广发中证500交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

广发基金管理有限公司
二〇一三年五月二十一日

一、重要声明与提示

《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,广发中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人广发基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读刊登在《中国证券报》等报刊及广发基金管理有限公司网站(www.gffunds.com.cn)上的《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:广发中证500交易型开放式指数证券投资基金
2、基金二级市场交易简称:广发500
3、二级市场交易代码:510510
4、基金申购、赎回简称:广发500
5、申购、赎回代码:510511
6、截至公告日前两个工作日即2013年5月17日基金份额总额:425,038,319.00份
7、截至公告日前两个工作日即2013年5月17日基金份额净值:1.0440元
8、本次上市交易份额:425,038,319.00份
9、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
10、上市交易日期:2013年5月24日
11、基金管理人:广发基金管理有限公司
12、基金托管人:中国工商银行股份有限公司
13、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”):广发证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2013年2月17日证监许可[2013]165号。
2、基金运作方式:交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:本基金自2013年3月18日至2013年3月29日进行发售。投资者可选择网下现金认购、网下股票认购和网上现金认购3种方式。其中,网下现金和网下股票认购的日期为2013年3月18日至2013年3月29日,网上现金认购的日期为2013年3月27日至2013年3月29日。
5、发售价格:人民币1.00元。
6、发售期限:网下现金认购10个工作日,网下股票认购10个工作日,网上现金认购3个工作日。
7、发售方式:投资者可选择网下现金认购、网下股票认购和网上现金认购3种方式。
8、发售机构:
①直销机构
投资者可以通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。
②代销机构
同时办理本基金的网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构:安信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司。
网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司:爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万和证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、国开证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、开源证券有限责任公司等代理销售机构。
上述销售机构排名不分先后。
(二)基金合同生效
本基金根据中国证监会证监许可[2013]165号文批准,自2013年3月18日起公开募集,截止2013年3月29日,基金募集工作已顺利结束。经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次募集的有效净认购金额为425,036,920.00元人民币(含募集股票),经基金注册登记人计算并确认的认购资金在募集期间的利息为1,399.00元人民币。本次募集所有资金已于2013年4月8日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购总户数为3,122户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算,募集期募集金额(含所募集股票市值)及利息结转的基金份额共计425,038,319.00份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人广发基金管理有限公司基金从业人员没有认购本基金。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
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》以及《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,于2013年4月11日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。
(三)基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所上证基字[2013]122号
2、上市交易日期:2013年5月24日
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
4、基金二级市场交易简称:广发500
5、二级市场交易代码:510510
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易
6、基金申购、赎回简称:广发500
7、申购、赎回代码:510511
投资者应当在本基金指定的一级交易商(申购赎回代理券商)办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。
目前本基金的一级交易商包括:广发证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司。
上述排名不分先后。本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商,并及时公告。
8、本次上市交易份额:425,038,319.00份
9、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2013年5月17日,本基金份额持有人户数为3,122户,平均每户持有的基金份额为136,142.96份。
(二)持有人结构
截至2013年5月17日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的基金份额为213,118,606.00份,占基金总份额的50.14%;个人投资者持有的基金份额为211,919,713.00份,占基金总份额的49.86%。
(三)前十名基金份额持有人情况
截至2013年5月17日,前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额的比例(%)
1	中信证券投资有限公司	81,550,000.00	19.19%
2	昆仑健康保险股份有限公司-万能保险产品	29,481,480.00	6.94%
3	丁碧霞	26,001,000.00	6.12%
4	未来资产基金管理有限公司-未来资产中国A股股票型母投资信托	18,000,000.00	4.23%
5	陈蠡	12,277,240.00	2.89%
6	未来资产基金管理有限公司-未来资产中国A股优势股票型母投资信托	12,000,000.00	2.82%
7	中信证券股份有限公司	11,650,000.00	2.74%
8	昆仑健康保险股份有限公司-传统保险产品	10,584,000.00	2.49%
9	中信建投证券股份有限公司	10,302,622.00	2.42%
10	光大证券股份有限公司	10,014,825.00	2.36%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、名称:广发基金管理有限公司
2、法定代表人:王志伟
3、总经理:林传辉
4、注册资本:1.2亿元人民币
5、注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
6、办公地址:广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33层
7、设立批准文号:中国证监会证监基字[2003]91号
8、工商登记注册的法人营业执照文号:440000000011836
9、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
10、股权结构:广发证券股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、烽火通信科技股份有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司,分别持有本基金管理人48.33%、16.67%、16.67%、10%和8.33%的股权。
11、内部组织结构及职能:

