

广发标普全球农业指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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:二〇一一年十月二十六日

§1 重要提示
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	广发全球农业指数(QDII)
基金主代码	270027
交易代码	270027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月28日
报告期末基金份额总额	383,327,061.98份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,年跟踪误差不超过5%,实现对标普全球农业指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制跟踪误差风险的双重约束下构建指数化投资组合。本基金将不低于85%的基金资产投资于标普全球农业指数成份股,备选成份股;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%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

投资目标	跟踪标的指数，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%，年跟踪误差率不超过 5%，实现与标的指数及业绩比较基准的有效跟踪	5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布																														
投资策略	本基金追求标的指数的长期增长和稳定性收益为投资目标，在降低跟踪误差和抑制波动性的双重约束下构建超标的投资组合 本基金将不低于 85% 的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股；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%。 本基金的投资标的为长期增长和稳定性收益为投资目标，在降低跟踪误差和抑制波动性的双重约束下构建超标的投资组合	<table><tr><th>国家（地区）</th><th>公允价值（人民币元）</th><th>占基金资产净值比例（%）</th></tr><tr><td>美国</td><td>163,654,027.87</td><td>53.05</td></tr><tr><td>新加坡</td><td>35,662,103.13</td><td>11.56</td></tr><tr><td>英国</td><td>22,103,723.25</td><td>7.16</td></tr><tr><td>瑞士</td><td>16,374,358.12</td><td>5.31</td></tr><tr><td>加拿大</td><td>13,578,601.98</td><td>4.40</td></tr><tr><td>日本</td><td>12,182,332.09</td><td>3.95</td></tr><tr><td>挪威</td><td>10,284,583.55</td><td>3.33</td></tr><tr><td>德国</td><td>5,466,979.58</td><td>1.77</td></tr><tr><td>中国香港</td><td>4,059,598.50</td><td>1.32</td></tr></table>	国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	美国	163,654,027.87	53.05	新加坡	35,662,103.13	11.56	英国	22,103,723.25	7.16	瑞士	16,374,358.12	5.31	加拿大	13,578,601.98	4.40	日本	12,182,332.09	3.95	挪威	10,284,583.55	3.33	德国	5,466,979.58	1.77	中国香港	4,059,598.50	1.32
国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）																														
美国	163,654,027.87	53.05																														
新加坡	35,662,103.13	11.56																														
英国	22,103,723.25	7.16																														
瑞士	16,374,358.12	5.31																														
加拿大	13,578,601.98	4.40																														
日本	12,182,332.09	3.95																														
挪威	10,284,583.55	3.33																														
德国	5,466,979.58	1.77																														
中国香港	4,059,598.50	1.32																														
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率																															
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。																															
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																															
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.																															
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行																															

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。
2、上述美国比重包括智利和巴西在美国上市 的 ADR。

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
------	------------	--------------



注:1、本基金合同于2011年6月28日生效,截止报告期末本基金合同生效未满一年。
2、本基金建仓期为六个月,至披露时点建仓期末结束。

§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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
邱伟	本基金的基金经理	2011-6-28	-	4	男,中国籍,统计学博士,持有证券业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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、《广发标普全球农业指数证券投资基金基金合同》和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。报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定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授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;在交易过程中,中央交易员按照 时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。

公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

监察稽核部风险管理岗通过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;监察稽核部稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人未管理与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合,未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2011年3季度全球市场大幅波动,遭遇了标普调降美国国债评级,导致美国市场大幅下跌,同时欧洲债务危机的加深影响了全球各市场,使全球投资者风险偏好大幅下降,纷纷抛售各类金融资产,黄金也未能幸免于难;相反,美国国债收益率持续创历史新低,美元反弹,资金从新兴市场回撤至美国国债市场。

中国国内经济在本季度进一步放缓,在海外各种因素和国内通胀持续高企的双重影响下,面临诸多不确定因素。本季度沪深300指数下跌15.2%,上证指数下跌14.6%,深证成指指数下跌15.02%。

