（上接B67版）

法定代表人：路瑶
联系人：侯英建
联系电话：010-65808756
业务传真：010-65807864
客服热线：95162，4008888160
公司网址：www.CIFCOFUND.com
（113）公司名称：万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人：李招弟
联系人：高晓芳
联系电话：010-59393923
业务传真：010 -59393074
客服热线：400-808-0069
公司网址：www.wy-fund.com
(114)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人：汪静波
联系人：方成
联系电话：021-38600735
业务传真：021-38509777
客服热线：400-821-5399
公司网址：www.noah-fund.com
（115）公司名称：上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021-54509998
业务传真：021-64385308
客服热线：4001818188
公司网址：www.1234567.com.cn
（116）公司名称：杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：张裕
联系电话：021-60897840
业务传真：0571-26697013
客服热线：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn
（117）公司名称：和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王利
联系人：吴阿婷
联系电话：0755-82721106-8642
业务传真：0755-82029055
客服热线：4009200022
公司网址：www.hexun.com
（118）公司名称：浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼（D区）801室
办公地址：浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼（D区）801室
法定代表人：陆彬彬
联系人：邹秀男
联系电话：0571-56028620
业务传真：0571-56899710
客服热线：400 068 0058
公司网址：www.jincheng-fund.com
（119）公司名称：东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层（详细地址）
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层（详细地址）
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
联系电话：010-66555316
业务传真：010-66555246
客服热线：4008888993
公司网址：www.dxzq.net.cn
（120）公司名称：北京钱袋财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：魏东
联系电话：010-57418829
业务传真：010-57569671
客服热线：400-678-5095
公司网址：www.niuqi.net
（121）公司名称：上海久富财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区吴淞路2819号1幢109室
办公地址：上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人：赵惠群
联系人：徐金华
联系电话：021-68685825
业务传真：021-68682297
客服热线：400-021-9898
公司网址：www.jfcta.com
（122）公司名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人：杨赞
联系人：张燕
联系电话：010-58325395
业务传真：010-58325282
客服热线：4008507771
公司网址：https://tzrj.com
（123）公司名称：大同证券经纪有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
联系电话：0351-4130322
业务传真：0351-4137986
客服热线：4007121212
公司网址：www.dsbc.com.cn
（124）公司名称：中国国际期货有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区姜子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人：王兵
联系人：聂森
联系电话：010-59539864
业务传真：010-59539806
客服热线：95162，400-8888-160
公司网址：www.cifco.net
（125）公司名称：北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁静
联系人：陈肇
联系电话：010-57756019
业务传真：010-57756199
客服热线：400-786-8868-5
公司网址：www.chtfund.com
（126）公司名称：嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：袁琪
电话：021-20289890
传真：021-20280110
网址：www.harvestwm.cn
客服电话：400-021-8850
（127）公司名称：北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
联系人：张晶晶
联系电话：010-66154828-809
业务传真：010-88067526
客服热线：010-66154828
公司网址：www.5ineh.com
（128）名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
联系电话：010-52855713
业务传真：010-85894285
客服热线：400-6099-200
公司网址：www.yixinfund.com
（129）名称：中经北证（北京）资产管理有限公司
公司简称：中经北证
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人：徐福星
联系人：张雪莹
联系电话：1326132070
业务传真：010-88381550
客服热线：010-68998820
公司网址：www.bnfunds.com
（130）名称：一路财富(北京)信息科技有限公司
公司简称：一路财富
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层
法定代表人：吴雪雯
联系人：刘栋栋
联系电话：010-88312877-8009
业务传真：010-88312099
客服热线：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com
（131）名称：中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲129号新华1949产业园东门
法定代表人：徐福星
联系人：陈宝宝
联系电话：13261320700
业务传真：010-88381550
客服热线：010-68998820
公司网址：www.bnfunds.com
（132）名称：厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人：林松
联系人：李智路
联系电话：0592-3122679
业务传真：0592-8060771
客服热线：0592-3122731
公司网址：www.xds.com.cn
（133）名称：北京微熙赢信投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人：王岩
联系人：胡明会
联系电话：010-59200855
业务传真：010-59200800
客服热线：400-819-9868
公司网址：www.ahjbinfund.com
（134）名称：中信建投期货有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山二路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B，C
办公地址：重庆市渝中区中山二路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
联系人：刘芸
联系电话：023-86769637
业务传真：023-86769629
客服热线：400-8877-780
公司网址：www.cfc108.com.cn
(135)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
（136）名称：中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心二路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心二路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：洪波
联系电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客服电话：4009908826
公司网址：www.citicsf.com
（137）名称：北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号盈特茶中心A座16层
法定代表人：戴浩
联系人：于婷婷
电话：13811217674
客服电话：010-56409010
公司网址：www.jmufund.com
（138）名称：北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人：梁洪军
联系人：李长平
电话：13621233213
传真：010-68854009
客服电话：4008-196-665
公司网址：www.buyforyou.com.cn
（139）名称：上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服电话：4008219031
公司网址：www.lufunds.com
（140）名称：德商期货有限责任公司
注册地址：合肥市芜湖路258号
办公地址：合肥市芜湖路258号
法定代表人：吴国华
联系人：蔡芳
联系电话：0551-62862801
业务传真：0551-62862801
客服热线：4008878707
公司网址：www.hsqh.net
（141）名称：深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区高新技术产业园南七道惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人：马力佳
电话：0755-83999907-815
传真：0411-83999926
客服电话：0755-83999907
公司网址：www.jinqianwo.cn
（142）名称：上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人：黄德雄
联系人：张瑾
联系电话：021-53519888
业务传真：021-63608830
客服热线：4008918918，021-962518
公司网址：www.962518.com
（143）名称：珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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12楼1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629019
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn
（144）名称：上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7-9层
法定代表人：冯修敏
联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611
传真：021-33323837
客服电话：400-820-2819
公司网址：https://tty.chinapnr.com
（145）名称：开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：黄芳、黄伟涛
电话：029-63387256
传真：029-81887060
客服电话：400-860-8866
公司网址：www.kcc.com
（146）名称：上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
传真021-63333523
客服电话：4000178000
公司网址：www.lingxianfund.com
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）注册登记机构
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中路3号4004-56室
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
法定代表人：王志伟
联系人：李公平
电话：020-89189970
传真：020-89989175
（三）律师事务所和经办律师
名称：国浩律师（广州）事务所
住所：广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层
负责人：程秉
电话：020—38799345
传真：020—38799335
经办律师：黄贞、陈桂华
联系人：程秉
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
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
联系人：洪投明
电话：021—61418888
传真：021—63350003
经办注册会计师：王明静、吴迪

