广发中证500指数证券投资基金（LOF）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：中国工商银行股份有限公司

时间：二〇一二年七月

【重要提示】

本基金于2009年9月21日经中国证监会证监许可【2009】982号文核准。本基金基金合同于2009年11月26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投资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。

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。

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。基金投资人自动成为基金合同项下的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《证券法》、《证券投资基金法》、《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。

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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，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。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》。

本招募说明书所载内容截止日为2012年5月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31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”），株洲通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司（原名香江投资有限公司”的公司股东于2012年5月10日更名为“深圳市前海香江金融控股集团有限公司”）、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公业家委员，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，现任广发证券副总裁、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、投资管理部副总经理、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，现任珠海大通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书，兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏征信有限公司、西安北方光电科技有限责任公司、武汉烽火捷天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司等公司董事，兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。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。

崔美娜：董事，女，工商管理硕士，现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长、深圳市金海马实业股份有限公司董事长、南方香江集团有限公司董事长、香江控股股份有限公司董事长、兼任广发证券监事、广发银行股份有限公司监事、全国妇联常委、中国产业发展促进会副会长、广东省政协常委、广东省工商联副主席、广东省女企业家协会会长、深圳市政协常委、香江社会救助基金会主席。

许冬瑾：董事，女，工商管理硕士，主管药师，现任集美药业股份有限公司董事长、副总经理。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂江：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、中国人民保险公司辽宁分公司总经理、交由它又易部执行。太平保险湖北分公司总经理、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。

刘志军：监事，男，管理学硕士，现任广州科技风险投资有限公司董事长、兼任广州生产力促进中心副主任、广州市科达实业发展公司总经理。曾任广州市统计局投资处处长、工业处处长、社会科技处处长。

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。曾任上海梁恒集团市场部经理、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，曾任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

陈盛业，男，中国籍，经济学博士，5年基金从业经历，持有证券业执业证书，2007年3月至2009年9月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员，研究小组主管；2009年9月至2010年8月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理，2010年8月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作，2010年12月11日起任广发沪深300指数基金及本基金基金经理。

历任基金经理：邱春梅，任职时间为2009年11月26日至2010年11月30日。

5、本基金投资宏观集体决策制度，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，投资管理部总经理陈仕德，研究发展部总经理傅友兴，固定收益部总经理张平。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：娄建清
注资资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2012年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现比肯的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线，拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年3月，中国工商银行共托管证券投资基金239只，其中封闭式7只，开放式232只，自2003年以来，本行连续八年获得香港《财资》杂志、英国《环球投资人》杂志《投资人》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、上海证券报等境内外权威财经媒体评选的29项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）场外发售机构

1、直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司、深圳理财中心、杭州理财中心及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务。

①、广州分公司
地址：广州市海珠区琶洲大道东1号东塔楼4楼
直销中心电话：020-89899073　020-89899042
传真：020-89899069　020-89899070

②、北京分公司
地址：北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层
电话：010-68083368
传真：010-68083078

③、上海分公司
地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室
电话：021-68885310
传真：021-68885200

④、深圳理财中心
地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦24楼05室
电话：0755-82701982
传真：0755-82572169

⑤、杭州理财中心
地址：杭州市西湖区华星路2-2号
电话：0571-81903158
传真：0571-81903158

⑥、网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。
本公司网上交易系统网址：www.gffunds.com.cn
本公司网址：www.gffunds.com.cn
客服电话：95105828（免长途费）或020-83936999
客服传真：020-34281105

⑦、赎资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2、代销机构

①、名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：娄建清
联系人：赵会军
电话：010-66107900
传真：010-66107914
客服电话：95588
公司网站：www.icbc.com.cn

②、名称：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（301-4316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
客服电话：95575或致电各地营业网点
公司网站：www.gf.com.cn

③、名称：中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（长安兴融中心）
法定代表人：王洪章
客服电话：95533
公司网站：www.ccb.com

④、名称：中国农业银行股份有限公司
住所：北京市建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客服电话：95599
公司网站：www.abchina.com

⑤、名称：中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
客服电话：95566
传真：010-66594946
公司网站：www.boc.cn

