

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

联接基金(LOF)

2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十四日

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 2018 年 8 月 22 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 2018 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.....	14
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.....	15
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.....	15
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.....	18
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末投资目标基金明细.....	40
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.13 投资组合报告附注.....	55

8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
9 开放式基金份额变动	57
10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
11 影响投资者决策的其他重要信息	63
12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

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	1,905,149,017.34 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	940,131,016.17 份	965,018,001.17 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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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	郭明
	联系电话	020-83936666	(010) 66105798
	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) 66105799
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-49848 (集中办公区)	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 (2018年1月1日至2018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	-20,760,632.54	-13,743,855.44
本期利润	-180,177,249.89	-82,702,641.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1967	-0.1228
本期加权平均净值利润率	-15.52%	-12.20%
本期基金份额净值增长率	-14.91%	-15.02%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 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	121,936,837.96	-91,668,087.75
期末可供分配基金份额利润	0.1297	-0.0950
期末基金资产净值	1,062,067,854.13	873,349,913.42
期末基金份额净值	1.1297	0.9050
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 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	12.97%	-9.50%

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	-8.00%	1.72%	-8.86%	1.77%	0.86%	-0.05%
过去三个月	-12.70%	1.28%	-13.93%	1.31%	1.23%	-0.03%
过去六个月	-14.91%	1.34%	-15.69%	1.37%	0.78%	-0.03%
过去一年	-13.15%	1.13%	-14.23%	1.16%	1.08%	-0.03%
过去三年	-40.28%	1.75%	-39.29%	1.80%	-0.99%	-0.05%
自基金合同生效起至今	12.97%	1.60%	15.08%	1.64%	-2.11%	-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	-8.01%	1.72%	-8.86%	1.77%	0.85%	-0.05%
过去三个月	-12.75%	1.28%	-13.93%	1.31%	1.18%	-0.03%
过去六个月	-15.02%	1.34%	-15.69%	1.37%	0.67%	-0.03%
过去一年	-13.42%	1.13%	-14.23%	1.16%	0.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-9.50%	1.00%	-8.95%	1.03%	-0.55%	-0.03%

(1) 业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

(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)

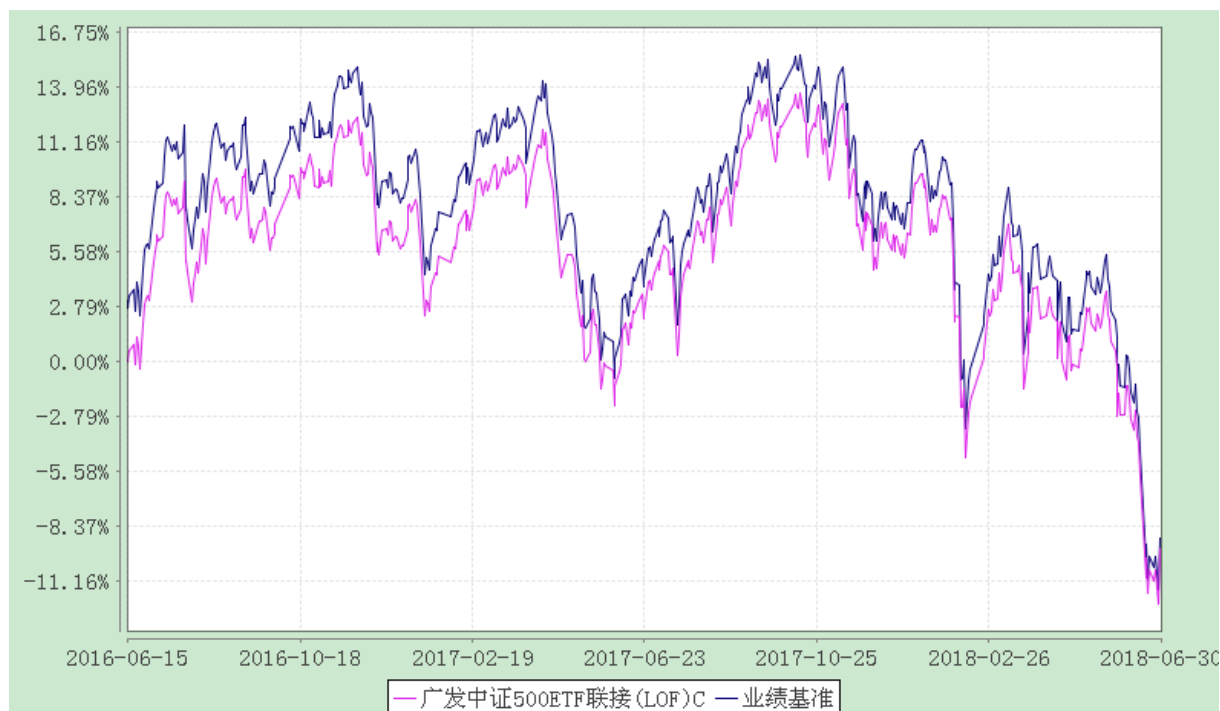
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 11 月 26 日至 2018 年 6 月 30 日)

广发中证 500ETF 联接(LOF)A



广发中证 500ETF 联接(LOF)C



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。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）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 30 个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与

战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

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 联接基金的基金经理；广发中证 500ETF 基金的基金经理；广发沪深 300ETF 基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板 300ETF 基金的基金经理；广发中小板 300 联接基金的基金经理；广发中证环保 ETF 联接基金的基金经理；广发军工 ETF 基金的基金经理；广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理；广发中证环保 ETF 基金的基金经理；广发创业板 ETF 基金的	2014-04-01	-	14 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日）。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 8 月 20 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 18 日起任职）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任

	<p>基金经理；广发创业板 ETF 联接基金的基金经理；广发量化稳健混合基金的基金经理；广发道琼斯石油指数 (QDII-LOF) 基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII) 基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数 (QDII) 基金的基金经理；广发纳指 100ETF 基金的基金经理；广发全球农业指数 (QDII) 基金的基金经理；广发全球医疗保健 (QDII) 基金的基金经理；广发生物科技指数 (QDII) 基金的基金经理；指数投资部总经理助理</p>				<p>职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2016 年 8 月 30 日起任职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2017 年 1 月 25 日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2017 年 4 月 25 日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (自 2017 年 5 月 25 日起任职)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理 (自 2017 年 8 月 4 日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理 (自 2018 年 4 月 26 日起任职)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF) 基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理 (自 2018 年 8 月 6 日起任职)。</p>
--	--	--	--	--	--

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，投资的债券必须来自公司债券库。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。金融工程与风险管理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%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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 类份额净值增长率为-14.91%，C 类份额净值增长率为-15.02%，同期业绩基准收益率为-15.69%，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

上半年，受金融去杠杆、信用债违约以及中美贸易战升级的持续不利影响，整体市场预期较为悲观，主流指数均呈现较大幅度的下挫，但同时也释放了一定的市场风险，目前很多行业估值均已处于历史低位，而随着流动性的逐步改善和市场环境的逐步消化，市场对于风险应对或许存在一定的过度反应。结合目前的估值水平，A 股市场进入了相对值得配置的阶段，投资者应关注未来的 A 股投资机会。

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、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理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。合规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遵规守信、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。

