广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2011年8月10日
公告日期:2011年8月5日

一、 重要声明与提示

《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告》(以下简称"本公告")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")管理人广发基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2011年4月27日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及广发基金管理有限公司网站(www.gffunds.com.cn)上公告的《"发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

1、基金二级市场交易简称:中小300
2、二级市场交易代码:159907
3、基金申购赎回简称:中小300
4、申购赎回代码:159907
5、标的指数简称:中小板300价格指数
6、标的指数代码:399008
7、2011年8月3日基金份额总额:652,598,847.00份
8、2011年8月3日基金份额净值:1.0940元
9、本次上市交易份额:652,598,847.00份
10、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
11、上市交易日期:2011年8月10日
12、基金管理人:广发基金管理有限公司
13、基金托管人:中国农业银行股份有限公司
14、申购赎回代理券商:
(1)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:林治海
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87557985
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
公司网址:www.gf.com.cn
(2)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
法定代表人:顾伟国
联系人:田薇
电话:010-66568430
传真:010-66568536
客户服务电话:4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。
公司网址:www.chinastock.com.cn
(3)中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:曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客户服务电话:95523或4008895523
电话委托电话:021-962505
公司网址:www.sywg.com
(4)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
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn
(5)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:倪图林
电话:0871-3577398
传真:0871-3578827
网址:www.hongtazq.com
(6)中航证券有限公司
住所:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
电话:0791-6768681
传真:0791-6770178
公司网址:www.avicsec.com
(7)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:陈琼菲
电话:021-50122222
传真:021-50122200
客户服务电话:4008209898
公司网站:www.cnhbstock.com
(8)齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
办公地址:济南市经七路86号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客户服务电话:95538
公司网址:www.qlzq.com.cn
(9)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:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客户服务电话:400-651-5988
公司网址:www.bhzq.com
(10)友信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国风凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.essence.com.cn
(11)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:潘鑫军
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务电话:95503
公司网址:www.dfzq.com.cn
(12)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29楼
法定代表人:万建华
联系人:丙敏桃
电话:021-38676666
传真:021-38670666
客户服务电话:400-8888-666
公司网址:www.gtja.com
(13)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:谢高得
电话:021-38565785
传真:021-38565955
客户服务热线:400-8888-123
公司网址:www.xyzq.com.cn
(14)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客户服务热线:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.htsec.com
(15)东法证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客户服务电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
(16)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:侯魏
联系人:郭熠
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618
公司网址:www.i618.com.cn

三、 基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2011年3月21日证监许可[2011]424号。
2、基金合同生效日:2011年6月3日。
3、基金运作方式:交易型开放式。
4、基金合同期限:不定期。
5、发售日期:2011年5月3日至2011年5月27日。其中,网下现金认购和网上现金认购的日期为2011年5月3日至2011年5月27日,网下股票认购的日期为2011年5月23日至2011年5月27日。
6、发售价格:人民币1.00元。
7、发售方式:投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。
8、发售机构:
(1)网下现金发售直销机构
广发基金管理有限公司
(2)网上现金发售代理机构
本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理:广发证券、国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、华泰联合证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、中银万国证券、中信万通证券、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福证券、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业证券、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安证券、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、信证证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投证券、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券等(排序不分先后)。
(2)网下股票发售代理机构为以下机构
广发证券、广发华福证券、兴业证券、中银万国证券、国泰君安证券、银河证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、华泰联合证券、东北证券、东方证券、平安证券、渤海证券、海通证券、金元证券、光大证券、东海证券、国盛证券、山西证券、湘财证券、国联证券、广州证券、中信证券、德邦证券、华安证券、中信金通证券、中原证券、国都证券、安信证券、中航证券、长江证券、齐鲁证券、江海证券、华宝证券、华龙证券、信达证券、厦门证券、南京证券、华融证券、浙商证券、西南证券、国金证券、财通证券、东吴证券、方正证券、国海证券、国元证券、华泰证券、民族证券、万联证券、中投证券、中信万通证券、长城证券等(排序不分先后)。
9、验资机构名称:德勤华永会计师事务所有限公司
10、募集资金总额及入账情况
本基金于2011年5月3日起公开募集,基金募集工作已于2011年5月27日顺利结束。
经德勤华永会计师事务所有限公司验资,本次募集的有效净认购金额为718,238,734.00元人民币(含募集股票市值),折合基金份额718,238,734.00份,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计59,530.17元人民币。募集资金已于2011年6月2日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购户数为9,412户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计718,294,002.00份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中,广发基金管理有限公司及本基金管理人基金从业人员未认购本基金。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
11、本基金募集备案情况
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《"发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《"发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2011年6月3日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。
(二)本基金份额折算
根据《"发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同"》和《"发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书"》的有关规定,广发基金管理有限公司确定2011年7月25日为广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日,折算后的基金份额净值与2011年7月25日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2011年7月25日,中小板300价格指数收盘值为1078.962点,本基金的基金资产净值为704,134,532.97元,折算前基金份额总额为718,294,002.00份,折算前基金份额净值为0.9803元。
根据《"发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书"》中约定的基金份额折算公式,基金份额折算比例为0.90854670(以四舍五入的方法保留到小数点后8位),折算后基金份额总额为652,598,847.00份,折算后基金份额净值为1.0790元。
本基金管理人已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于2011年7月26日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位(小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产),投资者可以自2011年7月27日起在销售机构查询折算后其持有的基金份额。
本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理,并互相核对。
(三)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上[2011]236号
2、上市交易日期:2011年8月10日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、基金二级市场交易简称:中小300
5、二级市场交易代码:159907
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易
6、本次上市交易份额:652,598,847.00份
7、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2011年8月3日,本基金份额持有人户数为9,412户,平均每户持有的基金份额为69,336.89份。
(二)持有人结构
截至2011年8月3日,本基金份额持有人结构如下:
个人投资者持有的基金份额为346,150,635份,占基金总份额的53.04%;机构投资者持有的基金份额为306,448,212份,占基金总份额的46.96%。
(三)截至2011年8月3日,前十名基金份额持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例(%)
1	广发证券-工行-广发金管家新型高成长集合资产管理计划	45,431,120.00	6.96%
2	红塔证券股份有限公司	27,258,292.00	4.18%
3	中航-浦发-中航金航2号集合资产管理计划	27,257,536.00	4.18%
4	中国银河证券股份有限公司	20,000,193.00	3.06%
5	海通证券股份有限公司	18,171,922.00	2.78%
6	渤海证券股份有限公司	18,171,690.00	2.78%
7	华宝证券有限责任公司	18,171,690.00	2.78%
8	齐鲁证券-中信-金泰山灵活配置集合资产管理计划	18,171,689.00	2.78%
9	山西证券股份有限公司	13,628,768.00	2.09%
10	兴业证券股份有限公司	9,086,753.00	1.39%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、 基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、公司概况
名称:广发基金管理有限公司
法定代表人:马庆泉
总经理:林传辉
注册资本:1.2亿元人民币
注册地址:广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
设立批准文号:中国证监会证监基字[2003]91号
工商登记注册的法人营业执照文号:440000000011836
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
2、股东及其出资比例:广发证券股份有限公司、香江投资有限公司、烽火通信科技股份有限公司、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。
3、内部组织结构及职能

