

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

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

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

Table with 2 columns: Item (基金简称, 基金代码, etc.) and Value (中小300, 159907, etc.)

Table with 2 columns: Item (主要财务指标) and Value (1.本期已实现收益 -17,134,468.18, etc.)

Table with 6 columns: Item (阶段), 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率标准差, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

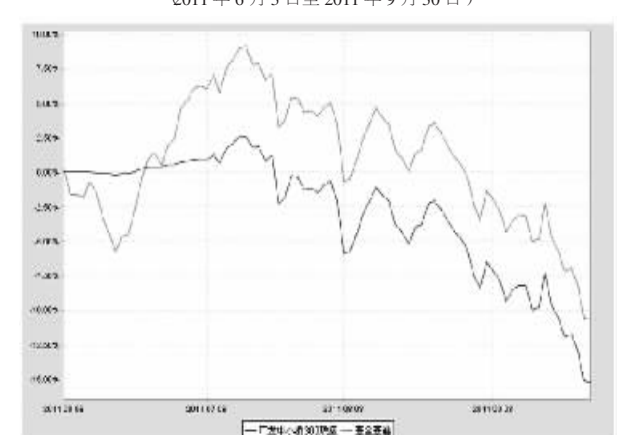


图 1 广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with 4 columns: Name (姓名), Position (职务), Term (任期), Description (说明)

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
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。

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。

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
本报告期内,7月初至本基金7月25日折算日之间,为本基金的建仓期间,整个建仓期间采用股票篮子买入的方式,以均匀速度逐步建仓,旨在规避指数波动的风险。

个建仓期间采用股票篮子买入的方式,以均匀速度逐步建仓,旨在规避指数波动的风险。建仓完毕后按照指数结构完全复制制指数进行运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
七月份建仓期内,由于仓位处于逐步加满的过程中,此期间净值略低于标的指数。截至7月25日累计净值下跌2.767%,同期标的指数上涨1.297%,相差4.064%。

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
中小企业板聚集了众多的战略新兴产业公司,符合未来经济结构调整的发展前景。

Table with 3 columns: Item (序号), Item (项目), Value (金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:上表中的股票投资项含可替代估值增值,而5.2的合计项不含可替代估值增值。

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: Item (序号), Stock Code (股票代码), Stock Name (股票名称), Quantity (数量(股)), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: Item (序号), Stock Code (股票代码), Stock Name (股票名称), Quantity (数量(股)), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: Item (序号), Stock Code (股票代码), Stock Name (股票名称), Quantity (数量(股)), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: Item (序号), Stock Code (股票代码), Stock Name (股票名称), Quantity (数量(股)), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

7.1 备查文件目录
1.中国证监会批准广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金募集的文稿;

广发基金管理有限公司
二〇一一年十月二十六日

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十六日

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

Table with 2 columns: Item (基金简称, 基金代码, etc.) and Value (广发内需增长混合, 270022, etc.)

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
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
2010年4月19日至2011年9月30日

顶,各项宏观指标回落明显。
2.基金运作回顾
本报告期内,我们增持了金融、地产和电解铝等行业,减持了装备制造等板块。

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), Net Asset Value Ratio (占基金资产净值比例(%)

7.1 备查文件目录
1.中国证监会批准广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;