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

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)2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	141,831,161.64	134,971,078.36
结算备付金		26,648,784.05	20,801,245.70
存出保证金		20,933,893.09	13,363,496.16
交易性金融资产	6.4.7.2	1,760,177,545.38	1,369,735,687.29
其中：股票投资		15,287,855.96	7,387,754.88
基金投资		1,744,889,689.42	1,362,347,932.41
债券投资		-	-
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		701,850.73	-
应收利息	6.4.7.5	44,941.86	26,677.45
应收股利		-	-
应收申购款		2,059,051.91	1,481,690.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	5,584,554.14	1,343,934.58
资产总计		1,957,981,782.80	1,541,723,810.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		-	21,508,326.32
应付赎回款		21,496,064.31	2,513,044.07
应付管理人报酬		79,104.26	50,672.62
应付托管费		15,820.85	10,134.52
应付销售服务费		109,728.19	67,164.17
应付交易费用	6.4.7.7	643,439.26	485,445.90

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	219,858.38	342,246.27
负债合计		22,564,015.25	24,977,033.87
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,905,149,017.34	1,194,099,610.53
未分配利润	6.4.7.10	30,268,750.21	322,647,165.96
所有者权益合计		1,935,417,767.55	1,516,746,776.49
负债和所有者权益总计		1,957,981,782.80	1,541,723,810.36

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，广发中证 500ETF 联接(LOF)A 基金份额净值人民币 1.1297 元，基金份额总额 940,131,016.17 份；广发中证 500ETF 联接(LOF)C 基金份额净值人民币 0.9050 元，基金份额总额 965,018,001.17 份；总份额总额 1,905,149,017.34 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-260,242,929.52	-6,664,775.22
1.利息收入		642,425.24	463,762.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	642,425.24	463,760.84
债券利息收入		-	1.30
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）		-32,840,438.75	-1,652,788.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,340,740.53	-1,267,193.20
基金投资收益	6.4.7.13	-24,769,738.49	-8,833,747.98
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-3,813,799.05	8,375,560.00
股利收益	6.4.7.16	83,839.32	72,592.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-228,375,403.90	-5,660,907.31

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	330,487.89	185,158.87
减：二、费用		2,636,962.36	1,254,756.56
1. 管理人报酬		438,336.06	364,441.68
2. 托管费		87,667.20	72,888.38
3. 销售服务费		1,194,721.25	365,760.97
4. 交易费用	6.4.7.19	683,554.21	229,930.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,985.99	-
7. 其他费用	6.4.7.20	225,697.65	221,734.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-262,879,891.88	-7,919,531.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-262,879,891.88	-7,919,531.78

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,194,099,610.53	322,647,165.96	1,516,746,776.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-262,879,891.88	-262,879,891.88
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）	711,049,406.81	-29,498,523.87	681,550,882.94
其中：1.基金申购款	2,072,611,555.76	38,652,282.83	2,111,263,838.59
2.基金赎回款	-1,361,562,148.95	-68,150,806.70	-1,429,712,955.65
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）	1,905,149,017.34	30,268,750.21	1,935,417,767.55
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,088,479,674.81	338,047,534.66	1,426,527,209.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,919,531.78	-7,919,531.78
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）	308,405,083.05	-12,553,806.37	295,851,276.68
其中：1.基金申购款	579,516,164.11	45,169,355.23	624,685,519.34
2.基金赎回款	-271,111,081.06	-57,723,161.60	-328,834,242.66
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）	1,396,884,757.86	317,574,196.51	1,714,458,954.37

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》、《公开募集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》、《公开募集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： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ ）。

本基金于 2016 年 6 月 15 日起增设场外 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。

本基金的财务报表于 2018 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（以下简称“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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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

本基金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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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、债券免征营业税或增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2、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。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向

主管税务机关申报缴纳，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，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。

4、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。

5、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。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	141,831,161.64
定期存款	-
其他存款	-
合计	141,831,161.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,011,295.68	15,287,855.96	-723,439.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	1,988,059,988.25	1,744,889,689.42	-243,170,298.83
其他	-	-	-
合计	2,004,071,283.93	1,760,177,545.38	-243,893,738.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	97,885,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	97,885,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	97,885,000.00	-	-	-

注：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，本基金本报告期末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）：

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1807	IC1807	20.00	20,752,000.00	-498,458.54
IC1808	IC1808	75.00	77,133,000.00	1,304,640.00
总额合计		-	97,885,000.00	806,181.46
减：可抵销期货暂收款		-	-	806,181.46
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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	41,850.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	153.09
应收结算备付金利息	2,938.25
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	44,941.86

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
其他应收款	-

待摊费用	-
可收退补款	5,584,554.14
合计	5,584,554.14

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	643,439.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	643,439.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,668.31
预提费用	218,190.07
合计	219,858.38

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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	933,114,966.50	933,114,966.50
本期申购	118,898,239.12	118,898,239.12
本期赎回（以“-”号填列）	-111,882,189.45	-111,882,189.45
本期末	940,131,016.17	940,131,016.17

广发中证 500ETF 联接(LOF)C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	260,984,644.03	260,984,644.03

本期申购	1,953,713,316.64	1,953,713,316.64
本期赎回（以“-”号填列）	-1,249,679,959.50	-1,249,679,959.50
本期末	965,018,001.17	965,018,001.17

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，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	981,599,572.10	-675,902,976.04	305,696,596.06
本期利润	-20,760,632.54	-159,416,617.35	-180,177,249.89
本期基金份额交易产生的变动数	6,847,698.50	-10,430,206.71	-3,582,508.21
其中：基金申购款	124,033,505.83	-94,820,754.90	29,212,750.93
基金赎回款	-117,185,807.33	84,390,548.19	-32,795,259.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	967,686,638.06	-845,749,800.10	121,936,837.96

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
上年度末	-4,321,467.13	21,272,037.03	16,950,569.90
本期利润	-13,743,855.44	-68,958,786.55	-82,702,641.99
本期基金份额交易产生的变动数	-16,726,934.49	-9,189,081.17	-25,916,015.66
其中：基金申购款	-44,945,793.71	54,385,325.61	9,439,531.90
基金赎回款	28,218,859.22	-63,574,406.78	-35,355,547.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,792,257.06	-56,875,830.69	-91,668,087.75

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	575,232.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,341.44
结算备付金利息收入	64,709.67
其他	141.55
合计	642,425.24

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	338,759.67
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-4,679,500.20
合计	-4,340,740.53

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	116,957,804.22
减：卖出股票成本总额	116,619,044.55
买卖股票差价收入	338,759.67

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	759,037,200.00
减：现金支付申购款总额	431,484,790.37
减：申购股票成本总额	332,231,909.83
申购差价收入	-4,679,500.20

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	709,328,096.72
减：卖出/赎回基金成本总额	734,097,835.21
基金投资收益	-24,769,738.49

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股指期货投资收益	-3,813,799.05

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	83,839.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	83,839.32

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-228,028,555.33
——股票投资	-750,039.83
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-227,278,515.50
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-346,848.57
——权证投资	-
——股指期货投资	-346,848.57
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-228,375,403.90

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	196,024.21
基金转换费收入	134,463.68
其他	-
合计	330,487.89

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	580,910.25
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	72,195.44
其中：申购费	18,772.66

赎回费	5,004.55
其他	48,418.23
期货交易费用	30,448.52
合计	683,554.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	7,507.58
上市费	29,752.78
合计	225,697.65

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	352,282,730.85	73.41%	-	-

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 2018年1月1日至2018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	328,084.14	77.86%	244,947.26	38.07%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	-	-	-	-

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	438,336.06	364,441.68
其中：支付销售机构的客户维护费	661,828.66	749,821.31

