

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

联接基金(LOF)

2016 年半年度报告

2016 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：二〇一六年七月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末投资目标基金明细	39
7.3 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.7 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	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.9 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贵金属投资明细	48
7.10 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	48
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.13 投资组合报告附注	49

8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
9 开放式基金份额变动	51
10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	56
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	1,349,024,528.10 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010 年 1 月 8 日	
下属两级基金的基金简称	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接(LOF)C
下属两级基金的交易代码	162711	002903
报告期末下属分级基金的份额总额	1,348,767,266.86 份	257,261.24 份

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	上海证券交易所
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

2.2 基金产品说明

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	<p>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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p>
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。

2.2.1 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。

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		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	洪渊
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105828, 020-83936999		95588
传真	020-89899158		010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室		北京市西城区复兴门内大街 55号
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		北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码	510308		100140
法定代表人	孙树明		易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）	
	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接(LOF)C
本期已实现收益	-81,395,853.92	27.76
本期利润	-300,375,917.96	6,553.42
加权平均基金份额本期利润	-0.2460	0.0861
本期加权平均净值利润率	-19.71%	8.46%

本期基金份额净值增长率	-18.26%	3.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	广发中证 500ETF 联接 (LOF)C
期末可供分配利润	381,197,099.87	-275.50
期末可供分配基金份额利润	0.2826	-0.0011
期末基金资产净值	1,729,964,366.73	265,808.86
期末基金份额净值	1.2826	1.0332
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	广发中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金份额累计净值增长率	28.26%	3.32%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.14%	1.42%	2.82%	1.47%	0.32%	-0.05%
过去三个月	-0.40%	1.53%	-0.49%	1.57%	0.09%	-0.04%
过去六个月	-18.26%	2.37%	-18.62%	2.43%	0.36%	-0.06%
过去一年	-32.19%	2.69%	-29.64%	2.77%	-2.55%	-0.08%
过去三年	74.27%	2.00%	84.88%	2.03%	-10.61%	-0.03%
自基金合同生效起至今	28.26%	1.74%	34.17%	1.78%	-5.91%	-0.04%

广发中证 500ETF 联接(LOF)C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.32%	0.97%	5.95%	1.30%	-2.63%	-0.33%
自基金合同生效起至今	3.32%	0.97%	5.95%	1.30%	-2.63%	-0.33%

1、业绩比较基准:95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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联接基金(LOF)

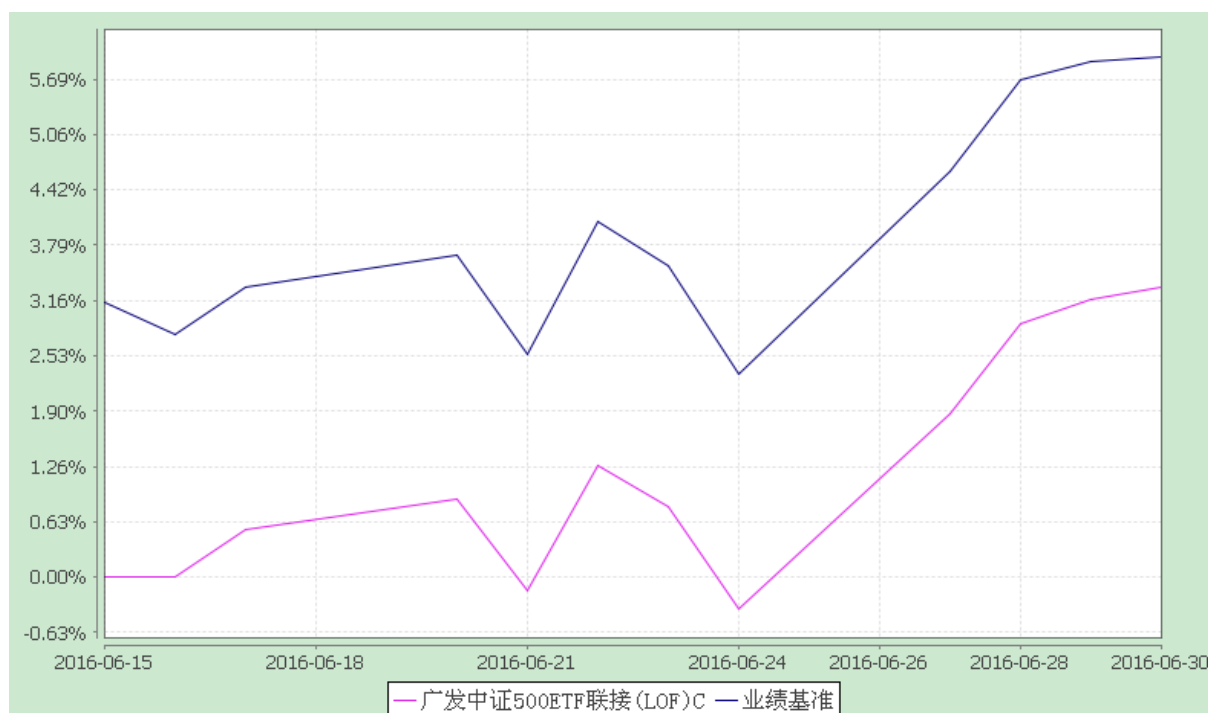
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 11 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日)

广发中证 500ETF 联接(LOF)A



广发中证 500ETF 联接(LOF)C



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和25个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）