⑥、名称：交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408483
客服电话：95559
公司网站：www.bankcomm.com

⑦、名称：招商银行股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
客服电话：95555
公司网站：www.cmbchina.com

⑧、名称：广发银行股份有限公司
住所：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：董建岳
联系人：廖金鑫、张大奕
电话：020-38322222、0571-96000888
传真：020-87311780
客服电话：400-830-8003
公司网站：www.gdb.com.cn

⑨、名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：倪苏云、虞合云
客服电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

⑩、名称：兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号兴业大厦9楼
法定代表人：高建平
联系人：刘珍
电话：021-52629999
客服电话：95561，或按打当地咨询电话
公司网站：www.cib.com.cn

⑪、名称：上海银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路168号
法定代表人：宁黎明
联系人：张萍
电话：021-68475888
传真：021-68476111
客服电话：021-962888
公司网站：www.bankofshanghai.com

⑫、名称：深圳发展银行股份有限公司
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遂宁
联系人：张菁
联系电话：0755-82088888
传真电话：0755-82080714
客服电话：95501
公司网站：www.sdb.com.cn

⑬、名称：中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
联系电话：0755-82088888
传真电话：0755-82080714
客服电话：95501
公司网站：www.sdb.com.cn

⑬、名称：广发证券股份有限公司
注册地址：广东省广州市越秀区广州大道北195号
法定代表人：姚建军
客服电话：400-83-96699（免租），020-96699（广州）
联系人：张扬韵
电话：020-37598442
传真：020-37590726
公司网站：www.gzs.com.cn

⑭、名称：南京银行股份有限公司
注册地址：江苏省南京市白下区淮海路50　号
办公地址：江苏省南京市白下区淮海路50　号
法人代表：林复
联系人：徐玲
联系电话：025-84551162
客服电话：96400、40088-96400
网址：www.njcb.com.cn

⑮、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）

⑯、名称：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：谢尚辉
电话：021-38565785
传真：021-38565955
客户服务热线：400-8888-123
公司网站：www.xyzq.com.cn

⑰、名称：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
客服电话：95523或4008895523
公司网站：www.swhy.com.cn

⑱、名称：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：吴倩
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服电话：400-8888-666
公司网站：www.gtja.com

⑲、名称：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号国际金融大厦C座
法定代表人：顾伟国
联系人：田薇
电话：010-66568430
传真：010-66568990
客服电话：4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。
公司网站：www.chinastock.com.cn

⑳、名称：中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：400-8888-108
传真：010-65182261
客服电话：400-8888-108
公司网站：www.csc108.com

㉑、名称：天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
电话：010-66045608
客服电话：010-66045678
传真：010-66045527
天相投顾网址：http://www.txsec.com
天相基金网网址：www.jjm.com.cn

㉒、名称：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
客服电话：95536
公司网站：www.guosen.com.cn

㉓、名称：招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
客服电话：95565、4008888111
公司网站：www.newone.com.cn

㉔、名称：华泰证券股份有限公司
住所：南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-83290834
传真：025-51863323
联系人：刀鸣
客服电话：95597
公司网站：www.htsc.com.cn

㉕、名称：中银国际证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区银城中路中银大厦39层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
电话：021-20328216
传真：021-50372474
客服电话：4006208888
公司网站：www.bocichina.com

㉖、名称：长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：李春芳
电话：0755-83516089
传真：0755-83515567
客户服务热线：0755-33680000；400-6666-888
公司网站：www.cgws.com

㉗、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：潘珊
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

㉘、名称：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
客服电话：95503
公司网站：www.dfzq.com.cn

㉙、名称：平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4036号荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
开放式基金咨询电话：400-600-8008
公司网站：www.china-invs.cn

㉚、名称：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
客服电话：95538
公司网站：www.qlzq.com.cn

㉛、名称：方正证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉区二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉区二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：彭博
电话：0731-85832343
传真：0731-85832214
客服电话：95571
公司网站：www.foundersc.com

㉜、名称：江海证券有限公司
地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宗宪
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客服电话：4006662288
公司网站：www.jhzq.com.cn

