广发制造业精选股票型证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发制造业精选股票
基金主代码	270028
交易代码	270028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	151,007,947.76份
投资目标	通过深入的研究,精选制造行业的优质上市公司进行投资,在严格控制风险的前提下,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,本基金投资组合的比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%。本基金管理人将根据宏观经济研究员对宏观经济形势的研究,策略研究员对市场运行趋势的研究,以及行业研究员对行业与上市公司投资价值的研究,综合考虑基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例,并定期或不定期地进行调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:80%×申银万国制造业指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	16,089,789.04
2.本期利润	14,716,793.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.1062
4.期末基金资产净值	181,803,884.48
5.期末基金份额净值	1.204

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

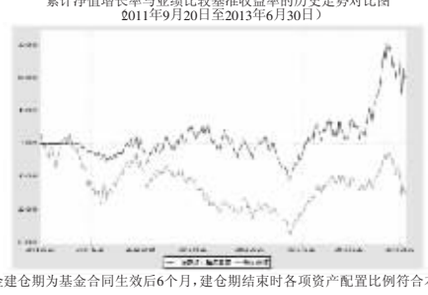
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.56%	1.89%	-2.40%	1.34%	16.96%	0.55%

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

广发制造业精选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年9月20日至2013年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李巍	本基金的基金经理	2011-9-20	-	8	男,中国籍,理学硕士,持有证券业执业资格证书,2005年7月至2010年6月任职于广发证券股份有限公司,2010年7月起在广发基金管理有限公司投资管理部工作,2011年9月20日起任广发制造业精选股票基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发制造业精选股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度,A股市场依然呈现结构分化明显的特点。上证综指与深证成指在本季度前半段小幅反弹后,于后半段大幅下跌,而创业板指数则始终保持强势,持续创年内新高。全季上证综指、深证成指、中小板指数和申万制造业指数涨幅分别为-11.51%、-13.45%、-3.42%、-3.24%。

年初之际,投资者本来普遍预期中国经济将持续复苏,分歧不过是"强复苏"还是"弱复苏"。随着3月开工旺季到来,PMI、发电量、铁路货运量、中长期贷款及系列草根调研等证据纷纷表明,经济复苏程度非常弱,投资者的分歧从"强弱"变成"有无"。4-6月的宏观数据则一路加剧并印证了这种担忧,站在目前时点,我们几可确定,始于去年4季度的本轮经济复苏已经夭折。在地产和基建投资的拉动下,投资增速依然保持在20%左右的高位,但考虑到国内严重的产能过剩和地方融资平台受限,未来趋势并不乐观;消费依然不温不火;出口数据表面看来不错,但其中有相当部分来自以外汇套利为目的的虚假贸易,在5月底外管局加强了相应监管后,外贸增速在6月环比大幅下滑。如此背景下,与宏观经济关联度极高的主板指数表现不佳也就在情理之中了,煤炭、水泥等强周期性板块成为上半年表现最差的行业。时至6月初,银行间市场"钱荒"爆发,可以认为是国内金融机构过度杠杆化、利用期限错配套利等深层次问题的一次集中爆发,也某种程度表明新的中央领导层对经济下滑容忍度的提升、对改革转型的决心很大,于是投资者进一步担心高利率会传导至实体经济并在随后爆发债务危机引致宏观经济失速下滑,主板指数再次经历一轮快速下跌。与之形成鲜明对比的是创业板指数,其背后的逻辑在于中国经济的转型与改革其实在08年金融危机之后已经悄然开始,虽然过去两年宏观增速一路下滑,但那些符合转型方向的行业,如消费电子、环保、医药、能源装备、智慧城市、文化传媒等,始终保持较高的景气度,且诞生了很多龙头企业引领行业发展,创业板的持续强势正在于有这样一批企业保持了业绩的持续快速增长。

