

广发沪深300指数证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

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:二〇一一年七月十九日

\$1 重要提示

基金管理人的董事局及董事会声明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、准确性负责。并承诺不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，对其中的内容的真实性、准确性负责。

基金的过往业绩并不代表其未来的投资表现。投资人选择本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

\$2 基金产品概况

基金名称	广发沪深300指数
基金代码	270010
交易代码	270010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月30日
报告期末基金份额总额	2,741,917,339.81份
投资目标	通过严谨的投资流程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，在严格控制风险的前提下，力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的差距控制在0.35%以内。
投资策略	本基金为指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在沪深300指数中的权重比例构建股票组合，并根据成份股的调整及时进行相应的调整。同时，本基金将定期评估和动态地调整组合的配置，增减股票品种，以期在组合的流动性和组合的基金标的指数的表现可能带来影响时，合理地调整组合的配置，降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同期存款基准利率
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，其风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

\$3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期 2011年4月1日-2011年6月30日	单位:人民币元
1.本期已实现收益		18,108,512.87	
2.本期利润		-175,423,514.56	
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0641	
4.期末基金份额净值		3,557,703,233.91	
5.期末基金份额总额		1,297	

注:①所列财务数据不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平以所列数字。

②本期利润实现收益扣除了期间利息收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金的净值表现

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	-4.63%	1.05%	-5.28%	1.04%	0.65%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其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的历史走势对比图

2008年12月30日至2011年6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比符合基金合同有关规定。

54 管理人报告

4.1 基金经理 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
陈晓益	本基金的基金经理 “安中证500” “10F”的基金经理	2010-12-1	4

注:1.任职日期和 离任日期指公司公告解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本基金期内,基金管理人严格按照《证券法》、《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金销售办法》、《基金评价办法》、《基金宣传推介办法》、《信息披露办法》、《基金定期报告格式及内容指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第1号——基金募集》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第2号——基金交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第3号——基金费用》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第4号——基金份额申购、赎回与转换》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第5号——信息披露与报告》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第6号——基金估值》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第7号——澄清与更正》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第8号——基金资产估值》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第9号——基金会计核算》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第10号——基金转换》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第11号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第12号——基金上市交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第13号——基金关联交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第14号——基金投资禁止行为》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第15号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第16号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第17号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第18号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第19号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第20号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第21号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第22号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第23号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第24号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第25号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第26号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第27号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第28号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第29号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第30号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第31号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第32号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第33号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第34号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第35号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第36号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第37号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第38号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第39号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第40号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第41号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第42号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第43号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第44号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第45号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第46号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第47号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第48号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第49号——基金资产估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第50号——基金资产估值方法》。

注:①所列财务数据不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平以所列数字。

②本期利润实现收益扣除了期间利息收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金的净值表现

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	-2.68%	0.94%	-4.44%	0.88%	1.76%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其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的历史走势对比图

2008年12月3日至2011年6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比符合基金合同有关规定。

54 管理人报告

4.1 基金经理 基金经理小组简介

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本基金期内,基金管理人严格按照《证券法》、《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金销售办法》、《基金评价办法》、《基金宣传推介办法》、《信息披露办法》、《基金定期报告格式及内容指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第1号——基金募集》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第2号——基金交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第3号——基金费用》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第4号——基金份额申购、赎回与转换》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第5号——信息披露与报告》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第6号——基金资产估值》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第7号——澄清与更正》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第8号——基金会计核算》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第9号——基金上市交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第10号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第11号——基金费用》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第12号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第13号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第14号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第15号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第16号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第17号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第18号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第19号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第20号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第21号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第22号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第23号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第24号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第25号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第26号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第27号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第28号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第29号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第30号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第31号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第32号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第33号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第34号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第35号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第36号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第37号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第38号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第39号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第40号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第41号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第42号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第43号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第44号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第45号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第46号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第47号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第48号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第49号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第50号——基金费用计提费率》。

注:①所列财务数据不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平以所列数字。

②本期利润实现收益扣除了期间利息收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金的净值表现

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	-2.68%	0.94%	-4.44%	0.88%	1.76%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其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的历史走势对比图

2008年12月3日至2011年6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比符合基金合同有关规定。

54 管理人报告

4.1 基金经理 基金经理小组简介

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本基金期内,基金管理人严格按照《证券法》、《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金销售办法》、《基金评价办法》、《基金宣传推介办法》、《信息披露办法》、《基金定期报告格式及内容指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第1号——基金募集》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第2号——基金交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第3号——基金费用》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第4号——基金份额申购、赎回与转换》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第5号——信息披露与报告》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第6号——基金资产估值》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第7号——澄清与更正》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第8号——基金会计核算》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第9号——基金上市交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第10号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第11号——基金费用》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第12号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第13号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第14号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第15号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第16号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第17号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第18号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第19号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第20号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第21号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第22号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第23号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第24号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第25号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第26号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第27号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第28号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第29号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第30号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第31号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第32号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第33号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第34号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第35号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第36号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第37号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第38号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第39号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第40号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第41号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第42号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第43号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第44号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第45号——基金费用计提费率》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第46号——基金费用计提费率》