

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

2012 年 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：二〇一二年七月二十五日

基金管理人及董事在报告期内所发表的任何言论或行为均不构成投资建议，且其内容的真实性、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、净值数据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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者投资广发基金旗下基金的风险由基金投资人自行承担。
本报告期末资产净值未发生变动，投资者投资，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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

2. 基金产品概况

基金简称	广发中板300ETF
基金代码	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。

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的结构及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。本基金投资于目标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%。

在正常行情下，本基金将根据标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，但标的指数的成份股及其权重发生变动时，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，结合估值模型、综合考量流动性、相关性、估值、流动性等因素来挑选标的指数中其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。

在正常行情下，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%，年化跟踪误差率不超过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中小板300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	中国工商银行股份有限公司

3. 主要财务指标和基金净值表现

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.上述基金财务指标不包括持有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上列数字。
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）扣除相关费用后的金额。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。

阶段	净值增长 率①	业绩比较 率标准差 率②	业绩比较 率基准差 率③	①-③	②-④
过去三个月	-5.62%	1.44%	-5.47%	1.46%	-0.15%
过去六个月	-10.42%	1.44%	-10.27%	1.46%	-0.02%

注：1.本基金合同生效以来基金合同生效3个月，建仓期结束后各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。
2.2012年基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

资料来源：广发基金管理有限公司
注：1.本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
2.2012年基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

4. 基金管理人及基金托管人

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
陆志明	本基金基金经理	2011-6-3	-	男，中国籍，经济学硕士，持有证券从业资格，1999年5月至2001年5月在鹏华证券有限公司任研究员，2001年5月至2010年8月在鹏华证券有限公司任研究员，2010年8月9日起任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011年6月3日起任广发中板300ETF基金经理，2011年6月9日起任广发中板300ETF联接基金基金经理，2011年6月9日起任广发中板300ETF联接基金基金经理。
魏军	本基金基金经理	2011-10-19	-	男，中国籍，数量经济学博士，持有证券从业资格，2008年7月至2010年10月任广发基金管理有限公司量化投资部副经理，2010年11月11日起任2011年11月18日任广发中板300ETF基金经理和广发中板300ETF联接基金基金经理，2011年10月19日起任广发中板300ETF及广发中板300ETF联接基金基金经理。

注：1.“任职日期”指“离任日期”指公司公开聘任或解聘日期。
2.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
3.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
4.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
5.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
6.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
7.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
8.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
9.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
10.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
11.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
12.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
13.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
14.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
15.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
16.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
17.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
18.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
19.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
20.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
21.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
22.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
23.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
24.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
25.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
26.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
27.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
28.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
29.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
30.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
31.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
32.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
33.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
34.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
35.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
36.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
37.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
38.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
39.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
40.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
41.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
42.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
43.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
44.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
45.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
46.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
47.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
48.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
49.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
50.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
51.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
52.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
53.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
54.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
55.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
56.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
57.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
58.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
59.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
60.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
61.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
62.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
63.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
64.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
65.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
66.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
67.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
68.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
69.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
70.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
71.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
72.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
73.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
74.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
75.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
76.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
77.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
78.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
79.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
80.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
81.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
82.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
83.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
84.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
85.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
86.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
87.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
88.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
89.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
90.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
91.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。
92.基金经理的变更须经中国证监会核准，并报中国证监会备案。

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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07月22日复核了本报告中的财务指标、净值表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。

本报告涉及未来预测的,不构成任何投资建议,投资者在进行投资前,应自行承担相应风险,并自行承担基金资产净值波动可能导致的风险。

基金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。

本报告对财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

2.1基金产品概况

基金简称	广发中小300指数
基金代码	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	741,508,918.48份
投资策略	通过将绝大部分基金资产投资于中小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。 本基金为中小300ETF的跟踪基金。中小300ETF是采用完全复制的方法实现对中小300指数的跟踪,跟踪标的为中小300指数。本基金主要投资于中小300ETF,中小300ETF本身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。 本基金在申购赎回中小300ETF基金份额时,二级市场交易中小300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的绩效可能会带来微小影响,或前期跟踪指标可能出现较大波动,因此,本基金在申购、赎回、转换等业务环节,可能会对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证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	本基金为股票型基金,风险和收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中小300ETF,具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券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300交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	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

跟踪标的指数: 中证300价格指数

基金主要投资范围: 跟踪标的指数的指数成份股以及与标的指数相关性较高的股票和股指期货及其他金融衍生品的投资,以实现对标的指数的跟踪,跟踪标的为中证300指数。本基金主要投资于目标基金,目标基金主要投资于中小300ETF,中小300ETF本身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。

基金管理人承诺,将根据标的指数的成份股组成,进行选股、增持、减持、空仓等仓位管理,以实现对标的指数的跟踪,跟踪标的为中证300指数。本基金主要投资于目标基金,目标基金主要投资于中小300ETF,中小300ETF本身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。

基金管理人承诺,将根据标的指数的成份股组成,进行选股、增持、减持、空仓等仓位管理,以实现对标的指数的跟踪,跟踪标的为中证300指数。本基金主要投资于目标基金,目标基金主要投资于中小300ETF,中小300ETF本身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。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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	-77,746,091.00
2.本期利润	-30,607,173.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0409
4.期末基金资产净值	534,127,526.54
5.期末基金份额净值	0.7184