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,667.20	72,888.38

注：1.2012 年 9 月 5 日起，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 2018年1月1日至2018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
广发基金管理有限公司	-	1,126,984.40	1,126,984.40
广发证券股份有限公司	-	918.99	918.99
合计	-	1,127,903.39	1,127,903.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
广发基金管理有限公司	-	339,698.86	339,698.86
广发证券股份有限公司	-	171.74	171.74
合计	-	339,870.60	339,870.60

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 0.20% (2018 年 5 月 16 日以前: 0.40%) 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	广发中证500ETF联 接(LOF)C
报告期初持有的基金 份额	32,422,670.38	-	99,308,776.44	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	66,886,106.06	-
报告期末持有的基 金份额	32,422,670.38	-	32,422,670.38	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	3.45%	-	3.26%	-

注：基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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	上年度可比期间

	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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	141,831,161.64	575,232.58	31,738,517.53	336,768.86

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，按银行同业利率或约定利率计息。

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

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

基金本报告期末持有 1,192,190,277.00 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 78.79%。

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（2018 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 2018 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
000693	*ST 华泽	2018-05-02	重大事项停牌	3.31	-	-	1,500.00	21,024.00	4,965.00	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项停牌	4.96	2018-07-02	4.46	1,900.00	13,262.00	9,424.00	-
002011	盾安环境	2018-05-02	重大事项停牌	6.40	-	-	1,500.00	9,825.00	9,600.00	-
600687	刚泰控股	2018-06-11	重大事项停牌	9.09	2018-08-20	8.18	1,100.00	10,781.00	9,999.00	-
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项停牌	7.21	-	-	1,400.00	11,088.00	10,094.00	-
600848	上海临港	2018-06-15	重大事项停牌	21.67	-	-	500.00	11,700.00	10,835.00	-
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大事项停牌	6.20	2018-08-13	5.57	1,900.00	13,072.00	11,780.00	-

002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项停牌	3.31	-	-	4,400.00	16,456.00	14,564.00	-
002512	达华智能	2018-06-19	重大事项停牌	9.70	-	-	1,600.00	16,240.00	15,520.00	-
002573	清新环境	2018-06-19	重大事项停牌	11.55	-	-	1,400.00	20,314.00	16,170.00	-
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项停牌	6.71	-	-	2,500.00	17,800.00	16,775.00	-
002665	首航节能	2018-05-29	重大事项停牌	5.80	-	-	3,000.00	19,380.00	17,400.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	-	-	3,300.00	20,570.00	17,721.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	-	-	2,107.00	22,596.00	19,995.43	-
600122	宏图高科	2018-06-19	重大事项停牌	7.40	-	-	3,030.00	23,848.80	22,422.00	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大事项停牌	12.28	-	-	1,900.00	26,847.00	23,332.00	-
002359	北讯集团	2018-05-21	重大事项停牌	19.58	-	-	1,500.00	39,524.00	29,370.00	-
600811	东方集团	2018-05-30	重大事项停牌	4.30	-	-	7,013.00	30,717.08	30,155.90	-
600750	江中药业	2018-05-02	重大事项停牌	17.75	2018-08-01	16.12	3,920.00	68,032.00	69,580.00	-

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 2018 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 2018 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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总裁负责。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、合规稽核部、金融工程与风险管理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。本基金本报告期末及上年度末未持有债券，因此与债券相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人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，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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 2018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	141,831,161.64	-	-	-	141,831,161.64
结算备付金	26,648,784.05	-	-	-	26,648,784.05
存出保证金	20,933,893.09	-	-	-	20,933,893.09
交易性金融资产	-	-	-	1,760,177,545.38	1,760,177,545.38
应收证券清算款	-	-	-	701,850.73	701,850.73
应收利息	-	-	-	44,941.86	44,941.86
应收申购款	262,455.20	-	-	1,796,596.71	2,059,051.91
其他资产	-	-	-	5,584,554.14	5,584,554.14
资产总计	189,676,293.98	-	-	1,768,305,488.82	1,957,981,782.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,496,064.31	21,496,064.31
应付管理人报酬	-	-	-	79,104.26	79,104.26
应付托管费	-	-	-	15,820.85	15,820.85
应付交易费用	-	-	-	643,439.26	643,439.26
应付销售服务费	-	-	-	109,728.19	109,728.19
其他负债	-	-	-	219,858.38	219,858.38
负债总计	-	-	-	22,564,015.25	22,564,015.25

利率敏感度缺口	189,676,293.98	-	-	1,745,741,473.57	1,935,417,767.55
上年度末 2017 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	134,971,078.36	-	-	-	134,971,078.36
结算备付金	20,801,245.70	-	-	-	20,801,245.70
存出保证金	13,363,496.16	-	-	-	13,363,496.16
交易性金融资产	-	-	-	1,369,735,687.29	1,369,735,687.29
应收利息	-	-	-	26,677.45	26,677.45
应收申购款	147,323.62	-	-	1,334,367.20	1,481,690.82
其他资产	-	-	-	1,343,934.58	1,343,934.58
资产总计	169,283,143.84	-	-	1,372,440,666.52	1,541,723,810.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	21,508,326.32	21,508,326.32
应付赎回款	-	-	-	2,513,044.07	2,513,044.07
应付管理人报酬	-	-	-	50,672.62	50,672.62
应付托管费	-	-	-	10,134.52	10,134.52
应付交易费用	-	-	-	485,445.90	485,445.90
应付销售服务费	-	-	-	67,164.17	67,164.17
其他负债	-	-	-	342,246.27	342,246.27
负债总计	-	-	-	24,977,033.87	24,977,033.87
利率敏感度缺口	169,283,143.84	-	-	1,347,463,632.65	1,516,746,776.49

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

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	15,287,855.96	0.79	7,387,754.88	0.49
交易性金融资产—基金投资	1,744,889,689.42	90.16	1,362,347,932.41	89.82
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	1,760,177,545.38	90.95	1,369,735,687.29	90.31

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	96,770,888.38	73,424,198.31
	业绩比较基准下降 5%	-96,770,888.38	-73,424,198.31

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见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 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 1,759,817,843.05 元, 属于第二层级的余额为 359,702.33 元, 无属于第三层级的金额 (2017 年 12 月 31 日: 属于第一层级的余额为 1,369,686,725.29 元, 属于第二层级的余额为 48,962.00 元, 无属于第三层级的金额)。

(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。

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	15,287,855.96	0.78
	其中: 股票	15,287,855.96	0.78
2	基金投资	1,744,889,689.42	89.12
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	168,479,945.69	8.60
8	其他各项资产	29,324,291.73	1.50
9	合计	1,957,981,782.80	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	1,744,889,689.42	90.16

7.3 报告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

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	171,733.00	0.01
B	采矿业	556,164.76	0.03
C	制造业	9,262,736.48	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	478,565.36	0.02
E	建筑业	206,029.72	0.01
F	批发和零售业	849,565.94	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	766,980.98	0.04
H	住宿和餐饮业	94,776.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	968,849.69	0.05
J	金融业	290,493.61	0.02
K	房地产业	881,524.86	0.05
L	租赁和商务服务业	234,015.46	0.01
M	科学研究和技术服务业	50,076.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	92,621.10	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,925.00	0.00
Q	卫生和社会工作	15,208.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	242,672.00	0.01
S	综合	118,918.00	0.01
	合计	15,287,855.96	0.79

