

广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

招募说明书【更新】摘要

[2011 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：二〇一一年七月

【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。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为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《基金法》、《运作办法》、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2011年5月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2011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：马庆泉
- 5、成立时间：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”）、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、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：拟任董事长，男，硕士。兼任上海证券交易所理事会理事，广东省红十字会常务理事，广东省慈善总会荣誉副会长，广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员，广东金融学会常务理事，广东市场经济促进会常务理事，广东省青年企业家协会名誉副会长，江西财经大学客座教授，美中经济合作组织（简称 UCECO）中国首席企业家。历任广东发展银行党组成员兼副行长，广东发展银行行长助理兼广发实业投资公司总经理，广东发展银行信托投资部经理、总经理，广东发展银行人事教育部经理，广东省委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。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，现任广发证券副总经理、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、投资自营部副总经理、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，现任烽火通信科技股份有限公司副总经理、

财务总监兼董事会秘书。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。

翟美卿：董事，女，企业管理硕士，现任香江集团总裁、金海马集团董事长、香江投资有限公司董事长、深圳香江控股股份有限公司董事长。兼任广发证券监事、全国妇联常委、中国产业发展促进会副会长、香江社会救助基金会主席、广东省妇联副主席、广东省政协常委。曾任广州棠涌家具厂、北京丰台美满家具厂厂长。

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

董茂云：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、中国人民保险公司汉口分公司总经理，太平保险湖北分公司总经理，太平保险公司总经理助理，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，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。

匡丽军：监事，女，大学本科学历，高级涉外秘书，现任广州科技风险投资有限公司办公室主任。曾任广州实达实业发展公司办公室主任、广州屈臣氏公司行政主管。

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，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。曾任上海荣臣集团市场部经理、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。

段西军：督察长，男，博士。曾在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，金融学博士，4 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 1 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：邱春杨，任职时间为 2009 年 11 月 26 日至 2010 年 11 月 30 日。

5、本基金投资采取集体决策制度，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，公司投资总监易阳方，研究发展部总经理傅友兴，固定收益部总经理谢军。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

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：姜建清

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

二、主要人员情况

截至 2011 年 3 月末, 中国工商银行资产托管部共有员工 130 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, 展现优异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 2011 年 3 月, 中国工商银行共托管证券投资基金 205 只, 其中封闭式 8 只, 开放式 197 只。自 2003 年以来, 本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、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 25 项最佳托管银行大奖; 2010 年, 本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行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、基金份额发售机构

(一) 场外发售机构

1、直销机构

本基金管理人通过在广州、北京、上海设立的分公司为投资者办理开放式基金开户、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 号保利国际广场南塔 32 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) 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、申购、赎回、基金转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网址公告。

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

2、代销机构

1、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：姜建清

联系人：赵会军

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(2) 名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客户服务电话：95575 或 020-87555888 转各营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

(3) 名称：广发华福证券有限责任公司

住所：福州市鼓楼区五四路 157 号新天地大厦第 7 层、8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外加拨 0591）或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(4) 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：郭树清

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(5) 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：项俊波

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(6) 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

客户服务电话：95566

传真：010-66594946

公司网址：www.boc.cn

(7) 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

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(8) 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

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(9) 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：詹全鑫、张大奕

电话：020-38322222、0571-96000888

传真：020-87311780

客服电话：400-830-8003

公司网址：www.gdb.com.cn

(10) 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、虞谷云

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(11) 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：刘玲

电话：021-52629999

客户服务电话：95561，或拨打当地咨询电话

公司网址：www.cib.com.cn

(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：张青

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

客户服务电话：95501

公司网址：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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-57092615

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址: www.cmbc.com.cn

(14) 名称: 中国光大银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人: 唐双宁

联系人: 薛军丽

电话: 010-68098777

客户服务电话: 95595 (全国)

公司网址: www.cebbank.com

(15) 名称: 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 孔丹

联系人: 丰靖

电话: 010-65550828

客服电话: 95558

公司网址: bank.ecitic.com

(16) 名称: 平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南中路 1099 号

法定代表人: 孙建一

联系人: 赵世永

电话: 0755-25859591

传真: 0755-22197701

客户服务电话: 40066-99999, 0755-961202

公司网址: www.pingan.com

(17) 名称: 北京银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人: 闫冰竹

联系人: 王曦

传真: 010-66226045

客户服务电话：95526

公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

(18) 名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：郑鹏

联系电话：010-85238667

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

(19) 名称：宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

联系方式：021-63586210

传真：021-63586215

客服电话：96528，上海地区 962528

公司网址：www.nbc.com.cn

公司网址：www.qdccb.com

(20) 名称：浙商银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号

办公地址：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系人：毛真海

联系电话：0571-87659546

传真：0571-87659188

客户服务电话：95527

公司网址：www.czbank.com

(21) 名称：东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

联系人：巫渝峰

电话：0769-22100193

传真：0769-22117730

客户服务电话：0769-96228

公司网址：www.dongguanbank.cn

(22) 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：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务热线：400-8888-123