注: ① 上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列示。

4. 基金经理

姓名	职务	在本基金的基金经理任期 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
陆志明	本基金的基金经理 2011-6-9	13	男,中国籍,经济学博士,持有证券从业资格,1999年8月至2001年5月任广发证券股份有限公司任研究员,2001年5月至2005年8月任广发基金研究员,2005年8月至2006年8月任广发基金基金经理,2006年8月至2007年9月任广发基金基金经理,2007年9月至2008年9月任广发基金基金经理,2008年9月至2009年9月任广发基金基金经理,2009年9月至2010年9月任广发基金基金经理,2010年9月至2011年9月任广发基金基金经理,2011年9月至2012年9月任广发基金基金经理,2012年9月至2013年9月任广发基金基金经理,2013年9月至2014年9月任广发基金基金经理,2014年9月至2015年9月任广发基金基金经理,2015年9月至2016年9月任广发基金基金经理,2016年9月至2017年9月任广发基金基金经理,2017年9月至2018年9月任广发基金基金经理,2018年9月至2019年9月任广发基金基金经理,2019年9月至2020年9月任广发基金基金经理,2020年9月至2021年9月任广发基金基金经理,2021年9月至2022年9月任广发基金基金经理,2022年9月至2023年9月任广发基金基金经理,2023年9月至2024年9月任广发基金基金经理,2024年9月至2025年9月任广发基金基金经理,2025年9月至2026年9月任广发基金基金经理,2026年9月至2027年9月任广发基金基金经理,2027年9月至2028年9月任广发基金基金经理,2028年9月至2029年9月任广发基金基金经理,2029年9月至2030年9月任广发基金基金经理,2030年9月至2031年9月任广发基金基金经理,2031年9月至2032年9月任广发基金基金经理,2032年9月至2033年9月任广发基金基金经理,2033年9月至2034年9月任广发基金基金经理,2034年9月至2035年9月任广发基金基金经理,2035年9月至2036年9月任广发基金基金经理,2036年9月至2037年9月任广发基金基金经理,2037年9月至2038年9月任广发基金基金经理,2038年9月至2039年9月任广发基金基金经理,2039年9月至2040年9月任广发基金基金经理,2040年9月至2041年9月任广发基金基金经理,2041年9月至2042年9月任广发基金基金经理,2042年9月至2043年9月任广发基金基金经理,2043年9月至2044年9月任广发基金基金经理,2044年9月至2045年9月任广发基金基金经理,2045年9月至2046年9月任广发基金基金经理,2046年9月至2047年9月任广发基金基金经理,2047年9月至2048年9月任广发基金基金经理,2048年9月至2049年9月任广发基金基金经理,2049年9月至2050年9月任广发基金基金经理,2050年9月至2051年9月任广发基金基金经理,2051年9月至2052年9月任广发基金基金经理,2052年9月至2053年9月任广发基金基金经理,2053年9月至2054年9月任广发基金基金经理,2054年9月至2055年9月任广发基金基金经理,2055年9月至2056年9月任广发基金基金经理,2056年9月至2057年9月任广发基金基金经理,2057年9月至2058年9月任广发基金基金经理,2058年9月至2059年9月任广发基金基金经理,2059年9月至2060年9月任广发基金基金经理,2060年9月至2061年9月任广发基金基金经理,2061年9月至2062年9月任广发基金基金经理,2062年9月至2063年9月任广发基金基金经理,2063年9月至2064年9月任广发基金基金经理,2064年9月至2065年9月任广发基金基金经理,2065年9月至2066年9月任广发基金基金经理,2066年9月至2067年9月任广发基金基金经理,2067年9月至2068年9月任广发基金基金经理,2068年9月至2069年9月任广发基金基金经理,2069年9月至2070年9月任广发基金基金经理,2070年9月至2071年9月任广发基金基金经理,2071年9月至2072年9月任广发基金基金经理,2072年9月至2073年9月任广发基金基金经理,2073年9月至2074年9月任广发基金基金经理,2074年9月至2075年9月任广发基金基金经理,2075年9月至2076年9月任广发基金基金经理,2076年9月至2077年9月任广发基金基金经理,2077年9月至2078年9月任广发基金基金经理,2078年9月至2079年9月任广发基金基金经理,2079年9月至2080年9月任广发基金基金经理,2080年9月至2081年9月任广发基金基金经理,2081年9月至2082年9月任广发基金基金经理,2082年9月至2083年9月任广发基金基金经理,2083年9月至2084年9月任广发基金基金经理,2084年9月至2085年9月任广发基金基金经理,2085年9月至2086年9月任广发基金基金经理,2086年9月至2087年9月任广发基金基金经理,2087年9月至2088年9月任广发基金基金经理,2088年9月至2089年9月任广发基金基金经理,2089年9月至2090年9月任广发基金基金经理,2090年9月至2091年9月任广发基金基金经理,2091年9月至2092年9月任广发基金基金经理,2092年9月至2093年9月任广发基金基金经理,2093年9月至2094年9月任广发基金基金经理,2094年9月至2095年9月任广发基金基金经理,2095年9月至2096年9月任广发基金基金经理,2096年9月至2097年9月任广发基金基金经理,2097年9月至2098年9月任广发基金基金经理,2098年9月至2099年9月任广发基金基金经理,2099年9月至2100年9月任广发基金基金经理,2100年9月至2101年9月任广发基金基金经理,2101年9月至2102年9月任广发基金基金经理,2102年9月至2103年9月任广发基金基金经理,2103年9月至2104年9月任广发基金基金经理,2104年9月至2105年9月任广发基金基金经理,2105年9月至2106年9月任广发基金基金经理,2106年9月至2107年9月任广发基金基金经理,2107年9月至2108年9月任广发基金基金经理,2108年9月至2109年9月任广发基金基金经理,2109年9月至2110年9月任广发基金基金经理,2110年9月至2111年9月任广发基金基金经理,2111年9月至2112年9月任广发基金基金经理,2112年9月至2113年9月任广发基金基金经理,2113年9月至2114年9月任广发基金基金经理,2114年9月至2115年9月任广发基金基金经理,2115年9月至2116年9月任广发基金基金经理,2116年9月至2117