委员会名称	职责
投资决策委员会	决定公募基金的投资理念、投资准则;研判市场时机,审议公募基金经理提交的投资产配置报告,确定公募基金资产配置比例;评估并审定公募基金投资策略及拟重点投资的证券;对委员会决议的执行情况进行监督等。
风险控制委员会	负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程,确保公司整体风险的识别、监控和管理;负责检查风险控制制度的落实情况,审阅公司各项风险与内控状况评价报告;针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况,组成危机处理小组,评估事件风险,制定危机处理方案并监督实施等。
部门名称	职能定位
投资管理部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究发展部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
机构投资部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
量化投资部	负责主动型量化基金产品及资产的研究和投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责QDII基金的投资管理
数量投资部	被动型指数基金产品及资产的研究和投资管理
金融工程部	负责产品开发、设计、报批工作,公司发展规划研究
市场拓展部	负责公募基金、一对多专户理财产品的募集与持续销售、营销推广、宣传信披工作,下设北京、上海、广州三个分公司。
电商及客服部	负责客户服务工作及通过网络渠道销售基金包括电子商务平台策划、建设、推广、运营等,下设深圳、杭州两个理财中心
机构理财部	负责企业年金、“一对一”专户理财业务、机构业务的市场开拓与服务
综合管理部	负责行政管理与后勤保障
财务部	负责公司财务管理工作
人力资源部	负责人力资源管理
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理,投资风险监控与业绩归因分析
中央交易部	负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控等
信息技术部	负责公司信息化建设工作
注册登记部	负责开放式基金和资产管理计划份额的登记存管和资金的清算管理
基金会计部	负责开放式基金、年金资产和资产管理计划的核算及相关信息披露工作
北京办事处	负责协调办理公司在京有关事项。

12、人员情况:
截止到2013年3月末,我公司共有员工260人,博士17人、硕士147人、本科81人、其他15人。
13、信息披露负责人:段西军
咨询电话:95105828(免长途费)
14、基金管理业务情况简介:
截至2012年12月31日,公司管理着28只证券投资基金、多个企业年金及特定客户资产管理专户,管理的公募基金资产总规模达1131.03亿元。
15、本基金经理简介
陈盛业,男,中国籍,经济学博士,持有证券业执业证书,6年基金从业经历,2007年3月至2009年9月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管,2009年9月至2010年8月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理,2010年8月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作,2010年12月1日起任本基金及广发中证500指数(LOF)基金的基金经理,2013年4月11日起任广发中证500ETF基金的基金经理。
(二)基金托管人
1、基金托管人概况
名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
成立时间:1984年1月1日
批准设立机关和批准设立文号:国务院(关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》国发[1983]146号)
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币349,018,545,827元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3号
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军
2、主要人员情况
截至2013年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工163人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
3、基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年3月,中国工商银行共托管证券投资基金305只,其中封闭式10只,开放式295只。自2003年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的37项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。
(三)一级交易商
1、名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87557985
客服电话:95575或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn
2、名称:东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:安岩岩
联系电话:0431-85096517
开放式基金咨询电话:4006000686:0431-85096733
开放式基金业务传真:0431-85096795
公司网站:www.nesc.cn
3、名称:东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
公司网站:www.dwzq.com.cn
4、名称:广州证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn
6、名称:齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
办公地址:济南市经七路86号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
公司网站:www.qlzq.com.cn
7、名称:中银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
联系人:曹晔
电话:021-33388215
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
电话委托电话:021-962505
公司网站:www.sywg.com
8、名称:万联证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
开放式基金咨询电话:400-888-133
开放式基金接收传真:020-22373718-1013
联系人:罗创斌
联系电话:020-37865070
公司网站:www.wlzq.com.cn
9、名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:4008-096-096
公司网站:www.swsc.com.cn
10、名称:中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:田薇
电话:010-66568430
传真:010-66568990
客服电话:4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。
公司网站:www.chinastock.com.cn
11、名称:中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-60833722
传真:010-60833739
客服电话:95558
公司网站:www.citics.com
12、名称:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:400-8888-108
传真:010-65182261
客服电话:400-8888-108
公司网站:www.csc108.com
13、名称:中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
联系人:王霈霈
电话:0571-86078823
客服电话:95548
(五)验资机构
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯卿
联系人:黄晓霞
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:黄晓霞、余志亮

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金2013年5月17日资产负债表如下:

