富安达增强收益债券型证券投资基金

【2013】第一季度报告

基金管理人：富安达基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：２０１３年４月２２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。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月19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2013年1月1日起至3月31日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	富安达增强收益债券	
基金主代码	710301	
交易代码	710301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年7月25日	
报告期末基金份额总额	138,858,453.88份	
投资目标	本基金将在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，结合FED模型，判断和预测经济发展周期及趋势，综合比较大类资产的收益及风险情况，确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。本基金通过久期配置、期限结构配置、类属配置策略来实现对固定收益类资产的配置。	
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属两级基金的份额总额	72,425,313.15	66,433,140.73

§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（2013年1月1日–2013年3月31日）	
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
1.本期已实现收益	4,119,979.11	3,511,333.96
2.本期利润	3,579,044.65	2,868,380.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0374	0.0339
4.期末基金资产净值	74,163,321.30	67,820,669.88
5.期末基金份额净值	1.024	1.021

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或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本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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

富安达增强收益债券A

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	2.96%	0.28%	1.05%	0.16%	1.91%	0.12%

富安达增强收益债券C

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	2.85%	0.28%	1.05%	0.16%	1.80%	0.12%

注：①本基金业绩比较基准为：10%×沪深300指数+90%×中债总财富总指数；

②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

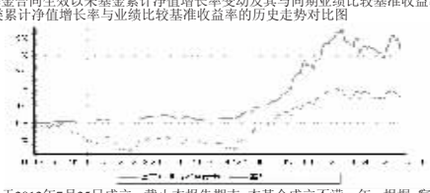
Return t =10%× （沪深300指数t / 沪深300指数 t–1）–1]+90%× [中债总财富总指数t / 中债总财富总指数（t–1）–1]

Benchmark t = [1+Return t)×Benchmark (t–1)

其中，t =1，2，3，…T，T 表示时间截至日。

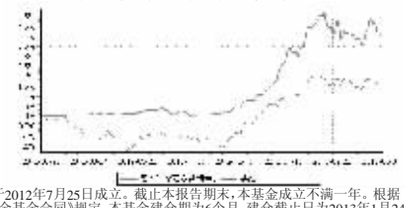
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本基金A类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



注：本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2013年1月24日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

本基金C类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



注：本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2013年1月24日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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		
黄强	本基金的基金经理、公司研究发展部副总监	2012年7月25日		19	历任浙江财政证券公司投资二部投资经理，光大证券有限公司资产管理部投资经理，助理总经理，研究所策略分析师，泰信基金管理有限公司投资管理财都高级投资经理，中信基金管理有限公司上海分公司高级经理、副总裁，光大保德信基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理，首席策略分析师，硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍

注：1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会关于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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其各项实施准则、《富安达增强收益债券型证券投资基金合同》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，为基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。

本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起，监察稽核部分季度对各基金公平交易执行情况进行了统计分析，按照特定计算周期，1分日、3日、5日和30日时间窗分析同向交易中存在价格差异的样本。通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析，在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内，因此不构成潜在利益输送的显著性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内国内通胀数据温和，经济增速低位徘徊，资金价格水平较低。股票市场先涨后跌，小盘股表现优异，其中沪深300指数下跌1.1%，而创业板指数大涨21.4%。债券市场继续稳步上行，中债总财富（总值）指数上行了1.22%，中标转债指数上行了5.6%。信用债表现依旧好于利率债，其中10年期国债收益率下行了3.5基点，而1年和3年期AA评级的信用债则分别大幅下移了54和33基点。本基金适时提升了杠杆率，重点投资了期限为3–5年的信用债，并提升了转债配比，取得良好的投资效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日，富安达增强收益债券A份额净值为1.0240元，C份额净值为1.0209元；富安达增强收益债券A份额净值增长率为2.96%，C份额净值增长率为2.85%，同期业绩比较基准增长率为1.05%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着中国政府换届顺利完成，十八大提出了工业化、信息化、城镇化和农业现代化同步发展的新四化运动，为中国梦的实现指明了路径方向。未来中国经济的将在缓步增长的基础上积极转型，期间将催生一批潜在的投资机会。二季度，IPO重启的迫近，股票市场或将继续震荡。债券市场由于前期涨幅较大，随着经济基本面的逐步改善和供给的增加，可能将缓步上行。本基金将顺势利导，做好资产转换和个券选择工作，力争继续为投资者创造超越基准的绝对回报。

§５ 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,825,555.70	2.90
	其中：股票	7,825,555.70	2.90
2	固定收益投资	247,307,716.26	91.73
	其中：债券	247,307,716.26	91.73
	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	5,082,711.18	1.89
6	其他各项资产	9,381,119.66	3.48
7	合计	269,597,102.80	100.00

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	5,453,290.00	3.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,529,040.00	1.08
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	704,200.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,025.70	0.10
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	7,825,555.70	5.51

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600104	上汽集团	119,700	1,771,560.00	1.25
2	600011	华能国际	221,600	1,529,040.00	1.08
3	600062	华润双鹤	51,200	1,255,936.00	0.88
4	300267	尔康制药	52,900	891,894.00	0.63
5	002701	奥瑞金	30,000	847,200.00	0.60
6	000028	国药一致	20,000	704,200.00	0.50
7	600592	龙溪股份	40,000	335,200.00	0.24
8	300206	理邦仪器	10,000	201,000.00	0.14
9	300155	安居宝	10,000	150,500.00	0.11
10	300229	拓尔思	10,230	139,025.70	0.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	105,511,802.65	74.31
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	81,255,000.00	57.23
7	可转债	60,540,913.61	42.64
8	其他	–	–
9	合计	247,307,716.26	174.18

