

广发沪深300指数证券投资基金

2011 年度报告摘要

2011年12月31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

基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守基金管理人职责,诚实守信,勤勉尽责,严格控制风险,保障基金份额持有人的合法权益。

2.1 基金基本情况
基金名称:广发沪深300指数证券投资基金
基金代码:270010
交易代码:270010

2.2 基金主要投资目标
本基金的投资目标是:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准水平的日均超额收益在-0.20%以内。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-106室

2.4 基金投资策略
本基金为指数基金,跟踪沪深300指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准水平的日均超额收益在-0.20%以内。

3.1 主要财务数据和净值指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末基金资产净值
3.1.3 基金份额净值

3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*95%+银行活期存款利率\*5%。

3.3 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准的对比图
本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准的对比图

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人
4.1.2 基金管理人及基金托管人

4.2 基金管理人及基金托管人
4.2.1 基金管理人及基金托管人
4.2.2 基金管理人及基金托管人

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人及基金托管人
4.3.2 基金管理人及基金托管人

4.4 基金管理人及基金托管人
4.4.1 基金管理人及基金托管人
4.4.2 基金管理人及基金托管人

4.5 基金管理人及基金托管人
4.5.1 基金管理人及基金托管人
4.5.2 基金管理人及基金托管人

4.6 基金管理人及基金托管人
4.6.1 基金管理人及基金托管人
4.6.2 基金管理人及基金托管人

4.7 基金管理人及基金托管人
4.7.1 基金管理人及基金托管人
4.7.2 基金管理人及基金托管人

4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人及基金托管人
4.8.2 基金管理人及基金托管人

4.9 基金管理人及基金托管人
4.9.1 基金管理人及基金托管人
4.9.2 基金管理人及基金托管人

Table with 4 columns: 关联方名称, 当期, 上期可比期间, 期末应付未付金额. Rows include 广发证券股份有限公司.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应收股利, 应收利息, 可供出售金融资产.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 持有至到期投资, 长期股权投资, 其他资产.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 关联方名称, 当期, 上期可比期间, 期末应付未付金额. Rows include 广发证券股份有限公司.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应收股利, 应收利息, 可供出售金融资产.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 持有至到期投资, 长期股权投资, 其他资产.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 转出证券基金, 2 转出基金份额, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收款项, 6 其他应收款, 7 其他, 8 合计.

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
9.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构
9.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 可供出售金融资产, 持有至到期投资, 长期股权投资.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应收股利, 应收利息, 可供出售金融资产.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 持有至到期投资, 长期股权投资, 其他资产.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期可比期间. Rows include 应付利息, 应付股利, 应付账款.