广发标普全球农业指数证券投资基金

【2013】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:二〇一三年十月二十三日

§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2013年10月18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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球农业指数(QDII)
基金主代码	270027
交易代码	270027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月28日
报告期末基金份额总额	251,378,384.14份
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0.5%,年跟踪误差不超过5%,实现对标普全球农业指数的有效跟踪。
投资策略	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。 本基金将不低于85%的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,431,048.43
2.本期利润	3,799,239.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0146
4.期末基金资产净值	238,445,496.72
5.期末基金份额净值	0.949

注:1.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。

2.上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。

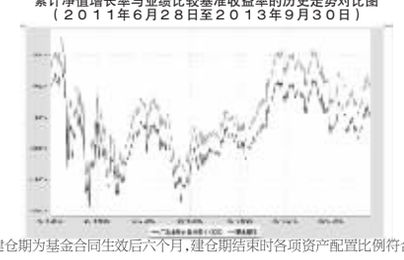
3.2 基金净值表现

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	1.61%	0.69%	1.87%	0.73%	-0.26%	-0.04%

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

广发标普全球农业指数证券投资基金
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28日至2013年9月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,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		
邱炜	本基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理	2011-6-28	-	6	男,中国籍,统计学博士,持有证券业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理,2013年8月9日起任广发美国房地产指数证券投资基金。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发标普全球农业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。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

三季度农业指数整体和大盘走势相似,农产品价格走势也比较稳定,没有出现大幅波动。整个农业指数的各个板块中,化肥板块受到7月底俄罗斯乌拉尔钾肥宣布退出钾肥联盟的消息的影响出现了集体的下挫,到9月末,整体化肥板块已经处于企稳反弹的阶段。本季度美国最大的肉类加工企业史密斯菲尔德正式被双汇收购而退市,并从农业指数中剔除。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本季度基金净值上涨1.61%,业绩比较基准上涨1.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来农产品价格整体上走势比较平稳,相对其他大宗商品比如石油黄金表现要好,波动也小,故今年农业指数到三季度为止的表现也较为平淡,预计在四季度会出现一定幅度的波动,主要原因来自于两方面:首先波动将来自于美国政府债务上限上调事件的影响,将会在一定程度上对全球市场造成影响,第二,四季度对于明年全年的农业生产资料的需求将会明确,故对相关企业的经营将会带来明确的指引,降低了基本面的不确定性。我们目前预期随着全球经济的进一步复苏,明年农业需求将会出现供销两旺的局面,从而有利于四季度到明年农业指数的运行。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	221,348,657.63	91.48
	其中:普通股	197,418,170.13	81.59
	存托凭证	23,930,487.50	9.89
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,332,699.89	7.99
8	其他各项资产	1,275,921.10	0.53
9	合计	241,957,278.62	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	137,213,386.71	57.54
英国	19,009,208.28	7.97
瑞士	18,963,268.70	7.95
日本	13,485,424.68	5.66
新加坡	13,042,598.85	5.47
挪威	8,224,763.07	3.45
加拿大	6,547,923.36	2.75
德国	2,927,938.98	1.23
以色列	1,934,145.00	0.81
合计	221,348,657.63	92.83

注:1.国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2.上述美国比重包括智利和巴西在美国上市的ADR。

3.上述英国比重包括俄罗斯在英国上市的GDR。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	80,773,377.10	33.87
工业	24,925,122.71	10.45
非必须消费品	-	-
必须消费品	115,650,157.82	48.50
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	221,348,657.63	92.83

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland公司	ADM US	纽约证券交易所	美国	91,600	20,746,696.51	8.70
2	BRF SA-ADR	BRF股份公司	BRFS US	纽约证券交易所	美国	126,900	19,137,844.84	8.03
3	SYNGENTA AG-REG	先正达股份公司	SYNN VX	瑞士证券交易所	瑞士	7,550	18,963,268.70	7.95
4	MONSANTO CO	孟山都	MON US	纽约证券交易所	美国	28,860	18,518,502.69	7.77
5	DEERE & CO	迪尔	DE US	纽约证券交易所	美国	32,030	16,027,354.61	6.72
6	BUNGE LTD	Bunge有限公司	BG US	纽约证券交易所	美国	34,280	15,998,293.63	6.71
7	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	英国联合食品集团	ABF LN	伦敦证券交易所	英国	84,200	15,700,354.68	6.58
8	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温省钾肥股份有限公司	POT US	纽约证券交易所	美国	71,550	13,759,740.43	5.77
9	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSN US	纽约证券交易所	美国	67,000	11,648,984.48	4.89
10	WILMAR INTERNATIONAL LTD	丰益国际有限公司	WIL SP	新加坡证券交易所	新加坡	574,000	8,915,187.95	3.74

