广发中债金融债指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中债金融债指数	
基金主代码	000348	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月7日	
报告期末基金份额总额	36,024,779.88份	
投资目标	本基金通过指数化投资,实现对标的指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为指数基金,主要采用优化抽样复制的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券交易特性等,对标的指数的久期等指标进行匹配,达到复制标的指数、控制跟踪误差、降低交易成本的目的。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:95%×中债-5年期金融债指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金是债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。 本基金采用优化抽样复制策略,跟踪中债-5年期金融债指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类
下属两级基金的交易代码	000348	000349
报告期末下属两级基金的份额总额	16,713,776.77份	19,311,003.11份

§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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类
1.本期已实现收益	209,637.23	134,356.42
2.本期利润	994,392.18	653,985.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0403	0.0355
4.期末基金资产净值	17,516,159.92	20,175,985.40
5.期末基金份额净值	1.0480	1.0448

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

1.广发中债金融债指数A类:

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	3.76%	0.16%	3.06%	0.14%	0.70%	0.02%

2.广发中债金融债指数C类:

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	3.66%	0.16%	3.06%	0.14%	0.60%	0.02%

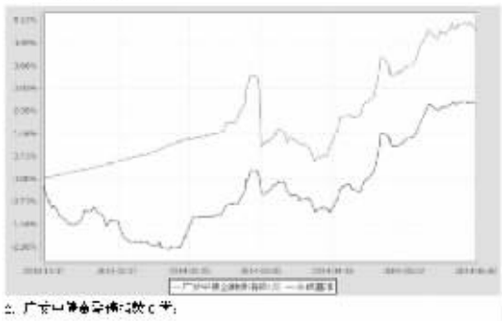
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中债金融债指数证券投资基金

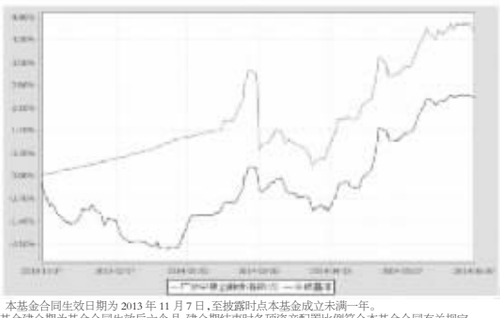
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年11月7日至2014年6月30日)

1. 广发中债金融债指数A类:



2. 广发中债金融债指数C类:



注:1. 本基金合同生效日期为2013年11月7日,至披露时点本基金成立未满一年。

2. 本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟伟	本基金的基金经理	2013-11-07	-	5	男,中国籍,数学博士,持有基金业执业资格证书,2009年7月至2013年11月先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员,2013年11月7日起任广发中债金融债指数基金的基金经理。

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 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、《广发中债金融债指数证券投资基金合同》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,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况。

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

报告期内,基金投资策略和运作情况

报告期内,本基金A类和C类的日均跟踪偏离度的绝对值为0.08%,符合基金合同的规定。

基金运作逐渐平稳,申购赎回因素对基金跟踪误差的冲击较一季度已经大幅降低。

作为被动型的指数基金,本基金采用抽样复制的方法,选取流动性较好的政策性金融债构建投资组合,较好的跟踪了标的指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发中债金融债A类本报告期内净值增长率为3.76%,广发中债金融债C类本报告期内净值增长率为3.66%,业绩基准增长率为3.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然6月份汇丰PMI指数站到了枯荣线之上,但宏观经济是否已经复苏还需时间验证。三季度,受房地产活动持续下行的影响,宏观经济未来仍面临较大的下行压力。从CPI指数的走势看,通胀有望维持在较低的水平,未来通胀上行的风险不大。

央行近期在公开市场上净投放资金,货币市场利率有望维持在合理的水平,流动性对债券市场的冲击已经减弱。

债券利率中枢目前仍然处于历史较高位置,未来利率中枢的下移将继续推动利率债价格的上升。未来债券市场或将呈现震荡向上的慢牛行情。我们认为在震荡上行过程中的短期回调是进行债券配置较好时机。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	43,468,598.20	90.13
	其中:债券	43,468,598.20	90.13
	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	3,200,000.00	6.63
	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	521,701.59	1.08
7	其他各项资产	1,041,089.27	2.16
8	合计	48,231,389.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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	1,994,598.20	5.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,474,000.00	110.03
	其中:政策性金融债	41,474,000.00	110.03
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	43,468,598.20	115.33

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

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	140203	14国开03	100,000	10,462,000.00	27.76
2	140202	14国开02	100,000	10,397,000.00	27.58
3	140409	14农发09	100,000	10,339,000.00	27.43
4	140303	14进出03	100,000	10,276,000.00	27.26
5	019314	13国债14	19,940	1,994,598.20	5.29

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 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	-
2	应收证券清算款	1,528.89
3	应收股利	-
4	应收利息	1,030,507.22
5	应收申购款	9,053.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,041,089.27

