广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年七月二十一日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发百发100指数	
基金主代码	000826	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年10月30日	
报告期末基金份额总额	1,996,744,209.36份	
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0.50%，年跟踪误差不超过6%，实现对中证百度百发策略100指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证百度百发策略100指数中的基准权重构建指数化投资组合。	
业绩比较基准	95%×中证百度百发策略100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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发百发100指数A	广发百发100指数E
下属分级基金的交易代码	000826	000827
报告期末下属分级基金的份额总额	774,984,585.35份	1,221,759,624.01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（2015年4月1日-2015年6月30日）	
	广发百发100指数A	广发百发100指数E
1.本期已实现收益	479,351,826.58	753,289,494.62
2.本期利润	249,199,652.26	368,843,752.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.2694	0.2547
4.期末基金资产净值	1,090,195,778.91	1,716,916,383.68
5.期末基金份额净值	1.407	1.405

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

1、广发百发100指数A：

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	19.22%	3.02%	24.17%	2.79%	-4.95%	0.23%

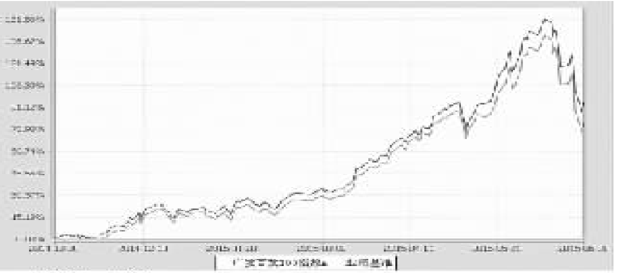
2、广发百发100指数E：

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	19.15%	3.02%	24.17%	2.79%	-5.02%	0.23%

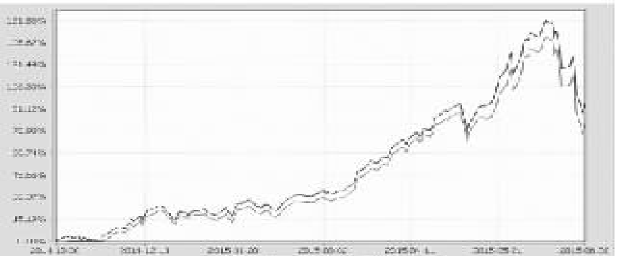
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金
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
（2014年10月30日至2015年6月30日）

1.广发百发100指数A：



2、广发百发100指数E：



注：(1)本基金合同生效日期为2014年10月30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6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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中小板300ETF及联接基金的基金经理；广发深证100指数分级基金的基金经理；广发中证全指可选消费ETF及联接基金的基金经理；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；广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源ETF基金的基金经理；广发中证全指原材料ETF基金的基金经理；数量投资部总经理	2014-10-30	-	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300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011年6月9日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金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医药卫生ETF基金的基金经理，2015年1月8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信息技术ETF联接基金的基金经理，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。
季峰	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；数据策略投资部副总经理	2014-11-24	-	6年	男，中国籍，管理学博士，持有基金业执业资格证书，2009年8月至2011年8月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作，2011年9月至2014年10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10月21日任广发中证全指可选消费ETF的基金经理，2014年11月24日起任广发百发100指数基金的基金经理，2015年2月13日起任广发养老指数基金的基金经理，2015年3月18日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理，2015年3月25日起任广发环保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、《广发中证百度百发策略100指数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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。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，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。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

2015年的6月，国内A股市场经历了前所未有的急速下跌行情，市场信心遭受冲击，抛盘压力。上证综指从6月15日至7月8日区间累计跌幅达到32.11%，创业板指区间累计跌幅39.38%，跌幅之大，速度之快，史无前例。随后监管陆续推出救市政策，投资者信心逐渐恢复，市场开始企稳。

