广发沪深300指数证券投资基金招募说明书【更新】摘要

[2009年第2号]

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

【重要提示】

广发沪深300指数证券投资基金(以下简称本基金)于2008年11月21日经中国证监会证监许可[2008]1295号文核准。本基金基金合同于2008年12月30日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据本基金合同和本基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金合同。

本基金的基金合同已经根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

本招募说明书所载内容截止日为2009年6月29日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)概况

1、名称:广发基金管理有限公司

2、住所:广东省珠海市凤凰北路19号农行商业大厦1208室

3、办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

4、法定代表人:马庆泉

5、设立时间:2003年8月5日

6、电话:020-89899117

7、联系人:段西军

8、注册资本:1.2亿元人民币

9、股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")、香江投资有限公司、烽火通信科技股份有限公司、广东康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司,分别持有本基金管理人48.33%、16.67%、16.67%、10%和8.33%的股权。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

马庆泉:董事长,男,博士,教授,研究员,中国人民大学博士生导师,第四届中国证券业协会副会长,中国证券业协会基金业委员会主任委员。历任中央党校研究室主任、副教授、教授,广发证券副总裁、常务副总裁、副董事长、总裁,嘉实基金管理有限公司董事长,第二届中国证券业协会秘书长,第三届中国证券业协会副会长等职务。

林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

刘晓燕:董事,女,大学本科学历,现任广发证券财务总监兼财务部总经理。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理、广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

艾俊:董事,男,管理学硕士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司财务总监。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿:董事,女,企业管理硕士,现任香江集团总裁、金海马集团董事长、香江投资有限公司董事长、深圳香江控股股份有限公司董事长。兼任全国妇联常委、中国产业发展促进会副会长、香江社会救助基金会主席、广东省政协常委。曾任广州棠甬家具厂、北京丰台美满家具厂厂长。

许冬瑾:董事,女,工商管理硕士,主管药师,广东康美药业股份有限公司副董事长、副总经理。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授。曾任复旦大学法律系副主任,复旦大学法学院副院长。

姚海鑫:独立董事,男,经济学博士、教授、博士生导师,现任辽宁大学学科建设处处长。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、辽宁大学工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、辽宁大学计财处处长。

罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任民安保险(中国)有限公司副总裁。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险公司总经理助理,副总经理兼纪委书记。

2、监事会成员

余利平:监事会主席,女,经济学博士,曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。

匡丽军:监事,女,大学本科学历,高级涉外秘书,广州科技风险投资有限公司办公室主任。曾任广州实达实业发展公司办公室主任、广州昆臣氏公司行政主管。

刘文红:监事,女,经济学硕士,现任广发基金管理有限公司市场拓展部副总经理。曾任广发证券研究发展中心研究员。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉:总经理,男,大学本科学历,曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

肖雯:副总经理,女,企业管理硕士,高级经济师。曾任珠海国际信托投资公司助理总经理、广发证券电子商务部副总经理、广发证券经纪业务总部副总经理。

朱平:副总经理,男,硕士,经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理有限公司总经理助理。

段西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

4、基金经理

邱春杨,男,中国籍,金融学硕士,8年证券从业经历,持有证券业执业资格证书,2001年3月至2002年10月任职于南方证券资产管理部,2002年11月至2008年2月先后任广发基金管理有限公司筹建人员、研究发展部产品设计小组组长、机构理财部副总经理、金融工程部副总经理,2008年2月1日起任公司金融工程部总经理,2008年12月30日起任本基金基金经理。

本基金自基金合同生效以来,未有其他人员担任本基金基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平、公司投资总监、投资管理部总经理易阳方,研究发展部副总经理傅友兴、固定收益部副总经理谢军。

二、基金托管人

一、基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

成立时间:1984年1月1日

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系人:蒋松云

联系电话:010-66105799

二、主要人员情况

截至2009年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工116人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统,强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2009年3月,托管证券投资基金116只,其中封闭式8只,开放式108只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初,中国工商银行先后被《证券时报》、香港《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》评选为2008年度"中国最佳托管银行",自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得16项国内外大奖。

三 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

基金管理人通过在广州、北京、上海设立的分公司和网上交易为投资人办理开放式基金开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务:

①)广州分公司

地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔32楼

直销中心电话:020-89899073

传真:020-89899069 020-89899070

②)北京分公司

地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦17楼

电话:010-68083368

传真:010-68083078

③)上海分公司

地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室

电话:021-68885310

传真:021-68885200

④)网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。本公司网上交易系统网址:www.gffunds.com.cn