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存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前10名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类
本报告期期初基金份额总额	32,727,853.61	16,228,826.83
本报告期基金总申购份额	1,499,123.31	8,712,499.02
减:本报告期基金总赎回份额	17,513,200.15	5,630,322.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,713,776.77	19,311,003.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)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.经中国证监会注册的广发中债金融债指数证券投资基金募集的文件;

2.《广发中债金融债指数证券投资基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发中债金融债指数证券投资基金托管协议》;

5.法律意见书;

6.基金管理人业务资格批件、营业执照;

7.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
二〇一四年七月十八日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:二〇一四年七月十八日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证500ETF
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月11日
报告期末基金份额总额	2,315,038,319.00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%。
业绩比较基准	中证500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证500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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	6,191,699.82
2.本期利润	71,452,688.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0302
4.期末基金资产净值	2,559,981,649.63
5.期末基金份额净值	1.1058

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。

3.2 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

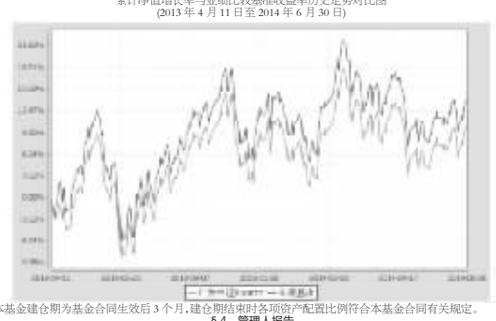
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.66%	1.06%	2.20%	1.07%	0.46%	-0.01%

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

广发中证500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

(2013年4月11日至2014年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理;广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理	2014-04-01	-	10	男,中国籍,工学学士,持有基金业执业证书,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司信息技术部工作,2010年11月至2014年3月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员。2014年4月1日起任广发沪深300指数、广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)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、《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金合同》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,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,存在1次成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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

(1)投资策略

作为ETF基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

(2)运作分析

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.02%,年化跟踪误差为0.38%,符合要求。

报告期内,本基金交易和申购赎回正常,运作过程中未发生风险事件。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要有两个:一是基金成份股调整因素,本基金季度末的成份股调整策略合理,较好地控制了该因素带来的误差;二是申购和赎回因素,本基金成立以来规模稳步增长,目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为2.66%,业绩比较基准增长率为2.20%,日均跟踪偏离度为0.01%,符合要求。报告期内本基金较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年将是中国经济转型的重要一年,对此我们持乐观态度,而中证500成份股大多数是由我国一批最具活力的中小企业所构成,代表了我国新兴的经济增长方式。随着经济复苏进程的推进和我国经济增长方式的转变,中证500指数所涵盖的领域有望成为未来经济发展的支柱产业,中证500指数的成长性也会更加彰显,因此我们看好中证500指数的中长期走势。

§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	3,808,189.76	0.14
	其中:股票	3,808,189.76	0.14
2	基金投资	2,524,450,195.83	94.54
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	141,084,790.14	5.28
8	其他各项资产	993,507.95	0.04
9	合计	2,670,336,683.68	100.00

5.2 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	广发中证500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	2,524,450,195.83	94.73

5.3 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,808,189.76	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	3,808,189.76	0.14

5.4 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	600432	吉恩镍业	175,429	2,533,194.76	0.10
2	002005	德豪润达	150,500	1,259,685.00	0.05
3	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.00

5.5 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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	586,318.31
2	应收证券清算款	1,163,168.28
3	应收股利	-
4	应收利息	16,652.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,766,138.65

5.12.4 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	125887	中期转债	3,461,450.00	0.14

5.12.5 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	603328	依顿电子	15,310.00	0.00	新股流通受限

§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	3,169,964,789.92
本报告期基金总申购份额	68,778,704.79
减:本报告期基金总赎回份额	175,363,659.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,063,379,835.70

§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	66,886,106.06
本报告期买入/申购总份额	0.00
本报告期卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	66,886,106.06
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.18

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(认)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证500指数证券投资基金(LOF)募集的文件;

2.《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》

3.《广发中证500指数证券投资基金(LOF)托管协议》

4.《广发中证500指数证券投资基金(LOF)招募说明书及》其更新版

5.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

6. 关于广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效公告

7.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》;

8.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》;

9.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书》;

10.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

11.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
二〇一四年七月十八日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6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:二〇一四年七月十八日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	广发中证500ETF联接(LOF)
基金主代码	162711
交易代码	162711
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月26日
报告期末基金份额总额	3,063,379,835.70份
投资目标	本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为ETF联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。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。 (一)资产配置策略 本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股、备选成份股,其中投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。 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.投资组合的投资方式 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。当目标ETF申购、赎回成交费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。 2.投资组合的调整 本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF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、目标ETF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,决定目标ETF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标的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,根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、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调整和调整,以更紧密的跟踪标的指数。 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标的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锁定持有期之后的一定时间以内卖出。 (四)债券投资策略 本基金将通过自上而下的宏观分析,结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置,并根据对个券相对价值的比较,进行个券选择和配置。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)股指期货及其他金融衍生品的投资策略 本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,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,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	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证500ETF
基金主代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月11日
基金份额上市的证券交易所	上海交易所
上市日期	2013年5月24日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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%。
业绩比较基准	中证500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证500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。

§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