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联接基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

通过将绝大部分基金资产投资于中小板300ETF，紧密跟踪标的指数的表现，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，包括中小板300ETF、中小板300价格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）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%，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%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

本基金为中小板300ETF联接基金，中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对中小板300价格指数紧密跟踪的被动式指数基金，本基金主要通过投资于中小板300ETF实现对标的指数紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。

（一）资产配置策略

本基金主要投资于中小板300ETF、中小板300价格指数成份股和备选成份股。其中投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%，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%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

（二）目标ETF投资策略

1、投资组合的构建

基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成中小板300ETF，使本基金投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%。

2、投资组合的投资方式

本基金投资于中小板300ETF的两种方式如下：

（1）申购和赎回：中小板300ETF开放申购赎回后，通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。

（2）二级市场方式：中小板300ETF上市交易后，通过券商在二级市场进行中小板300ETF基金份额的交易。

在基金的日常投资管理中，本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和赎回目标ETF的基金份额，实现指数化投资目标。同时，本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标ETF基金份额。例如，在买入、卖出量低于最小申购、赎回单位时，基金管理人可以通过二级市场直接买入、卖出目标ETF基金份额。这两种投资方式的选择，首先要考虑交易便利性及市场流动性两个方面的因素；其次，在交易制度允许和市场流动性充分的前提下，通过综合考虑交易成本和价格优势，优化得出目标基金ETF份额的买入、卖出数量。