股市大跌之前刚好赶上百发100更换样本股，本季度前几期样本中我们基本上保持了市场中性的风格，虽然今年主要的行情以创业板风格为主，但百发100通过稳健的选股模型，基本上以非小盘风格的组合跟上了小盘风格的收益，实属不易。但6月下旬市场的运行结果远远超出市场预期，由于样本股涵盖了四成场内两融股票，三周之内指数调整幅度超过40%。

反思这一过程，在突发的系统性风险出现以后，做为指数型基金，无奈受限于高仓位比例的限制，很难对于市场做出积极的应对。指数基金股票持仓的限制在流动性枯竭与大额赎回共振时又加剧了跟踪偏离度的幅度。同时本次市场急速下跌中，出现大面积股票停牌，以及恐慌性抛盘引起的大面积股票跌停，进而出现流动性危机。在极端行情下，我们通过控制持仓，较好的控制了跟踪误差，6月15日至7月10日市场大幅波动期间，百发100跑赢标的指数0.33%，偏离度较小。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发100指数基金A类净值增长率为19.22 %，E类净值增长率为19.15 %，同期业绩比较基准收益率为24.17%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场在国家政策救助的情况下，已经企稳。国内经济政策的调整也是不断积极向上，证券市场信心初步开始恢复。监管层将会进一步提振市场，盘活存量资金，稳定指数运行中枢，但短期内市场或将维持宽幅波动整理的行情模式。根据百发100运作的经验，市场风格振荡时，百发100选股模型优选股票会有比较良好的表现。在经历过这次大调整之后，我们对后续市场持谨慎乐观的态度，在市场企稳的前提下，预先布局后市，持续跟进新兴产业崛起的主线条，延伸多元化的题材，发挥大数据选股的优势，争取在修复行情中为投资者获取稳健收益。

§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	2,573,449,282.08	84.18
	其中：股票	2,573,449,282.08	84.18
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	80,373,113.47	2.63
7	其他各项资产	403,403,903.17	13.20
8	合计	3,057,226,298.72	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	18,013,235.34	0.64
B	采矿业	25,858,094.72	0.92
C	制造业	1,728,827,806.37	61.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	213,655,090.01	7.61
E	建筑业	41,403,562.75	1.47
F	批发和零售业	122,112,731.41	4.35
G	交通运输、仓储和邮政业	147,691,264.75	5.26
H	住宿和餐饮业	1,410.75	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,109,897.20	0.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	177,161,635.38	6.31
L	租赁和商务服务业	16,262,010.89	0.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,197,717.51	0.65
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	42,154,825.00	1.50
	合计	2,573,449,282.08	91.68

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	600726	华电能源	3,455,293	44,849,703.14	1.60
2	600186	莲花味精	4,178,100	43,702,926.00	1.56
3	000882	华联股份	4,876,300	42,813,914.00	1.53
4	600212	江泉实业	3,443,978	42,154,290.72	1.50
5	000534	万泽股份	2,495,738	41,803,611.50	1.49
6	000510	*ST金路	4,407,200	40,237,736.00	1.43
7	002043	兔宝宝	3,424,400	39,414,844.00	1.40
8	002530	丰东股份	2,286,456	38,160,950.64	1.36
9	600408	*ST安泰	6,186,088	38,106,302.08	1.36
10	000690	宝新能源	2,886,403	36,512,997.95	1.30

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山西安泰集团股份有限公司（股票代码：600408）于于2015年5月19日收到中国证券监督管理委员会山西监管局的调查通知书，因公司涉嫌信息披露违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对公司立案调查。

本基金投资该公司的主要原因是：1、公司对上游焦煤行业的积极延伸，预计将是未来公司走出困境的在公司层面的关键。通过向焦煤资源延伸，一方面有利于保障 公司焦煤供应，另一方面将会给公司带来可观的投资收益；2、我们认为焦炭行业将会逐步走出谷底，核心理由是 我们预计山西省今年将明显加大焦炭行业的整合力度。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

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	2,996,039.72
2	应收证券清算款	400,329,409.32
3	应收股利	-
4	应收利息	78,454.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	403,403,903.17