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名证券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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	427,803.40
3	应收股利	201,259.70
4	应收利息	1,070.42
5	应收申购款	98,093.75
6	其他应收款	427,122.65
7	待摊费用	120,571.18
8	其他	-
9	合计	1,275,921.10

5.10.4 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。

5.10.5 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未存在流通受限情况。

§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	266,923,239.37
本报告期基金总申购份额	3,391,680.87
减:本报告期基金总赎回份额	18,936,536.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	251,378,384.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发标普全球农业指数证券投资基金募集的文件;

2.《广发标普全球农业指数证券投资基金基金合同》;

3.《广发标普全球农业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.《广发标普全球农业指数证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

【2013】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:二〇一三年十月二十三日

§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10月18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
场内简称	中小300
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	614,598,847.00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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	4,359,258.38
2.本期利润	107,215,551.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1596
4.期末基金资产净值	598,382,511.68
5.期末基金份额净值	0.9736

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0.8846。

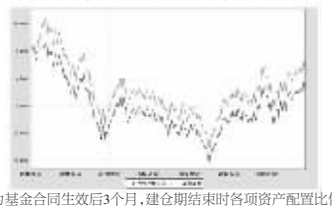
3.2 基金净值表现

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	18.89%	1.51%	19.06%	1.53%	-0.17%	-0.02%

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

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	-	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。报告期内净值增长18.89%,同期业绩基准增长19.06%,相差0.17%。报告期内,基金的日均偏离度为0.02%,年化跟踪误差为0.40%,符合合同规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度,市场出现了较大反弹,但是指数差别很大,沪深300指数涨幅9%,中小300指数涨幅接近20%。展望四季度,虽然经济会逐步走出低谷,但是从政府的表态来看,政府改革的目标不是追求更快的经济增长,而是调结构,稳增长,所以股市的热点依然是与新的经济模式相关的公司,中小板300指数里含有众多优质的企业,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	596,531,805.31	99.49
	其中:股票	596,531,805.31	99.49
2	固定收益投资	232,582.83	0.04
	其中:债券	232,582.83	0.04
	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	2,841,552.41	0.47
6	其他各项资产	4,808.69	0.00
7	合计	599,610,749.24	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	11,525,316.58	1.93
B	采矿业	7,349,192.23	1.23
C	制造业	414,015,080.32	69.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,258,972.18	0.54
E	建筑业	31,019,852.69	5.18
F	批发和零售业	41,937,076.28	7.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,482,704.90	0.25
H	住宿和餐饮业	2,541,095.82	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,387,028.91	6.75
J	金融业	11,648,080.10	1.95
K	房地产业	10,422,545.36	1.74
L	租赁和商务服务业	15,445,886.14	2.58
M	科学研究和技术服务业	595,980.39	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	4,902,993.41	0.82
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	596,531,805.31	99.69

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	2,308,844	29,668,645.40	4.96
2	002241	歌尔声学	386,321	16,333,651.88	2.73
3	002415	海康威视	570,816	15,069,542.40	2.52
4	002236	大华股份	297,858	12,395,867.64	2.07
5	002353	杰瑞股份	140,990	9,880,579.20	1.65
6	002450	康得新	394,455	9,459,030.90	1.58
7	002570	贝因美	204,300	8,498,880.00	1.42
8	002230	科大讯飞	173,019	8,239,164.78	1.38
9	002038	双鹭药业	146,681	8,192,133.85	1.37
10	002594	比亚迪	182,144	7,169,187.84	1.20

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	-	-
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	232,582.83	0.04
8	其他	-	-
9	合计	232,582.83	0.04

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	128003	华天转债	1,895	232,582.83	0.04
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为主要目的,在构建债券投资组合时,可通过国债期货对冲利率风险。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,185.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	623.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,808.69

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

§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	676,598,847.00
本报告期基金总申购份额	71,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	133,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	614,598,847.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

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:二〇一三年十月二十三日

§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10月18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	573,049,598.24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