

广发中债金融债指数证券投资基金

2014 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中债金融债指数基金 and its code 000448.

Table with 2 columns: 基金运作方式 and 基金合同生效日期. Includes details like 契约型开放式 and 2013年4月11日.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,本基金A类和C类的日均跟踪偏离度的绝对值为0.08%,符合基金合同的规定。

基金运作平稳,申购赎回因素对基金跟踪误差的冲击较一季度已经大幅降低。
作为被动型指数基金,本基金采用抽样复制的方法,选取流动性较好的政策性金融债构建投资组合。

较好的跟踪了标的指数。
4.2 报告期内基金的投资表现
广发中债金融债A类本报告期净值增长率为3.7%,广发中债金融债C类本报告期净值增长率为3.06%,均跑赢基准增长率为3.06%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
报告期内,上证指数创出了历史新高,但宏观经济是否已经复苏还需时间验证。三季度,受房地产市场下行影响,宏观经济未来仍面临较大的下行压力。

债券利率中枢仍处于历史高位位置,未来利率中枢的下移将继续带动利率价格的上升。未来债券市场或将呈现震荡向上的慢牛行情。我们认为在震荡上行过程中的短期调整是进行债券配置的好时机。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号 and 项目. Lists asset categories like 权益投资 and 债券投资.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号 and 债券品种. Lists bond types like 国债 and 央行票据.

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 2 columns: 序号 and 债券代码. Lists specific bond codes and their values.

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.本基金本报告期末未持有股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.12 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 and 项目. Lists other assets like 应收利息 and 其他应收款.

5.13 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。
5.14 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。

5.15 报告期末持有的流通受限证券投资情况

5.15.1 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。
5.15.2 报告期末前十名债券中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名债券中不存在流通受限情况。

5.16 开放式基金变动

Table with 2 columns: 项目 and 基金名称. Lists fund assets like 广发中债金融债指数基金A类.

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(以A类)申购、赎回或买卖本基金的情况。
5.8 备查文件目录
1.经中国证监会备案的广发中债金融债指数证券投资基金募集的文件;
2.《广发中债金融债指数证券投资基金基金合同》;
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
4.《广发中债金融债指数证券投资基金托管协议》;
5.法律法规文件;
6.基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照;
8.存放在广州:
广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
8.2 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:基金管理人网站:http://www.gfund.com.
投资者如对本报告有任何疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话9510882或020-83936999,或发送邮件于:services@gf-funds.com.cn.

广发基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

2014 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金 and its code 510510.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金 and its code 510510.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2014 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) and its code 510512.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) and its code 510512.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) and its code 510512.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现,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2014年4月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Includes details for 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) and its code 510512.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.

Table with 2 columns: 基金管理人 and 基金托管人. Lists 广发基金管理有限公司 and 中国银行股份有限公司.