、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理九十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发

安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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 300ETF 及联接基金的基金经理；广发中证 500ETF 基金的基金经理；广发中小板 300ETF 及联接基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；	2014-04-01	-	12 年	男，中国籍，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书，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 日至 2016 年 1 月 17 日任广发沪深 300 指数基金的基金经理，2014 年 4 月 1 日起任广发中证 500ETF 以及广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理，2015 年 8 月 20 日起任广发沪深 300ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 18 日起任广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理，

	数量投资部总经理助理				2016 年 1 月 25 日起任广发中小板 300ETF 及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日起任数量投资部总经理助理。
--	------------	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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%，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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 0.08%，符合要求。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是成份股调整、申购和赎回因素，本基金目前规模水平下，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 A 类份额的净值增长率为-18.26%，同期业绩比较基准收益率为-18.62%，较好地跟踪了指数。本报告期内，本基金新增 C 类份额，其净值增长率为 3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，全球经济复苏乏力，几大经济体的走势都并不乐观，而国内也处在去产能加速时期，稳增长和经济转型压力依然巨大；股市方面，1 月初人民币贬值以及熔断等情况引发了股票市场非理性恐慌行为，1 月份整体市场累计跌幅较大，其后市场触底反弹，自 2 月份以来市场表现为震荡向上的趋势。

展望 3 季度，国际方面，英国脱欧带来的经济不确定性，将使美联储加息政策更加谨慎；国内方面，当前经济依然在保增长、防风险和促转型之间的艰难平衡，而未来经济呈现为“L”形走势也得到了市场认可，具体来看供给侧结构性改革是帮助中国走出困局的关键。综合来看，未来市场风险偏好有望延续，整体市场可能继续保持震荡走势，市场存在结构性行情和局部性机会，未来深港通等政策预期也将提振市场信心。

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动高收益指数，中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势，而在短期表现，往往被誉为“反弹急先锋”，我们认为，对于未来的市场行情，投资者若

进行中短期的反弹波段操作，可关注中证 500 指数基金。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金的收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	65,568,058.99	34,447,867.22
结算备付金		51,957,147.59	24,528,396.60
存出保证金		7,629,092.75	3,736,533.20
交易性金融资产	6.4.7.2	1,606,855,685.52	1,586,816,632.66
其中：股票投资		3,546,937.50	5,446,178.14
基金投资		1,602,869,821.62	1,581,370,454.52
债券投资		438,926.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,989,298.20	914,325.24
应收利息	6.4.7.5	20,595.17	10,152.12

应收股利		-	-
应收申购款		369,378.55	349,447.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	9,191.10	525,887.46
资产总计		1,735,398,447.87	1,651,329,242.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,572,043.56	2,071,313.51
应付管理人报酬		51,654.42	29,022.79
应付托管费		10,330.88	5,804.55
应付销售服务费		12.04	-
应付交易费用	6.4.7.7	301,480.34	662,610.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	232,751.04	344,648.98
负债合计		5,168,272.28	3,113,400.58
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,349,024,528.10	1,050,445,971.73
未分配利润	6.4.7.1 0	381,205,647.49	597,769,870.03
所有者权益合计		1,730,230,175.59	1,648,215,841.76
负债和所有者权益总计		1,735,398,447.87	1,651,329,242.34

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，广发中证 500ETF 联接(LOF)A 基金份额净值人民币 1.2826 元，基金份额总额 1,348,767,266.86 份；广发中证 500ETF 联接(LOF)C 基金份额净值人民币 1.0332 元，基金份额总额 257,261.24 份；总份额总额 1,349,024,528.10 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 30 日
一、收入		-299,391,708.72	1,401,251,509.20
1. 利息收入		399,779.69	487,407.53
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	399,132.20	487,407.53
债券利息收入		647.49	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-80,927,216.70	1,311,207,169.36
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-3,106,727.41	10,927,068.37
基金投资收益	6.4.7.1 3	-78,071,086.70	1,277,736,833.72
债券投资收益	6.4.7.1 4	5,652.19	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	238,368.00	22,515,040.00
股利收益	6.4.7.1 6	6,577.22	28,227.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-218,973,538.38	87,871,548.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	109,266.67	1,685,383.54
减：二、费用		977,655.82	1,440,792.74
1. 管理人报酬		294,628.80	280,392.00
2. 托管费		58,925.75	56,078.35
3. 销售服务费		12.04	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	403,512.04	869,558.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.2 0	220,577.19	234,763.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-300,369,364.54	1,399,810,716.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-300,369,364.54	1,399,810,716.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,050,445,971.73	597,769,870.03	1,648,215,841.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-300,369,364.54	-300,369,364.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	298,578,556.37	83,805,142.00	382,383,698.37
其中：1. 基金申购款	406,793,987.82	112,771,388.47	519,565,376.29
2. 基金赎回款	-108,215,431.45	-28,966,246.47	-137,181,677.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,349,024,528.10	381,205,647.49	1,730,230,175.59
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,011,598,607.59	316,480,181.12	2,328,078,788.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,399,810,716.46	1,399,810,716.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-826,808,880.81	-659,943,723.80	-1,486,752,604.61
其中：1. 基金申购款	732,099,103.99	515,044,210.82	1,247,143,314.81
2. 基金赎回款	-1,558,907,984.80	-1,174,987,934.62	-2,733,895,919.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,184,789,726.78	1,056,347,173.78	2,241,136,900.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) (原名为广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2009]982 号文核准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发中证 500 指数证券投资基金基金合同》(后更名为《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》，以下简称“基金合同”)发起，于 2009 年 11 月 26 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金已向中国证监会备案，并于 2009 年 11 月 26 日获得确认。