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	600176	中国巨石	23,400	239,382.00	0.01
2	603019	中科曙光	3,500	160,545.00	0.01
3	600201	生物股份	8,459	144,564.31	0.01
4	600521	华海药业	5,220	139,321.80	0.01
5	600426	华鲁恒升	7,900	138,961.00	0.01
6	600298	安琪酵母	3,500	124,880.00	0.01
7	600872	中炬高新	4,400	123,200.00	0.01
8	603589	口子窖	2,000	122,900.00	0.01
9	600256	广汇能源	29,230	119,550.70	0.01
10	600584	长电科技	6,940	117,563.60	0.01
11	600673	东阳光科	11,100	114,663.00	0.01
12	600600	青岛啤酒	2,600	113,958.00	0.01
13	600315	上海家化	2,754	109,141.02	0.01
14	601233	桐昆股份	6,313	108,709.86	0.01
15	600879	航天电子	15,200	106,856.00	0.01
16	600885	宏发股份	3,503	104,809.76	0.01
17	600525	长园集团	9,900	104,643.00	0.01
18	600004	白云机场	7,900	103,411.00	0.01
19	600392	盛和资源	6,100	99,003.00	0.01
20	600884	杉杉股份	4,400	97,240.00	0.01
21	600325	华发股份	12,300	95,079.00	0.00
22	600079	人福医药	6,963	92,050.86	0.00
23	600138	中青旅	4,400	87,692.00	0.00

24	601168	西部矿业	13,922	87,430.16	0.00
25	600062	华润双鹤	3,500	85,925.00	0.00
26	603369	今世缘	3,500	79,905.00	0.00
27	600718	东软集团	6,100	79,666.00	0.00
28	600808	马钢股份	21,908	78,649.72	0.00
29	600260	凯乐科技	2,900	77,836.00	0.00
30	603444	吉比特	600	76,674.00	0.00
31	600643	爱建集团	7,900	74,260.00	0.00
32	600967	内蒙一机	5,800	73,892.00	0.00
33	600060	海信电器	5,500	73,645.00	0.00
34	600760	中航沈飞	2,000	72,080.00	0.00
35	600160	巨化股份	9,840	72,028.80	0.00
36	600388	龙净环保	5,478	70,008.84	0.00
37	600143	金发科技	13,410	70,000.20	0.00
38	600183	生益科技	7,634	69,927.44	0.00
39	600282	南钢股份	15,800	69,836.00	0.00
40	600750	江中药业	3,920	69,580.00	0.00
41	600572	康恩贝	9,600	68,832.00	0.00
42	600511	国药股份	2,536	68,345.20	0.00
43	600460	士兰微	5,500	67,100.00	0.00
44	600161	天坛生物	3,440	66,564.00	0.00
45	603883	老百姓	800	66,528.00	0.00
46	600642	申能股份	13,200	66,264.00	0.00
47	600655	豫园股份	7,000	66,150.00	0.00
48	603658	安图生物	800	65,968.00	0.00
49	600266	北京城建	7,000	65,800.00	0.00
50	600094	大名城	11,347	65,358.72	0.00
51	600380	健康元	5,500	65,230.00	0.00
52	600258	首旅酒店	2,400	65,208.00	0.00
53	600755	厦门国贸	8,800	64,152.00	0.00
54	600267	海正药业	4,400	63,976.00	0.00
55	600056	中国医药	3,500	63,945.00	0.00
56	600410	华胜天成	7,300	63,875.00	0.00
57	600348	阳泉煤业	8,800	62,920.00	0.00
58	600409	三友化工	7,300	62,853.00	0.00
59	600418	江淮汽车	9,597	62,476.47	0.00
60	600499	科达洁能	9,000	61,740.00	0.00
61	002422	科伦药业	1,900	60,990.00	0.00
62	600516	方大炭素	2,500	60,950.00	0.00
63	600875	东方电气	8,200	60,762.00	0.00
64	600787	中储股份	7,804	60,402.96	0.00
65	600978	宜华生活	8,791	60,042.53	0.00
66	603816	顾家家居	800	58,808.00	0.00
67	600291	西水股份	4,400	58,784.00	0.00

68	600125	铁龙物流	7,000	58,590.00	0.00
69	600240	华业资本	7,900	57,907.00	0.00
70	600839	四川长虹	20,200	57,772.00	0.00
71	600216	浙江医药	4,400	56,188.00	0.00
72	600729	重庆百货	1,700	56,015.00	0.00
73	600859	王府井	2,600	55,302.00	0.00
74	600528	中铁工业	5,400	55,188.00	0.00
75	600737	中粮糖业	7,300	55,042.00	0.00
76	600037	歌华有线	5,288	54,572.16	0.00
77	600270	外运发展	2,600	54,496.00	0.00
78	600466	蓝光发展	8,660	53,692.00	0.00
79	600500	中化国际	7,844	53,496.08	0.00
80	600970	中材国际	7,900	52,772.00	0.00
81	002410	广联达	1,900	52,687.00	0.00
82	600801	华新水泥	3,500	52,605.00	0.00
83	600635	大众公用	14,100	52,452.00	0.00
84	600179	安通控股	5,100	51,663.00	0.00
85	600575	皖江物流	13,906	51,591.26	0.00
86	601000	唐山港	21,724	51,051.40	0.00
87	002405	四维图新	2,500	50,625.00	0.00
88	600645	中源协和	2,600	50,076.00	0.00
89	600478	科力远	9,800	49,980.00	0.00
90	600435	北方导航	6,100	49,776.00	0.00
91	600835	上海机电	2,600	49,036.00	0.00
92	601678	滨化股份	7,860	48,574.80	0.00
93	600863	内蒙华电	21,014	47,701.78	0.00
94	600598	北大荒	5,200	47,632.00	0.00
95	600171	上海贝岭	4,100	47,478.00	0.00
96	600648	外高桥	2,588	47,308.64	0.00
97	600166	福田汽车	22,800	46,284.00	0.00
98	600717	天津港	6,100	45,933.00	0.00
99	000661	长春高新	200	45,540.00	0.00
100	601098	中南传媒	3,600	45,504.00	0.00
101	600614	鹏起科技	7,900	45,109.00	0.00
102	600623	华谊集团	4,500	44,910.00	0.00
103	600823	世茂股份	10,737	44,880.66	0.00
104	600664	哈药股份	11,300	44,861.00	0.00
105	603659	璞泰来	700	44,723.00	0.00
106	600503	华丽家族	11,400	44,574.00	0.00
107	600277	亿利洁能	8,500	44,540.00	0.00
108	600064	南京高科	6,038	44,318.92	0.00
109	600881	亚泰集团	11,700	43,641.00	0.00
110	600597	光明乳业	4,400	43,428.00	0.00
111	600039	四川路桥	13,200	43,296.00	0.00