委员会名称	职责
投资决策委员会	决定公募基金的投资理念、投资准则;研判市场时机,审议公募基金经理提交的资产配置报告,确定公募基金资产配置比例;评估并审定公募基金投资策略及拟重点投资的证券;对委员会决议的执行情况进行监督等。
风险控制委员会	负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程,确保公司整体风险的识别、监控和管理;负责检查风险控制制度的落实情况,审阅公司各项风险与内控状况评价报告;针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况,组成危机处理小组,评估事件风险,制定危机处理方案并监督实施等。

部门名称	职能定位
投资管理部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究发展部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
机构投资部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责QDII基金的投资管理
数量投资部	负责公募指数型基金的管理、指数衍生产品(包括股指期货等)的研究和应用、量化选股的投资产品研究和管理
金融工程部	负责产品开发、设计、报批工作,公司发展规划研究
市场拓展部	负责公募基金、一对多专户理财产品的募集与持续销售、营销推广、客户服务工作,下设北京、上海、广州三个分公司。
机构理财部	负责企业年金、"一对一"专户理财业务,机构业务的市场开拓与服务
综合管理部	负责行政管理与后勤保障
财务部	负责公司财务管理工作
人力资源部	负责人力资源管理
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理,投资风险监控与业绩归因分析
中央交易部	负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控等
信息技术部	负责公司信息化建设工作
注册登记部	负责开放式基金和资产管理计划份额的登记存管和资金的清算管理
基金会计部	负责开放式基金、年金资产和资产管理计划的核算及相关信息披露工作
北京办事处	负责协调办理公司在京有关事项。

4、截止2011年6月30日,广发基金管理有限公司总人数214人,其中博士学位16人、硕士学位115人和学士学位68人。
5、本基金经理
陆志明先生,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月任大鹏证券有限公司研究员,2001年5月至2010年8月就职于深圳证券信息有限公司,历任指数小组组长、指数部副总监、总监,2010年8月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300ETF基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300联接基金的基金经理。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国农业银行股份有限公司(简称:"中国农业银行")
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人:项俊波
成立日期:2009年1月15日
注册资本:32,479,411.7万元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-63201510
传真:010-63201816
联系人:李芳菲
中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过日已的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营,可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"惠你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。
中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《金球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"金牌理财"TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。
中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。
2、主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工130名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。
3、基金托管业务经营情况
截止2011年7月13日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共103只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕元证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富三克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天惠红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、中万巨擎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海监管灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海深证300回报数据增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、银华长城能源基础股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金。
(三)验资机构
名称:德勤华永会计师事务所有限公司
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯卿
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏 洪锐明
联系人:胡小骏

