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 年度报告摘要

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：二〇一五年三月三十日

§1 重要提示

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2015年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	2,011,598,607.59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

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	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。

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	蒋松云
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	228,391,568.13	-64,237,810.13	-335,913,854.72
本期利润	877,529,798.79	530,911,431.30	-28,846,729.00
加权平均基金份额本期利润	0.2889	0.1295	-0.0064
本期基金份额净值增长率	35.10%	15.76%	0.14%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1081	-0.1434	-0.2602
期末基金资产净值	2,328,078,788.71	3,219,465,375.21	3,525,089,366.38
期末基金份额净值	1.1573	0.8566	0.7400

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

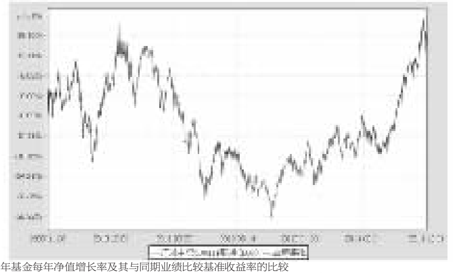
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.30%	1.39%	7.87%	1.37%	-0.57%	0.02%
过去六个月	33.04%	1.16%	33.85%	1.16%	-0.81%	0.00%
过去一年	35.10%	1.18%	37.09%	1.18%	-1.99%	0.00%
过去三年	56.60%	1.33%	59.90%	1.34%	-3.30%	-0.01%
过去五年	14.70%	1.43%	17.92%	1.45%	-3.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	15.73%	1.42%	17.25%	1.46%	-1.52%	-0.04%

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

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

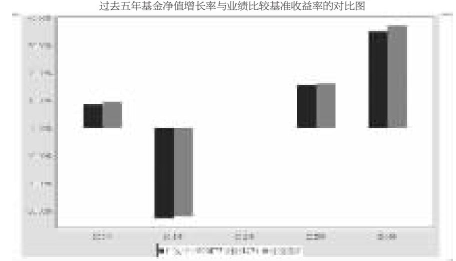
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年11月26日至2014年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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风险投资有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和22个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、国际业务部、营销服务部、互联网金融部（下辖深圳理财中心、杭州理财中心）、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司。

截至2014年12月31日，本基金管理人管理五十七只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币市场基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发季季利理财债券型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金和广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为1334.68亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深300指数基金的基金经理；广发中证500ETF基金的基金经理	2014-04-01	-	10.5年	男，中国籍，工学学士，持有基金业执业证书，2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司信息技术部工作，2010年11月至2014年3月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员。2014年4月1日起任广发沪深300指数、广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理。
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；广发深证100指数分级基金的基金经理	2013-10-10	2014-04-01	8年	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2014年3月31日在广发基金管理有限公司数量投资部工作，2010年12月1日至2014年3月31日任广发沪深300指数基金，2010年12月1日至2013年10月9日任广发中证500指数(LOF)基金的基金经理，2013年4月11日至2014年3月31日任广发中证500ETF基金的基金经理，2013年9月9日至2014年3月31日任广发深证100指数分级基金的基金经理，2013年10月10日至2014年3月31日任广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理。

注：（1）基金经理的"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 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，本基金出现39次涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。原因是本基金于2013年10月10日由广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更为广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），由于广发中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"广发中证500ETF"）对于在深圳证券交易所上市的成份股采用现金替代的方式进行申购赎回，所以本基金需要卖出所持深圳股票后方能申购广发中证500ETF以满足对广发中证500ETF的投资比例不低于本基金资产净值的90%的合同要求，由于此调仓操作和广发中证500ETF发生了反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

（1）投资策略

作为ETF联接基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证500ETF及指数成份股等，间接复制指数，同时积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

（2）运作分析

报告期内，本基金日均跟踪误差为0.05%，年化跟踪误差0.76%，符合要求。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要有两个：一是基金成份股调整因素，本基金报告期内的成份股调整策略合理，较好的控制了该因素带来的误差；二是申购和赎回因素，本基金成立以来规模稳步增长，目前的规模水平下，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，本基金的净值增长率为35.10%，同期业绩比较基准收益率为37.09%，日均跟踪偏离度绝对值为0.005%，符合要求。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

第4季度，中证500等中小板指数逊色于沪深300等大盘指数，主要原因是受沪港通以及央行降息降准等政策利好刺激，最终在金融板块带领下，大盘蓝筹板块行情得到快速飙升；前3季度，中小板块的表现明显好于沪深300等大盘指数；从全年看，创业板上涨12.83%，中证500上涨39.01%，沪深300上涨51.66%。因此，中证500指数是全市场中小市值股票的典型代表，相对部分热点指数而言，能较好地把握住市场行情。

2014年，被誉为改革元年，政府推进了很多行业改革，反映在股市中是改革创新预期增强和无风险收益率下降带来的大量资金的流入，因此整体市场估值上升。

2015年，我们认为经济转型依然是股市表现的内在因素，同时未来预期的深港通、"一带一路"等政策调控，有利于活跃证券市场以及金融板块，加速资源配置优化，有利于未来市场整体表现；其中深港通的推出，将更有利于中证500中小市值指数的表现，中证500能较好地抓住市场整体行情，未来我们中长期看好中证500指数。

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、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本公司现没有进行任何定价服务的签约。