本基金募集期为 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 20 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 8,635,797,223.98 元，有效认购户数为 107,956 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 634,322.52 元，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2009 年 11 月 26 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 8,635,797,223.98 份。

根据本基金的管理人于 2013 年 10 月 11 日发布的《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》，本基金变更为广发中证 500ETF 的联接基金，允许本基金投资股指期货，参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务，并相应地对基金合同中有关本基金名称、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改。《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》修订为《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》，原《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》同日起失效。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例

不低于基金资产净值的 5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金于 2016 年 6 月 15 日起，经基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，在原有份额的基础上增设场外 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额注册登记业务办理机构为中国证券登记结算有限责任，在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，而不计提销售服务费；C 类基金份额注册登记业务办理机构为广发基金管理有限公司，在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式。本基金 C 类基金份额在场外申购和赎回。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。两类份额之间不得相互转换。本基金以中证 500 指数为标的指数，本基金的业绩比较基准采用： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ （2013 年 10 月 10 日前，本基金的业绩比较基准采用： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ ）。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
4. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
5. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
6. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
7. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	活期存款	65,568,058.99
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	65,568,058.99	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,391,638.64	3,546,937.50	155,298.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	396,000.00	438,926.40
	银行间市场	-	-
	合计	396,000.00	438,926.40
资产支持证券	-	-	-
基金	1,718,564,009.96	1,602,869,821.62	-115,694,188.34
其他	-	-	-
合计	1,722,351,648.60	1,606,855,685.52	-115,495,963.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	35,051,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	35,051,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	35,051,720.00	-	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动

IC1607	IC1607	29	35,051,720.00	1,263,800.00
总额合计			35,051,720.00	1,263,800.00
减：可抵销期货暂收款				1,263,800.00
股指期货投资净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	10,390.40
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	108.63
应收结算备付金利息	9,453.86
应收债券利息	642.28
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	20,595.17

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	9,191.10
合计	9,191.10

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	301,480.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	301,480.34

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,954.28
预提费用	218,796.76
合计	232,751.04

6.4.7.9 实收基金

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,050,445,971.73	1,050,445,971.73
本期申购	406,463,553.39	406,463,553.39
本期赎回（以“-”号填列）	-108,142,258.26	-108,142,258.26
本期末	1,348,767,266.86	1,348,767,266.86

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

广发中证 500ETF 联接(LOF)C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期申购	330,434.43	330,434.43
本期赎回（以“-”号填列）	-73,173.19	-73,173.19
本期末	257,261.24	257,261.24

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,192,332,328.06	-594,562,458.03	597,769,870.03
本期利润	-81,395,853.92	-218,980,064.04	-300,375,917.96
本期基金份额交易产生的变动数	326,214,364.37	-242,411,216.57	83,803,147.80
其中：基金申购款	444,773,075.40	-332,005,932.37	112,767,143.03

基金赎回款	-118,558,711.03	89,594,715.80	-28,963,995.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,437,150,838.51	-1,055,953,738.64	381,197,099.87

广发中证 500ETF 联接(LOF)C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	27.76	6,525.66	6,553.42
本期基金份额交易产生的变动数	-303.26	2,297.46	1,994.20
其中：基金申购款	-453.19	4,698.63	4,245.44
基金赎回款	149.93	-2,401.17	-2,251.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-275.50	8,823.12	8,547.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	261,642.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,513.21
结算备付金利息收入	130,078.24
其他	4,898.69
合计	399,132.20

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-184,233.19
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-2,922,494.22
合计	-3,106,727.41

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,543,882.93
减：卖出股票成本总额	7,728,116.12
买卖股票差价收入	-184,233.19

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	735,479,400.00
减：现金支付申购款总额	412,192,762.94
减：申购股票成本总额	326,209,131.28
申购差价收入	-2,922,494.22

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	521,760,978.40
减：卖出/赎回基金成本总额	599,832,065.10
基金投资收益	-78,071,086.70

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	27,657.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,000.00
减：应收利息总额	5.21
买卖债券差价收入	5,652.19

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股指期货投资收益	238,368.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,577.22
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,577.22

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-220, 107, 210. 38
——股票投资	255, 391. 20
——债券投资	42, 926. 40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-220, 405, 527. 98
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1, 133, 672. 00
——权证投资	-
——股指期货投资	1, 133, 672. 00
4. 其他	-
合计	-218, 973, 538. 38

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	108, 855. 39
手续费返还	-
基金转换费收入	411. 28
印花税返还	-
其他	-
合计	109, 266. 67

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	389, 378. 09
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	14, 133. 95
合计	403, 512. 04

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39, 781. 56
信息披露费	149, 179. 94
银行汇划费	1, 780. 43
上市费	29, 835. 26
合计	220, 577. 19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发期货有限公司	基金管理人母公司的全资子公司
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	133,701,278.08	39.40%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	124,518.30	39.87%	-	-