年9月任广发基金基金经理,2117年9月至2118年9月任广发基金基金经理,2118年9月至2119年9月任广发基金基金经理,2119年9月至2120年9月任广发基金基金经理,2120年9月至2121年9月任广发基金基金经理,2121年9月至2122年9月任广发基金基金经理,2122年9月至2123年9月任广发基金基金经理,2123年9月至2124年9月任广发基金基金经理,2124年9月至2125年9月任广发基金基金经理,2125年9月至2126年9月任广发基金基金经理,2126年9月至2127年9月任广发基金基金经理,2127年9月至2128年9月任广发基金基金经理,2128年9月至2129年9月任广发基金基金经理,2129年9月至2130年9月任广发基金基金经理,2130年9月至2131年9月任广发基金基金经理,2131年9月至2132年9月任广发基金基金经理,2132年9月至2133年9月任广发基金基金经理,2133年9月至2134年9月任广发基金基金经理,2134年9月至2135年9月任广发基金基金经理,2135年9月至2136年9月任广发基金基金经理,2136年9月至2137年9月任广发基金基金经理,2137年9月至2138年9月任广发基金基金经理,2138年9月至2139年9月任广发基金基金经理,2139年9月至2140年9月任广发基金基金经理,2140年9月至2141年9月任广发基金基金经理,2141年9月至2142年9月任广发基金基金经理,2142年9月至2143年9月任广发基金基金经理,2143年9月至2144年9月任广发基金基金经理,2144年9月至2145年9月任广发基金基金经理,2145年9月至2146年9月任广发基金基金经理,2146年9月至2147年9月任广发基金基金经理,2147年9月至2148年9月任广发基金基金经理,2148年9月至2149年9月任广发基金基金经理,2149年9月至2150年9月任广发基金基金经理,2150年9月至2151年9月任广发基金基金经理,2151年9月至2152年9月任广发基金基金经理,2152年9月至2153年9月任广发基金基金经理,2153年9月至2154年9月任广发基金基金经理,2154年9月至2155年9月任广发基金基金经理,2155年9月至2156年9月任广发基金基金经理,2156年9月至2157年9月任广发基金基金经理,2157年9月至2158年9月任广发基金基金经理,2158年9月至2159年9月任广发基金基金经理,2159年9月至2160年9月任广发基金基金经理,2160年9月至2161年9月任广发基金基金经理,2161年9月至2162年9月任广发基金基金经理,2162年9月至2163年9月任广发基金基金经理,2163年9月至2164年9月任广发基金基金经理,2164年9月至2165年9月任广发基金基金经理,2165年9月至2166年9月任广发基金基金经理,2166年9月至2167年9月任广发基金基金经理,2167年9月至2168年9月任广发基金基金经理,2168年9月至2169年9月任广发基金基金经理,2169年9月至2170年9月任广发基金基金经理,2170年9月至2171年9月任广发基金基金经理,2171年9月至2172年9月任广发基金基金经理,2172年9月至2173年9月任广发基金基金经理,2173年9月至2174年9月任广发基金基金经理,2174年9月至2175年9月任广发基金基金经理,2175年9月至2176年9月任广发基金基金经理,2176年9月至2177年9月任广发基金基金经理,2177年9月至2178年9月任广发基金基金经理,2178年9月至2179年9月任广发基金基金经理,2179年9月至2180年9月任广发基金基金经理,2180年9月至2181年9月任广发基金基金经理,2181年9月至2182年9月任广发基金基金经理,2182年9月至2183年9月任广发基金基金经理,2183年9月至2184年9月任广发基金基金经理,2184年9月至2185年9月任广发基金基金经理,2185年9月至2186年9月任广发基金基金经理,2186年9月至2187年9月任广发基金基金经理,2187年9月至2188年9月任广发基金基金经理,2188年9月至2189年9月任广发基金基金经理,2189年9月至2190年9月任广发基金基金经理,2190年9月至2191年9月任广发基金基金经理,2191年9月至2192年9月任广发基金基金经理,2192年9月至2193年9月任广发基金基金经理,2193年9月至2194年9月任广发基金基金经理,2194年9月至2195年9月任广发基金基金经理,2195年9月至2196年9月任广发基金基金经理,2196年9月至2197年9月任广发基金基金经理,2197年9月至2198年9月任广发基金基金经理,2198年9月至2199年9月任广发基金基金经理,2199年9月至2200年9月任广发基金基金经理,2200年9月至2201年9月任广发基金基金经理,2201年9月至2202年9月任广发基金基金经理,2202年9月至2203年9月任广发基金基金经理,2203年9月至2204年9月任广发基金基金经理,2204年9月至2205年9月任广发基金基金经理,2205年9月至2206年9月任广发基金基金经理,2206年9月至2207年9月任广发基金基金经理,2207年9月至2208年9月任广发基金基金经理,2208年9月至2209年9月任广发基金基金经理,2209年9月至2210年9月任广发基金基金经理,2210年9月至2211年9月任广发基金基金经理,2211年9月至2212年9月任广发基金基金经理,2212年9月至2213年9月任广发基金基金经理,2213年9月至2214年9月任广发基金基金经理,2214年9月至2215年9月任广发基金基金经理,2215年9月至2216年9月任广发基金基金经理,2216年9月至2217年9月任广发基金基金经理,2217年9月至2218年9月任广发基金基金经理,2218年9月至2219年9月任广发基金基金经理,2219年9月至2220年9月任广发基金基金经理,2220年9月至2221年9月任广发基金基金经理,2221年9月至2222年9月任广发基金基金经理,2222年9月至2223年9月任广发基金基金经理,2223年9月至2224年9月任广发基金基金经理,2224年9月至2225年9月任广发基金基金经理,2225年9月至2226年9月任广发基金基金经理,2226年9月至2227年9月任广发基金基金经理,2227年9月至2228年9月任广发基金基金经理,2228年9月至2229年9月任广发基金基金经理,2229年9月至2230年9月任广发基金基金经理,2230年9月至2231年9月任广发基金基金经理,2231年9月至2232年9月任广发基金基金经理,2232年9月至2233年9月任广发基金基金经理,2233年9月至2234年9月任广发基金基金经理,2234年9月至2235年9月任广发基金基金经理,2235年9月至2236年9月任广发基金基金经理,2236年9月至2237年9月任广发基金基金经理,2237年9月至2238年9月任广发基