㉝、名称：华龙证券有限责任公司
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：宋歌
电话：021-50122086
传真：021-50122200
客服电话：4008209898
公司网站：www.cnhbstock.com

㉞、名称：英大证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：赵文宏
联系人：王蕾
电话：0755-83007069
传真：0755-83007167
客服电话：4008-698-698
公司网站：www.ydsc.com.cn

㉟、名称：中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座6-9层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座6-9层
法定代表人：赵大建
联系人：李燕
联系电话：010-59355941
客服电话：400088-95618
公司网站：www.e5618.com

㊱、名称：华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
电话：0931-4890100
传真：0931-4890118
客服电话：400-6898888
公司网站：www.hlzqgs.com

㊲、名称：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
客服电话：400-800-8899
公司网站：www.cindasc.com

㊳、名称：厦门证券有限公司
注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：傅毅辉
联系人：严金文
电话：0592-5161642
传真：0592-5161640
客服电话：0592-5163588
公司网站：www.xmzq.cn

㊴、名称：南京证券有限责任公司
住所：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
电话：025-83367888-4201
传真：022-83320066
客户服务热线：4008285888
公司网站：www.njzq.com.cn

㊵、名称：华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
法定代表人：丁之锁
联系人：陶毓
电话：010-58568040
传真：010-58568062
客服电话：010-58568118
公司网站：www.hrsec.com.cn

㊶、名称：浙商证券有限责任公司
注册地址：杭州市杭大路1号
办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人：吴承
联系人：邮丽辉
电话：0571-87901053
传真：0571-87901913
客服电话：0571-967777
公司网站：www.stocke.com.cn

㊷、名称：西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：王珠林
联系人：陈诚
电话：023-63786464
传真：023-63786311
客服电话：4008-096-096
公司网站：www.swsc.com.cn

㊸、名称：国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：金喆
电话：028-86690126
传真：028-86690126
客服电话：4006600109
公司网站：www.gjzq.com.cn

㊹、名称：新时代证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街1号A座8层
办公地址：北京市西城区金融大街1号A座8层
法人代表：马金声
联络人：孙恺
联系电话：010-83561149
客服电话：400-698-9898
传真：010-83561094
网址：www.xsdzq.cn

㊺、名称：日信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔伯杰
联系人：陈书杉
联系电话：010-88086830-730　010-88086830-737
传真：010-66412537
客服电话：010-88086830
公司网址：www.rxzq.com.cn

㊻、名称：天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法人代表：余磊
联系人：瞿璇
联系电话：027-87618882
客服电话　028-86712334
传真：027-87618863
公司网址：www.tfzq.com

㊼、名称：东莞证券有限责任公司
注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼
法人代表：张运勇
联系人：苏卓仁
联系电话：0769-22112062
客服电话：0769-961130
传真：0769-22119423
公司网址：www.dgzq.com.cn
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本基金，并及时公告。

（二）场内发售机构

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所相关规定的深圳证券交易所会员单位（具体名单见深交所网站http://www.szse.cn/main/marketdata/jyjy/jymmemberlist/）。

（三）注册登记机构

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
办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话：010-59378835
传真：010-59378907
联系人：任瑞新

（四）律师事务所和经办律师

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：程荣
电话：020-38799345
传真：020-38799335
经办律师：程荣、李彩霞
联系人：程荣

（五）会计师事务所和经办注册会计师

名称：深圳中勤城会计师事务所有限公司
办公地址：深圳市福田区滨河路与彩田路交汇处联合广场A栋塔楼
法定代表人：饶永
电话：0755-83732888
传真：0755-82237549
经办注册会计师：杨克晶　谭文欣
联系人：杨克晶

四、基金的名称

广发中证500指数证券投资基金

五、基金的类型

上市契约型开放式

六、基金的投资目标

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0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证500指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）等，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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

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流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金股票投资比例为90%-95%，其中将不低于90%的股票资产投资于中证500指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于股票资产的15%，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%。

（二）股票组合构建

1、股票组合构建原则

本基金采用完全复制法来跟踪中证500指数，按照个股在标的指数中证500指数中的基准权重构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。