公司网址：www.xyzq.com.cn

(23) 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

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托电话：021-962505

公司网址：www.sywg.com

(24) 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：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务电话：400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(25) 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 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客户服务电话：4008-888-888 或拨打各城市营业网点咨询电话。

公司网址：www.chinastock.com.cn

(26) 名称：中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(27) 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

客户服务电话：010-66045678

传真：010-66045500

公司网址：<http://www.txsec.com> 或 <https://jijin.txsec.com>

(28) 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

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(29) 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

客户服务电话：95565、4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

(30) 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：程高峰

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(31) 名称：华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 (01A、02、03、04)、17A、

18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌、庞晓芸

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

客户服务电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

(32) 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：张静

电话：021-68604866

传真：021-50372474

客户服务电话：4006208888

公司网址：www.bocichina.com

(33) 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：匡婷

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000；400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

(34) 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：潘锴

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

公司网址：www.nesc.cn

（35）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

客户服务电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（36）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大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626319

开放式基金业务传真：0755-82400862

全国统一总机：4008866338

全国免费业务咨询电话：4008816168

网址：www.pingan.com

（37）名称：渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

(38) 名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客户服务热线：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

(39) 名称：东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

公司网址：www.dwzq.com.cn

(40) 名称：金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

客户服务电话：4008-888-228

公司网址：www.jyzq.cn

(41) 名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：4008888788，10108998

公司网址：www.ebscn.com

(42) 名称：东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

客服电话：4008888588

联系人：李涛

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网址：www.longone.com.cn

(43) 名称：国盛证券有限责任公司

注册地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信大厦 4 楼

法定代表人：曾小普

联系人：徐美云

电话：0791-6285337

传真：0791-6289395

客户服务电话：0791-6285337，6273972

公司网址：www.gsstock.com

(44) 名称：山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

客户服务电话：400-666-1618

公司网址：www.i618.com.cn

（45）名称：湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

开放式基金客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

（46）名称：国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客户服务电话：400-888-5288，0510-82588168

公司网址：www.glsc.com.cn

（47）名称：国海证券有限责任公司

住所：中国广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅峰

联系人：武斌

电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

客户服务电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(48) 名称：广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：刘东

联系人：林洁茹

电话：020-87322668

传真：020-87325036

客户服务电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

(49) 名称：第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

联系人：梁大为

电话：0755-82485087

传真：0757-82485081

客服电话：4008881888

公司网址：www.fcsc.cn

(50) 名称：中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84588888

传真：010-84865560

客服电话：95558

公司网址：www.citics.com

(51) 名称：德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：罗芳

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-8888-128

公司网址：www.tebon.com.cn

(52) 名称：国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：陈琳琳

联系电话：0551-2246273

开放式基金咨询电话：安徽地区：95578

开放式基金业务传真：0551-2272100

公司网址：www.gyzq.com.cn

(53) 名称：华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦

法定代表人：李工

联络人：甘霖

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

客户服务电话：96518，4008096518

公司网址：www.hazq.com

(54) 名称：中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层（266061）

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(55) 名称：中信金通证券有限责任公司

浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

电话：0571-87112510

客户服务电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

(56) 名称：财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市解放路 111 号

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87828042

客户服务电话：0571-96336, (上海地区：962336)

公司网址：www.ctsec.com

(57) 名称：中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：石保上

联系人：程月艳、耿铭

电话：0371-65585670

传真：0371-65585665

客户服务电话：0371-967218 或 4008139666

公司网址: www.ccnew.com

(58) 名称: 国都证券有限责任公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人: 常喆

联系人: 黄静

电话: 010-84183333

传真: 010-84183311-3389

客户服务电话: 400-818-8118

公司网址: www.guodu.com

(59) 名称: 万联证券有限责任公司

注册地址: 广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层

办公地址: 广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层

法定代表人: 张建军

开放式基金咨询电话: 400-8888-133

开放式基金接收传真: 020-22373718-1013

联系人: 罗创斌

联系电话: 020-37865070

网址: www.wlzq.com.cn

(60) 名称: 财富证券有限责任公司

注册地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人: 周晖

联系人: 郭磊

电话: 0731-84403319

公司网址: www.cfzq.com

(61) 名称: 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：www.essence.com.cn