金基金经理,2238年9月至2239年9月任广发基金基金经理,2239年9月至2240年9月任广发基金基金经理,2240年9月至2241年9月任广发基金基金经理,2241年9月至2242年9月任广发基金基金经理,2242年9月至2243年9月任广发基金基金经理,2243年9月至2244年9月任广发基金基金经理,2244年9月至2245年9月任广发基金基金经理,2245年9月至2246年9月任广发基金基金经理,2246年9月至2247年9月任广发基金基金经理,2247年9月至2248年9月任广发基金基金经理,2248年9月至2249年9月任广发基金基金经理,2249年9月至2250年9月任广发基金基金经理,2250年9月至2251年9月任广发基金基金经理,2251年9月至2252年9月任广发基金基金经理,2252年9月至2253年9月任广发基金基金经理,2253年9月至2254年9月任广发基金基金经理,2254年9月至2255年9月任广发基金基金经理,2255年9月至2256年9月任广发基金基金经理,2256年9月至2257年9月任广发基金基金经理,2257年9月至2258年9月任广发基金基金经理,2258年9月至2259年9月任广发基金基金经理,2259年9月至2260年9月任广发基金基金经理,2260年9月至2261年9月任广发基金基金经理,2261年9月至2262年9月任广发基金基金经理,2262年9月至2263年9月任广发基金基金经理,2263年9月至2264年9月任广发基金基金经理,2264年9月至2265年9月任广发基金基金经理,2265年9月至2266年9月任广发基金基金经理,2266年9月至2267年9月任广发基金基金经理,2267年9月至2268年9月任广发基金基金经理,2268年9月至2269年9月任广发基金基金经理,2269年9月至2270年9月任广发基金基金经理,2270年9月至2271年9月任广发基金基金经理,2271年9月至2272年9月任广发基金基金经理,2272年9月至2273年9月任广发基金基金经理,2273年9月至2274年9月任广发基金基金经理,2274年9月至2275年9月任广发基金基金经理,2275年9月至2276年9月任广发基金基金经理,2276年9月至2277年9月任广发基金基金经理,2277年9月至2278年9月任广发基金基金经理,2278年9月至2279年9月任广发基金基金经理,2279年9月至2280年9月任广发基金基金经理,2280年9月至2281年9月任广发基金基金经理,2281年9月至2282年9月任广发基金基金经理,2282年9月至2283年9月任广发基金基金经理,2283年9月至2284年9月任广发基金基金经理,2284年9月至2285年9月任广发基金基金经理,2285年9月至2286年9月任广发基金基金经理,2286年9月至2287年9月任广发基金基金经理,2287年9月至2288年9月任广发基金基金经理,2288年9月至2289年9月任广发基金基金经理,2289年9月至2290年9月任广发基金基金经理,2290年9月至2291年9月任广发基金基金经理,2291年9月至2292年9月任广发基金基金经理,2292年9月至2293年9月任广发基金基金经理,2293年9月至2294年9月任广发基金基金经理,2294年9月至2295年9月任广发基金基金经理,2295年9月至2296年9月任广发基金基金经理,2296年9月至2297年9月任广发基金基金经理,2297年9月至2298年9月任广发基金基金经理,2298年9月至2299年9月任广发基金基金经理,2299年9月至2300年9月任广发基金基金经理,2300年9月至2301年9月任广发基金基金经理,2301年9月至2302年9月任广发基金基金经理,2302年9月至2303年9月任广发基金基金经理,2303年9月至2304年9月任广发基金基金经理,2304年9月至2305年9月任广发基金基金经理,2305年9月至2306年9月任广发基金基金经理,2306年9月至2307年9月任广发基金基金经理,2307年9月至2308年9月任广发基金基金经理,2308年9月至2309年9月任广发基金基金经理,2309年9月至2310年9月任广发基金基金经理,2310年9月至2311年9月任广发基金基金经理,2311年9月至2312年9月任广发基金基金经理,2312年9月至2313年9月任广发基金基金经理,2313年9月至2314年9月任广发基金基金经理,2314年9月至2315年9月任广发基金基金经理,2315年9月至2316年9月任广发基金基金经理,2316年9月至2317年9月任广发基金基金经理,2317年9月至2318年9月任广发基金基金经理,2318年9月至2319年9月任广发基金基金经理,2319年9月至2320年9月任广发基金基金经理,2320年9月至2321年9月任广发基金基金经理,2321年9月至2322年9月任广发基金基金经理,2322年9月至2323年9月任广发基金基金经理,2323年9月至2324年9月任广发基金基金经理,2324年9月至2325年9月任广发基金基金经理,2325年9月至2326年9月任广发基金基金经理,2326年9月至2327年9月任广发基金基金经理,2327年9月至2328年9月任广发基金基金经理,2328年9月至2329年9月任广发基金基金经理,2329年9月至2330年9月任广发基金基金经理,2330年9月至2331年9月任广发基金基金经理,2331年9月至2332年9月任广发基金基金经理,2332年9月至2333年9月任广发基金基金经理,2333年9月至2334年9月任广发基金基金经理,2334年9月至2335年9月任广发基金基金经理,2335年9月至2336年9月任广发基金基金经理,2336年9月至2337年9月任广发基金基金经理,2337年9月至2338年9月任广发基金基金经理,2338年9月至2339年9月任广发基金基金经理,2339年9月至2340年9月任广发基金基金经理,2340年9月至2341年9月任广发基金基金经理,2341年9月至2342年9月任广发基金基金经理,2342年9月至2343年9月任广发基金基金经理,2343年9月至2344年9月任广发基金基金经理,2344年9月至2345年9月任广发基金基金经理,2345年9月至2346年9月任广发基金基金经理,2346年9月至2347年9月任广发基金基金经理,2347年9月至2348年9月任广发基金基金经理,2348年9月至2349年9月任广发基金基金经理,2349年9月至2350年9月任广发基金基金经理,2350年9月至2351年9月任广发基金基金经理,2351年9月至2352年9月任广发基金基金经理,2352年9月至2353年9月任广发基金基金经理,2353年9月至2354年9月任广发基金基金经理,2354年9月至2355年9月任广发基金基金经理,2355年9月至2356年9月任广发基金基金经理,2356年9月至2357年9月任广发基金基金经理,2357年9月至2358年9月任广发基金基金经理,2358年9月至2359年9月任广发基金基金经理,2359