广发制造业精选混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:二〇一五年十月二十六日

§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2015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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发制造业精选混合
基金主代码	270028
交易代码	270028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	358,390,576.81份
投资目标	通过深入的研究,精选制造行业的优质上市公司进行投资,在严格控制风险的前提下,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金,本基金投资组合的比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。本基金管理人将根据宏观经济研究员对宏观经济形势的研究,策略研究员对市场运行趋势的研究,以及行业研究员对行业与上市公司投资价值的研究,综合考虑基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例,并定期或不定期地进行调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:80%×申银万国制造业指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-249,117,318.46
2.本期利润	-225,434,129.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6307
4.期末基金资产净值	716,288,655.33
5.期末基金份额净值	1.999

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或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

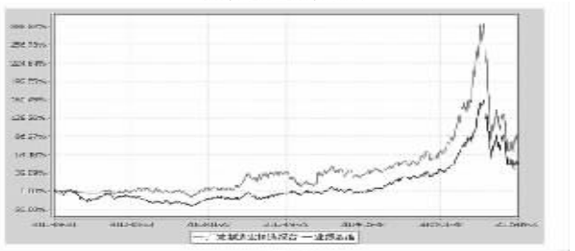
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.16%	4.23%	-24.52%	3.30%	-0.64%	0.93%

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

广发制造业精选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历史走势对比图

(2011年9月20日至2015年9月30日)



§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
李巍	本基金的基金经理;广发策略优选混合基金的基金经理;广发主题领先混合基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2011-09-20	-	10年	男,中国籍,理学硕士,持有基金业执业资格证书。2005年7月至2010年6月任职于广发证券股份有限公司,2010年7月起在广发基金管理有限公司权益投资一部工作,2011年9月20日起任广发制造业精选混合基金的基金经理,2013年9月9至2015年2月16日任广发核心精选混合基金的基金经理,2014年3月17日起任广发策略优选混合基金的基金经理,2014年7月31日起任广发主题领先混合基金的基金经理,2015年1月14日起任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理。

注:1.“任职日期”和“离职日期”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、《广发制造业精选混合型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规定。

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。监察稽核部风险控制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;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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内没有出现违规情况。

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

3季度,A股主要指数持续下跌,其中显在7月和9月中下旬出现两次反弹,但整体跌幅仍较大。本季,上证综指、深证成指、创业板指及申万制造业指数跌幅分别为28.63%、30.34%、27.14%和31.29%。

宏观经济在3季度延续了之前的疲弱走势,PMI、投资增速、工业增加值、发电量、大宗工业品价格等主要经济指标均不断走低,且有越来越弱之势,中央政府虽然积极推出各种微刺激和稳增长措施,但效果并不明显,经济可能过程仍未结束。这种宏观背景下,大部分传统周期性行业和制造业普遍景气度较差,虽然相对估值水平不高,但业绩低于预期的可能性大;同时,部分新兴行业虽然景气度高,业绩增速较快,但经过两年的持续上涨,相对市盈率水平已经非常高。投资者们发现,经过6月后半段的快速调整,A股整体泡沫依然严重,于是在7月上旬继续快速下跌。当然,A股的泡沫化只是本次暴跌的背景原因,更重要的推力在于,监管部门规范场外配资等杠杆行为触发市场开始下跌,市场下跌速度较快导致部分杠杆账户被强制平仓,加速市场下跌,并形成持续负反馈。此种情景,可谓是A股大多数投资者从未经历过的,投资者风险偏好快速下降。所幸国家及时出手稳定市场,提供交易流动性,市场也顺势出现一定反弹,时至8月上旬,市场运短期稳住,但整体泡沫化及杠杆率较高的问题并未彻底解决;81汇改产生的人民币贬值及美元加息预期的提升,导致投资者风险偏好再次快速下降,部分投资者开始全面看空中国经济和人民币资产,认为中国经济的转型与改革已然失败,A股市场开始了新一轮的快速下跌,并导致全球金融市场剧烈波动,甚至有言论认为新一轮全球金融危机已在眼前。其实市场悲观绝望的时候往往就是机会所在;不经意间,一些向好的因素已在悄然出现。比如,稳增长措施持续落地、经济企稳的概率在提升,央行8月25日的双降显示了我国货币政策的独立性也为81汇改的真正目的做了最好的诠释和佐证,国内无风险利率持续走低,美国加息预期减弱等等,最为重要的因素在于,经过本轮快速下跌,已经有一批优秀公司的估值降至合理水平,具备了中长期配置的价值。市场也悄然从九月初开始了反弹。