(62) 名称：中航证券有限公司

住所：江西省南昌市抚河北路 291 号教育出版大厦 9 楼 904 室

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-6768681

传真：0791-677018

公司网址：www.scstock.com

(63) 名称：长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：95579

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

公司客服网址：www.95579.com

公司网址：www.cjsc.com

(64) 名称：瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

联系人：谢亚凡

电话：010-58328752

传真：010-58328748

客户服务电话：400-887-8827

公司网址：www.ubssecurities.com

(65) 名称：恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：鞠瑾

联系人：常向东

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

客户服务电话：0471-4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

(66) 名称：中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：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 18 层至 21 层

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 18 层至 21 层

法定代表人：杨明辉

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

公司网址：www.cjis.cn

(67) 名称：齐鲁证券有限公司

注册地址：济南经十路 20518 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

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(68) 名称: 方正证券股份有限公司

注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 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

网址: www.foundersc.com

(69) 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: 张宇宏

电话: 0451-82336863

传真: 0451-82287211

客户服务电话: 4006662288

公司网址: www.jhzq.com.cn

(70) 名称: 华宝证券有限责任公司

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: 陈康菲

电话: 021-50122222

传真: 021-50122200

客户服务电话: 4008209898

公司网站: www.cnhbstock.com

(71) 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：赵文安

联系人：王睿

电话：0755-83007069

传真：0755-83007167

客户服务电话：4008-698-698

公司网站：www.ydsc.com.cn

(72) 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 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

联系电话：010-59355941

客服电话：40088-95618

公司网站：www.e5618.com

(73) 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

客户服务电话：0931-4890100、4890619、4890618

公司网站：www.hlzqgs.com

(74) 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

客户服务电话：400-800-8899

公司网站：www.cindasc.com

(75) 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：卢金文

电话：0592-5161642

传真：0592-5161640

客户服务电话：0592-5163588

公司网站：www.xmzq.cn

(76) 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：400 828 5888

公司网址：www.njzq.com.cn

(77) 名称：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛北街 26 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：林长华

电话：010-58568181

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

公司网址：www.hrsec.com.cn

(78) 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: 谢项辉

电话: 0571-87901053

传真: 0571-87901913

客户服务电话: 0571-967777

公司网址: www.stocke.com.cn

(79) 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

客户服务电话: 4008-096-096

公司网址: www.swsc.com.cn

(80) 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: 4006 600109

网址: www.gjzq.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/tjsj/jypm/memberlist/>）。

二、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—58598839

传真：010—58598907

联系人：朱立元

三、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：程秉

电话：020—38799345

传真：020—38799335

经办律师：程秉、李彩霞

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有限公司

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：胡小骏

电话：021—61418888

传真：021—63350003

经办注册会计师：胡小骏、洪锐明

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分股，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，对股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) 根据决策纪要，基金经理小组构造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误差的评估，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： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。

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 2011 年 6 月 10 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 2011 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	3,794,749,280.32	94.38
	其中: 股票	3,794,749,280.32	94.38
2	固定收益投资	1,473,492.79	0.04
	其中: 债券	1,473,492.79	0.04
	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	215,743,625.24	5.37
6	其他各项资产	8,782,779.32	0.22
7	合计	4,020,749,177.67	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	76,256,334.96	1.91
B	采掘业	56,296,848.95	1.41
C	制造业	2,244,497,759.27	56.14
C0	食品、饮料	127,851,486.47	3.20
C1	纺织、服装、皮毛	110,319,351.66	2.76
C2	木材、家具	19,961,049.27	0.50

C3	造纸、印刷	87,249,590.14	2.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	430,897,191.06	10.78
C5	电子	310,665,457.69	7.77
C6	金属、非金属	309,921,877.18	7.75
C7	机械、设备、仪表	592,927,873.72	14.83
C8	医药、生物制品	223,729,708.26	5.60
C99	其他制造业	30,974,173.82	0.77
D	电力、煤气及水的生产和供应业	146,174,657.42	3.66
E	建筑业	101,262,320.94	2.53
F	交通运输、仓储业	154,341,373.61	3.86
G	信息技术业	206,665,887.39	5.17
H	批发和零售贸易	265,073,522.97	6.63
I	金融、保险业	17,538,207.42	0.44
J	房地产业	187,327,441.95	4.69
K	社会服务业	101,562,823.58	2.54
L	传播与文化产业	55,253,522.15	1.38
M	综合类	182,498,579.71	4.56
	合计	3,794,749,280.32	94.92

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	002073	软控股份	1,349,116	32,743,045.32	0.82
2	000581	威孚高科	657,689	25,985,292.39	0.65
3	600252	中恒集团	793,590	24,299,725.80	0.61
4	002008	大族激光	1,012,244	21,773,368.44	0.54

5	002106	莱宝高科	467,646	21,750,215.46	0.54
6	600311	荣华实业	1,209,578	19,716,121.40	0.49
7	002123	荣信股份	488,502	18,465,375.60	0.46
8	000970	中科三环	645,749	18,197,206.82	0.46
9	600079	人福医药	857,007	18,194,258.61	0.46
10	600160	巨化股份	723,452	18,064,596.44	0.45