年9月至2360年9月任广发基金基金经理,2360年9月至2361年9月任广发基金基金经理,2361年9月至2362年9月任广发基金基金经理,2362年9月至2363年9月任广发基金基金经理,2363年9月至2364年9月任广发基金基金经理,2364年9月至2365年9月任广发基金基金经理,2365年9月至2366年9月任广发基金基金经理,2366年9月至2367年9月任广发基金基金经理,2367年9月至2368年9月任广发基金基金经理,2368年9月至2369年9月任广发基金基金经理,2369年9月至2370年9月任广发基金基金经理,2370年9月至2371年9月任广发基金基金经理,2371年9月至2372年9月任广发基金基金经理,2372年9月至2373年9月任广发基金基金经理,2373年9月至2374年9月任广发基金基金经理,2374年9月至2375年9月任广发基金基金经理,2375年9月至2376年9月任广发基金基金经理,2376年9月至2377年9月任广发基金基金经理,2377年9月至2378年9月任广发基金基金经理,2378年9月至2379年9月任广发基金基金经理,2379年9月至2380年9月任广发基金基金经理,2380年9月至2381年9月任广发基金基金经理,2381年9月至2382年9月任广发基金基金经理,2382年9月至2383年9月任广发基金基金经理,2383年9月至2384年9月任广发基金基金经理,2384年9月至2385年9月任广发基金基金经理,2385年9月至2386年9月任广发基金基金经理,2386年9月至2387年9月任广发基金基金经理,2387年9月至2388年9月任广发基金基金经理,2388年9月至2389年9月任广发基金基金经理,2389年9月至2390年9月任广发基金基金经理,2390年9月至2391年9月任广发基金基金经理,2391年9月至2392年9月任广发基金基金经理,2392年9月至2393年9月任广发基金基金经理,2393年9月至2394年9月任广发基金基金经理,2394年9月至2395年9月任广发基金基金经理,2395年9月至2396年9月任广发基金基金经理,2396年9月至2397年9月任广发基金基金经理,2397年9月至2398年9月任广发基金基金经理,2398年9月至2399年9月任广发基金基金经理,2399年9月至2400年9月任广发基金基金经理,2400年9月至2401年9月任广发基金基金经理,2401年9月至2402年9月任广发基金基金经理,2402年9月至2403年9月任广发基金基金经理,2403年9月至2404年9月任广发基金基金经理,2404年9月至2405年9月任广发基金基金经理,2405年9月至2406年9月任广发基金基金经理,2406年9月至2407年9月任广发基金基金经理,2407年9月至2408年9月任广发基金基金经理,2408年9月至2409年9月任广发基金基金经理,2409年9月至2410年9月任广发基金基金经理,2410年9月至2411年9月任广发基金基金经理,2411年9月至2412年9月任广发基金基金经理,2412年9月至2413年9月任广发基金基金经理,2413年9月至2414年9月任广发基金基金经理,2414年9月至2415年9月任广发基金基金经理,2415年9月至2416年9月任广发基金基金经理,2416年9月至2417年9月任广发基金基金经理,2417年9月至2418年9月任广发基金基金经理,2418年9月至2419年9月任广发基金基金经理,2419年9月至2420年9月任广发基金基金经理,2420年9月至2421年9月任广发基金基金经理,2421年9月至2422年9月任广发基金基金经理,2422年9月至2423年9月任广发基金基金经理,2423年9月至2424年9月任广发基金基金经理,2424年9月至2425年9月任广发基金基金经理,2425年9月至2426年9月任广发基金基金经理,2426年9月至2427年9月任广发基金基金经理,2427年9月至2428年9月任广发基金基金经理,2428年9月至2429年9月任广发基金基金经理,2429年9月至2430年9月任广发基金基金经理,2430年9月至2431年9月任广发基金基金经理,2431年9月至2432年9月任广发基金基金经理,2432年9月至2433年9月任广发基金基金经理,2433年9月至2434年9月任广发基金基金经理,2434年9月至2435年9月任广发基金基金经理,2435年9月至2436年9月任广发基金基金经理,2436年9月至2437年9月任广发基金基金经理,2437年9月至2438年9月任广发基金基金经理,2438年9月至2439年9月任广发基金基金经理,2439年9月至2440年9月任广发基金基金经理,2440年9月至2441年9月任广发基金基金经理,2441年9月至2442年9月任广发基金基金经理,2442年9月至2443年9月任广发基金基金经理,2443年9月至2444年9月任广发基金基金经理,2444年9月至2445年9月任广发基金基金经理,2445年9月至2446年9月任广发基金基金经理,2446年9月至2447年9月任广发基金基金经理,2447年9月至2448年9月任广发基金基金经理,2448年9月至2449年9月任广发基金基金经理,2449年9月至2450年9月任广发基金基金经理,2450年9月至2451年9月任广发基金基金经理,2451年9月至2452年9月任广发基金基金经理,2452年9月至2453年9月任广发基金基金经理,2453年9月至2454年9月任广发基金基金经理,2454年9月至2455年9月任广发基金基金经理,2455年9月至2456年9月任广发基金基金经理,2456年9月至2457年9月任广发基金基金经理,2457年9月至2458年9月任广发基金基金经理,2458年9月至2459年9月任广发基金基金经理,2459年9月至2460年9月任广发基金基金经理,2460年9月至2461年9月任广发基金基金经理,2461年9月至2462年9月任广发基金基金经理,2462年9月至2463年9月任广发基金基金经理,2463年9月至2464年9月任广发基金基金经理,2464年9月至2465年9月任广发基金基金经理,2465年9月至2466年9月任广发基金基金经理,2466年9月至2467年9月任广发基金基金经理,2467年9月至2468年9月任广发基金基金经理,2468年9月至2469年9月任广发基金基金经理,2469年9月至2470年9月任广发基金基金经理,2470年9月至2471年9月任广发基金基金经理,2471年9月至2472年9月任广发基金基金经理,2472年9月至2473年9月任广发基金基金经理,2473年9月至2474年9月任广发基金基金经理,2474年9月至2475年9月任广发基金基金经理,2475年9月至2476年9月任广发基金基金经理,2476年9月至2477年9月任广发基金基金经理,2477年9月至2478年9月任广发基金基金经理,2478年9月至2479年9月任广发基金基金经理,2479年9月至2480年9月任广发基金基金经理,2480年9月至2