本报告期内,本基金及时调整策略,加大了对符合转型与改革方向的高景气度行业的配置,如消费电子、能源装备、安防设备、智能电网、led、环保设备等,取得了不错的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

全季基金净值上涨14.56%,跑赢基准的1.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点展望下半年,宏观经济增速持续走低,流动性确定不如上半年宽松,美国经济持续复苏带来巨大资金回流压力,IPO重启,整个市场似乎被利空充斥。尽管如此,我们始终保持着对A股市场的希望,无论是中国经济还是A股市场,确实面临着很多中长期问题,但切不可将其短期化,"不发生系统性风险"应是新一届中央领导层在解决问题的过程中主导思想,这也就意味着在经济寻底的过程绝非持续向下,在波动中总会有机会存在。

对强周期性行业,我们将采取谨慎回避的态度。对于符合经济转型方向、高景气度行业中的优质公司,考虑到过去半年涨幅已经较大、估值已经偏高、且业绩预期已经较充分,未来一个季度难再有绝对收益,我们可能会适当减持,同时增加汽车、家电等低估值行业的配置。当然,组合的整体配置方向仍将是制造业中的优质成长股,毕竟这些行业和公司代表了中国经济未来的发展方向。

13年3季度,我们会采取相对谨慎的操作策略,无论是仓位上还是行业配置上,希望为持有人带来较好的收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	147,184,770.38	79.18
	其中:股票	147,184,770.38	79.18
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	27,790,966.89	14.95
6	其他各项资产	10,904,939.19	5.87
7	合计	185,880,676.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	125,183,270.38	68.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,831,500.00	6.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,421,000.00	2.98
M	科学研究和技术服务业	870,400.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,878,600.00	2.13
S	综合	-	-
	合计	147,184,770.38	80.96

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000400	许继电气	550,000	14,894,000.00	8.19
2	300146	汤臣倍健	220,000	9,677,800.00	5.32
3	600703	三安光电	469,943	9,229,680.52	5.08
4	000651	格力电器	339,959	8,519,372.54	4.69
5	600406	国电南瑞	550,000	8,211,500.00	4.52
6	300088	长信科技	330,000	6,959,700.00	3.83
7	002005	德豪润达	660,000	6,138,000.00	3.38
8	002241	歌尔声学	150,000	5,443,500.00	2.99
9	300058	蓝色光标	130,000	5,421,000.00	2.98
10	300303	聚飞光电	330,000	5,263,500.00	2.90

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	288,555.44
2	应收证券清算款	6,134,620.59
3	应收股利	-
4	应收利息	7,131.24
5	应收申购款	4,474,631.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,904,939.19

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	136,518,800.51
本报告期基金总申购份额	113,865,884.04
减:本报告期基金总赎回份额	99,376,736.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	151,007,947.76

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发制造业精选股票型证券投资基金募集的文件;

2.《广发制造业精选股票型证券投资基金合同》;

3.《广发制造业精选股票型证券投资基金托管协议》;

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《广发制造业精选股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.法律意见书

7.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

8.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 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

7.3 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
二〇一三年七月十八日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月11日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证500ETF
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月11日
报告期末基金份额总额	173,038,319份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	中证500指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数中证500指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月11日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	22,150,482.55
2.本期利润	1,762,630.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	158,818,777.23
5.期末基金份额净值	0.9178

注:(1)本基金合同于2013年4月11日生效。

(2)所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

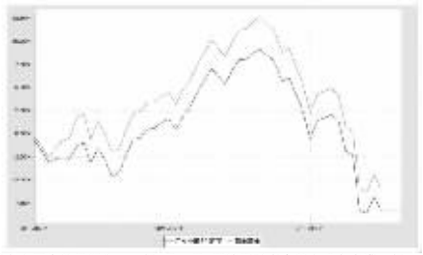
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.22%	1.52%	-5.86%	1.60%	-2.36%	-0.08%

