广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

〔2012年第1号〕

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

时间：二〇一二年一月

【重要提示】

本基金于2011年3月21日经中国证监会证监基金字〔2011〕424号文核准。本基金基金合同于2011年6月3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。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。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的表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年12月2日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30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：广东省珠海市拱北情侣南路255号4层

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：王志伟

5、设立时间：2003年8月5日

6、电话：020-83936666

全国统一客服热线：95105828

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”）、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、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。

（二）、主要人员情况

1、董事会成员

王志伟：董事长，男，经济学硕士，高级经济师。兼任广东省第十届政协委员，广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员，广东金融学会常务理事，江西财经大学客座教授。历任广发证券股份有限公司董事长兼党委书记，广东发展银行党组成员兼副行长，广东发展银行行长助理，广东发展银行信托投资部总经理，广东发展银行人事教育部经理，广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

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，兼任广发国际资产管理有限公司董事长。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。

孙晓燕：董事，女，硕士，现任广发证券副总经理、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。

戈俊：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副总经理、财务总监兼董事会秘书。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。兼任广发证券监事、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、广东省妇联副主席、广东省政协常委。曾任广州棠涌家具厂、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，现任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，现任辽宁大学发展规划处处长。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、学科建设处处长。

罗海平：独立董事，男，经济学博士，现任阳光财产保险股份有限公司总裁。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，太平保险公司副总经理兼纪委书记，民安保险（中国）有限公司副总裁。

2、监事会成员

余利平：监事会主席，女，经济学博士，兼任广发国际资产管理有限公司董事。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，现任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、广州屈臣氏公司行政主管。

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，兼任广发国际资产管理有限公司董事长。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。

易阳方：副总经理，男，经济学硕士，经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发聚丰股票型证券投资基金及广发制造业精选股票型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理，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

陆志明：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。

魏军：男，中国籍，数量经济学博士，3年基金从业经历，持有证券业执业资格证书，2008年7月至2010年10月任广发基金管理有限公司量化研究员，2010年3月11日起至2011年10月18日任广发沪深300指数基金和广发中证500指数基金的基金经理助理，2011年10月19日起任广发中小板300ETF及广发中小板300联接基金的基金经理。

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，公司副总经理易阳方，研究发展部总经理傅友兴，固定收益部总经理谢军。

二、基金托管人

（一）、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

（二）、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。

（三）、基金托管业务经营情况

截止2011年3月29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93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、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、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、泰达荷银货币市场基金、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、富兰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、泰达荷银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、富国天成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、申万巴黎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、中海蓝筹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、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金（LOF）、景顺长城能源基建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。

三、相关服务机构

（一）、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）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：况雨林

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：陈康菲

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：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

（10）安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号中国凤凰大厦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：芮敏祺

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）信达证券股份有限公司

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：侯巍

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.cnm

（17）名称：东北证券股份有限公司

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：0431-85096795

公司网站：www.nesc.cn

（18）名称：华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

公司网站：www.hfzq.com.cn

客服电话：96326（福建省外请先拨0591）

（二）、二级市场交易代办证券公司

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。

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

（三）、登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

（四）、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 黄贞

联系人：程秉

（五）、审计基金资产的会计师事务所

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

四、基金的名称

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股和备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略

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%。

一般情形下，本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在标的指数成份股发生调整、配股、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，综合考虑行业属性、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度之内，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%。

在法律法规允许的情况下，基金管理人在履行相应程序后可以使用相关金融衍生工具，以更好地实现基金的投资目标。但基金管理人使用相关金融衍生工具必须是以提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差等为目的，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

（一）投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

（二）投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制等决策。

（三）投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1、研究：数量投资部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

2、投资决策：投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

3、组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理主要以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