112	603766	隆鑫通用	7,900	42,897.00	0.00
113	600827	百联股份	4,200	42,840.00	0.00
114	000830	鲁西化工	2,500	42,700.00	0.00
115	600557	康缘药业	3,431	42,372.85	0.00
116	600017	日照港	13,185	42,323.85	0.00
117	600895	张江高科	3,600	41,400.00	0.00
118	600908	无锡银行	7,000	41,230.00	0.00
119	601200	上海环境	2,590	40,999.70	0.00
120	600582	天地科技	11,161	40,960.87	0.00
121	600026	中远海能	9,600	40,704.00	0.00
122	600594	益佰制药	4,400	39,424.00	0.00
123	600098	广州发展	6,076	39,190.20	0.00
124	603868	飞科电器	800	38,696.00	0.00
125	600141	兴发集团	3,301	38,456.65	0.00
126	600563	法拉电子	777	38,453.73	0.00
127	600280	中央商场	4,400	38,368.00	0.00
128	000977	浪潮信息	1,600	38,160.00	0.00
129	603899	晨光文具	1,200	38,028.00	0.00
130	601966	玲珑轮胎	2,400	37,848.00	0.00
131	603515	欧普照明	800	37,392.00	0.00
132	603885	吉祥航空	2,400	36,984.00	0.00
133	002340	格林美	6,100	36,905.00	0.00
134	600649	城投控股	6,000	36,720.00	0.00
135	603000	人民网	4,400	36,520.00	0.00
136	002050	三花智控	1,900	35,815.00	0.00
137	603077	和邦生物	20,600	35,638.00	0.00
138	603228	景旺电子	719	35,547.36	0.00
139	002001	新和成	1,870	35,455.20	0.00
140	601717	郑煤机	6,100	35,441.00	0.00
141	002049	紫光国微	800	35,296.00	0.00
142	000786	北新建材	1,900	35,207.00	0.00
143	601016	节能风电	12,202	35,019.74	0.00
144	600545	卓郎智能	4,400	34,936.00	0.00
145	002078	太阳纸业	3,600	34,884.00	0.00
145	601179	中国西电	10,200	34,884.00	0.00
146	000418	小天鹅 A	500	34,675.00	0.00
147	600633	浙数文化	4,100	34,194.00	0.00
148	600422	昆药集团	4,400	34,100.00	0.00
149	600993	马应龙	2,000	34,020.00	0.00
150	601128	常熟银行	5,877	33,616.44	0.00
151	600580	卧龙电气	4,400	33,528.00	0.00
152	601311	骆驼股份	2,900	33,263.00	0.00
153	600416	湘电股份	4,600	33,074.00	0.00
154	600195	中牧股份	1,700	33,065.00	0.00

155	601689	拓普集团	1,700	33,048.00	0.00
156	600108	亚盛集团	11,400	32,946.00	0.00
157	600307	酒钢宏兴	15,600	32,760.00	0.00
158	600312	平高电气	5,800	32,712.00	0.00
159	600874	创业环保	3,500	32,690.00	0.00
160	600316	洪都航空	3,500	32,620.00	0.00
161	600611	大众交通	8,177	32,544.46	0.00
162	600021	上海电力	4,800	32,352.00	0.00
163	600329	中新药业	1,700	32,300.00	0.00
164	002271	东方雨虹	1,870	31,808.70	0.00
165	600366	宁波韵升	5,200	31,720.00	0.00
166	601928	凤凰传媒	5,200	31,616.00	0.00
167	600936	广西广电	6,600	31,416.00	0.00
168	603198	迎驾贡酒	1,700	31,229.00	0.00
169	002179	中航光电	800	31,200.00	0.00
170	600120	浙江东方	2,300	31,165.00	0.00
171	300253	卫宁健康	2,500	30,975.00	0.00
171	600565	迪马股份	10,500	30,975.00	0.00
172	600169	太原重工	13,200	30,888.00	0.00
173	600770	综艺股份	5,200	30,680.00	0.00
174	600073	上海梅林	4,581	30,417.84	0.00
175	002038	双鹭药业	800	30,392.00	0.00
176	601001	大同煤业	6,100	30,256.00	0.00
177	000998	隆平高科	1,600	30,176.00	0.00
178	600811	东方集团	7,013	30,155.90	0.00
179	000860	顺鑫农业	800	30,000.00	0.00
180	000066	中国长城	4,200	29,862.00	0.00
181	600578	京能电力	9,547	29,786.64	0.00
182	600754	锦江股份	800	29,568.00	0.00
183	002311	海大集团	1,400	29,540.00	0.00
184	300383	光环新网	2,200	29,502.00	0.00
185	601127	小康股份	1,700	29,393.00	0.00
186	002359	北讯集团	1,500	29,370.00	0.00
187	000656	金科股份	6,100	29,280.00	0.00
188	000690	宝新能源	4,200	29,232.00	0.00
189	601880	大连港	15,000	29,100.00	0.00
190	600058	五矿发展	3,500	29,085.00	0.00
191	600338	西藏珠峰	1,400	29,008.00	0.00
192	002092	中泰化学	3,000	28,920.00	0.00
193	000636	风华高科	1,800	28,584.00	0.00
194	000513	丽珠集团	650	28,567.50	0.00
195	600869	智慧能源	6,040	28,508.80	0.00
196	600151	航天机电	7,000	28,420.00	0.00
197	600395	盘江股份	4,600	27,922.00	0.00

198	603188	亚邦股份	2,700	27,540.00	0.00
199	002223	鱼跃医疗	1,400	27,286.00	0.00
200	002176	江特电机	2,800	27,216.00	0.00
201	000050	深天马 A	1,900	27,018.00	0.00
202	002127	南极电商	2,850	26,761.50	0.00
203	002384	东山精密	1,100	26,400.00	0.00
204	600765	中航重机	3,496	26,010.24	0.00
205	600694	大商股份	800	26,008.00	0.00
206	601699	潞安环能	2,800	25,928.00	0.00
207	603877	太平鸟	766	25,530.78	0.00
208	603556	海兴电力	1,400	25,438.00	0.00
209	000997	新大陆	1,600	25,200.00	0.00
210	600155	华创阳安	3,500	25,165.00	0.00
211	002013	中航机电	3,300	24,981.00	0.00
212	600971	恒源煤电	3,495	24,954.30	0.00
213	600438	通威股份	3,600	24,840.00	0.00
214	002371	北方华创	500	24,835.00	0.00
215	600006	东风汽车	6,044	24,719.96	0.00
216	002019	亿帆医药	1,400	24,710.00	0.00
217	000488	晨鸣纸业	1,900	24,548.00	0.00
218	000009	中国宝安	5,000	24,500.00	0.00
219	002195	二三四五	5,720	24,481.60	0.00
220	300088	长信科技	4,200	24,360.00	0.00
221	000581	威孚高科	1,100	24,321.00	0.00
222	600773	西藏城投	3,500	24,220.00	0.00
223	600566	济川药业	500	24,095.00	0.00
224	603355	莱克电气	800	24,040.00	0.00
225	002268	卫士通	1,100	24,013.00	0.00
226	603888	新华网	1,400	23,604.00	0.00
227	300166	东方国信	1,600	23,568.00	0.00
228	600317	营口港	10,400	23,504.00	0.00
229	600346	恒力股份	1,600	23,456.00	0.00
230	600259	广晟有色	800	23,424.00	0.00
231	600640	号百控股	2,300	23,391.00	0.00
232	002439	启明星辰	1,100	23,342.00	0.00
233	002408	齐翔腾达	1,900	23,332.00	0.00
234	601777	力帆股份	4,400	23,012.00	0.00
235	000681	视觉中国	800	22,960.00	0.00
236	000703	恒逸石化	1,540	22,915.20	0.00
237	601801	皖新传媒	3,000	22,830.00	0.00
238	000960	锡业股份	1,900	22,819.00	0.00
239	600757	长江传媒	4,000	22,760.00	0.00
240	002353	杰瑞股份	1,400	22,750.00	0.00
241	300182	捷成股份	3,000	22,740.00	0.00

