

## 广发沪深300指数证券投资基金

[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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

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。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司对本基金合同规定,于2014年10月23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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300指数
基金代码	270010
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
交易代码	270010
基金运作方式	契约型开放式
报告期末基金份额总额	1,353,524,377.31份
基金合同生效日	2008年12月30日
报告期末基金份额总额	1,353,524,377.31份

通过本基金的出资比例和数量和基金管理人。实现指投资收益率和净值增长与业绩比较基准的最近。

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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	27,575,237.95	
2.本期利润	216,862,169.57	
3.加权平均基金份额本期利润	0.1314	
4.期末基金资产净值	1,502,097,653.83	
5.期末基金份额净值	1.110	

注:(1)所述基金收益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 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

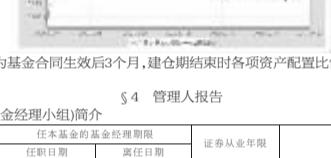
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	收益差异③=①-②	②-④
过去三个月	13.73%	0.85%	12.55%	0.80%

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

广发沪深300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历史走势对比图

(2008年12月30日至2014年9月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后6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(或基金经理小组成员)期间	离任日期	证券从业年限	说明
刘杰	广发基金管理有限公司基金经理,500ETF基金经理,广发沪深300指数基金经理	2014-04-01	-	10	

注:1.“任职日期”和“离任日期”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合规性情况的说明

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、《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》及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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建章立制、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的执行监控及定期的分析评估,保证公平交易的原则。

在投资决策的内部控制方面,公司制定了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制度,投资组合在投资范围之内以自选决策,超过投资权限的操作需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、公平分配”的原则,公平公正地分配资金。监察稽核部严格执行岗位分离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;核风险管理通过对投资、研究及交易等全流程的监控预警,实现投资风险的事后风险控制。

4.3.2 公平交易制度的具体执行情况

报告期内,上述公平交易制度执行情况良好,不同的投资组合受到公平对待,未发生任何不公平的交易行为。

4.3.3 相同投资组合的交易情况

(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)或同一组合在同一天进行反向交易,如果因应对大额赎回等特殊情况下需要进行反向交易的,则需经公司领导严审并报批并报备。

4.4 报告期内本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内,本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.6 本基金于2014年经阶段性转型,稳健,低风险,低波动,结构为基,中短期经济增速略有下降,国内企业盈利有所影响,同时转型也给创新能力比较强的企业相对较多的机会,而经济

盈利有所影响,同时转型也给创新能力比较强的企业相对较多的机会,而经济

盈利有所影响,同时转型也给