4、交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

5、绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

6、组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金的标的指数为中小板300价格指数。

十、风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

广发基金管理有限公司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。

基金托管人中国农业银行根据本基金基金合同规定，于2011年12月26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2011年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1，报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	992,155,411.78	98.63
	其中：股票	992,155,411.78	98.63
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,977,745.53	0.69
6	其他各项资产	6,798,684.92	0.68
7	合计	1,005,931,842.23	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，下表的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末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	22,257,501.00	2.22
B	采掘业	27,989,273.21	2.79
C	制造业	665,014,816.70	66.23
C0	食品、饮料	52,716,928.07	5.25
C1	纺织、服装、皮毛	29,189,975.96	2.91
C2	木材、家具	4,469,450.92	0.45
C3	造纸、印刷	18,299,522.70	1.82
C4	石油、化学、塑胶、塑料	101,848,615.00	10.14
C5	电子	100,551,811.26	10.01
C6	金属、非金属	61,820,877.63	6.16
C7	机械、设备、仪表	187,216,298.61	18.65
C8	医药、生物制品	90,252,032.19	8.99
C99	其他制造业	18,649,304.36	1.86
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,385,589.03	0.64
E	建筑业	45,045,219.75	4.49
F	交通运输、仓储业	4,993,165.62	0.50
G	信息技术业	72,583,169.07	7.23
H	批发和零售贸易	90,267,259.43	8.99
I	金融、保险业	18,043,688.00	1.80
J	房地产业	15,730,430.27	1.57
K	社会服务业	16,869,667.12	1.68
L	传播与文化产业	5,431,449.60	0.54
M	综合类	1,544,174.60	0.15
	合计	992,155,403.40	98.81

3、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投资明细

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	5,410,282	56,321,035.62	5.61
2	002304	洋河股份	236,759	32,199,224.00	3.21
3	002202	金风科技	1,627,600	16,178,344.00	1.61
4	002422	科伦药业	274,955	16,087,617.05	1.60
5	002073	软控股份	748,460	13,607,002.80	1.36
6	002142	宁波银行	1,428,500	13,256,480.00	1.32
7	002155	辰州矿业	464,032	12,208,681.92	1.22
8	002106	莱宝高科	478,336	11,790,982.40	1.17
9	002001	新和成	417,908	9,131,289.80	0.91
10	002038	双鹭药业	278,922	9,023,126.70	0.90

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、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。

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。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

（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。

（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。

（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	338,736.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,274.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,972.28
8	其他	-
9	合计	6,798,684.92

（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）、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不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2011年9月30日。

一、净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

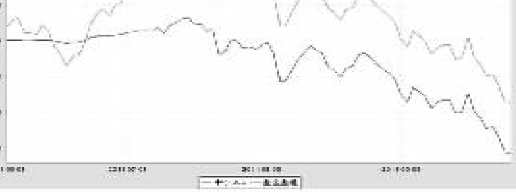
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效至今	-15.73%	1.13%	-8.72%	1.39%	-7.01%	-0.26%

二、本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

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

（2011年6月3日至2011年9月30日）



注：本基金合同生效日期为2011年6月3日，建仓期为3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规定。

十三、基金的费用

（一）、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金合同生效后的信息披露费用；

4、基金份额持有人大会费用；

5、基金上市费及年费；

6、基金的指数使用许可费；

7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

8、基金的证券交易费用；

9、基金财产拨划支付的银行费用；

10、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

（三）、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年管理费率}\div\text{当年天数}$，本基金年管理费率为0.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年托管费率}\div\text{当年天数}$，本基金年托管费率为0.1%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付标的指数使用许可费。

基金的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

（1）当$E\leq 350$亿元时：

$H=E\times 0.03\%\div\text{当年天数}$

（2）当$E>350$亿元时：

$H=350\text{亿元}\times 0.03\%\div\text{当年天数}+(E-350\text{亿元})\times 0.02\%\div\text{当年天数}$

H为每日应计提的指数使用许可费

E为前一日基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度7.5万元，即不足7.5万元时按照7.5万元收取。

指数使用许可费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计，按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于下一个季度开始后10个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数供应商根据相应指数使用许可协议变更指数使用许可费的计算方法、费率等，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4、上述一中3到9项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（五）、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体上刊登公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“第三部分 基金管理人”部分，根据基金管理人的人员变动情况进行了更新。

2、在“第四部分 基金托管人”部分，根据托管行人员变动情况和基金托管业务经营情况对托管人信息进行了相应更新。

3、在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了相关的代销机构，对原有销售机构的资料进行更新，相关事宜均已公告。