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

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	600186	莲花味精	43,702,926.00	1.56	重大事项
2	000882	华联股份	42,813,914.00	1.53	重大事项
3	600212	江泉实业	42,154,290.72	1.50	重大事项
4	000534	万泽股份	41,803,611.50	1.49	重大事项
5	000510	*ST金路	40,237,736.00	1.43	重大事项（注）
6	002043	兔宝宝	39,414,844.00	1.40	重大事项
7	002530	丰东股份	38,160,950.64	1.36	重大事项
8	600408	*ST安泰	38,106,302.08	1.36	重大事项

注：此停牌股票在期末虽已复牌但交易仍不活跃，因此未采用市价估值。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发百发100指数A	广发百发100指数E
本报告期期初基金份额总额	773,525,601.98	1,093,941,266.06
本报告期基金总申购份额	325,017,023.50	575,108,831.85
减：本报告期基金总赎回份额	323,558,040.13	447,290,473.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	774,984,585.35	1,221,759,624.01

§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（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

(一)中国证监会批准广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金募集的文件
(二)《广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金合同》
(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(四)《广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)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
二〇一五年七月二十一日

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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：二〇一五年七月二十一日

§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2015年7月15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	广发中证全指可选消费ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
报告期末基金份额总额	300,156,094.00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	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指可选消费指数。
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4月1日-2015年6月30日）
1.本期已实现收益	76,301,412.71
2.本期利润	76,980,959.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.2950
4.期末基金资产净值	629,891,716.88
5.期末基金份额净值	2.0985

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。

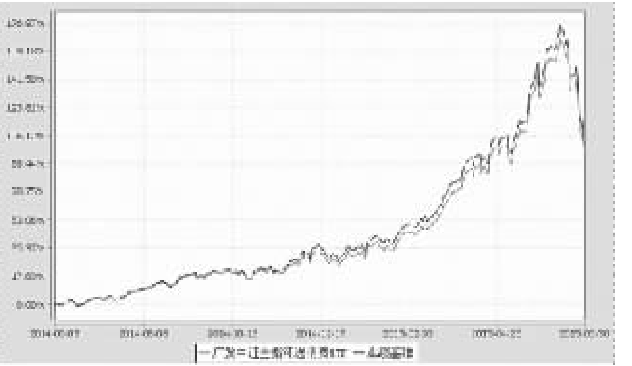
3.2 基金净值表现

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	21.33%	2.78%	21.50%	2.78%	-0.17%	0.00%

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

广发中证全指可选消费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
（2014年6月3日至2015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合同约定。

§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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中小板300ETF及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；广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源ETF基金的基金经理；广发中证全指原材料ETF基金的基金经理；数量投资部总经理	2014-06-03	-	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300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2011年6月9日起任广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金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医药卫生ETF基金的基金经理，2015年1月8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信息技术ETF联接基金的基金经理，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。
季峰	本基金的基金经理；广发百发100指数基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；数据策略投资部副总经理	2014-10-21	-	6年	男，中国籍，管理学博士，持有基金业执业资格证书，2009年8月至2011年8月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作，2011年9月至2014年10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10月21日任广发中证全指可选消费ETF的基金经理，2014年11月24日起任广发百发100指数基金的基金经理，2015年2月13日起任广发养老指数基金的基金经理，2015年3月18日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理，2015年3月25日起任广发环保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 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、《广发中证全指可选消费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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。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，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。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是申购和赎回因素，作为ETF基金，由于本基金规模较小，申购赎回对本基金的跟踪效果有较大影响。报告期内，日均跟踪偏离度绝对值为0.05%，年化跟踪误差为1.27%，符合合同规定。