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

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年4月11日至2013年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日期为2013年4月11日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后3个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈盛业	本基金的基金经理;广发中证500指数(lof)基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理	2013-4-11	-	6	男,中国籍,经济学博士,持有证券业执业证书,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日起任广发沪深300指数基金及广发中证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。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

按照指数结构复制指数进行运作。本季度内,基金交易和申购赎回正常,运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-8.22%,基金资产的日均跟踪误差为0.05%,日均跟踪偏离度为0.01%,符合控制在0.2%以内的要求。报告期内本基金较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政府已经意识未来中国经济可持续发展必须要走转型的道路,中证500成份股大多数是有转型前景的公司,因此我们看好指数的长期走势。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	156,306,182.11	97.61
	其中:股票	156,306,182.11	97.61
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,327,688.00	2.08
6	其他各项资产	506,892.31	0.32
7	合计	160,140,762.42	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,471,000.72	2.19
B	采矿业	2,883,894.16	1.82
C	制造业	92,308,593.96	58.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,474,787.70	4.71
E	建筑业	4,445,667.11	2.80
F	批发和零售业	8,411,540.80	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	4,674,320.83	2.94
H	住宿和餐饮业	129,546.35	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,328,233.97	5.87
J	金融业	1,289,779.10	0.81
K	房地产业	13,523,023.46	8.51
L	租赁和商务服务业	1,788,848.64	1.13
M	科学研究和技术服务业	679,223.16	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	1,514,791.26	0.95
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	3,748,174.09	2.36
S	综合	636,436.80	0.40
	合计	156,307,862.11	98.42

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000998	隆平高科	84,700	1,755,831.00	1.11
2	002230	科大讯飞	33,418	1,543,911.60	0.97
3	000400	许继电气	40,850	1,106,218.00	0.70
4	600436	片仔癀	7,880	1,078,141.60	0.68
5	000661	长春高新	10,709	1,048,518.19	0.66
6	000503	海虹控股	74,404	1,047,608.32	0.66
7	600867	通化东宝	68,400	1,018,476.00	0.64
8	600200	江苏吴中	64,361	1,006,606.04	0.63
9	000793	华闻传媒	98,843	990,406.86	0.62
10	000598	兴蓉投资	187,832	903,471.92	0.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.9 投资组合报告附注

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

5.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	149,989.14
2	应收证券清算款	345,376.63
3	应收股利	10,305.60
4	应收利息	1,220.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	506,892.31

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000998	隆平高科	1,755,831.00	1.11	重大事项
2	600436	片仔癀	1,078,141.60	0.68	重大事项
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	425,038,319
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	122,000,000
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	374,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	173,038,319

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

7.2 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

7.3 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
二〇一三年七月十八日

广发中证500指数证券投资基金(LOF)

【2013】第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证500指数(LOF)
基金主代码	162711
交易代码	162711
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月26日
报告期末基金份额总额	3,837,791,697.21份
投资目标	采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证500指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行同业存款收益率。
风险收益特征	较高风险、较高预期收益,风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-134,416.99
2.本期利润	-131,931,954.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0324
4.期末基金资产净值	2,823,395,448.34
5.期末基金份额净值	0.736

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

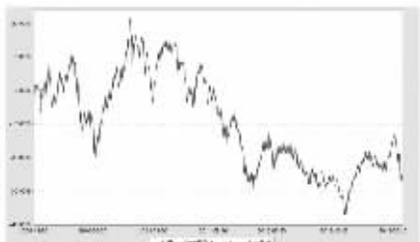
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.15%	1.46%	-5.81%	1.46%	0.66%	0.00%

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

广发中证500指数证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年11月26日至2013年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后三个月,建仓期结束时本基金资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈盛业	本基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理;广发中证500ETF基金的基金经理	2010-12-1	-	6	男,中国籍,经济学博士,持有证券业执业证书,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日起任广发沪深300指数基金及广发中证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。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公