4、在“第十一部分 基金的投资”部分，更新了截至2011年9月30日的投资组合报告的内容。

5、在“第十二部分 基金的业绩”部分，对截至2011年9月30日的基金业绩表现情况予以披露。

6、根据最新公告对“第二十四部分 其他应披露的事项”进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一二年一月十六日

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2012年“春节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2012年1月16日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德货币市场证券投资基金	
基金简称	交银货币	
基金主代码	519588	
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司	
公告依据	《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》、《交银施罗德货币市场证券投资基金招募说明书》等	
恢复相关业务的日期及原因说明	恢复申购日	2012年1月30日
	恢复转换转入日	2012年1月30日
	恢复定期定额投资日	2012年1月30日
	恢复申购、转换转入、定期定额投资的原因说明	根据中国证监会《关于2012年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》（证监办发[2011]103号）精神，2012年1月21日（星期六）至2012年1月29日（星期日）上海证券交易所和深圳证券交易所休市九天，2012年1月30日（星期一）起照常开市。为保护基金份额持有人的利益，根据有关法律法规和基金合同的相关规定，决定于2012年1月30日恢复本基金申购、转换转入和定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	交银货币A	交银货币B
下属分级基金的交易代码	519588	519589
该分级基金是否恢复申购、转换转入、定期定额投资	是	是

2.其他需要提示的事项

特别提示：如有疑问，请拨打客户服务热线：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，或登陆公司网站www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com获取相关信息。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2012年“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2012年1月16日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德货币市场证券投资基金	
基金简称	交银货币	
基金主代码	519588	
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司	
公告依据	《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》、《交银施罗德货币市场证券投资基金招募说明书》等	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2012年1月19日
	暂停转换转入起始日	2012年1月19日
	暂停定期定额投资起始日	2012年1月19日
	限制申购金额(单位：元)	-
	限制转换转入金额(单位：元)	-
	暂停申购、转换转入、定期定额投资的原因说明	根据中国证监会《关于2012年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》（证监办发[2011]103号）精神，2012年1月21日（星期六）至2012年1月29日（星期日）上海证券交易所和深圳证券交易所休市九天，2012年1月30日（星期一）起照常开市。为保护基金份额持有人的利益，根据有关法律法规和基金合同的相关规定，决定对本基金暂停申购、转换转入和定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	交银货币A	交银货币B
下属分级基金的交易代码	519588	519589
该分级基金是否暂停申购、转换转入、定期定额投资	是	是

注：本基金本次同时暂停定期定额投资业务，亦不设限制金额。

2.其他需要提示的事项

本基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务期间，其转换转出、赎回等其他业务以及本公司管理的其他开放式基金的各项交易业务仍照常办理。自2012年1月30日起，本基金所有销售网点恢复办理本基金的正常申购、转换转入及定期定额投资业务。

根据中国证监会《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（证监基金字〔2005〕41号）有关条款的规定，投资者于2012年1月20日赎回或转换转出的本基金基金份额将于2012年1月30日起不再享受本基金的分配权益，但仍享有赎回当日和整个节假日期间本基金的收益。假期前未确认的交易申请、未到账的赎回款项等，将于2012年1月30日起继续处理。

特别提示：

（一）投资者于2012年1月18日赎回或转换转出的本基金基金份额将于2012年1月19日起不再享受本基金的分配权益，赎回资金或转换资金将于2012年1月20日从基金资产划出，但由于资金划转周期，有可能2012年1月30日之后才能到账。投资者于2012年1月19日赎回或转换转出的本基金基金份额将于2012年1月20日起不再享受本基金的分配权益，但赎回资金或转换资金将于2012年1月30日从基金资产划出。