242	000975	银泰资源	2,240	22,713.60	0.00
243	000930	中粮生化	2,200	22,660.00	0.00
244	600122	宏图高科	3,030	22,422.00	0.00
245	600777	新潮能源	10,200	22,338.00	0.00
246	000887	中鼎股份	1,550	22,335.50	0.00
247	000999	华润三九	800	22,264.00	0.00
248	000729	燕京啤酒	3,300	22,209.00	0.00
249	600657	信达地产	5,200	22,100.00	0.00
250	002506	协鑫集成	4,700	21,996.00	0.00
251	002183	怡亚通	3,300	21,945.00	0.00
252	600748	上实发展	4,339	21,868.56	0.00
253	601608	中信重工	8,400	21,840.00	0.00
254	002589	瑞康医药	1,600	21,824.00	0.00
255	603328	依顿电子	1,993	21,624.05	0.00
256	600428	中远海特	6,031	21,410.05	0.00
257	000732	泰禾集团	1,100	21,395.00	0.00
258	600458	时代新材	2,891	21,277.76	0.00
259	000039	中集集团	1,600	21,248.00	0.00
260	600639	浦东金桥	1,700	21,216.00	0.00
261	002640	跨境通	1,400	21,028.00	0.00
262	002373	千方科技	1,600	20,880.00	0.00
263	000981	银亿股份	2,800	20,860.00	0.00
264	600184	光电股份	1,670	20,691.30	0.00
265	002273	水晶光电	1,600	20,592.00	0.00
266	300058	蓝色光标	3,600	20,520.00	0.00
267	000528	柳工	1,900	20,349.00	0.00
268	600651	飞乐音响	5,200	20,280.00	0.00
269	000988	华工科技	1,400	20,230.00	0.00
270	603568	伟明环保	798	20,189.40	0.00
271	600187	国中水务	7,100	20,164.00	0.00
272	000778	新兴铸管	4,700	20,116.00	0.00
273	300324	旋极信息	2,107	19,995.43	0.00
274	300274	阳光电源	2,200	19,734.00	0.00
275	002407	多氟多	1,400	19,628.00	0.00
276	002670	国盛金控	1,821	19,612.17	0.00
277	002745	木林森	1,100	19,569.00	0.00
278	600300	维维股份	6,000	19,560.00	0.00
279	000401	冀东水泥	2,200	19,514.00	0.00
280	600996	贵广网络	2,600	19,292.00	0.00
281	002440	闰土股份	1,650	19,288.50	0.00
282	600517	置信电气	5,200	19,240.00	0.00
283	000089	深圳机场	2,500	19,125.00	0.00
284	002244	滨江集团	3,600	18,720.00	0.00
285	002030	达安基因	1,210	18,658.20	0.00

286	002221	东华能源	1,900	18,563.00	0.00
287	002028	思源电气	1,100	18,469.00	0.00
288	300055	万邦达	1,600	18,384.00	0.00
289	300115	长盈精密	1,400	18,158.00	0.00
290	000878	云南铜业	1,900	18,126.00	0.00
291	600743	华远地产	7,000	17,990.00	0.00
292	603225	新凤鸣	900	17,973.00	0.00
293	600862	中航高科	2,900	17,835.00	0.00
294	000970	中科三环	1,900	17,765.00	0.00
295	000596	古井贡酒	200	17,756.00	0.00
296	300197	铁汉生态	3,300	17,721.00	0.00
297	002491	通鼎互联	1,600	17,712.00	0.00
298	002665	首航节能	3,000	17,400.00	0.00
299	600393	粤泰股份	4,800	17,376.00	0.00
300	000078	海王生物	3,600	17,316.00	0.00
301	603806	福斯特	782	17,211.82	0.00
302	000547	航天发展	2,200	17,182.00	0.00
303	300010	立思辰	1,400	17,136.00	0.00
304	000598	兴蓉环境	4,200	17,052.00	0.00
305	300133	华策影视	1,600	17,040.00	0.00
306	002299	圣农发展	1,100	17,039.00	0.00
307	002281	光迅科技	800	16,960.00	0.00
308	002431	棕榈股份	2,500	16,775.00	0.00
309	002004	华邦健康	3,300	16,764.00	0.00
310	002358	森源电气	1,100	16,555.00	0.00
311	002152	广电运通	2,800	16,464.00	0.00
312	603056	德邦股份	600	16,434.00	0.00
313	002131	利欧股份	7,800	16,380.00	0.00
314	002573	清新环境	1,400	16,170.00	0.00
315	002583	海能达	1,900	15,865.00	0.00
316	300287	飞利信	2,200	15,818.00	0.00
317	000979	中弘股份	15,600	15,756.00	0.00
318	300199	翰宇药业	1,100	15,708.00	0.00
319	002366	台海核电	1,100	15,686.00	0.00
320	002285	世联行	2,500	15,675.00	0.00
321	002512	达华智能	1,600	15,520.00	0.00
322	603025	大豪科技	800	15,472.00	0.00
323	002603	以岭药业	1,100	15,378.00	0.00
324	300026	红日药业	4,200	15,330.00	0.00
325	002701	奥瑞金	2,800	15,288.00	0.00
326	600292	远达环保	2,600	15,262.00	0.00
327	300244	迪安诊断	800	15,208.00	0.00
328	000685	中山公用	1,900	15,143.00	0.00
329	600536	中国软件	700	15,141.00	0.00

330	002517	恺英网络	2,100	15,099.00	0.00
331	000848	承德露露	1,400	14,826.00	0.00
332	600350	山东高速	3,600	14,580.00	0.00
333	002477	雏鹰农牧	4,400	14,564.00	0.00
334	002368	太极股份	500	14,535.00	0.00
335	000031	中粮地产	2,500	14,450.00	0.00
336	002280	联络互动	2,500	14,300.00	0.00
337	002191	劲嘉股份	1,900	14,193.00	0.00
338	002242	九阳股份	800	14,152.00	0.00
339	300113	顺网科技	800	13,928.00	0.00
340	002390	信邦制药	1,900	13,908.00	0.00
341	000027	深圳能源	2,800	13,832.00	0.00
342	600618	氯碱化工	1,625	13,828.75	0.00
343	600481	双良节能	4,500	13,770.00	0.00
344	002635	安洁科技	800	13,760.00	0.00
345	600053	九鼎投资	800	13,736.00	0.00
346	002505	大康农业	6,400	13,696.00	0.00
347	002400	省广集团	4,200	13,566.00	0.00
348	002266	浙富控股	3,600	13,500.00	0.00
349	300159	新研股份	1,900	13,452.00	0.00
350	002056	横店东磁	1,900	13,319.00	0.00
351	000718	苏宁环球	3,600	13,212.00	0.00
352	603169	兰石重装	2,600	13,026.00	0.00
353	000807	云铝股份	2,500	12,950.00	0.00
354	000006	深振业 A	2,200	12,892.00	0.00
355	601231	环旭电子	1,400	12,698.00	0.00
356	002128	露天煤业	1,400	12,684.00	0.00
357	601969	海南矿业	2,300	12,604.00	0.00
358	000758	中色股份	2,800	12,600.00	0.00
359	002233	塔牌集团	1,100	12,584.00	0.00
360	000012	南玻 A	2,530	12,523.50	0.00
361	002254	泰和新材	1,100	12,518.00	0.00
362	300002	神州泰岳	3,000	12,510.00	0.00
363	300001	特锐德	1,100	12,496.00	0.00
364	000667	美好置业	5,800	12,354.00	0.00
365	002250	联化科技	1,400	12,348.00	0.00
366	002332	仙琚制药	1,400	12,250.00	0.00
367	000563	陕国投 A	3,600	12,240.00	0.00
368	603569	长久物流	857	12,237.96	0.00
369	300257	开山股份	800	12,232.00	0.00
370	002444	巨星科技	1,100	12,111.00	0.00
371	002249	大洋电机	2,800	12,068.00	0.00
372	000727	华东科技	6,400	12,032.00	0.00
373	600167	联美控股	1,200	12,000.00	0.00