当中小板300ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

3、投资组合的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资中小板300ETF的时间和方式。

（1）当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、中小板300ETF的申购或买入等；

（2）当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定中小板300ETF的赎回或卖出等。

（三）股票投资策略

1、股票组合构建原则

根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行中小板指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据中小板300价格指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因交成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密跟踪标的指数。

3、股票组合的调整

（1）定期调整

本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的中小板300价格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

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，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，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

（四）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，主要投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。

（五）投资决策依据和决策程序

1、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。

2、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操作过程中的组合构建、调整决策，特别是对目标ETF份额的投资决策。

3、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管理全程可确执行，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、目标ETF二级市场的流动性和折溢价分析、成份股流动性分析、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，基金经理构建以目标ETF为主的投资组合。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：交易执行人员根据有关投资决策，在规定的交易执行、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：基金经理将跟踪目标ETF及标的指数的变动，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：中小板300价格指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

十、风险收益特征

本基金为ETF联接基金，风险和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，主要投资于中小板300ETF，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股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2015年12月31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2015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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,008,626.20	2.36
	其中：股票	5,008,626.20	2.36
2	基金投资	190,299,478.39	89.65
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	12,944,999.60	6.10
8	其他各项资产	4,021,080.39	1.89
9	合计	212,274,184.58	100.00

2、期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	190,299,478.39	90.83

3、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	9,032.00	0.00
B	采矿业	–	–
C	制造业	3,747,713.20	1.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	212,847.00	0.10
F	批发和零售业	152,076.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	58,086.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	768,126.00	0.37
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	60,746.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	5,008,626.20	2.39

4、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	002191	劲嘉股份	23,200	445,904.00	0.21
2	002368	太极股份	4,800	314,496.00	0.15
3	002030	达安基因	8,800	299,200.00	0.14
4	002219	恒康医疗	7,800	290,472.00	0.14
5	002174	游族网络	2,900	259,637.00	0.12
6	002106	莱宝高科	14,500	238,090.00	0.11
7	002622	永大集团	8,700	219,936.00	0.10
8	002577	雷柏科技	2,600	209,560.00	0.10
9	002345	潮宏基	10,000	195,800.00	0.09
10	002310	东方园林	9,600	194,400.00	0.09

5、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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9、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。

10、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。

11、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。

12、投资组合投资的前三

（1）根据公开市场信息，报告期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	124,165.77
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,134.77
5	应收申购款	3,894,779.85
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,021,080.39

（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

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	002191	劲嘉股份	445,904.00	0.21	重大事项
2	002368	太极股份	314,496.00	0.15	重大事项
3	002030	达安基因	299,200.00	0.14	重大事项
4	002219	恒康医疗	290,472.00	0.14	重大事项
5	002174	游族网络	259,637.00	0.12	重大事项
6	002106	莱宝高科	238,090.00	0.11	重大事项
7	002622	永大集团	219,936.00	0.10	重大事项
8	002577	雷柏科技	209,560.00	0.10	重大事项
9	002345	潮宏基	195,800.00	0.09	重大事项
10	002310	东方园林	194,400.00	0.09	重大事项

十二、基金业绩

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2015年6月30日。

一、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

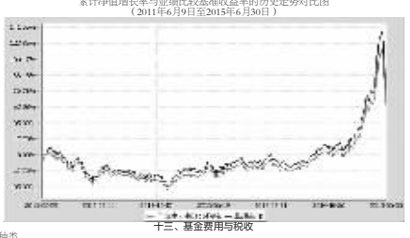
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011.6.9-2011.12.31	-26.56%	1.29%	-22.40%	1.42%	-4.16%	-0.13%
2012.1.1-2012.12.31	-2.85%	1.42%	-2.57%	1.44%	-0.28%	-0.02%
2013.1.1-2013.12.31	21.60%	1.43%	22.02%	1.45%	-0.42%	-0.02%
2014.1.1-2014.6.30	0.23%	1.26%	0.09%	1.27%	0.14%	-0.01%
2014.1.1-2014.12.31	14.40%	1.21%	15.18%	1.21%	-0.78%	0.00%
2015.1.1-2015.6.30	65.52%	2.32%	72.22%	2.24%	-6.70%	0.08%
自基金合同生效至今	64.28%	1.50%	82.56%	1.51%	-18.28%	-0.01%