本公司网址:www.gffunds.com.cn

客服电话:95105828或020-83936999

客服传真:020-34281105

2、代销机构

①)名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

联系人:田耕

电话:010-66107900

传真:010-66107914

客户服务热线:95588

公司网址:www.icbc.com.cn

②)名称:广发证券股份有限公司

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:黄岗

电话:020-87555888-875

传真:020-87557985

客户服务热线:95575或020-87555888转各营业网点

公司网址:www.gf.com.cn

③)名称:广发华福证券有限责任公司

住所:福州市五四路157号新天地大厦8层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

电话:0591-87383623

传真:0591-87383610

客户服务电话:96326(福建省外加拨0591)或按打各城市营业网点咨询电话

④)名称:中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)

法定代表人:郭树清

客户服务电话:95533

公司网址:www.ccb.com

⑤)名称:华夏银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:翟鸿祥

联系人:郑鹏

联系电话:010-85238667

传真:010-85238680

客户服务电话:95577

公司网址:www.hxb.com.cn

⑥)名称:交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:021-58781234

传真:021-58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

公司网址:www.bankcomm.com

⑦)名称:上海银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路168号

法定代表人:陈辛

联系人:张萍

电话:021-63370888

传真:021-63371203

客户服务电话:021-962888

公司网址:www.bankofshanghai.com

⑧)名称:平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

联系人:霍兆龙

电话:0755-25859591

传真:0755-25879453

客户服务电话:40066-99999,0755-961202

公司网址:www.18ebank.com

⑨)名称:兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路154号

办公地址:上海市江宁路168号兴业大厦9楼

法定代表人:高建平

电话:021-52629999

联系人:苏健

客户服务电话:95561,或拨打当地咨询电话

公司网址:www.cib.com.cn

⑩)名称:招商银行股份有限公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

客户服务电话:95555

公司网址:www.cmbchina.com

⑪)名称:北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:闫冰竹

联系人:王曦

联系电话:010-66223584

客户服务电话:010-96169(北京),022-96269(天津),021-53599688(上海),029-85766888(西安),0755-23957088(深圳)

公司网址:www.bankofbeijing.com.cn

⑫)名称:中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座?

法定代表人:孔丹

客服电话:95558

公司网址:bank.ecitic.com

⑬)名称:中国光大银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

客服电话:95595(全国)

公司网址:www.cebbank.com

⑭)名称:宁波银行股份有限公司

住所:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

联系人:胡技勉

联系方式:021-63586210

传真:021-63586215

客服电话:96528,上海地区962528

公司网址:www.nbcb.com.cn

⑮)名称:青岛银行股份有限公司

注册地址:山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦

法定代表人:张广鸿

联系人:徐楠

联系电话:0532-85709793

传真:0532-85709839

客户服务电话:(青岛)96588,(全国)400-66-96588,0532-85709799

公司网址:www.qdccb.com

⑯)名称:长城证券有限责任公司

住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:黄耀华

联系人:高峰

电话:0755-83516094

传真:0755-83516199

客户服务电话:0755-82288968

公司网址:www.cc168.com.cn

⑰)名称:东北证券有限责任公司

注册地址:长春市自由大路1138号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

联系人:潘锴

电话:0431-85096709

开放式基金咨询电话:4006000686;0431-85096733

开放式基金业务传真:0431-85680032

公司网址:www.nesc.cn

⑱)名称:德邦证券有限责任公司

注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人:方加春

联系人:罗芳

电话:021-68761616

传真:021-68767981

客户服务电话:4008888128

公司网址:www.tebon.com.cn

⑲)名称:东吴证券有限责任公司

住所:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

法定代表人:吴永敏

联系人:方晓丹

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

公司网址:www.dwzq.com.cn

⑳)名称:广州证券有限责任公司

住所:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

法定代表人:吴志明

联系人:樊刚正

电话:020-87322668

传真:020-87325036

客户服务电话:020-961303

公司网址:www.gzs.com.cn

㉑)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务电话:4008888788,10108998

公司网址:www.ebscn.com

㉒)名称:国海证券有限责任公司

住所:中国广西南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅峰

联系人:覃清芳

电话:0771-5539262

传真:0771-5539033

客户服务电话:4008888100(全国),96100(广西)