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21.33%，同期业绩基准收益率为21.50%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度末，在资金流动性并非很充裕，政府清场外配资，中小股票估值过高，外加希腊债务问题迟迟没有明朗的因素作用下，市场可谓内忧外患，出现了前所未有的快速深度回调。但政府依旧会推进结构调整，行业改革的宏观政策，为未来经济的健康持续发展做铺垫，同时政府也希望通过牛市来配合经济改革，降低企业融成本，因此未来市场总体向上的趋势未发生变化。随着国内房地产的调控与人民币升值的影响，投资与出口在我国经济增长的作用逐步减弱。经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动，这是大势所趋。而随着居民收入的提高，改善型消费品的需求旺盛，可选消费品增速明显高于必需消费品。结合政府的宏观政策，可以预见，未来可选消费的发展速度应该高于全市场的发展速度。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于2015年1月1日至2015年3月31日连续57个工作日出现资产净值低于五千万。

§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	623,748,828.31	97.88
	其中：股票	623,748,828.31	97.88
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	7,704,328.46	1.21
7	其他各项资产	5,781,382.96	0.91
8	合计	637,234,539.73	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	2,319,816.00	0.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	376,332,777.83	59.75
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	85,257,514.02	13.54
G	交通运输、仓储和邮政业	3,252,278.64	0.52
H	住宿和餐饮业	5,231,914.20	0.83
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,849,744.39	6.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,097,550.00	0.49
L	租赁和商务服务业	38,844,417.31	6.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,199,941.57	2.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	863,250.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	55,499,624.35	8.81
S	综合	-	-
	合计	623,748,828.31	99.02

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	000651	格力电器	453,294	28,965,486.60	4.60
2	000333	美的集团	421,948	15,730,221.44	2.50
3	600104	上汽集团	659,927	14,914,350.20	2.37
4	002024	苏宁云商	886,800	13,568,040.00	2.15
5	600637	东方明珠	272,004	11,445,928.32	1.82
6	000917	电广传媒	266,500	11,430,185.00	1.81
7	000625	长安汽车	461,200	9,754,380.00	1.55
8	000100	TCL 集团	1,706,900	9,643,985.00	1.53
9	000793	华闻传媒	462,400	9,594,800.00	1.52
10	000069	华侨城A	734,100	9,528,618.00	1.51

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	73,321.39
2	应收证券清算款	5,707,080.72
3	应收股利	-
4	应收利息	980.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,781,382.96

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

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	000917	电广传媒	11,430,185.00	1.81	重大事项
2	000793	华闻传媒	9,594,800.00	1.52	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	10,156,094.00
本报告期基金总申购份额	512,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	222,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	300,156,094.00

§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（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

(一)中国证监会批准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
(二)《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(四)法律意见书
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照
(六)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。

广发基金管理有限公司
二〇一五年七月二十一日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2015 第二季度 报告

2015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：二〇一五年七月二十一日

§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7月15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）
场内简称	广发500L
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	1,184,789,726.78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 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。 (三)股票投资策略 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。 (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

主要财务指标	报告期（2015年4月1日-2015年6月30日）
1.本期已实现收益	1,185,803,006.24
2.本期利润	663,889,808.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.4376
4.期末基金资产净值	2,241,136,900.56
5.期末基金份额净值	1.8916

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。

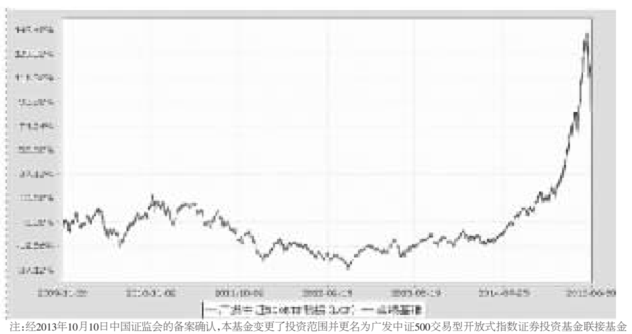
3.2 基金净值表现

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	21.58%	2.82%	21.66%	2.75%	-0.08%	0.07%