本季度标普全球农业指数(人民币计价)下跌19.4%,纳斯达克综合指数下跌12.9%,标普500指数下跌14.3%,英国富时100指数下跌13.7%,德国DAX指数下跌25.4%,法国CAC40指数下跌25.1%,香港恒生指数下跌21.5%。

广发标普全球农业指数基金成立于6月24日,在本季度初尚处于建仓期,7月后期基本达到本投资组合要求的仓位比例。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内,本基金净值下跌19.7%,跟踪指数下跌19.4%,日均内平均跟踪误差为0.109%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
虽然受债务危机等因素的影响,未来全球经济将受负面冲击,欧洲债务危机的持续发展仍将主导未来市场的走势,但是从农业行业来看,我们仍处于非常好的基本面之中,股价暂时的下跌不是基于行业基本面的变化,而是受市场整体风险偏好所影响。

当前,各类农产品价格仍处于高位,根据美国农业部的预测,七月份异常炎热和九月份的低温将进一步降低主要农作物的产量,比如玉米由产从去年每英亩152.8蒲式耳降低至148.1蒲式耳;同时各主要农产品的库存仍然处于几年来的低位,同时全球对农产品的需求量却在仍在高位,这导致了农产品价格的持续坚挺,以及处于农业产业链上游的种子公司化肥机械等子行业的稳步增长,而全球贸易量的增加提升了粮食贸易及加工商的机会。

经济走势的不确定性将持续影响市场的未来走势,我们预计全球农业指数仍将处在相对大的范围内波动,但是目前看来行业基本仍处于景气状态,在短期内出现大幅变化的概率较小。

因此,我们认为市场由系统性风险带来的快速下跌给投资者提供了较好的加仓机会。我们将确保严格按照基金合同规定,争取进一步减小跟踪误差。

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定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授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要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、比例分配、综合平衡”的原则,公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同日反向交易,公司可以借用公平交易模块,确保交易的公平。		谴责和处罚。
5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。		5.10.3 其他各项资产构成
序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	17,343,678.73

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	163,654,027.87	53.05
新加坡	35,662,103.13	11.56
英国	22,103,723.25	7.16
瑞士	16,374,558.12	5.31
加拿大	13,578,601.98	4.40
日本	12,182,332.09	3.95
挪威	10,284,583.55	3.33
德国	5,466,979.58	1.77
中国香港	4,059,598.50	1.32

注:1、国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。
2、上述美国比重包括智利和巴西在美国上市的ADR。
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	109,016,597.01	35.34
工业	29,795,121.65	9.66
非必需消费品	-	-
必需消费品	144,554,789.41	46.85
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	283,366,508.07	91.85

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称(英文)	公司名称(中文)	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	WILSP	WILMAR INTERNATIONAL LTD	丰益国际有限公司	新加坡证券交易所	新加坡	1,006,000	25,854,704.12	8.38
2	BRFSUS	BRF-BRASIL FOODS SA-ADR	Perdigao股份公	纽约证券交易所	美国	216,758	24,147,144.01	7.83
3	POTUS	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温钾肥股份有限公	纽约证券交易所	美国	83,228	22,859,300.78	7.41
4	ABF LN	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	英国联合食品集团	伦敦证券交易所	英国	200,597	22,103,723.25	7.16
5	MONUS	MONSANTO CO	孟山都公司	纽约证券交易所	美国	55,100	21,023,305.60	6.81
6	ADMUS	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland公司	纽约证券交易所	美国	133,310	21,018,330.35	6.81
7	DEUS	DEERE & CO	迪尔公司	纽约证券交易所	美国	44,367	18,205,372.56	5.90
8	SYNNVX	SYNGENTA AG-REG	先正达股份公	瑞士证券交易所	瑞士	9,813	16,374,558.12	5.31
9	MOSUS	MOSMAY COYHE	Mosiac公司	纽约证券交易所	美国	46,020	14,321,398.83	4.64
10	BGUNUS	BUNGE LTD	Bunge有限公司	纽约证券交易所	美国	36,595	13,555,780.49	4.39

