

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

报告期截止日期:二〇一六年三月二十八日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、监事会对本基金报告期内存在的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性及完整性承担个别及连带的法律责任。年度报告已分三部分“独立董事意见”、“基金管理人和托管人对本报告书中的财务指标、净值表现、利润分配情况、投资组合报告等进行逐项说明”和“风险揭示”两节披露于基金定期报告中。

基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人勤勉尽责地履行基金合同和本报告书规定的义务,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。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘要自年度报告正式公告之日起六个月内有效。

本报告期:2015年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	广发中小板300股票
基金简称	270028
交易代码	270028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同成立日	2011年7月6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
基金募集金额	212,406,833.01
基金类型	股票型

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称:广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金

基金代码:159902

基金运作方式:交易型开放式

基金合同成立日:2011年7月6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

基金类型:股票型

基金募集金额:212,406,833.01

基金类型:股票型

2.2 基金产品说明

投资目标:通过持有大部分基金投资于小盘300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求长期的回报率和最小化风险。

投资策略:本基金将主要采用复制法,即严格按照标的指数的构成比例和权重配置股票,并根据标的指数的变动定期调整股票的配置比例,以期在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。

业绩比较基准:中小板300指数×95%+银行存款利率(税后)×5%。

风险收益特征:本基金为股票型基金,风险收益特征高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,基金净值为指数型基金,主要投资于中小板300只股票,具有较高的风险,同时具有较高的预期收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 广发基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

姓名 谢晖军 王晓农

信息披露负责人 联系电话 010-66000609

电子邮箱 dyp@fundsf.com.cn txy@abcchina.com

客户服务电话 951028 020-83936999

传真 020-8899158

2.4 信息披露方式

基金管理人通过管理人互联网网址

http://www.gffund.com

基金管理人各销售渠道 广州证券交易所、上海证券交易所、深圳证券交易所

2.5 主要财务指标、基金净值表现及本期分配情况

单位:人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

2015年 2014年 2013年

本期初累计基金收入 121,226,232.69 34,612,977.09 -29,-20,216,993.76

本期末基金资产净值 132,562,280.29 64,755,519.34 108,439,088.92

本期末基金份额净值 0.6159 0.4246 0.7178

本期末可供分配利润 44.7995 14.4094 21.60%

3.1.2 期末可供分配利润 2015年: 0.4370 2014年: 0.0954 2013年: -0.0524

3.1.3 期末可供分配利润余额 305,636,533.61 280,183,046.06 460,288,759.69

3.1.4 期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%) 1.4770 0.9295 0.8767

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益。

2.期初可供分配利润未充分计提应付利息已实现部分的折算(期末可供分配利润,不是当年利润)。

3.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

4.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

5.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

6.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

7.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

8.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

9.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

10.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

11.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

12.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

13.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

14.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

15.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

16.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

17.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

18.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

19.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

20.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

21.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

22.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

23.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

24.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

25.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

26.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

27.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

28.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

29.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

30.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

31.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

32.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

33.本基金的基金合同不包括持有人大会决议内容,持有人大会决议须经基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

34.管理人报告

本基金曾因未按照规定报送季度报告,被中国证监会出具警示函,并已按要求完成整改。

35.基金的财务指标

3.2.1 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.3 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.4 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.5 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.6 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.7 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.8 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.9 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金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1日至2015年12月31日

3.2.10 基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金