注：1. 股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）。

2. 本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3. 本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	294,628.80	280,392.00
其中：支付销售机构的客户维护费	682,090.25	1,380,255.96

注：1. 2013 年 10 月 10 日前，本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。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付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2. 2013 年 10 月 10 日起，本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。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 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

E 取 0

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,925.75	56,078.35

注：1. 2013 年 10 月 10 日前，本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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

费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2. 2013 年 10 月 10 日起，本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。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 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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 E 取 0。

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接(LOF)C	合计
广发基金	-	12.04	12.04
合计	-	12.04	12.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接(LOF)C	合计
广发基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经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划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接(LOF)C	广发中证500ETF联接(LOF)A
期初持有的基金份额	99,308,776.44	-	66,886,106.06
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	99,308,776.44	-	66,886,106.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.36%	-	5.65%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发中证 500ETF 联接(LOF)C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	65,568,058.99	261,642.06	127,491,179.45	413,033.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

基金本报告期末持有 953,578,334.00 份目标 ETF 基金广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额，占其总份额的比例为 95.07%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000582	北部湾港	2016-02-29	重大事项停牌	16.32	-	-	500.00	8,123.00	8,160.00	-
000636	风华高科	2016-03-15	重大事项停牌	8.84	2016-07-13	9.72	2,500.00	21,425.00	22,100.00	-
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	1,500.00	21,024.00	18,750.00	-
600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项停牌	5.52	2016-07-01	5.62	4,200.00	22,806.00	23,184.00	-
600773	西藏城投	2016-06-30	重大事项停牌	15.67	-	-	800.00	12,216.00	12,536.00	-
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大事项停牌	2.52	-	-	2,900.00	7,308.00	7,308.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风

险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	438,926.40	-
未评级	-	-
合计	438,926.40	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2. 以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债及央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影

响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,568,058.99	-	-	-	65,568,058.99
结算备付金	51,957,147.59	-	-	-	51,957,147.59
存出保证金	7,629,092.75	-	-	-	7,629,092.75
交易性金融资产	-	438,926.40	-	1,606,416,759.12	1,606,855,685.52
应收证券清算款	-	-	-	2,989,298.20	2,989,298.20
应收利息	-	-	-	20,595.17	20,595.17
应收申购款	179,124.65	-	-	190,253.90	369,378.55
其他资产	-	-	-	9,191.10	9,191.10
资产总计	125,333,423.98	438,926.40	-	1,609,626,097.49	1,735,398,447.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,572,043.56	4,572,043.56
应付管理人报酬	-	-	-	51,654.42	51,654.42
应付托管费	-	-	-	10,330.88	10,330.88
应付交易费用	-	-	-	301,480.34	301,480.34
应付销售服务费	-	-	-	12.04	12.04
其他负债	-	-	-	232,751.04	232,751.04
负债总计	-	-	-	5,168,272.28	5,168,272.28
利率敏感度缺口	125,333,423.98	438,926.40	-	1,604,457,825.	1,730,230,17

				21	5.59
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,447,867.22	-	-	-	34,447,867.22
结算备付金	24,528,396.60	-	-	-	24,528,396.60
存出保证金	3,736,533.20	-	-	-	3,736,533.20
交易性金融资产	-	-	-	1,586,816,632.66	1,586,816,632.66
应收证券清算款	-	-	-	914,325.24	914,325.24
应收利息	-	-	-	10,152.12	10,152.12
应收申购款	56,465.67	-	-	292,982.17	349,447.84
其他资产	-	-	-	525,887.46	525,887.46
资产总计	62,769,262.69	-	-	1,588,559,979.65	1,651,329,242.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,071,313.51	2,071,313.51
应付管理人报酬	-	-	-	29,022.79	29,022.79
应付托管费	-	-	-	5,804.55	5,804.55
应付交易费用	-	-	-	662,610.75	662,610.75
其他负债	-	-	-	344,648.98	344,648.98
负债总计	-	-	-	3,113,400.58	3,113,400.58
利率敏感度缺口	62,769,262.69	-	-	1,585,446,579.07	1,648,215,841.76

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-5,161.66	-
	市场利率下降 25 个基点	5,161.66	-

注：本基金上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金上年度末资产净值无重大影响

响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,546,937.50	0.20	5,446,178.14	0.33
交易性金融资产—基金投资	1,602,869,821.6 2	92.64	1,581,370,454.5 2	95.94
交易性金融资产—债券投资	438,926.40	0.03	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,606,855,685.5 2	92.87	1,586,816,632.6 6	96.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	82,894,480.43	76,507,940.96

	业绩比较基准下降 5%	-82,894,480.43	-76,507,940.96
--	-------------	----------------	----------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参考最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,606,324,721.12 元，属于第二层级的余额为 530,964.40 元，无属于第三层级的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层级 1,581,768,957.66 元，第二层级 5,047,675.00 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,546,937.50	0.20
	其中：股票	3,546,937.50	0.20
2	基金投资	1,602,869,821.62	92.36
3	固定收益投资	438,926.40	0.03

	其中：债券	438,926.40	0.03
	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	117,525,206.58	6.77
8	其他各项资产	11,017,555.77	0.63
9	合计	1,735,398,447.87	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	1,602,869,821.62	92.64

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	43,780.00	0.00
B	采矿业	96,930.00	0.01
C	制造业	2,034,542.10	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,852.00	0.01
E	建筑业	56,890.00	0.00
F	批发和零售业	249,548.00	0.01