公司网址:www.ghzq.com.cn

㉓)名称:国联证券有限责任公司

住所:无锡市县前东街168号

法定代表人:范炎

联系人:袁丽萍

电话:0510-82831662

传真:0510-82830162

客户服务电话:0510-82588168

公司网址:www.glsc.com.cn

㉔)名称:国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

住所:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼

法定代表人:何如

联系人:齐晓燕

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

客户服务电话:800-810-8868

公司网址:www.guosen.com

㉕)名称:国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦27楼

法定代表人:祝幼一

联系人:芮敏棋

电话:021-38676161

传真:021-38670161

客户服务电话:400-8888-666

公司网址:www.gtja.com

㉖)名称:华安证券有限责任公司

注册地址:安徽省合肥市长江中路357号

办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦

法定代表人:李工

联络人:甘霖

电话:0551-5161666

传真:0551-5161600

客户服务电话:0551-96518,4008096518

公司网址:www.hazq.com

㉗)名称:海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

联系人:金芸、杨薇

电话:021-53594566

传真:021-53858549

客户服务电话:021-962503

公司网址:www.htsec.com

㉘)名称:华泰证券股份有限公司

住所:南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

电话:025-84457777-950,248

传真:025-84579763

联系人:李金龙、张小波

客户服务电话:95597

公司网址:www.htsc.com.cn

㉙)名称:联合证券有限责任公司

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

联系人:庞晓芸

电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

客户服务电话:400-8888-555,0755-25125666

公司网址:www.lhzq.com

㉚)名称:金元证券股份有限公司

注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼

法定代表人:陆涛

联系人:金春

电话:0755-83025695

传真:0755-83025625

客户服务电话:4008-888-228

公司网址:www.jyzq.cn

㉛)名称:平安证券有限责任公司

办公地址:深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人:叶黎成

联系人:袁月

电话:0755-22627802

传真:0755-82433794

客户服务电话:95511

公司网址:www.pa18.com

㉜)名称:山西证券股份有限公司

住所:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人:侯巍

联系人:张治国

电话:0351-8686703

传真:0351-8686619

客户服务电话:400-666-1618

公司网址:www.i618.com.cn

㉝)名称:申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

联系人:曹晖

电话:021-54033888

传真:021-54038844

客户服务电话:021-962505

公司网址:www.sw2000.com.cn

㉞)名称:湘财证券有限责任公司

注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人:陈学荣

联系人:李梦涛

电话:021-68634818-8631

传真:021-68865680

开放式基金客服电话:400-888-1551

公司网址:www.xcsc.com

㉟)名称:中国银河证券股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法人代表:肖时庆

联系人:胡长生

电话:010-66568047

传真:010-665668536

客户服务电话:4008-888-888或按打各城市营业网点咨询电话。

公司网址:www.chinastock.com.cn

㊱)名称:招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人:宫少林

联系人:黄健

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

客户服务电话:95565、4008888111

公司网址:www.newone.com.cn

㊲)名称:中银国际证券有限责任公司

住所:上海市浦东新区区银城中路中银大厦39层

法定代表人:平岳

联系人:张静、金坚

电话:021-68604866

传真:021-50372474

客户服务电话:021-68604866

公司网址:www.bociglobal.com

㊳)名称:中信证券股份有限公司

住所:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-84588888

传真:010-84865560

公司网址:www.ecitic.com

㊴)名称:中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

联系人:权唐

电话:010-85130588

传真:010-65182261

客户服务电话:400-8888-108

公司网址:www.csc108.com

㊵)名称:中信金通证券有限责任公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

联系人:王勤

电话:0571-85783715

传真:0571-85783749

客户服务电话:0571-96598

公司网址:www.bigsun.com.cn

㊶)名称:中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区香港东路316号

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

联系人:丁韶燕

电话:0532-85022026

传真:0532-85022026

客户服务电话:0532-96577

公司网址:www.zxwt.com.cn

㊷)名称:财通证券经纪有限责任公司

注册地址:杭州市解放路111号

法定代表人:沈继宁

联系人:乔骏

电话:0571-87925129

传真:0571-87925129

客户服务电话:0571-96336

公司网址:www.ctsec.com

㊸)名称:国都证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层

办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人:王少华

联系人:黄静

电话:010-84183390

传真:010-64482090

客户服务热线:400-818-8118

公司网址:www.guodu.com

㊹)名称:财富证券有限责任公司

注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼(410005)

办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼(410005)