二、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

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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9日至2015年6月30日）



十三、基金费用与税收

（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、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

6、基金的证券交易费用；

7、基金财产拨划支付的银行费用；

8、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，本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则记0

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，支付日顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则记0

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，支付日顺延。

3、上述一切3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相关协议的规定，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联接基金招募说明书更新》2015年2号进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“第二部分 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“第九部分 基金的投资”部分，更新了截至2015年9月30日的投资组合报告的内容。

5、在“第十部分 基金的业绩”部分，对截至2015年6月30日的基金业绩表现情况予以披露。

6、根据最新公告对“第二十二部分 其他应披露的事项”进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一五年一月八日

证券代码：000048 证券简称：康达尔 公告编号：2016-009

深圳市康达尔（集团）股份有限公司 关于核销公司及控股子公司坏帐的补充公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市康达尔（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年1月6日就第八届董事会2015年第七次临时会议审议的《关于核销公司及控股子公司坏帐的议案》进行了公告（详见公司指定的信息披露报刊《证券时报》及中国证监会指定网站（http://www.cninfo.com.cn）发布的《关于核销公司及控股子公司坏帐的公告》（公告编号：2016-004））。根据深圳证券交易所的要求，现补充公告如下：

根据《企业会计准则》的相关规定要求，公司按照依法合规、规范操作、逐笔审批、账销案存的原则，拟对经营过程中长期挂账、追收无果且已全额计提坏账准备的部分应收款项（包括应收账款和其他应收款，下同）予以核销，本次核销的应收款项坏账金额合计为170,312,254.43元：

一、公司拟核销应收款项129,804,462.54元，其中应收账款5,986,131.58元，其他应收款123,818,330.96元（详见下表）：

会计科目	单位名称	核销金额（单位：元）	核销原因
应收账款	兴发行有限公司	4,528,352.27	1998年发生的应收款，早已无法联系到该公司
应收账款	深圳美霖迪有限公司	1,457,779.31	无法联系到该公司，该公司营业执照2004年已吊销
其他应收款	申银万国证券公司	79,983,684.55	公司采取诉讼方式追讨，2007年二审已败诉
其他应收款	上海中西新生力生物工程有限公司	29,782,096.18	该公司2008年度审计报告显示，年末净资产已为-7064万元，无资产可清偿
其他应收款	深圳市宝路得投资有限公司	5,000,000.00	无法联系到该公司，该公司营业执照2005年已吊销
其他应收款	深圳宝安经安投资公司	3,000,000.00	无法联系到该公司，该公司营业执照2010年已吊销
其他应收款	康雅购物城	2,560,332.36	该单位于2000年前因经营亏损倒闭，无资产可清偿
其他应收款	深圳康达尔（安徽）饲料有限公司	1,777,227.20	该单位2014年度审计报告显示，年末净资产为-2190.5万元，本年度已破产清算，无资产可清偿
其他应收款	北京中科创业投资有限公司	660,486.28	该公司2000年已倒闭，无资产可清偿
其他应收款	珠海宾图发展有限公司	535,000.00	2000年支付的购货款，因未取得发票长期挂账
其他应收款	王玉梅律师事务所北京分所	354,489.00	2001年发生的律师费用，因未取得发票长期挂账。
其他应收款	上海中科创业投资有限公司	165,015.39	该公司2000年已倒闭，无资产可清偿
合 计		129,804,462.54	

二、公司拟核销深圳市康达尔贸易有限公司应收账款7,194,723.83元（详见下表）：

会计科目	单位名称	核销金额（单位：元）	核销原因
应收账款	广东省连州市烟丝厂	3,349,684.89	2000年前发生的业务，债务人已清算注销，贸易公司已收到清算款，剩余债权无法收回。
应收账款	台湾皓塘实业公司	2,