G	交通运输、仓储和邮政业	156,388.00	0.01
H	住宿和餐饮业	13,384.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	274,053.40	0.02
J	金融业	19,540.00	0.00
K	房地产业	275,841.00	0.02
L	租赁和商务服务业	43,958.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	32,074.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,756.00	0.00
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	63,863.00	0.00
S	综合	72,538.00	0.00
	合计	3,546,937.50	0.20

7.3.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002405	四维图新	3,750	92,250.00	0.01
2	000997	新大陆	3,000	60,120.00	0.00
3	002180	艾派克	1,750	49,927.50	0.00
4	002168	深圳惠程	3,500	49,280.00	0.00
5	002354	天神娱乐	500	43,640.00	0.00
6	002092	中泰化学	4,500	38,070.00	0.00
7	600584	长电科技	1,800	36,522.00	0.00
8	600522	中天科技	3,500	34,300.00	0.00
9	002030	达安基因	1,100	30,580.00	0.00
10	002384	东山精密	1,500	29,790.00	0.00
11	002505	大康农业	7,600	29,640.00	0.00
12	600521	华海药业	1,200	29,184.00	0.00

13	000612	焦作万方	4,000	28,560.00	0.00
14	600525	长园集团	2,000	27,700.00	0.00
15	600503	华丽家族	3,000	27,510.00	0.00
16	600201	生物股份	1,000	27,330.00	0.00
17	600436	片仔癀	600	27,006.00	0.00
18	600079	人福医药	1,600	26,832.00	0.00
19	601012	隆基股份	2,000	26,100.00	0.00
20	600879	航天电子	1,600	24,928.00	0.00
21	600978	宜华生活	2,200	24,508.00	0.00
22	600498	烽火通信	1,000	24,280.00	0.00
23	002277	友阿股份	2,100	24,192.00	0.00
24	603019	中科曙光	600	23,892.00	0.00
25	600664	哈药股份	2,800	23,212.00	0.00
26	600166	福田汽车	4,200	23,184.00	0.00
27	600699	均胜电子	600	22,980.00	0.00
28	600682	南京新百	800	22,776.00	0.00
29	600266	北京城建	1,800	22,482.00	0.00
30	000636	风华高科	2,500	22,100.00	0.00
31	600478	科力远	1,800	21,726.00	0.00
32	600635	大众公用	3,600	21,708.00	0.00
33	600122	宏图高科	1,600	21,408.00	0.00
34	600158	中体产业	1,200	21,300.00	0.00
35	600645	中源协和	600	21,084.00	0.00
36	600143	金发科技	3,200	20,608.00	0.00
37	600418	江淮汽车	1,600	20,288.00	0.00
38	600487	亨通光电	1,600	20,128.00	0.00
39	600388	龙净环保	1,600	20,096.00	0.00
40	600673	东阳光科	3,200	20,000.00	0.00
41	600198	大唐电信	1,000	19,880.00	0.00
42	600482	中国动力	600	19,662.00	0.00
43	600643	爱建集团	2,000	19,540.00	0.00
44	600655	豫园商城	1,800	19,512.00	0.00
45	600200	江苏吴中	1,000	19,370.00	0.00
46	600138	中青旅	1,000	19,320.00	0.00
47	600594	益佰制药	1,200	19,176.00	0.00
48	600366	宁波韵升	800	19,096.00	0.00
49	600094	大名城	2,000	19,000.00	0.00
50	600312	平高电气	1,200	18,792.00	0.00
51	000693	ST 华泽	1,500	18,750.00	0.00
52	600435	北方导航	1,400	18,634.00	0.00
53	600851	海欣股份	1,400	18,634.00	0.00
54	600151	航天机电	1,600	18,080.00	0.00
55	600240	华业资本	1,800	18,036.00	0.00
56	600410	华胜天成	1,600	17,952.00	0.00

57	600755	厦门国贸	2,200	17,490.00	0.00
58	600770	综艺股份	1,400	17,444.00	0.00
59	600171	上海贝岭	1,000	17,370.00	0.00
60	600736	苏州高新	1,900	17,347.00	0.00
61	600811	东方集团	2,600	17,316.00	0.00
62	600176	中国巨石	1,800	17,226.00	0.00
63	600884	杉杉股份	1,000	17,210.00	0.00
64	600601	方正科技	4,000	17,200.00	0.00
65	600160	巨化股份	1,600	17,008.00	0.00
66	600499	科达洁能	1,000	16,910.00	0.00
67	600565	迪马股份	2,600	16,796.00	0.00
68	000669	金鸿能源	1,000	16,700.00	0.00
69	600516	方大炭素	1,800	16,452.00	0.00
70	002181	粤传媒	2,000	16,420.00	0.00
71	600392	盛和资源	1,000	16,380.00	0.00
72	600500	中化国际	1,800	16,272.00	0.00
73	600687	刚泰控股	1,000	16,260.00	0.00
74	600528	中铁二局	1,400	16,254.00	0.00
75	603766	隆鑫通用	800	16,176.00	0.00
76	601929	吉视传媒	4,000	16,120.00	0.00
77	601311	骆驼股份	800	15,880.00	0.00
78	600056	中国医药	1,000	15,860.00	0.00
79	600216	浙江医药	1,200	15,828.00	0.00
80	600316	洪都航空	800	15,608.00	0.00
81	600881	亚泰集团	3,200	15,424.00	0.00
82	600694	大商股份	400	15,408.00	0.00
83	600597	光明乳业	1,200	15,216.00	0.00
84	600651	飞乐音响	1,200	15,192.00	0.00
85	600633	浙报传媒	1,000	15,040.00	0.00
86	600058	五矿发展	800	15,016.00	0.00
87	600639	浦东金桥	600	14,988.00	0.00
88	600611	大众交通	2,200	14,982.00	0.00
89	600536	中国软件	600	14,952.00	0.00
90	600064	南京高科	1,000	14,950.00	0.00
91	600787	中储股份	2,000	14,860.00	0.00
92	601155	新城控股	1,600	14,816.00	0.00
93	601699	潞安环能	2,200	14,388.00	0.00
94	600298	安琪酵母	800	14,272.00	0.00
95	600572	康恩贝	2,200	14,256.00	0.00
96	601880	大连港	2,400	14,184.00	0.00
97	600026	中海发展	2,400	14,160.00	0.00
98	600108	亚盛集团	2,800	14,140.00	0.00
99	601777	力帆股份	1,200	14,124.00	0.00
100	600426	华鲁恒升	1,600	14,096.00	0.00