374	002690	美亚光电	500	11,920.00	0.00
375	300376	易事特	2,200	11,814.00	0.00
376	002437	誉衡药业	1,900	11,780.00	0.00
377	002308	威创股份	1,400	11,620.00	0.00
378	002064	华峰氨纶	2,800	11,564.00	0.00
379	000926	福星股份	1,600	11,504.00	0.00
380	300297	蓝盾股份	1,400	11,354.00	0.00
381	002354	天神娱乐	1,200	11,112.00	0.00
382	601020	华钰矿业	800	11,032.00	0.00
383	000543	皖能电力	2,500	11,025.00	0.00
384	000158	常山北明	1,600	10,992.00	0.00
385	000712	锦龙股份	1,100	10,978.00	0.00
386	002544	杰赛科技	800	10,952.00	0.00
387	002155	湖南黄金	1,600	10,944.00	0.00
388	000400	许继电气	1,400	10,934.00	0.00
389	000021	深科技	1,600	10,912.00	0.00
390	600587	新华医疗	800	10,904.00	0.00
391	000519	中兵红箭	1,400	10,878.00	0.00
392	600126	杭钢股份	1,819	10,859.43	0.00
393	600848	上海临港	500	10,835.00	0.00
394	002807	江阴银行	1,900	10,678.00	0.00
395	002277	友阿股份	2,300	10,603.00	0.00
396	002463	沪电股份	2,800	10,472.00	0.00
396	002672	东江环保	800	10,472.00	0.00
397	000090	天健集团	1,680	10,416.00	0.00
398	002032	苏泊尔	200	10,300.00	0.00
399	000937	冀中能源	2,500	10,275.00	0.00
400	000592	平潭发展	3,600	10,224.00	0.00
401	002375	亚厦股份	1,900	10,146.00	0.00
402	000426	兴业矿业	1,400	10,094.00	0.00
403	600687	刚泰控股	1,100	9,999.00	0.00
404	000028	国药一致	200	9,980.00	0.00
405	000612	焦作万方	1,900	9,975.00	0.00
406	002048	宁波华翔	800	9,864.00	0.00
407	000501	鄂武商 A	800	9,832.00	0.00
408	000062	深圳华强	500	9,800.00	0.00
409	002123	梦网集团	1,100	9,779.00	0.00
410	002434	万里扬	1,100	9,658.00	0.00
411	601019	山东出版	1,200	9,612.00	0.00
412	000572	海马汽车	2,800	9,604.00	0.00
413	002011	盾安环境	1,500	9,600.00	0.00
414	600917	重庆燃气	1,400	9,534.00	0.00
415	002681	奋达科技	1,100	9,526.00	0.00
416	300273	和佳股份	1,400	9,492.00	0.00

417	002022	科华生物	800	9,480.00	0.00
418	002345	潮宏基	1,100	9,460.00	0.00
419	000877	天山股份	1,400	9,450.00	0.00
420	000587	金洲慈航	1,900	9,424.00	0.00
421	002063	远光软件	1,100	9,306.00	0.00
422	300039	上海凯宝	1,600	9,280.00	0.00
423	000552	靖远煤电	2,800	9,156.00	0.00
424	002251	步步高	800	9,104.00	0.00
425	002489	浙江永强	2,500	9,100.00	0.00
426	600059	古越龙山	1,100	8,965.00	0.00
427	000600	建投能源	1,600	8,912.00	0.00
428	000969	安泰科技	1,400	8,750.00	0.00
429	002269	美邦服饰	3,000	8,700.00	0.00
430	000061	农产品	1,600	8,640.00	0.00
430	002707	众信旅游	900	8,640.00	0.00
431	002428	云南锗业	1,100	8,492.00	0.00
432	002317	众生药业	800	8,456.00	0.00
433	002482	广田集团	1,400	8,358.00	0.00
434	002276	万马股份	1,400	8,176.00	0.00
435	000541	佛山照明	1,350	8,086.50	0.00
436	002106	莱宝高科	1,400	8,064.00	0.00
437	000829	天音控股	1,100	8,063.00	0.00
438	002073	软控股份	1,400	8,050.00	0.00
439	300147	香雪制药	1,100	7,931.00	0.00
440	002657	中科金财	500	7,920.00	0.00
441	600284	浦东建设	1,619	7,900.72	0.00
442	002118	紫鑫药业	1,100	7,865.00	0.00
443	001696	宗申动力	1,600	7,840.00	0.00
444	000652	泰达股份	2,500	7,800.00	0.00
445	601811	新华文轩	800	7,776.00	0.00
446	002709	天赐材料	200	7,708.00	0.00
447	000762	西藏矿业	800	7,704.00	0.00
448	002503	搜于特	2,200	7,700.00	0.00
449	000680	山推股份	2,200	7,568.00	0.00
450	000777	中核科技	800	7,472.00	0.00
451	002663	普邦股份	2,500	7,425.00	0.00
452	002261	拓维信息	1,600	7,360.00	0.00
453	002642	荣之联	800	7,352.00	0.00
454	002588	史丹利	1,400	7,252.00	0.00
455	300134	大富科技	800	7,152.00	0.00
456	000990	诚志股份	500	7,000.00	0.00
457	600894	广日股份	1,180	6,997.40	0.00
458	000099	中信海直	1,100	6,996.00	0.00
459	603377	东方时尚	500	6,925.00	0.00

460	600939	重庆建工	1,400	6,916.00	0.00
461	600826	兰生股份	500	6,785.00	0.00
462	000897	津滨发展	3,000	6,780.00	0.00
463	601002	晋亿实业	1,100	6,721.00	0.00
464	002414	高德红外	500	6,720.00	0.00
465	000025	特力 A	200	6,434.00	0.00
466	002479	富春环保	1,100	6,215.00	0.00
467	300032	金龙机电	1,100	6,171.00	0.00
468	002093	国脉科技	800	6,168.00	0.00
469	601872	招商轮船	1,700	6,137.00	0.00
470	300116	坚瑞沃能	2,200	6,072.00	0.00
471	002342	巨力索具	1,600	6,064.00	0.00
472	000806	银河生物	1,400	6,062.00	0.00
473	002325	洪涛股份	1,600	5,920.00	0.00
474	600628	新世界	800	5,744.00	0.00
475	000049	德赛电池	200	5,644.00	0.00
476	300291	华录百纳	800	5,640.00	0.00
477	002416	爱施德	960	5,635.20	0.00
478	300043	星辉娱乐	1,400	5,600.00	0.00
479	002041	登海种业	800	5,456.00	0.00
480	002392	北京利尔	1,600	5,440.00	0.00
481	002344	海宁皮城	1,100	5,346.00	0.00
482	600776	东方通信	1,100	5,324.00	0.00
483	002818	富森美	200	5,276.00	0.00
484	300202	聚龙股份	500	5,215.00	0.00
485	000693	*ST 华泽	1,500	4,965.00	0.00
486	002551	尚荣医疗	800	4,920.00	0.00
487	000761	本钢板材	1,100	4,444.00	0.00
488	000662	天夏智慧	650	4,179.50	0.00
489	000816	*ST 慧业	2,500	4,000.00	0.00
490	603528	多伦科技	500	3,970.00	0.00
491	000987	越秀金控	500	3,930.00	0.00
492	000536	华映科技	1,400	3,850.00	0.00
493	002190	成飞集成	200	3,418.00	0.00
494	002122	*ST 天马	1,600	3,232.00	0.00
495	002815	崇达技术	200	3,220.00	0.00
496	002018	*ST 华信	2,200	3,190.00	0.00
497	600289	*ST 信通	1,100	2,662.00	0.00
498	603001	奥康国际	200	2,382.00	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	4,702,597.53	0.31
2	603019	中科曙光	4,417,578.00	0.29
3	600426	华鲁恒升	4,140,877.00	0.27
4	600516	方大炭素	3,940,088.00	0.26
5	600521	华海药业	3,826,163.40	0.25
6	600584	长电科技	3,760,484.48	0.25
7	600525	长园集团	3,746,758.42	0.25
8	600176	中国巨石	3,493,873.40	0.23
9	600298	安琪酵母	3,433,731.00	0.23
10	600315	上海家化	3,390,034.08	0.22
11	600004	白云机场	3,338,420.40	0.22
12	600872	中炬高新	3,330,084.25	0.22
13	603589	口子窖	3,292,359.92	0.22
14	600600	青岛啤酒	3,214,524.00	0.21
15	601233	桐昆股份	3,140,129.92	0.21
16	600879	航天电子	3,123,933.00	0.21
17	600256	广汇能源	3,115,703.80	0.21
18	600642	申能股份	3,109,032.71	0.20
19	600673	东阳光科	3,086,097.00	0.20
20	600885	宏发股份	3,080,026.73	0.20