（二）请投资者及早做好交易安排，避免因交易跨越“春节”假期带来不便及资金在途的损失。

如有疑问，请拨打客户服务热线：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，或登陆公司网站www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com获取相关信息。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德双利债券证券投资基金于2012年“春节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2012年1月16日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德双利债券证券投资基金	
基金简称	交银双利债券	
基金主代码	519683	
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司	
公告依据	《交银施罗德双利债券证券投资基金基金合同》、《交银施罗德双利债券证券投资基金招募说明书》等	
恢复相关业务的日期及原因说明	恢复申购日	2012年1月30日
	恢复转换转入日	2012年1月30日
	恢复定期定额投资日	2012年1月30日
	恢复申购、转换转入、定期定额投资的原因说明	根据中国证监会《关于2012年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》（证监办发[2011]103号）精神，2012年1月21日（星期六）至2012年1月29日（星期日）上海证券交易所和深圳证券交易所休市九天，2012年1月30日（星期一）起照常开市。为保护基金份额持有人的利益，根据有关法律法规和基金合同的相关规定，决定于2012年1月30日恢复本基金申购、转换转入和定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	交银双利债券A/B	交银双利债券C
下属分级基金的交易代码	519683（前端）、519684（后端）	519685
该分级基金是否恢复申购、转换转入、定期定额投资	是	是

2.其他需要提示的事项

特别提示：如有疑问，请拨打客户服务热线：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，或登陆公司网站www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com获取相关信息。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德双利债券证券投资基金于2012年“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2012年1月16日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德双利债券证券投资基金	
基金简称	交银双利债券	
基金主代码	519683	
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司	
公告依据	《交银施罗德双利债券证券投资基金基金合同》、《交银施罗德双利债券证券投资基金招募说明书》等	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2012年1月19日
	暂停转换转入起始日	2012年1月19日
	暂停定期定额投资起始日	2012年1月19日
	限制申购金额(单位：元)	-
	限制转换转入金额(单位：元)	-
	暂停申购、转换转入、定期定额投资的原因说明	根据中国证监会《关于2012年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》（证监办发[2011]103号）精神，2012年1月21日（星期六）至2012年1月29日（星期日）上海证券交易所和深圳证券交易所休市九天，2012年1月30日（星期一）起照常开市。为保护基金份额持有人的利益，根据有关法律法规和基金合同的相关规定，决定对本基金暂停申购、转换转入和定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	交银双利债券A/B	交银双利债券C
下属分级基金的交易代码	519683（前端）、519684（后端）	519685
该分级基金是否暂停申购、转换转入、定期定额投资	是	是

注：本基金本次同时暂停定期定额投资业务，亦不设限制金额。

2.其他需要提示的事项

本基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务期间，其转换转出、赎回等其他业务以及本公司管理的其他开放式基金的各项交易业务仍照常办理。自2012年1月30日起，本基金所有销售网点恢复办理本基金的正常申购、转换转入及定期定额投资业务。

投资者于2012年1月20日赎回或转换转出本基金基金份额的，赎回或转换的有效申请将于2012年1月30日按照2012年1月20日本基金的基金份额净值确认赎回金额或转换金额。假期前未确认的交易申请、未到账的赎回款项等，将于2012年1月30日起继续处理。

特别提示：

（一）投资者于2012年1月18日赎回或转换转出本基金基金份额的，赎回或转换资金将于2012年1月20日从基金资产划出，但由于资金划转周期，有可能2012年1月30日之后才能到账。投资者于2012年1月19日赎回或转换转出本基金基金份额的，赎回或转换资金将于2012年1月30日从基金资产划出。

（二）请投资者及早做好交易安排，避免因交易跨越“春节”假期带来不便及资金在途的损失。

如有疑问，请拨打客户服务热线：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，或登陆公司网站www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com获取相关信息。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金于2012年“春节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2012年1月16日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德增利债券证券投资基金	
基金简称	交银增利债券	
基金主代码	519680	
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司	
公告依据	《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》、《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》等	
恢复相关业务的日期及原因说明	恢复申购日	2012年1月30日
	恢复转换转入日	2012年1月30日
	恢复定期定额投资日	2012年1月30日
	恢复申购、转换转入、定期定额投资的原因说明	根据中国证监会《关于2012年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》（证监办发[2011]103号）精神，2012年1月21日（星期六）至2012年1月29日（星期日）上海证券交易所和深圳证券交易所休市九天，2012年1月30日（星期一）起照常开市。为保护基金份额持有人的利益，根据有关法律法规和基金合同的相关规定，决定于2012年1月30日恢复本基金申购、转换转入和定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	交银增利债券A/B	交银增利债券C
下属分级基金的交易代码	519680（前端）、519681（后端）	519682
该分级基金是否恢复申购、转换转入、定期定额投资	是	是