101	600348	阳泉煤业	2,200	14,014.00	0.00
102	600717	天津港	1,600	13,904.00	0.00
103	600587	新华医疗	600	13,854.00	0.00
104	600017	日照港	3,400	13,770.00	0.00
105	600073	上海梅林	1,200	13,740.00	0.00
106	600422	昆药集团	1,000	13,640.00	0.00
107	600580	卧龙电气	1,200	13,452.00	0.00
108	600557	康缘药业	820	13,390.60	0.00
109	600754	锦江股份	400	13,384.00	0.00
110	600325	华发股份	1,200	13,284.00	0.00
111	600260	凯乐科技	800	13,088.00	0.00
112	600808	马钢股份	5,400	13,014.00	0.00
113	600067	冠城大通	1,800	12,978.00	0.00
114	600183	生益科技	1,400	12,978.00	0.00
115	600380	健康元	1,400	12,852.00	0.00
116	600967	北方创业	1,200	12,756.00	0.00
117	600320	振华重工	3,000	12,750.00	0.00
118	600750	江中药业	400	12,720.00	0.00
119	600039	四川路桥	3,200	12,608.00	0.00
120	600970	中材国际	2,000	12,600.00	0.00
121	600773	西藏城投	800	12,536.00	0.00
122	600993	马应龙	600	12,498.00	0.00
123	600416	湘电股份	1,000	12,470.00	0.00
124	601010	文峰股份	2,400	12,456.00	0.00
125	600006	东风汽车	1,400	12,418.00	0.00
126	600869	智慧能源	1,200	12,360.00	0.00
127	600872	中炬高新	1,000	12,340.00	0.00
128	600175	美都能源	2,600	12,220.00	0.00
129	600267	海正药业	1,000	12,150.00	0.00
130	600433	冠豪高新	1,400	12,096.00	0.00
131	600880	博瑞传播	1,400	11,914.00	0.00
132	600220	江苏阳光	2,600	11,856.00	0.00
133	600169	太原重工	3,000	11,700.00	0.00
134	600765	中航重机	800	11,664.00	0.00
135	601000	唐山港	3,000	11,640.00	0.00
136	600086	东方金钰	1,200	11,616.00	0.00
137	600187	国中水务	2,600	11,596.00	0.00
138	600835	上海机电	600	11,514.00	0.00
139	600259	广晟有色	200	11,452.00	0.00
140	600517	置信电气	1,200	11,412.00	0.00
141	600575	皖江物流	2,600	11,258.00	0.00
142	600289	亿阳信通	800	11,192.00	0.00
143	600112	天成控股	1,000	11,160.00	0.00
144	600161	天坛生物	400	11,116.00	0.00

145	600460	士兰微	1,400	11,102.00	0.00
146	600062	华润双鹤	600	10,932.00	0.00
147	600537	亿晶光电	1,400	10,794.00	0.00
148	600409	三友化工	1,600	10,784.00	0.00
149	603188	亚邦股份	600	10,776.00	0.00
150	600277	亿利洁能	1,800	10,710.00	0.00
151	600894	广日股份	800	10,664.00	0.00
152	600270	外运发展	600	10,494.00	0.00
153	600826	兰生股份	400	10,472.00	0.00
154	600284	浦东建设	1,000	10,440.00	0.00
155	603806	福斯特	200	10,438.00	0.00
156	600805	悦达投资	1,200	10,416.00	0.00
157	600831	广电网络	800	10,368.00	0.00
158	601717	郑煤机	1,800	10,260.00	0.00
159	600125	铁龙物流	1,600	10,192.00	0.00
160	600292	远达环保	800	10,136.00	0.00
161	600351	亚宝药业	1,000	10,030.00	0.00
162	603883	老百姓	200	9,948.00	0.00
163	600729	重庆百货	400	9,920.00	0.00
164	600395	盘江股份	1,200	9,912.00	0.00
165	600004	白云机场	800	9,808.00	0.00
166	600823	世茂股份	1,400	9,506.00	0.00
167	600300	维维股份	1,600	9,504.00	0.00
168	600628	新世界	800	9,440.00	0.00
169	600236	桂冠电力	1,400	9,408.00	0.00
170	600496	精工钢构	2,200	9,372.00	0.00
171	600757	长江传媒	1,100	9,229.00	0.00
172	600859	王府井	600	9,144.00	0.00
173	600563	法拉电子	200	9,104.00	0.00
174	600180	瑞茂通	600	9,066.00	0.00
175	601666	平煤股份	2,200	8,998.00	0.00
176	600428	中远航运	1,600	8,976.00	0.00
177	600809	山西汾酒	400	8,872.00	0.00
178	603077	和邦生物	1,800	8,856.00	0.00
179	600509	天富能源	1,200	8,820.00	0.00
180	603567	珍宝岛	400	8,740.00	0.00
181	600812	华北制药	1,400	8,694.00	0.00
182	601001	大同煤业	1,600	8,592.00	0.00
183	600282	南钢股份	3,600	8,460.00	0.00
184	601126	四方股份	800	8,424.00	0.00
185	600059	古越龙山	800	8,232.00	0.00
186	600790	轻纺城	1,400	8,218.00	0.00
187	601886	江河集团	800	8,216.00	0.00
188	000582	北部湾港	500	8,160.00	0.00