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	600516	方大炭素	2,059,146.00	0.14
2	600176	中国巨石	1,507,952.00	0.10
3	600201	生物股份	1,487,517.00	0.10
4	603019	中科曙光	1,471,549.00	0.10
5	600426	华鲁恒升	1,263,741.00	0.08
6	600521	华海药业	1,263,619.08	0.08
7	600584	长电科技	1,246,039.00	0.08
8	603589	口子窖	1,207,861.14	0.08
9	600315	上海家化	1,196,823.74	0.08
10	600438	通威股份	1,164,236.00	0.08

11	600298	安琪酵母	1,101,805.81	0.07
12	600004	白云机场	1,083,992.00	0.07
13	600600	青岛啤酒	1,081,867.00	0.07
14	601233	桐昆股份	1,036,363.00	0.07
15	600642	申能股份	1,013,467.94	0.07
16	600872	中炬高新	1,004,732.00	0.07
17	600079	人福医药	982,226.00	0.06
18	600260	凯乐科技	977,962.00	0.06
19	600885	宏发股份	966,880.00	0.06
20	600879	航天电子	958,803.00	0.06

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

买入股票成本（成交）总额	362,917,013.29
卖出股票收入（成交）总额	116,957,804.22

7.6 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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
IC1807	IC1807	20.00	20,752,000.00	-498,458.54	-
IC1808	IC1808	75.00	77,133,000.00	1,304,640.00	-
公允价值变动总额合计					806,181.46
股指期货投资本期收益					-3,813,799.05
股指期货投资本期公允价值变动					-346,848.57

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	20,933,893.09
2	应收证券清算款	701,850.73
3	应收股利	-
4	应收利息	44,941.86
5	应收申购款	2,059,051.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	5,584,554.14
9	合计	29,324,291.73

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	67,250	13,979.64	39,771,806.14	4.23%	900,359,210.03	95.77%
广发中证 500ETF 联接(LOF)C	40,437	23,864.73	868,079,538.42	89.95%	96,938,462.75	10.05%
合计	107,687	17,691.54	907,851,344.56	47.65%	997,297,672.78	52.35%

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	3.02%
2	钱慎	530,000.00	2.67%
3	蔡静岚	459,734.00	2.32%

4	赵宪扬	323,590.00	1.63%
5	郑卓权	300,024.00	1.51%
6	吴本明	300,018.00	1.51%
7	张敬忠	300,009.00	1.51%
8	姚芝珍	291,320.00	1.47%
9	洪桂芳	274,200.00	1.38%
10	赵天相	260,000.00	1.31%

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	1,176,939.32	0.1252%
	广发中证 500ETF 联接 (LOF)C	121,768.13	0.0126%
	合计	1,298,707.45	0.0682%

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、基金投资和相关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	0~10
	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	933,114,966.50	260,984,644.03
本报告期基金总申购份额	118,898,239.12	1,953,713,316.64
减：本报告期基金总赎回份额	111,882,189.45	1,249,679,959.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	940,131,016.17	965,018,001.17

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
广发证券	8	352,282,730.85	73.41%	328,084.14	77.86%	-
方正证券	7	127,578,316.66	26.59%	93,298.15	22.14%	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
中银国际	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-

华鑫证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中泰证券	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
首创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

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。

10.8 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关于增加嘉实财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-08
2	广发基金管理有限公司关于增加金惠家为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-10
3	广发基金管理有限公司关于增加海银基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-12
4	广发基金管理有限公司关于增加众升财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
5	广发基金管理有限公司关于增加中信建投期货为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
6	广发基金管理有限公司关于增加浙商证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
7	广发基金管理有限公司关于增加浙江金观诚为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
8	广发基金管理有限公司关于增加宜信普泽为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
9	广发基金管理有限公司关于增加泰诚财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
10	广发基金管理有限公司关于增加世纪证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
11	广发基金管理有限公司关于增加泉州银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
12	广发基金管理有限公司关于增加民族证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
13	广发基金管理有限公司关于增加江南农商行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
14	广发基金管理有限公司关于增加恒天明泽为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
15	广发基金管理有限公司关于增加方正证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-19
16	广发基金管理有限公司关于增加中山证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
17	广发基金管理有限公司关于增加西南证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
18	广发基金管理有限公司关于增加国联证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
19	广发基金管理有限公司关于增加东兴证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
20	广发基金管理有限公司关于增加德州银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
21	广发基金管理有限公司关于增加北京钱景基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-01-26
22	广发基金管理有限公司关于增加万联证券为	《中国证券报》、《证券时	2018-01-31

	旗下部分基金销售机构的公告	报》、《上海证券报》	
23	广发基金管理有限公司关于增加挖财基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-02-05
24	广发基金管理有限公司关于增加中正达广为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-02-05
25	广发基金管理有限公司关于增加厦门银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-02-06
26	广发基金管理有限公司关于增加佳泓（北京）为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-02
27	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在华信证券开通转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-07
28	广发基金管理有限公司关于增加上海证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-13
29	广发基金管理有限公司关于增加东莞农商行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-16
30	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）修改基金合同的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22
31	广发基金管理有限公司关于增加国泰君安为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类份额销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-23
32	广发基金管理有限公司关于增加国泰君安证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-29
33	广发基金管理有限公司关于增加渣打银行为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类(LOF)销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-04-02
34	广发基金管理有限公司关于增加华泰证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-04-04
35	广发基金管理有限公司关于增加华金证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-05-15
36	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金实施销售服务费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-05-15
37	广发基金管理有限公司关于增加西安银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-05-16
38	广发基金管理有限公司关于增加信诚基金销售为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-05-25
39	广发基金管理有限公司关于增加上海银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-05-28
40	广发基金管理有限公司关于增加华融湘江银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-06-01
41	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销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-06-13
42	广发基金管理有限公司关于增加江苏银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-06-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180129-20180426	0.00	369,139,904.02	369,139,904.02	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

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>。

广发基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日