2.其他需要提示的事项

特别提示：如有疑问，请拨打客户服务热线：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，或登陆公司网站www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com获取相关信息。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利债券证券投资基金于2012年“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2012年1月16日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德增利债券证券投资基金	
基金简称	交银增利债券	
基金主代码	519680	
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司	
公告依据	《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》、《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》等	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2012年1月19日
	暂停转换转入起始日	2012年1月19日
	暂停定期定额投资起始日	2012年1月19日
	限制申购金额(单位：元)	-
	限制转换转入金额(单位：元)	-
	暂停申购、转换转入、定期定额投资的原因说明	根据中国证监会《关于2012年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》（证监办发[2011]103号）精神，2012年1月21日（星期六）至2012年1月29日（星期日）上海证券交易所和深圳证券交易所休市九天，2012年1月30日（星期一）起照常开市。为保护基金份额持有人的利益，根据有关法律法规和基金合同的相关规定，决定对本基金暂停申购、转换转入和定期定额投资业务。
下属分级基金的基金简称	交银增利债券A/B	交银增利债券C
下属分级基金的交易代码	519680（前端）、519681（后端）	519682
该分级基金是否暂停申购、转换转入、定期定额投资	是	是

注：本基金本次同时暂停定期定额投资业务，亦不设限制金额。

2.其他需要提示的事项

本基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务期间，其转换转出、赎回等其他业务以及本公司管理的其他开放式基金的各项交易业务仍照常办理。自2012年1月30日起，本基金所有销售网点恢复办理本基金的正常申购、转换转入及定期定额投资业务。

投资者于2012年1月20日赎回或转换转出本基金基金份额的，赎回或转换的有效申请将于2012年1月30日按照2012年1月20日本基金的基金份额净值确认赎回金额或转换金额。假期前未确认的交易申请、未到账的赎回款项等，将于2012年1月30日起继续处理。

特别提示：

（一）投资者于2012年1月18日赎回或转换转出本基金基金份额的，赎回或转换资金将于2012年1月20日从基金资产划出，但由于资金划转周期，有可能2012年1月30日之后才能到账。投资者于2012年1月19日赎回或转换转出本基金基金份额的，赎回或转换资金将于2012年1月30日从基金资产划出。

（二）请投资者及早做好交易安排，避免因交易跨越“春节”假期带来不便及资金在途的损失。

如有疑问，请拨打客户服务热线：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，或登陆公司网站www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com获取相关信息。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期即将到期的第七次提示性公告

交银施罗德保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于2009年1月21日生效。本基金保本周期为三年，自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日，即2012年1月30日。

本基金保本周期即将届满，并将按照基金合同的约定变更为一只非保本的混合型基金，即“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”（以下简称“交银行业”）。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“519697”。转型后基金的投资目标、投资策略及基金费率等按照《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

本基金保本周期到期选择期为保本周期到期日及其后三个工作日，即自2012年1月30日（含）起至2012年2月2日（含）止。基金份额持有人可在保本周期到期选择期内的交易时间里，通过基金管理人和各代销机构的营业网点进行到期选择。在上述保本周期到期选择期内，基金份额持有人可以选择赎回本基金基金份额，将本基金基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额，或继续持有变更后的“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。对于在保本周期到期选择期内未提出赎回或者转换出申请的基金份额持有人，将默认其选择持有变更后的“交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。

有关本基金保本周期到期安排及转型为交银行业后的相关运作业务规则详情请查阅本基金管理人2012年1月13日发布的《交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告》及刊登于2012年1月13日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的交银行业的《基金合同摘要》、《招募说明书》等。投资者亦可通过本基金管理人网站或相关代销机构查阅交银行业的相关基金法律文件。

本基金管理人亦将于近期逐步披露关于交银行业相关销售业务开展的各项安排，敬请广大投资者予以关注。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一二年一月十六日