

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

[2014]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:2014年10月27日

重要提示

基金管理人的董事会及监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。

本公司原原则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)或同一投资组合在不同时间点内进行反向交易。如果因对应于大额赎回等因素需要进行反向交易的,则需经公司领导层审批并报监管机构备案。

基金经理人员认为诚信、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。

基金管理人承诺在本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年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 270002

交易代码 270002

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.2 基金基本概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.3 基金基本概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.4 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.5 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.6 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.7 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.8 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.9 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.10 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.11 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.12 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.13 基金产品概况

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 159007

基金运作方式 约约开放式

基金合同生效日 2011年6月19日

报告期末基金份额总额 447,227,500.99份

投资目标 通过本基金大部分资金投资于中小板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的联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对标的指数的跟踪,通过在交易所内进行反向交易,从而达到对标的指数的跟踪效果。本基金投资于中小板300ETF的对标的指数的复制效果及与成份股的比值不小于基金资产净值的95%。本基金通过投资于中小板300ETF,追求基金净值的持续增长,并力争在风险调整后收益与业绩比较基准的差距在合理的范围内。

基金经理人 周志华

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

2.14 基金产品概况

基金名称 广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金