481年9月任广发基金基金经理,2481年9月至2482年9月任广发基金基金经理,2482年9月至2483年9月任广发基金基金经理,2483年9月至2484年9月任广发基金基金经理,2484年9月至2485年9月任广发基金基金经理,2485年9月至2486年9月任广发基金基金经理,2486年9月至2487年9月任广发基金基金经理,2487年9月至2488年9月任广发基金基金经理,2488年9月至2489年9月任广发基金基金经理,2489年9月至2490年9月任广发基金基金经理,2490年9月至2491年9月任广发基金基金经理,2491年9月至2492年9月任广发基金基金经理,2492年9月至2493年9月任广发基金基金经理,2493年9月至2494年9月任广发基金基金经理,2494年9月至2495年9月任广发基金基金经理,2495年9月至2496年9月任广发基金基金经理,2496年9月至2497年9月任广发基金基金经理,2497年9月至2498年9月任广发基金基金经理,2498年9月至2499年9月任广发基金基金经理,2499年9月至2500年9月任广发基金基金经理,2500年9月至2501年9月任广发基金基金经理,2501年9月至2502年9月任广发基金基金经理,2502年9月至2503年9月任广发基金基金经理,2503年9月至2504年9月任广发基金基金经理,2504年9月至2505年9月任广发基金基金经理,2505年9月至2506年9月任广发基金基金经理,2506年9月至2507年9月任广发基金基金经理,2507年9月至2508年9月任广发基金基金经理,2508年9月至2509年9月任广发基金基金经理,2509年9月至2510年9月任广发基金基金经理,2510年9月至2511年9月任广发基金基金经理,2511年9月至2512年9月任广发基金基金经理,2512年9月至2513年9月任广发基金基金经理,2513年9月至2514年9月任广发基金基金经理,2514年9月至2515年9月任广发基金基金经理,2515年9月至2516年9月任广发基金基金经理,2516年9月至2517年9月任广发基金基金经理,2517年9月至2518年9月任广发基金基金经理,2518年9月至2519年9月任广发基金基金经理,2519年9月至2520年9月任广发基金基金经理,2520年9月至2521年9月任广发基金基金经理,2521年9月至2522年9月任广发基金基金经理,2522年9月至2523年9月任广发基金基金经理,2523年9月至2524年9月任广发基金基金经理,2524年9月至2525年9月任广发基金基金经理,2525年9月至2526年9月任广发基金基金经理,2526年9月至2527年9月任广发基金基金经理,2527年9月至2528年9月任广发基金基金经理,2528年9月至2529年9月任广发基金基金经理,2529年9月至2530年9月任广发基金基金经理,2530年9月至2531年9月任广发基金基金经理,2531年9月至2532年9月任广发基金基金经理,2532年9月至2533年9月任广发基金基金经理,2533年9月至2534年9月任广发基金基金经理,2534年9月至2535年9月任广发基金基金经理,2535年9月至2536年9月任广发基金基金经理,2536年9月至2537年9月任广发基金基金经理,2537年9月至2538年9月任广发基金基金经理,2538年9月至2539年9月任广发基金基金经理,2539年9月至2540年9月任广发基金基金经理,2540年9月至2541年9月任广发基金基金经理,2541年9月至2542年9月任广发基金基金经理,2542年9月至2543年9月任广发基金基金经理,2543年9月至2544年9月任广发基金基金经理,2544年9月至2545年9月任广发基金基金经理,2545年9月至2546年9月任广发基金基金经理,2546年9月至2547年9月任广发基金基金经理,2547年9月至2548年9月任广发基金基金经理,2548年9月至2549年9月任广发基金基金经理,2549年9月至2550年9月任广发基金基金经理,2550年9月至2551年9月任广发基金基金经理,2551年9月至2552年9月任广发基金基金经理,2552年9月至2553年9月任广发基金基金经理,2553年9月至2554年9月任广发基金基金经理,2554年9月至2555年9月任广发基金基金经理,2555年9月至2556年9月任广发基金基金经理,2556年9月至2557年9月任广发基金基金经理,2557年9月至2558年9月任广发基金基金经理,2558年9月至2559年9月任广发基金基金经理,2559年9月至2560年9月任广发基金基金经理,2560年9月至2561年9月任广发基金基金经理,2561年9月至2562年9月任广发基金基金经理,2562年9月至2563年9月任广发基金基金经理,2563年9月至2564年9月任广发基金基金经理,2564年9月至2565年9月任广发基金基金经理,2565年9月至2566年9月任广发基金基金经理,2566年9月至2567年9月任广发基金基金经理,2567年9月至2568年9月任广发基金基金经理,2568年9月至2569年9月任广发基金基金经理,2569年9月至2570年9月任广发基金基金经理,2570年9月至2571年9月任广发基金基金经理,2571年9月至2572年9月任广发基金基金经理,2572年9月至2573年9月任广发基金基金经理,2573年9月至2574年9月任广发基金基金经理,2574年9月至2575年9月任广发基金基金经理,2575年9月至2576年9月任广发基金基金经理,2576年9月至2577年9月任广发基金基金经理,2577年9月至2578年9月任广发基金基金经理,2578年9月至2579年9月任广发基金基金经理,2579年9月至2580年9月任广发基金基金经理,2580年9月至2581年9月任广发基金基金经理,2581年9月至2582年9月任广发基金基金经理,2582年9月至2583年9月任广发基金基金经理,2583年9月至2584年9月任广发基金基金经理,2584年9月至2585年9月任广发基金基金经理,2585年9月至2586年9月任广发基金基金经理,2586年9月至2587年9月任广发基金基金经理,2587年9月至2588年9月任广发基金基金经理,2588年9月至2589年9月任广发基金基金经理,2589年9月至2590年9月任广发基金基金经理,2590年9月至2591年9月任广发基金基金经理,2591年9月至2592年9月任广发基金基金经理,2592年9月至2593年9月任广发基金基金经理,2593年9月至2594年9月任广发基金基金经理,2594年9月至2595年9月任广发基金基金经理,2595年9月至2596年9月任广发基金基金经理,2596年9月至2597年9月任广发基金基金经理,2597年9月至2598年9月任广发基金基金经理,2598年9月至2599年9月任广发基金基金经理,2599年9月至2600年9月任广发基金基金经理,2600年9月至2601年9月任广发基金基金经理,2601年9月至2602年9	