资产	期末余额(元)	负债和所有者权益	期末余额(元)
资产:		负债:	
银行存款	6,217,309.67	短期借款	-
结算备付金	3,952,688.29	交易性金融负债	-
存出保证金	79,984.81	衍生金融负债	-
交易性金融资产	433,907,274.00	卖出回购金融资产款	-
其中:股票投资	433,907,274.00	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	98,391.77
基金投资	-	应付托管费	19,678.34
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	448,286.50
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	159,782.60	应付利息	-
应收股利	57,549.19	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	47,279.47
其他资产	-	负债合计	613,636.08
		所有者权益:	
		实收基金	425,038,319.00
		未分配利润	18,722,633.48
		所有者权益合计	443,760,952.48
资产合计:	444,374,588.56	负债与持有人权益总计:	444,374,588.56

附注:本基金发行在外的基金份额为425,038,319.00份,基金份额净值为1.0440元。

八、基金投资组合

截止到2013年5月17日,本基金的投资组合如下:
(一)基金资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占基金资产总值比重(%)
股 票	433,907,274.00	97.64
债 券	-	-
银行存款及清算备付金合计	10,169,997.96	2.29
其他资产	297,316.60	0.07
资产总值	444,374,588.56	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

项目名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	6,454,714.28	1.45
B 采矿业	8,997,758.35	2.03
C 制造业	259,887,473.58	58.56
D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业	21,761,536.53	4.90
E 建筑业	12,550,429.63	2.83
F 批发和零售业	23,600,323.98	5.32
G 交通运输、仓储和邮政业	12,596,939.05	2.84
H 住宿和餐饮业	409,425.00	0.09
I 信息传输、软件和信息技术服务业	23,093,690.63	5.20
J 金融业	3,938,548.20	0.89
K 房地产业	37,323,095.20	8.41
L 租赁和商务服务业	5,384,930.10	1.21
M 科学研究和技术服务业	2,254,550.00	0.51
N 水利、环境和公共设施管理业	5,306,494.90	1.20
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生和社会工作业	-	-
R 文化、体育和娱乐业	8,420,448.57	1.90
S 综合	1,926,916.00	0.43
合计	433,907,274.00	97.78

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	市值占净值比(%)
000826	桑德环境	99529	3,493,467.90	0.79
002230	科大讯飞	84418	3,304,964.70	0.74
002450	康得新	120500	3,107,695.00	0.70
000400	许继电气	101330	3,084,485.20	0.70
000503	海虹控股	185304	3,048,250.80	0.69
000598	兴蓉投资	461900	2,757,543.00	0.62
000661	长春高新	27087	2,703,282.60	0.61
600079	人福医药	101708	2,640,339.68	0.60
002456	欧菲光	47900	2,620,130.00	0.59
000917	电广传媒	183299	2,474,536.50	0.56

(四)按券种分类的债券投资组合
截至2013年5月17日,本基金未持有债券。
(五)按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细
截至2013年5月17日,本基金未持有债券。
(六)投资组合报告附注
①本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。
②本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
③其他资产:

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	79,984.81
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	159,782.60
4	应收股利	57,549.19
合计		297,316.60

④本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2013年5月17日,本基金未持有可转换债券。
⑤按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细
截至2013年5月17日,本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

无。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。
(二)根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

十二、备查文件目录

(一)中国证监会核准广发中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
(二)《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(四)《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件和营业执照
(七)基金托管人业务资格批件和营业执照
风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

广发基金管理有限公司
二〇一三年五月二十一日

附件:基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
(一)基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
①依法募集基金;
②自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
③依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
④销售基金份额;
⑤召集基金份额持有人大会;
⑥依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
⑦在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
⑧选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
⑨担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
⑩依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
⑪在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
⑫依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
⑬在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
⑭以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
⑮选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
⑯在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;
⑰在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
⑱法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
①依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
②办理基金备案手续;
③自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
⑥除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
⑦保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
⑧按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
⑨保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;
⑩复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价;
⑪办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
⑫对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
⑬保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
⑭建立并保存基金份额持有人名册;
⑮按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
⑯依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价;
⑰依据《基法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
⑱按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;
⑲参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
⑳面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;
㉑因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
㉒按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
㉓执行生效的基金份额持有人大会的决定;
㉔法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
(二)基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
①自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
②依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
③监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
④根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算;
⑤提议召开或召集基金份额持有人大会;
⑥在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
⑦法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:
①以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
②设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
③建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
④除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
⑤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
⑥按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
⑦保守基金商业秘密,除《基法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;
⑧复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价;
⑨办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
⑩对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
⑪保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
⑫建立并保存基金份额持有人名册;
⑬按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
⑭依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价;
⑮依据《基法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
⑯按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;
⑰参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
⑱面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金管理人;
⑲因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
⑳监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基