报告期内,本基金对市场下跌的速度和投资者情绪的变化估计不足,未能及时控制好仓位,造成较大回撤;但在8月底市场最悲观的时候并未盲目悲观,而是精选了一批优质的成长股进行了增持,在9月份取得了不错的效果。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为-25.16%,同期业绩比较基准收益率为-24.52%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前的时点,我们对未来一个季度的市场并不悲观。经济虽然依然在寻底,但企稳的概率在提升;人民币虽然依然有贬值压力,但不会形成快速贬值的预期,人民币资产依然是全球范围内最具吸引力的资产之一;改革与转型的进程纵有波折,但仍在稳步推进;投资者风险偏好虽然很难完全修复,但也很难再差,且已开始恢复;还有我们一直强调的流动性宽松并未变化,居民大类资产配置向权益类资产转移的速度虽会放缓但不会停止。中国经济和A股市场需要更多正能量。

前途虽然光明,但过程的曲折往也不能忽视,4季度,本基金将会以审慎的态度采取均衡的配置策略,包括灵活的仓位选择和多样化的风格资产。怎底线,“这类弹性标的”配置比例会低于上半年,更加偏好基本面扎实、估值合理的白马成长股。寻找真正的成长股才是长期获取超额收益的源泉。

在2015年4季度,本基金希望能为投资者带来较好的收益。

§5投资组合报告

5.1 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	592,869,518.69	80.58
	其中:股票	592,869,518.69	80.58
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	129,656,032.80	17.62
7	其他各项资产	13,186,384.07	1.79
8	合计	735,711,935.56	100.00

5.2 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	29,242,959.20	4.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	328,415,854.19	45.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,781,422.00	1.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	169,507,300.15	23.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	45,237,763.15	6.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,684,220.00	1.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	592,869,518.69	82.77

5.3 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	300207	欣旺达	2,400,000	59,952,000.00	8.37
2	002183	怡亚通	1,042,585	45,237,763.15	6.32
3	600446	金证股份	1,440,000	36,590,400.00	5.11
4	002169	智光电气	2,000,000	35,460,000.00	4.95
5	300226	上海钢联	664,200	35,162,748.00	4.91
6	300113	顺网科技	767,515	33,755,309.70	4.71
7	300136	信维通信	982,800	27,292,356.00	3.81
8	300017	网宿科技	500,139	26,362,326.69	3.68
9	300056	三维丝	915,763	21,117,494.78	2.95
10	300203	聚光科技	763,509	18,362,391.45	2.56

5.4 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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,041,521.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,679.99
5	应收申购款	12,125,182.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,186,384.07

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	45,237,763.15	6.32	重大事项
2	600446	金证股份	36,590,400.00	5.11	重大事项
3	300056	三维丝	21,117,494.78	2.95	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	331,470,355.36
本报告期基金总申购份额	338,492,816.11
减:本报告期基金总赎回份额	311,572,594.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	358,390,576.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	22,640,754.72
本报告期买入申购总份额	-
本报告期卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	22,640,754.72
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.32

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(人)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》的最新规定,股票基金的股票资产投资比例下限由60%上调至80%。上述调整使广发基金管理有限公司管理的十只股票基金,包括广发聚丰股票型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金和广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF),不再符合股票基金的相关定义,经与该十只基金的基金托管人协商一致,并按中国证监会备案,广发基金管理有限公司将该十只基金变更为混合型证券投资基金,基金合同中的相关条款亦做相应修订。

详情可见本基金管理人于2015年8月7日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司官方网站发布的《广发基金管理有限公司关于旗下十只基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发制造业精选混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发制造业精选混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发制造业精选混合型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.《广发制造业精选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.法律意见书

7.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

8.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2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

9.3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.网站查阅: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
二〇一五年十月二十六日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:二〇一五年十月二十六日

§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2015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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中小板300ETF
场内简称	中小300
基金主代码	159907
交易代码	159907
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
报告期末基金份额总额	173,598,847.00份
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。
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%。
业绩比较基准	中小板300价格指数。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-75,138,726.79
2.本期利润	-104,269,129.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5897
4.期末基金资产净值	230,146,347.56
5.期末基金份额净值	1.3257

注:①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本基金已于2011年7月25日进行了份额折算,基金份额折算比例为0.90854670。

④本基金本报告期末还原后基金份额净值为1.2045。

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

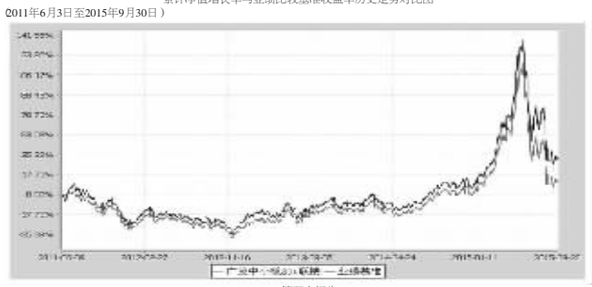
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-30.56%	3.82%	-28.52%	3.61%	-2.04%	0.21%