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

61 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。
本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、净值数据和投资收益等数据，保证报告相关内容真实、准确、完整，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，也不保证基金份额持有人其未来未表现。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。
本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

62 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,通过严格的投资组合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0.75%,平跟踪误差不超过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,并根据标的指数的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增发、增发、分红等行为时,或因成份股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

63 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	单位:人民币元
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	3,203,424,843.75
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

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 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本基金累计净值增长率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)
报告期末本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年11月26日至2012年9月30日

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	汇 兑 丰	404,433	22,127,985.10	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	百得兴	1,153,789	18,642,876.57	0.58
6	602029	七 匹 狼	888,688	18,484,710.40	0.58
7	000917	电广传媒	1,459,390	17,373,167.00	0.54
8	600192	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

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	1110194	11央票94	1,100,000	106,370,000.00	3.32

注:1. 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。
2. 本基金建仓期间,本基金管理人严格遵守下列法律法规:《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》和具有约束力的法律法规的规定。本基金按照信用、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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。
3. 公平交易制度的执行情况
本基金管理人建立了科学、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及及时的分析和评估,保证公平交易原则的实现。
在投资决策的内部制度方面,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,超过授权权限的必须经过严格的审批程序。中央交易部提供 实时询价、研究小组支持、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通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及监督,实现投资风险的事中风险控制;稽核风控通过投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的实时监控。

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行为。
3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。
4. 投资行为符合法律法规及基金合同的规定
本基金管理人严格遵守下列法律法规:《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》和具有约束力的法律法规的规定。本基金按照信用、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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人建立了科学、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及及时的分析和评估,保证公平交易原则的实现。
在投资决策的内部制度方面,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,超过授权权限的必须经过严格的审批程序。中央交易部提供 实时询价、研究小组支持、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通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及监督,实现投资风险的事中风险控制;稽核风控通过投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的实时监控。