189	601678	滨化股份	1,600	8,144.00	0.00
190	600761	安徽合力	800	8,072.00	0.00
191	600720	祁连山	1,200	8,052.00	0.00
192	600456	宝钛股份	400	8,048.00	0.00
193	600481	双良节能	1,400	8,022.00	0.00
194	600551	时代出版	400	7,984.00	0.00
195	600825	新华传媒	1,000	7,950.00	0.00
196	600586	金晶科技	1,800	7,740.00	0.00
197	600748	上实发展	800	7,712.00	0.00
198	601908	京运通	1,000	7,670.00	0.00
199	601369	陕鼓动力	1,200	7,656.00	0.00
200	603355	莱克电气	200	7,620.00	0.00
201	603005	晶方科技	200	7,574.00	0.00
202	603169	兰石重装	600	7,476.00	0.00
203	600850	华东电脑	260	7,459.40	0.00
204	600195	中牧股份	400	7,320.00	0.00
205	601005	重庆钢铁	2,900	7,308.00	0.00
206	600596	新安股份	1,000	7,290.00	0.00
207	603589	口子窖	200	7,242.00	0.00
208	603699	纽威股份	400	7,096.00	0.00
209	600261	阳光照明	1,000	7,060.00	0.00
210	601801	皖新传媒	600	7,002.00	0.00
211	600657	信达地产	1,400	6,972.00	0.00
212	601002	晋亿实业	800	6,960.00	0.00
213	600053	九鼎投资	200	6,926.00	0.00
214	600141	兴发集团	600	6,912.00	0.00
215	600329	中新药业	400	6,908.00	0.00
216	600617	国新能源	600	6,876.00	0.00
217	600466	蓝光发展	800	6,848.00	0.00
218	600483	福能股份	600	6,810.00	0.00
219	601515	东风股份	600	6,780.00	0.00
220	600280	中央商场	1,000	6,760.00	0.00
221	600864	哈投股份	600	6,738.00	0.00
222	600335	国机汽车	600	6,726.00	0.00
223	603025	大豪科技	200	6,714.00	0.00
224	600776	东方通信	800	6,712.00	0.00
225	600743	华远地产	1,400	6,622.00	0.00
226	601233	桐昆股份	600	6,516.00	0.00
227	600251	冠农股份	800	6,400.00	0.00
228	600874	创业环保	800	6,216.00	0.00
229	600132	重庆啤酒	400	6,076.00	0.00
230	600425	青松建化	1,400	5,950.00	0.00
231	603328	依顿电子	200	5,908.00	0.00
232	601965	中国汽研	600	5,766.00	0.00

233	600468	百利电气	400	5,660.00	0.00
234	600971	恒源煤电	1,000	5,520.00	0.00
235	601226	华电重工	600	5,502.00	0.00
236	603698	航天工程	200	5,488.00	0.00
237	600397	安源煤业	1,200	5,304.00	0.00
238	600618	氯碱化工	400	5,252.00	0.00
239	600510	黑牡丹	600	5,232.00	0.00
240	600801	华新水泥	800	5,048.00	0.00
241	603555	贵人鸟	200	4,986.00	0.00
242	600507	方大特钢	1,000	4,800.00	0.00
243	603198	迎驾贡酒	200	4,782.00	0.00
244	600088	中视传媒	200	4,744.00	0.00
245	603568	伟明环保	200	4,620.00	0.00
246	600184	光电股份	200	4,528.00	0.00
247	603001	奥康国际	200	4,252.00	0.00
248	600917	重庆燃气	400	3,980.00	0.00
249	600623	华谊集团	200	3,962.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600201	生物股份	3,709,240.62	0.23
2	600079	人福医药	3,349,850.00	0.20
3	600816	安信信托	3,062,505.08	0.19
4	600521	华海药业	2,901,144.57	0.18
5	600635	大众公用	2,811,187.57	0.17
6	600522	中天科技	2,800,770.97	0.17
7	600673	东阳光科	2,779,027.32	0.17
8	600482	中国动力	2,702,322.48	0.16
9	601012	隆基股份	2,681,843.52	0.16
10	600158	中体产业	2,676,027.95	0.16
11	600655	豫园商城	2,668,658.00	0.16
12	600138	中青旅	2,624,593.00	0.16
13	600694	大商股份	2,562,752.76	0.16
14	600525	长园集团	2,553,219.80	0.15
15	600074	保千里	2,519,012.86	0.15
16	600498	烽火通信	2,488,206.00	0.15
17	600503	华丽家族	2,481,030.00	0.15