法定代表人:周晖

联系人:郭磊

电话:0731-4403319

公司网址:www.cfzq.com

㊺)名称:世纪证券有限责任公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人:段强

联系人:刘军辉

电话:0755-83199511

公司网址:www.esco.com.cn

㊻)名称:万联证券有限责任公司

住所:广州市中山二路18号电信广场36.37层

法定代表人:李舫金

联系人:罗创斌

电话:020-37865031

客户服务电话:400-8888-133

公司网址:www.wlzq.com.cn

㊼)名称:江南证券有限责任公司

住所:江西省南昌市抚河北路291号教育出版大厦6楼

法定代表人:姚江涛

联系人:余雅娜

电话:0791-6768763

公司网址:www.scstock.com

㊽)名称:天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人:林义相

联系人:莫晓丽

电话:010-66045529

客户服务电话:010-66045678

传真:010-66045500

公司网址:www.txsec.com 或 www.txjijin.com

㊾)名称:长江证券股份有限公司

地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务电话:4008-888-999或027-85808318

传真:86-27-85481900

公司网址:http://www.95579.com

㊿)名称:兴业证券股份有限公司

住所:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

联系人:杨盛芳

电话:021-68419974

传真:021-68419867

客户服务电话:021-68419974

公司网址:www.xyzq.com.cn

(51)名称:第一创业证券有限责任公司

住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层

法定代表人:刘学民

联系人:王立洲

电话:0755-25832494

传真:0757-25831718

公司网址:www.firstcapital.com.cn

(52)名称:国元证券股份有限公司

住所:合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

联系人:程维

联系电话:0551-2207936

开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400-8888-777

开放式基金业务传真:0551—2207935

公司网址:www.gyzq.com.cn

(53)名称:东方证券股份有限公司

住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

电话:021-63325888

传真:021-63326173

客户服务电话:021-962506

公司网址:www.dfzq.com.cn

(54)名称:渤海证券股份有限公司

注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址:天津市河西区宾水道3号

法定代表人:张志军

联系人:王兆权

电话:022-28451861

传真:022-28451892

客户服务电话:4006515988

公司网址:www.bhzq.com

(55)名称:信泰证券有限责任公司

注册、办公地址:南京市长江路88号

法定代表人:钱凯法

联系人:舒萌菲

电话:025-84784782

传真:025-84784741

客户服务电话:400-8888-918

公司网址:www.thope.com

(56)名称:安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

联系人:张茜萍

电话:0755-82558098

传真:0755-82558003

客服电话:4008-001-001、4008-006-006

公司网址:www.essence.com.cn

(57)名称:国盛证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市永叔路15号

办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人:管荣升

联系人:徐美云

电话:0791- 6285337

传真:0791-6289395

公司网址:www.gsstock.com

(58)名称:中原证券股份有限公司

注册地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦

办公地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦

法定代表人:石保上

联系人:程月艳、耿铭

电话:0371-65585670

传真:0371-65585665

客户服务电话:0371-967218或4008139666

公司网址:www.ccnew.com

(59)名称:瑞银证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人:刘弘

联系人:谢亚凡、韩晓光

电话:010-59226788

传真:010-59226840

客户服务电话:400-887-8827

公司网址:www.ubssecurities.com

(60)名称:恒泰证券有限责任公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人:刘汝军

联系人:常向东

电话:0471-4913998

传真:0471-4930707

客户服务电话:0471-4961259

公司网址:www.cnht.com.cn

(61)名称:宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址:北京西直门北大街甲43号金运大厦B座

法定代表人:汤世生

联系人:李巍

电话:010-62294608-6460

传真:010-62296854

客户服务电话:010-62294600

公司网址:www.hysec.com

(62)名称:东海证券有限责任公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦11楼

法定代表人:朱科敏

联系人:李涛

电话:021-50586660-8966

传真:021-50819897

客户服务电话:400-888-8588、021-52574550 0519-88166222 0379-64902266

公司网址:www.longone.com.cn

(63)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务电话:4008888788、10108998

公司网址:www.ebscn.com

(64)名称:方正证券有限责任公司

注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址:湖南省长沙市建湘路479号

法定代表人:雷杰

客服电话:95571

电话:0731-2882340、0571-87782047

传真:0731-2882332

网址:www.founder.sc.com

(65)名称:齐鲁证券有限公司

注册地址:济南市经十路128号

办公地址:济南市经十路128号

法定代表人:李玮

联系人:王霖

电话:0531-81283906

传真:0531-81283900

客户服务电话:95538

公司网址:www.qlzq.com.cn

(66)名称:江海证券经纪有限责任公司

地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:葛新

电话:0451-82269286

传真:0451-82269286

客户服务电话:4006662288

公司网址:www.jhzq.com.cn

(67)名称:华宝证券经纪有限责任公司

注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人:陈林

联系人:翟立权

电话:021-50122102

客户服务电话:4008209898

公司网站:www.cnhbstock.com

3、其他代销机构

本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

二、注册登记人

名称:广发基金管理有限公司

住所:广东省珠海市凤凰北路19号农行商业大厦1208室

法定代表人:马庆泉

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

电话:020-89899129

传真:020-89899175

联系人:李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:国浩律师集团(广州)事务所

住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼

负责人:程秉

电话:020-38799345

传真:020-38799335

经办律师:程秉 李彩霞

联系人:程秉

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:深圳鹏城会计师事务所

办公地址:深圳市福田区滨河大道5022号联合广场A座7楼

法人代表:饶永

电话:0755-82203222

传真:0755-82237549

经办注册会计师:杨克晶 侯立勋

联系人:杨克晶

四、基金的名称

广发沪深300指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等,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%。