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品。
5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Market Vectors Agribusiness ETF	ETF	契约型开放式	Van Eck Associates Corp	9,065,836.79	2.94
2	Directionality Agribusiness Bull 3x Shares	ETF	契约型开放式	Bafferty Asset Management LLC	477,888.48	0.15
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10 投资组合报告附注
5.10.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	17,343,678.73
3	应收股利	205,245.91
4	应收利息	2,332.06
5	应收申购款	106,556.89
6	其他应收款	7,551,184.83
7	待摊费用	118,664.63
8	其他	-
9	合计	25,327,671.82

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动
单位:份
本报告期初基金份额总额 446,564,827.62
本报告期基金总申购份额 4,240,512.91
减:本报告期基金总赎回份额 67,478,279.55
本报告期基金分拆变动份额 -
本报告期末基金份额总额 383,327,061.98

§7 备查文件目录
7.1 备查文件目录
1.中国证监会批准广发标普全球农业指数证券投资基金募集的文件;
2.《广发标普全球农业指数证券投资基金基金合同》;
3.《广发标普全球农业指数证券投资基金托管协议》;
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.《广发标普全球农业指数证券投资基金招募说明书》及其更新版;
6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点
广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
7.3 查阅方式
1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30;13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;
2.网站查询:基金管理人网址: http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828 或 020-83936999,或发电子邮件: services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一一年十月二十六日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十六日

§1 重要提示
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况	
基金名称	广发中小板300联接
基金主代码	270026
交易代码	270026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月9日
报告期末基金份额总额	829,236,801.58份

投资目标
通过将绝大部分基金资产投资于中小板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。

本基金为中小板300ETF联接基金,中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对中小板300价格指数紧密跟踪的被动式指数基金,本基金主要通过投资于中小板300ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或标的指数的成份股发生重大调整和成份股发生生息、增发、分红等行为时,基金经理可以对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。

中小板300价格指数收益率>95%+银行活期存款利率(税后)<5%。

本基金为ETF联接基金,风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中小板300ETF,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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

2.1.1 目标基金基本情况
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 交易型开放式
基金合同生效日 2011年6月3日
基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所
上市日期 2011年8月10日
基金管理人名称 广发基金管理有限公司
基金托管人名称 中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品概况
投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数的成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在标的指数的成份股发生调整、新股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况,结合经验判断,综合考虑行业性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代,以期在规定的风险承受限之内,尽量缩小跟踪误差。在正常情况下,本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.2%,年化跟踪误差不超过2%。

中小板300价格指数。
本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数中小板300价格指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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 2011 年 7 月 1 日-2011 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-34,097,613.70
2.本期利润	-139,567,247.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1508
4.期末基金资产净值	703,065,539.72
5.期末基金份额净值	0.8478

注:0所述基金财务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 本报告期基金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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.66%	1.21%	-12.42%	1.32%	-3.24%	-0.11%
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		广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 2011年6月9日至2011年9月30日)				

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2011年6月9日至2011年9月30日)

注:本基金合同生效日期为2011年6月9日,建仓期为三个月,至披露时点未满一年,建仓期结束时本基金资产配置比例符合合同约定。

§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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李志明	本基金的基金经理,广发中小板300ETF基金的基金经理,数量投资部总经理	2011-6-9	-	12	男,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月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券交易所任部门总监,2010年8月9日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300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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、《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和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。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定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授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;在交易过程中,中央交易员按照 时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。

公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

监察稽核部风险管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监测及预警,实现投资风险的事中风险控制;监察稽核部稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人未管理与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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、《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和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。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的约定。

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