3、股票组合调整

①、定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的中证500指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

②、不定期调整

1、与指数相关的调整

根据指数编制规则，当中证500指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据中证500指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

2、申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，对投票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3、其他调整

本基金可以参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

（三）投资决策依据和决策程序

1、决策依据

以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

①、投资决策委员会制定整体投资战略。

②、研究发展部对中证500指数成份股进行持续跟踪调研分析，并根据自身或者其他研究机构的研究成果提供研究报告，对投资决策提供建议。

③、基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略，在研究部门研究报告的指引下，结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟订基金的具体投资计划。

④、投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

⑤、根据决议纪要，基金经理小组选出具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。

⑥、交易部按有关交易规则执行，并将有关信息及情况及时反馈基金经理小组。

⑦、绩效评估与风险管理岗采用量化模型进行跟踪以及差的评估，并定期进行基金绩效评估，向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

⑧、风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；绩效评估与风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×银行同业存款收益率。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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。

基金托管人中国工商银行根据本基金基金合同规定，于2012年6月13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2012年3月31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	3,391,177,761.63	93.02
	其中：股票	3,391,177,761.63	93.02
2	固定收益投资	145,110,000.00	3.98
	其中：债券	145,110,000.00	3.98
	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	96,771,441.01	2.65
6	其他各项资产	12,655,297.84	0.35
7	合计	3,645,714,500.48	100.00

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	61,562,650.36	1.69
B	采掘业	47,868,499.30	1.32
C	制造业	1,953,611,147.79	53.70
C0	食品、饮料	181,100,762.06	4.98
C1	纺织、服装、皮毛	105,602,025.58	2.90
C2	木材、家具	15,519,959.73	0.43
C3	造纸、印刷	69,264,227.11	1.90
C4	石油、化学、塑胶、塑料	339,591,103.44	9.33
C5	电子	264,647,899.98	7.27
C6	金属、非金属	227,327,318.30	6.25
C7	机械、设备、仪表	488,544,772.62	13.43
C8	医药、生物制品	226,835,921.68	6.23
C99	其他制造业	35,177,157.29	0.97
D	电力、煤气及水的生产和供应业	141,081,906.18	3.88
E	建筑业	68,056,711.77	1.87
F	交通运输、仓储业	151,492,814.32	4.16
G	信息技术业	162,605,775.48	4.47
H	批发和零售贸易	220,303,510.62	6.06
I	金融、保险业	29,853,610.93	0.82
J	房地产业	241,708,643.38	6.64
K	社会服务业	113,263,435.00	3.11
L	传播与文化产业	86,747,174.14	2.38
M	综合类	113,021,882.36	3.11
	合计	3,391,177,761.63	93.21

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	000970	中科三环	924,028	24,015,487.72	0.66
2	000917	电广传媒	739,712	21,540,413.44	0.59
3	600060	海信电器	1,186,180	21,208,898.40	0.58
4	600827	友谊股份	1,755,219	21,027,523.62	0.58
5	600199	金种子酒	885,222	17,757,553.32	0.49
6	000939	凯迪电力	1,717,174	17,223,255.22	0.47
7	000877	天山股份	778,827	16,962,852.06	0.47
8	600298	安琪酵母	619,711	16,509,101.04	0.45
9	600079	人福医药	898,217	16,176,888.17	0.44
10	002236	大华股份	317,422	15,261,649.76	0.42

4、报告期末按债券品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	145,110,000.00	3.99
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	145,110,000.00	3.99

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

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	1101094	11央行票据94	1,500,000	145,110,000.00	3.99
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

6、投资组合报告附注

①、本基金持有的股票投资的组合中的股票，在报告编制日前一年内本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。

②、本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

③、本基金其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,047,776.16
2	应收证券清算款	1,039,143.56
3	应收股利	-
4	应收利息	1,623,147.06
5	应收申购款	8,945,231.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,655,297.84

⑤）截至2012年3月31日，本基金未持有的处于转股期的可转换债券。

⑥）截至2012年3月31日，本基金未持有权证。

⑦）截至2012年3月31日，本基金未持有资产