本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金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,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

(一)资产配置策略

本基金原则上将不低于90%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和备选成分股,其中备选成份股投资比例不高于15%,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5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。如果法律法规允许,本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的100%,此事项无须经基金份额持有人大会同意。

(二)股票组合构建

1、股票组合构建原则

本基金原则上采用完全复制法来跟踪沪深300指数,按照个股在标的指数沪深300指数中的基准权重进行指数化投资组合构建。

2、股票组合构建方法

如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,使基金管理人无法依指数权重购买成份股,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合管理进行适当变通和调整,最终获得更接近标的指数的收益率。

3、股票组合调整

①)定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的沪深300指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

②)不定期调整

1)与指数相关的调整

根据指数编制规则,当沪深300指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据沪深300指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。

2)申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3)其他调整

针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

(三)股资决策依据和决策程序

1、决策依据

以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

①)股资决策委员会制定整体投资战略。

②)研究发展部对沪深300指数成份股进行持续跟踪调研分析,并根据自身或者其他研究机构的研究成果提供研究报告,对投资决策提供建议。

③)基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,在研究部门研究报告的指引下,结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订基金的具体投资计划。

④)股资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

⑤)根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由交易部执行。

⑥)交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组。

⑦)金融工程部采用量化模型进行成份股权重的测算和跟踪误差的评估,并定期进行基金绩效评估,向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

⑧)风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;金融工程部重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

九、业绩比较基准

本基金以沪深300指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率。

如果沪深300指数被停止编制及发布,或沪深300指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300指数不宜继续作为本基金的标的指数,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的标的指数和业绩比较基准,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

十、风险收益特征

本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、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基金合同规定,于2009年7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。

本投资组合报告所载数据截至2009年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)基金资产配置组合

项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
权益投资	878,103,545.69	84.68
其中:股票	878,103,545.69	84.68
固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	123,908,712.37	11.95
其他资产	34,926,126.51	3.37
合计	1,036,938,384.57	100.00

(二)期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	5,110,167.30	0.54
B 采掘业	91,878,501.97	9.62
C 制造业	246,295,573.37	25.80
C0 食品、饮料	35,247,571.30	3.69
C1 纺织、服装、皮毛	5,620,760.96	0.59
C2 木材、家具	620,329.50	0.06
C3 造纸、印刷	3,385,358.96	0.35
C4 石油、化学、塑胶、塑料	26,110,241.70	2.73
C5 电子	4,663,031.30	0.49
C6 金属、非金属	80,405,173.41	8.42
C7 机械、设备、仪表	67,789,730.40	7.10
C8 医药、生物制品	17,776,795.71	1.86
C99 其他制造业	4,676,580.13	0.49
D 电力、煤气及水的生产和供应业	30,907,804.07	3.24
E 建筑业	22,782,269.96	2.39
F 交通运输、仓储业	57,698,217.01	6.04
G 信息技术业	28,904,781.07	3.03
H 批发和零售贸易	22,675,493.41	2.38
I 金融、保险业	273,976,807.88	28.70
J 房地产业	56,048,958.75	5.87
K 社会服务业	14,789,626.77	1.55
L 传播与文化产业	2,855,520.07	0.30
M 综合类	24,179,824.06	2.53
合计	878,103,545.69	91.97

(三)期末基金投资前十名股票明细

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	600030	中信证券	1,336,545	34,041,801.15	3.57
2	600036	招商银行	2,052,569	32,697,424.17	3.42
3	601318	中国平安	699,006	27,338,124.66	2.86
4	601328	交通银行	3,787,259	24,352,075.37	2.55
5	601939	建设银行	5,529,818	23,778,217.40	2.49
6	600016	民生银行	4,582,070	23,276,915.60	2.44
7	600000	浦发银行	964,600	21,144,032.00	2.21
8	601166	兴业银行	852,077	19,580,729.46	2.05
9	000002	万科A	2,356,386	19,510,876.08	2.04
10	601088	中国神华