、保险业 | 30,775,133.35 | 0.96 |
| J | 房地产业 | 223,105,444.62 | 6.96 |
| K | 社会服务业 | 110,952,635.95 | 3.46 |
| L | 传播与文化产业 | 80,307,955.38 | 2.51 |
| M | 综合类 | 89,553,525.47 | 2.80 |
| | 合计 | 3,005,295,937.17 | 93.82 |

5.3 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 | 000963 | 华东医药 | 891,568 | 30,759,096.00 | 0.96 |
| 2 | 000799 | 酒鬼酒 | 404,533 | 22,127,955.10 | 0.69 |
| 3 | 600594 | 益佰制药 | 1,048,285 | 21,951,087.90 | 0.69 |
| 4 | 600079 | 人福医药 | 983,125 | 21,176,512.50 | 0.66 |
| 5 | 600637 | 百视通 | 1,155,789 | 18,642,876.57 | 0.58 |
| 6 | 002029 | 七匹狼 | 888,688 | 18,484,710.40 | 0.58 |
| 7 | 000917 | 电广传媒 | 1,459,930 | 17,373,167.00 | 0.54 |
| 8 | 600199 | 金种子酒 | 807,491 | 17,199,558.30 | 0.54 |
| 9 | 600702 | 沱牌舍得 | 489,967 | 15,928,827.17 | 0.50 |
| 10 | 000826 | 桑德环境 | 620,308 | 15,166,530.60 | 0.47 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | 106,370,000.00 | 3.32 |
| 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 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 106,370,000.00 | 3.32 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1101094 | 11央票94 | 1,100,000 | 106,370,000.00 | 3.32 |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 904,587.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 66,509.91 |
| 4 | 应收利息 | 3,048,380.52 |
| 5 | 应收申购款 | 710,437.43 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,729,915.00 |

5.8.4 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换期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,372,185,709.58 |
| 本报告期基金总申购份额 | 215,465,049.54 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 155,320,144.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,432,330,614.87 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中证500指数证券投资基金(LOF)募集的文件;

2.《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《广发中证500指数证券投资基金托管协议》;

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《广发中证500指数证券投资基金(LOF)招募说明书》及更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

**广发基金管理有限公司**
**二〇一二年十月二十五日**

# 广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 【2012】第三季度报告

**基金管理人:广发基金管理有限公司**
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一二年十月二十五日**

### §1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

2.1基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 广发中小板300联接 |
| 基金主代码 | 270026 |
| 交易代码 | 270026 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年6月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 743,508,918.48份 |
| 投资目标 | 通过将绝大部分基金资产投资于中小板300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为中小板300ETF联接基金。中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对中小板300价格指数紧密跟踪的被动式指数基金,本基金主要通过投资于中小板300ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。<br>当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理可以对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。 |
| 业绩比较基准 | 中小板300价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为ETF联接基金,风险和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,主要投资于中小板300ETF,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。 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

2.1.1目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159907 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年6月3日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2011年8月10日 |
| 基金管理人名称 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国农业银行股份有限公司 |

2.1.2目标基金产品概况

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。一般情形下,本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况,结合经验判断,综合考虑行业属性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。在正常情况下,本基金力争控制投资组合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0.2%,年化跟踪误差不超过2%。 |
| 业绩比较基准 | 中小板300价格指数。 |
| 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中小板300价格指数的表现,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。 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1