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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年6月3日至2015年9月30日)



§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
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300联接基金的基金经理;广发深100指数分级基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF;广发百发100指数基金的基金经理;广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理;广发中证全指信息技术ETF及联接基金的基金经理;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发医药卫生联接基金的基金经理;广发中证全指金融地产ETF及联接基金的基金经理;广发指数分级基金的基金经理;广发中证全指原材料ETF基金的基金经理;广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理;广发中证全指原材料联接基金的基金经理;广发能源联接基金的基金经理;广发金融地产联接基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;广发原材料联接基金的基金经理;广发主题消费联接基金的基金经理;数量投资部总经理	2011-06-03	-	16年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书。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月在深圳证券信息有限公司任部门总监,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300ETF基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300ETF联接基金的基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金的基金经理,2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理,2015年1月29日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理,2015年3月23日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年4月15日起任广发可选消费联接基金的基金经理,2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理,2015年6月25日起任广发中证全指能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理,广发金融地产联接基金的基金经理,2015年7月1日起任广发沪深300指数基金和广发中证500指数基金的基金经理,2015年7月9日起任广发能源联接和广发金融地产联接基金的基金经理,2015年7月23日起任广发医疗指数分级基金的基金经理,2015年8月18日起任广发原材料联接和广发主题消费联接基金的基金经理。
魏军	本基金的基金经理;广发中小板300ETF基金的基金经理;广发深证100指数分级基金的基金经理	2011-10-19	-	7年	男,中国籍,数量经济学博士,持有基金业执业资格证书。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,2014年4月1日起任广发深证100指数分级基金的基金经理。

注:1.“任职日期”和“离职日期”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。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规定。

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。监察稽核部风险控制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;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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本基金的净值增长率为-32.15%,同期业绩比较基准收益率为-27.09%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度,由于中小股票估值过高,恐慌情绪蔓延,市场遭遇了大幅下跌。随着政府的救市,流动性的注入,并且一些杠杆工具的被限制,在3季度末市场逐渐趋于平稳,可以预计未来的市场暴涨暴跌的可能性也大幅降低。虽然经济依然弱势,但政府调经济结构的决心未变,预计4季度稳增长政策仍将加码,经济增长将会逐步恢复。中小板300指数里含有众多优质的企业,可以期待中小板300指数良好的成长性为投资者带来相对超额收益;同时,中小板300指数优秀的弹性也可作为波段操作的有力工具。

§5投资组合报告

5.1 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	226,517,288.16	97.85
	其中:股票	226,517,288.16	97.85
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,910,135.41	2.12
7	其他各项资产	59,681.79	0.03
8	合计	231,487,105.36	100.00

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

5.2 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	3,403,549.42	1.48
B	采矿业	1,259,434.88	0.55
C	制造业	157,078,059.49	68.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,000,439.30	0.43
E	建筑业	7,709,313.27	3.35
F	批发和零售业	9,743,402.97	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	384,352.54	0.17
H	住宿和餐饮业	971,938.64	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,028,201.32	10.01
J	金融业	7,910,428.61	3.44
K	房地产业	2,542,189.98	1.10
L	租赁和商务服务业	8,540,206.06	3.71
M	科学研究和技术服务业	409,536.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	2,111,606.08	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	424,632.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	226,517,290.56	98.42

5.3 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	苏宁云商	504,396	6,113,279.52	2.66
2	002183	怡亚通	81,550	5,965,382.50	2.59
3	002415	海康威视	145,859	4,752,086.22	2.06
4	002450	康得新	150,327	4,553,404.83	1.98
5	002594	比亚迪	62,578	3,755,305.78	1.63
6	002230	科大讯飞	101,459	2,719,101.20	1.18
7	002304	洋河股份	48,464	2,640,803.36	1.15
8	002202	金风科技	189,527	2,560,509.77	1.11
9	002142	宁波银行	213,524	2,400,009.76	1.04
10	002252	上海莱士	57,164	2,372,306.00	1.03

5.4 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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,534.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,147.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,681.79

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	5,965,382.50	2.59	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	157,098,847.00
本报告期基金总申购份额	241,500,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	225,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	173,598,847.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(人)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1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件;

2.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3.《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4.《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》及其更新版;

5.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2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

8.3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.网站查阅: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
二〇一五年十月二十六日

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2015 第三季度 报告

2015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:二〇一五年十月二十六日

§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