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行为。
3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。
4. 投资行为符合法律法规及基金合同的规定
本基金管理人严格遵守下列法律法规:《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》和具有约束力的法律法规的规定。本基金按照信用、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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人建立了科学、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及及时的分析和评估,保证公平交易原则的实现。
在投资决策的内部制度方面,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,超过授权权限的必须经过严格的审批程序。中央交易部提供 实时询价、研究小组支持、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通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及监督,实现投资风险的事中风险控制;稽核风控通过投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的实时监控。

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行为。
3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。
4. 投资行为符合法律法规及基金合同的规定
本基金管理人严格遵守下列法律法规:《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》和具有约束力的法律法规的规定。本基金按照信用、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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人建立了科学、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及及时的分析和评估,保证公平交易原则的实现。
在投资决策的内部制度方面,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,超过授权权限的必须经过严格的审批程序。中央交易部提供 实时询价、研究小组支持、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通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及监督,实现投资风险的事中风险控制;稽核风控通过投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的实时监控。

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行为。
3.2 异常交易行为的专项说明

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

三 季 度 报 告

在经济复苏逐步的过程中,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第三季度的优异表现,相对收益优势进一步得到彰显。

从收益、风险角度,在经济复苏背景下,可以看好中小300指数良好的成长性,择机长期配置,分享相对超额收益。从历史波动情况看,中小300指数具备较强的弹性,亦适合作波段配置,阶段性持有。

55 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况 适用于ETF联接基金情况)

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	267,768.53	0.05
	其中:股票	267,768.53	0.05
2	基金投资	504,988,169.76	94.33
3	固定收益投资	19,340,000.00	3.61
	其中:债券	19,340,000.00	3.61
	资产支持证券	-	-
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	8,986,210.15	1.68
7	其他各项资产	1,760,283.65	0.33
8	合计	535,342,432.09	100.00

5.2 期末投资目标基金明细 适用于ETF联接基金情况)

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	504,988,169.76	94.54

5.3 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,252.00	0.00
D	食品饮料	6,402.00	0.00
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	1,850.00	0.00
D1	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	259,516.53	0.05
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	267,768.53	0.05

5.4 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
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序的前五名资产支持证券投资明细

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

5.8 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

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.2 报告期末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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	552,387.62
5	应收申购款	457,896.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,760,283.65

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.5 报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.6 报告期末持有的前十名股票中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	002500	山西证券	259,516.53	0.05	重大事项
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.9.7 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资产支持证券投资明细

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

5.9.9 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

5.9.10 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	552,387.62
5	应收申购款	457,896.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,760,283.65

5.9.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.12 报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.13 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.14 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.15 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.16 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资产支持证券投资明细

5.9.17 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

5.9.18 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

5.9.19 投资组合报告附注

5.9.20 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.21 报告期末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。

5.9.22 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.23 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.24 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.25 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资产支持证券投资明细

5.9.26 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

5.9.27 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

5.9.28 投资组合报告附注

5.9.29 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.30 报告期末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。

5.9.31 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.32 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.33 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.34 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资产支持证券投资明细

5.9.35 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

5.9.36 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

5.9.37 投资组合报告附注

5.9.38 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.39 报告期末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。

5.9.40 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.41 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.42 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.43 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资产支持证券投资明细

5.9.44 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

5.9.45 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

5.9.46 投资组合报告附注

5.9.47 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.48 报告期末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。

5.9.49 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.50 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.51 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.52 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资产支持证券投资明细

5.9.53 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

5.9.54 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

5.9.55 投资组合报告附注

5.9.56 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.57 报告期末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。

5.9.58 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.59 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.60 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.61 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资产支持证券投资明细

5.9.62 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

5.9.63 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

5.9.64 投资组合报告附注

5.9.65 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.66 报告期末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。

5.9.67 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.68 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.69 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.70 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资产支持证券投资明细

5.9.71 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

5.9.72 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

5.9.73 投资组合报告附注

5.9.74 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.75 报告期末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。

5.9.76 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.77 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.78 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.79 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资产支持证券投资明细

5.9.80 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

5.9.81 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

5.9.82 投资组合报告附注

5.9.83 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.84 报告期末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。

5.9.85 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.86 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.87 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.88 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资产支持证券投资明细

5.9.89 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

5.9.90 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

5.9.91 投资组合报告附注

5.9.92 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.93 报告期末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。

5.9.94 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.95 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.96 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.97 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资产支持证券投资明细

5.9.98 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

5.9.99 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

5.9.100 投资组合报告附注

5.9.101 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.102 报告期末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。

5.9.103 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.104 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.105 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.106 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资产支持证券投资明细

5.9.107 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

5.9.108 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

5.9.109 投资组合报告附注

5.9.110 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.111 报告期末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。

5.9.112 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.113 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.114 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.115 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资产支持证券投资明细

5.9.116 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

5.9.117 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

5.9.118 投资组合报告附注

5.9.119 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.120 报告期末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。

5.9.121 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.122 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.123 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.124 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资产支持证券投资明细

5.9.125 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

5.9.126 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

5.9.127 投资组合报告附注

5.9.128 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.129 报告期末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。

5.9.130 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.131 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.132 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央行票据94	200,000	19,340,000.00	3.62
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.9.133 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资产支持证券投资明细

5.9.134 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

5.9.135 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

5.9.136 投资组合报告附注

5.9.137 报告期内本基金投资,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未公开重大违法违规事实。

5.9.138 报告期末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。

5.9.139 报告期末持有的前十名股票中流通受限情况的说明

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

5.9.140 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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------