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	-	-
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	可转债	1,473,492.79	0.04
7	其他	-	-
8	合计	1,473,492.79	0.04

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	110012	海运转债	6,210	763,022.70	0.02
2	128233	塔牌转债	3,768	539,498.47	0.01
3	125887	中鼎转债	1,317	170,971.62	0.00
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

6. 本期末基金未持有权证投资。

7. 投资组合报告附注

(1) 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的 10%。

(2) 报告期内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股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(3) 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。

(4) 本基金其他各项资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1,795,241.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,457.48
5	应收申购款	6,943,080.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,782,779.32

(5) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128233	塔牌转债	539,498.47	0.01

(6) 本报告期内本基金未主动或被动持有权证。

(7) 本报告期本基金未持有资产支持证券。

(8) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

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其未来表现。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 2011 年 3 月 31 日。

1、净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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)
2009.11.26-2009.12.31	0.90%	0.67%	-0.56%	2.06%	1.46%	-1.39%
2010.01.01-2010.12.31	8.52%	1.71%	9.57%	1.72%	-1.05%	-0.01%
2011.01.01-2011.3.31	0.82%	1.41%	1.23%	1.43%	-0.41%	-0.02%
自基金成立至今	10.39%	1.59%	10.29%	1.69%	0.1%	-0.1%

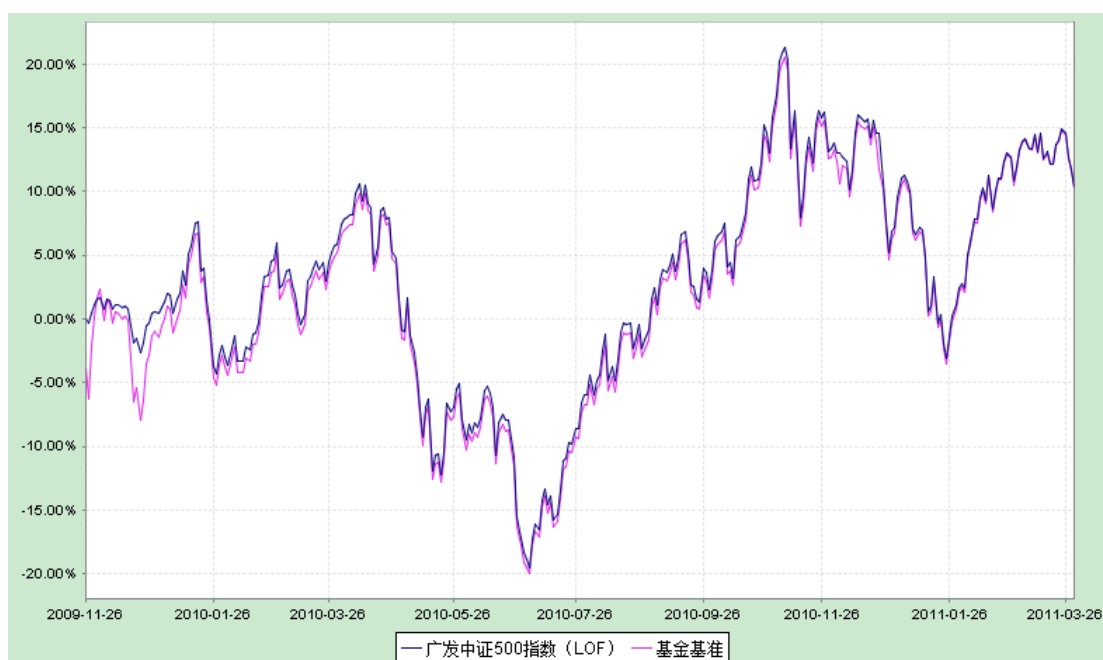
注：业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$

2、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

广发中证 500 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的历史走势对比图

(2009 年 11 月 26 日至 2011 年 3 月 31 日)



(1) 业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$

(2) 本基金建仓期为基金合同生效后三个月, 建仓期结束时本基金资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、基金的证券交易费用;
- 7、基金的银行汇划费用;
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等, 支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—7 项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、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;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用, 包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后, 可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率, 须召开基金份额持有人大会审议; 调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率, 无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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《广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》(2010 年 2 号) 进行了更新, 主要更新的内容如下:

- 1、在“第三部分 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“第十二部分 基金的投资”部分, 更新了截至 2011 年 3 月 31 日的投资组合报告的内容。
- 5、在“第十三部分 基金的业绩”部分, 对截至 2011 年 3 月 31 日的基金业绩表现情况予以披露。
- 6、根据最新公告对“第二十五部分 其他应披露的事项”进行了更新。

广发基金管理有限公司

二〇一一年七月九日