18	600664	哈药股份	2,469,934.16	0.15
19	600160	巨化股份	2,436,082.00	0.15
20	600436	片仔癀	2,355,759.08	0.14

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600086	东方金钰	317,520.00	0.02
2	600859	王府井	193,976.88	0.01
3	002466	天齐锂业	146,880.00	0.01
4	002439	启明星辰	72,090.00	0.00
5	002701	奥瑞金	69,745.00	0.00
6	002085	万丰奥威	66,321.00	0.00
7	002400	省广股份	66,081.00	0.00
8	300072	三聚环保	65,537.00	0.00
9	300253	卫宁健康	63,893.00	0.00
10	000998	隆平高科	61,747.00	0.00
11	002004	华邦健康	59,460.00	0.00
12	000930	中粮生化	57,801.00	0.00
13	000988	华工科技	56,844.00	0.00
14	002657	中科金财	55,420.00	0.00
15	000887	中鼎股份	55,020.00	0.00
16	000012	南玻 A	53,100.00	0.00
17	002276	万马股份	52,561.00	0.00
18	002340	格林美	52,350.00	0.00
19	002271	东方雨虹	51,030.00	0.00
20	002308	威创股份	50,865.00	0.00

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	331,782,615.56
卖出股票的收入（成交）总额	7,543,882.93

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	438,926.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	438,926.40	0.03

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120001	16 以岭 EB	3,960	438,926.40	0.03

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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	公允价值变动	风险说明
IC1607	IC1607	29.00	35,051,720.00	1,263,800.00	-
公允价值变动总额合计					1,263,800.00
股指期货投资本期收益					238,368.00
股指期货投资本期公允价值变动					1,133,672.00

7.11.2 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为主要目的。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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,629,092.75
2	应收证券清算款	2,989,298.20
3	应收股利	-
4	应收利息	20,595.17
5	应收申购款	369,378.55

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	9,191.10
9	合计	11,017,555.77

7.13.4 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。

7.13.5 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不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	73,168	18,433.84	364,302,971.53	27.01%	984,464,295.33	72.99%
广发中证 500ETF 联接 (LOF)C	39	6,596.44	-	0.00%	257,261.24	100.00%
合计	73,207	18,427.53	364,302,971.53	27.00%	984,721,556.57	73.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

广发中证 500ETF 联接(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张群娣	600,000.00	2.25%
2	刘健强	569,000.00	2.13%
3	钱慎	530,000.00	1.99%
4	蔡静岚	459,734.00	1.72%
5	冯学正	383,000.00	1.44%
6	郑卓权	300,024.00	1.13%
7	吴本明	300,018.00	1.13%
8	张敬忠	300,009.00	1.13%
9	赵天相	260,000.00	0.98%
10	林碧玲	257,404.00	0.97%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	804,666.72	0.0597%
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)C	100.00	0.0389%
	合计	804,766.72	0.0597%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	10~50
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	0
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接(LOF)C
基金合同生效日（2009 年 11 月 26 日）基金份额总额	8,635,797,223.98	-
本报告期期初基金份额总额	1,050,445,971.73	-
本报告期基金总申购份额	406,463,553.39	330,434.43
减：本报告期基金总赎回份额	108,142,258.26	73,173.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,348,767,266.86	257,261.24

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。

相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉

讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	6	541,096.88	0.16%	395.70	0.13%	-
国信证券	4	187,207,487.94	55.17%	174,350.47	55.82%	-
川财证券	2	17,876,635.59	5.27%	13,072.82	4.19%	-
广发证券	7	133,701,278.08	39.40%	124,518.30	39.87%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
国泰君安	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
华安证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	新增 1 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

江海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	27,657.40	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司旗下基金（除 QDII 基	《中国证券报》、《证	2016-06-30

	金) 资产净值公告	券时报》、《上海证券报》	
2	广发基金管理有限公司关于增加大智慧财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-27
3	广发基金管理有限公司关于广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)新增场外 C 类基金的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-13
4	广发基金管理有限公司关于增加宁波银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-01
5	广发基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-05
6	广发基金管理有限公司关于增加利得基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-04-13
7	广发基金管理有限公司关于增加诺亚正行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-09
8	广发基金管理有限公司关于增加平安银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-04
9	广发基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-18
10	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04
11	广发基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04

11 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者投资需求, 根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《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》的有关约定, 广发基金管理有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致, 并报中国证监会备案, 决定于 2016 年 6 月 15 日起, 对广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)在现有份额的基础上增设场外 C 类基金份额(C 类基金份额代码: 002903), 原份额转为 A 类份额, 同时根据最新法律法规对《基金合同》和《托管协议》进行了相

应修改。本公告可见本基金管理人于 2016 年 6 月 13 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司官方网站发布的《关于广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)新增场外 C 类基金份额并修改基金合同部分条款的公告》。

12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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

12.3 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

二〇一六年七月二十六日