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金2011年8月3日资产负债表如下:

资 产	2011年8月3日	负债和所有者权益	2011年8月3日
	余额		余额
资 产:		负债:	
银行存款	9,684,670.47	短期借款	
结算备付金	15,585,134.16	交易性金融负债	
存出保证金	6,442,701.34	衍生金融负债	
交易性金融资产	683,419,148.38	卖出回购金融资产款	
其中:股票投资	683,326,154.38	应付证券清算款	41,545.79
债券投资	92,994.00	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	29,236.25
基金投资		应付托管费	5,847.25
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	566,170.32
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	53,466.02	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	587,645.39
其他资产		负债合计	1,230,445.00
		所有者权益:	
		实收基金	718,294,002.00
		未分配利润	-4,339,326.63
		所有者权益合计	713,954,675.37
资产合计:	715,185,120.37	负债与持有人权益总计:	715,185,120.37

八、 基金投资组合

截止到2011年8月3日,本基金的投资组合如下:
(一)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	683,326,154.38	95.55
	其中:股票	683,326,154.38	95.55
2	固定收益投资	92,994.00	0.01
	其中:债券	92,994.00	0.01
	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	25,269,804.63	3.53
6	其他各项资产	6,496,167.36	0.91
7	合计	715,185,120.37	100.00

(二)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	14,120,226.00	1.98
B	采掘业	20,434,445.72	2.86
C	制造业	459,624,907.08	64.38
C0	食品、饮料	32,419,082.51	4.54
C1	纺织、服装、皮毛	19,793,438.00	2.77
C2	木材、家具	3,372,896.00	0.47
C3	造纸、印刷	12,436,884.50	1.74
C4	石油、化学、塑胶、塑料	68,809,823.62	9.64
C5	电子	71,249,194.47	9.98
C6	金属、非金属	43,184,222.26	6.05
C7	机械、设备、仪表	133,078,933.83	18.64
C8	医药、生物制品	62,557,093.69	8.76
C99	其他制造业	12,723,338.20	1.78
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,572,300.00	0.64
E	建筑业	32,977,858.24	4.62
F	交通运输、仓储业	3,531,966.00	0.49
G	信息技术业	49,915,259.37	6.99
H	批发和零售贸易	60,958,988.84	8.54
I	金融、保险业	11,579,725.00	1.62
J	房地产业	10,793,336.38	1.51
K	社会服务业	10,486,323.75	1.47
L	传播与文化产业	3,260,782.00	0.46
M	综合类	1,070,036.00	0.15
	合计	683,326,154.38	95.71

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	002024	苏宁电器	3,153,825	38,192,820.75	5.35
2	002304	洋河股份	137,959	19,272,872.30	2.70
3	002202	金风科技	948,800	12,846,752.00	1.80
4	002422	科伦药业	160,255	11,166,568.40	1.56
5	002155	辰州矿业	270,500	9,897,595.00	1.39
6	002073	软控股份	436,300	8,896,157.00	1.25
7	002142	宁波银行	832,700	8,851,601.00	1.24
8	002106	莱宝高科	278,800	7,494,144.00	1.05
9	002001	新 和 成	243,600	6,988,884.00	0.98
10	002008	大族激光	570,581	6,909,735.91	0.97

(四)按券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	92,994.00	0.01
8	其他		
9	合计	92,994.00	0.01

(五)按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

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	129031	巨轮转2	750	92,994.00	0.01

(六)投资组合报告附注
1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
2、基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,442,701.34
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	53,466.02
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	6,496,167.36

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金2011年8月3日未持有处于转股期的可转换债券。
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2011年8月3日前十名股票中不存在流通受限情况。
6、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 重大事件揭示

以2011年7月25日为基金份额折算日,本基金进行了基金份额折算,具体内容详见第三章的"(二)本基金份额折算"。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、 基金份额申购、赎回

(一)申购和赎回场所
投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。
基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商,并予以公告。在相关条件许可的前提下,基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构,并予以公告。
目前,本基金申购赎回代理券商的名单如下:广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、中航证券有限公司、华宝证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、渤海证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、山西证券股份有限公司。若深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购赎回的,本基金管理人将另行公告。
(二)申购与赎回的开放日及时间
1、申购、赎回的开始时间
自"2011年8月10日"起,本基金开始办理申购、赎回。
2、开放日及开放时间
基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。
基金上市后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(三)申购与赎回的原则
1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式,即申购和赎回均以份额申请。
2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
4、申购、赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。
5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益,不违背交易所相关规则的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。
(四)申购与赎回的程序
1、申购和赎回的申请
基金投资者必须按申购赎回代理券商规定的手续,在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。
基金投资者在提交申购申请时须根据申购、赎回清单备足申购对价,基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金,否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。
2、申购和赎回申请的确认
基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。