3.2.2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交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009年11月26日至2015年6月30日）



注：经2013年10月10日中国证监会的备案确认，本基金变更了投资范围并更名为广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）。

§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基金的基金经理	2014-04-01	-	11年	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联接基金（LOF）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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。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，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。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联接基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证500ETF及指数成份股等，间接复制指数，同时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0.09%，年化跟踪误差1.51%，符合要求。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素，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

本报告期内，本基金的净值增长率为21.58%，同期业绩比较基准收益率为21.66%，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

2015年6月中下旬，受场外配资以及创业板高估值等因素影响，沪深市场出现了强烈的短期下挫；截至7月中旬，整体市场恐慌情绪得到有效遏制，市场中短期处于触底反弹阶段。中证500指数二季度涨幅22.79%。

我们认为6月底7月初，整体市场存在过度悲观的情绪，而随着现代通讯技术的进步，也进一步导致了过度恐慌，进而体现为诸多股票流动性的极度枯竭，而流动性枯竭会导致估值非理性降低，抑制股价。

中短期内，整体市场依然处于反弹恢复阶段，而中证500近期停牌较多，未来一段时间内，预计将陆续复牌，届时中证500将有相对较好的表现。

§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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	834,386.89	0.03
	其中：股票	834,386.89	0.03
2	基金投资	2,146,812,798.95	89.89
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	154,860,509.25	6.48
8	其他各项资产	85,720,859.72	3.59
9	合计	2,388,228,554.81	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	2,146,812,798.95	95.79

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	492,045.00	0.02
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	93,306.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	37,549.89	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,584.00	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,734.00	0.00
L	租赁和商务服务业	48,168.00	0.00
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	834,386.89	0.04

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	600499	科达洁能	6,000	177,840.00	0.01
2	600410	华胜天成	2,800	133,952.00	0.01
3	600654	中安消	4,200	129,822.00	0.01
4	600175	美都能源	7,800	82,992.00	0.00
5	600078	澄星股份	4,000	60,920.00	0.00
6	600482	风帆股份	1,200	50,856.00	0.00
7	600790	轻纺城	3,600	48,168.00	0.00
8	603223	恒通股份	3,137	37,549.89	0.00
9	600500	中化国际	1,100	19,228.00	0.00
10	600198	大唐电信	500	17,720.00	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

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					22,515,040.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

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根据安徽皖江物流（集团）股份有限公司（股票代码：600575）2014年10月11日发布的《安徽皖江物流（集团）股份有限公司关于被中国证券监督管理委员会立案调查的公告》显示，因公司涉嫌信息披露违法违规，被中国证券会进行立案调查。

本基金对该股票的投资逻辑是：第一，皖江物流的子公司淮矿物流已停止经营、相关债务债权已经剥离上市公司，且钢铁价格很难进一步大幅下跌，预计不会有更多的债务风险暴露。第二，皖江物流绝对控股股东为安徽省属国有独资企业淮南矿业，是其旗下唯一上市平台，控股股东会竭尽全力处理公司的危机。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

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	532,407.81
2	应收证券清算款	78,985,165.96
3	应收股利	-
4	应收利息	17,370.65
5	应收申购款	5,457,860.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	728,054.41
9	合计	85,720,859.72

5.12.4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。

5.12.5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	600499	科达洁能	177,840.00	0.01	重大事项
2	600410	华胜天成	133,952.00	0.01	重大事项
3	600654	飞乐股份	129,822.00	0.01	重大事项
4	600175	美都能源	82,992.00	0.00	重大事项
5	600078	澄星股份	60,920.00	0.00	重大事项
6	600482	风帆股份	50,856.00	0.00	重大事项
7	600790	轻纺城	48,168.00	0.00	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	1,807,848,611.77
本报告期基金总申购份额	450,456,724.61
减：本报告期基金总赎回份额	1,073,515,609.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,184,789,726.78

§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	-
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	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（%）	5.65

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
二〇一五年七月二十一日