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	126018	08江铜债	332,140	29,351,211.80	20.67
2	112090	12中兴01	207,511	20,574,715.65	14.49
3	1282517	12杉杉MTN1	200,000	20,380,000.00	14.35
4	1282490	12川国栋MTN1	200,000	20,278,000.00	14.28
5	1282429	12广汇MTN2	200,000	20,216,000.00	14.24

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	40,869.00
2	应收证券清算款	5,869,849.50
3	应收股利	–
4	应收利息	3,469,007.42
5	应收申购款	1,393.74
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	9,381,119.66

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	14,115,024.00	9.94
2	110015	石化转债	9,875,205.60	6.96
3	110019	恒丰转债	4,439,600.00	3.13
4	113002	工行转债	3,960,379.80	2.79
5	110016	川投转债	3,689,542.40	2.60

5.9.5 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中不存在流通受限情况。

§６ 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
本报告期期初基金份额总额	127,639,237.02	109,902,759.50
本报告期基金总申购份额	21,505,813.21	20,249,780.80
减：本报告期基金总赎回份额	76,719,737.08	63,719,399.57
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	72,425,313.15	66,433,140.73

注：本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

§７ 影响投资者决策的其他重要信息

201301/22 富安达增强收益债券型证券投资基金2012年第4季度报告；

201302/22 富安达基金管理有限公司关于与易宝支付合作开通光大银行、建设银行、农业银行、中国银行、温州银行、工商银行、浦发银行、平安银行、兴业银行、交通银行及中信银行借记卡网上直销业务的公告；

201303/11 富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要；

201303/11 富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）；

201303/11 富安达增强收益债券型证券投资基金分红公告；

201303/15 关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构及开通开放式基金网上申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告；

201303/26 富安达增强收益债券型证券投资基金2012年年度报告。

§８ 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准富安达增强收益债券型证券投资基金设立的文件

《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》

《富安达增强收益债券型证券投资基金托管协议》

《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》

基金管理人业务资格批件和营业执照

基金托管人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

8.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司
二〇一三年四月二十二日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

【2013】第一季度报告

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：二〇一三年四月二十二日

§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2013年4月17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2013年1月1日起至3月31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	764,598,847.00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%。 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。
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(2013年1月1日–2013年3月31日)
1.本期已实现收益	–21,776,579.72
2.本期利润	59,835,235.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0725
4.期末基金资产净值	644,809,085.91
5.期末基金份额净值	0.8433

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0.7662。

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	9.00%	1.47%	9.26%	1.47%	–0.26%	0.00%

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2013年3月31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	–	14	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	–	5	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联接基金基金合同》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。报告期内净值上涨9.00%，同期业绩基准上涨9.26%，相差0.26%。报告期内，基金资产的跟踪误差得到良好控，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

在经济见底和政策刺激的预期下，一季度沪深300指数先涨后跌，中小板300指数上涨后，伴随大盘的调整呈现震荡走势。随着政府调控房地产和收缩银行流动性，市场的表现并不乐观。展望二季度，政府调控的格调没变，我们判断周期性行业缺乏上涨的逻辑依据，而中小板300指数里含有众多成长性较好的企业，可以期待中小板300指数良好的成长性为投资者带来相对超额收益；同时，中小板300指数优秀的弹性也可作为波段操作的有力工具。

§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	642,012,622.99	99.37
	其中：股票	642,012,622.99	99.37
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	3,733,893.06	0.58
6	其他各项资产	321,785.75	0.05
7	合计	646,068,301.80	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	16,096,007.06	2.50
B	采矿业	11,090,481.48	1.72
C	制造业	457,852,740.73	71.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,758,898.62	0.74
E	建筑业	42,746,713.78	6.63
F	批发和零售业	29,568,843.96	4.59
G	交通运输、仓储和邮政业	1,604,023.47	0.25
H	住宿和餐饮业	2,960,292.62	0.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,635,379.25	4.60
J	金融业	16,305,974.52	2.53
K	房地产业	11,898,399.69	1.85
L	租赁和商务服务业	12,131,084.65	1.88
M	科学研究和技术服务业	735,148.36	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	4,628,634.80	0.72
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	642,012,622.99	99.57

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	002024	苏宁云商	2,815,846	17,936,939.02	2.78
2	002415	海康威视	334,308	12,884,230.32	2.00
3	002236	大华股份	178,579	12,411,240.50	1.92
4	002241	歌尔声学	206,771	10,421,258.40	1.62
5	002422	科伦药业	162,416	10,392,999.84	1.61
6	002038	双鹭药业	166,023	10,376,437.50	1.61
7	002304	洋河股份	163,783	10,215,145.71	1.58
8	002353	杰瑞股份	125,561	9,800,036.05	1.52
9	002142	宁波银行	911,492	9,652,700.28	1.50
10	002450	康得新	271,564	8,690,048.00	1.35

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,663.86
2	应收证券清算款	315,379.43
3	应收股利	–
4	应收利息	742.46
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	321,785.75

5.9.4 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。

5.9.5 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	824,598,847.00
本报告期基金总申购份额	132,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	192,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	764,598,847.00

§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；

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
二〇一三年四月二十二日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2013】第一季度报告

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：二〇一三年四月二十二日

§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2013年4月17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2013年1月1日起至3月31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	737,130,793.87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。 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