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"（三）基金收益分配原则"的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，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。本报告期内，广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2014年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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 王明静 洪锐明签字出具了德师报(审)字(15)第P0321号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：	-	-
银行存款	111,381,767.52	165,671,954.80
结算备付金	-	13,933.40
存出保证金	372,792.06	710,190.41
交易性金融资产	2,227,790,150.44	3,056,166,970.94
其中：股票投资	5,533,087.38	7,611,278.05
基金投资	2,222,257,063.06	3,048,555,692.89
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	9,402,257.78	3,211,959.39
应收利息	21,475.51	33,266.19
应收股利	-	-
应收申购款	1,117,016.11	684,171.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	75,364.98	8,537.68
资产总计	2,350,160,824.40	3,226,500,983.87
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	21,298,715.42	4,213,383.65
应付管理人报酬	41,688.10	75,033.41
应付托管费	8,337.62	15,006.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	277,694.76	2,483,429.96
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	455,599.79	248,754.95
负债合计	22,082,035.69	7,035,608.66
所有者权益：	-	-
实收基金	2,011,598,607.59	3,758,440,863.96
未分配利润	316,480,181.12	-538,975,488.75
所有者权益合计	2,328,078,788.71	3,219,465,375.21
负债和所有者权益总计	2,350,160,824.40	3,226,500,983.87

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值人民币1.1573元，基金份额总额2,011,598,607.59份。

7.2 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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

资产	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	880,908,667.19	559,555,764.06
1.利息收入	1,138,841.40	1,450,227.65
其中：存款利息收入	1,138,841.40	1,449,105.72
债券利息收入	-	1,121.93
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)	228,464,521.23	-39,667,417.63
其中：股票投资收益	657,235.56	-65,912,253.02
基金投资收益	227,806,516.97	-1,692,781.31
债券投资收益	-	169,711.88
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	768.70	27,767,904.82
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	649,138,230.66	595,149,241.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,167,073.90	2,623,712.61
减：二、费用	3,378,868.40	28,644,332.76
1.管理人报酬	743,188.18	16,199,725.98
2.托管费	148,637.60	3,239,945.23
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,011,933.96	8,626,177.85
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	475,108.66	578,483.70
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	877,529,798.79	530,911,431.30
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	877,529,798.79	530,911,431.30

7.3 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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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）	3,758,440,863.96	-538,975,488.75	3,219,465,375.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	877,529,798.79	877,529,798.79
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）	-1,746,842,256.37	-22,074,128.92	-1,768,916,385.29
其中：1.基金申购款	1,468,452,614.43	-148,867,137.37	1,319,585,477.06
2.基金赎回款	-3,215,294,870.80	126,793,008.45	-3,088,501,862.35
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）	2,011,598,607.59	316,480,181.12	2,328,078,788.71
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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）	4,764,782,519.75	-1,239,693,153.37	3,525,089,366.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	530,911,431.30	530,911,431.30
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）	-1,006,341,655.79	169,806,233.32	-836,535,422.47
其中：1.基金申购款	2,116,112,334.77	-380,944,361.15	1,735,167,973.62
2.基金赎回款	-3,122,453,990.56	550,750,594.47	-2,571,703,396.09
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）	3,758,440,863.96	-538,975,488.75	3,219,465,375.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王志伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

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

本基金募集期为2009年10月22日至2009年11月20日，本基金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，折合基金份额634,322.52份，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》，变更本基金的投资范围及相关事项，将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。相应地对基金合同中有关本基金的名称、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) 基金份额持有人大会决议经中国证券监督管理委员会于2013年10月10日备案确认，自该日生效。根据《<广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同>修改说明》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《广发中证500指数证券投资基金(LOF)托管协议》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》、《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》，并已报中国证监会审核。《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《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》自中国证监会备案确认广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效之日起，原《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《广发中证500指数证券投资基金(LOF)托管协议》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，2013年10月10日前本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、到期日在一年以内的政府债券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具；2013年10月10日起，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）。本基金的业绩比较基准采用：95%×中证500指数收益率+5%×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%×中证500指数收益率+5%×银行同业存款收益率)。

本基金的财务报表于2015年3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》，同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2. 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，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。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. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
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
广发证券股份有限公司(注1)	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
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
瑞元资本管理有限公司(注2)	基金管理人控股子公司

注：1、广发证券股份有限公司于2014年7月31日对广发基金管理有限公司进行增资，并对其实施控制，广发基金管理有限公司由此成为广发证券股份有限公司的子公司。

2、广发基金管理有限公司公司于2013年6月14日在珠海设立控股子公司瑞元资本管理有限公司。

除上述事项外，本报告期内及上年度可比期间不存在其他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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	18,064,936.50	1.58%	506,334,955.84	9.98%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	1,958,634.00	66.20%

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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	16,443.28	1.59%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	453,755.63	10.70%	176,263.02	7.10%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	743,188.18	16,199,725.98
其中：支付销售机构的客户维护费	3,079,090.86	3,537,786.49

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×0.60%÷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×0.50%÷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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	148,637.60	3,239,945.23

注：1.2013年10月10日前，本基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.12%的年费率计提.托管费的计算方法如下：

H=E×0.12%÷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×0.10%÷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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
报告期初持有的基金份额	100,006,000.06	100,006,000.06
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	33,119,894.00	-
报告期末持有的基金份额	66,886,106.06	100,006,000.06
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.33%	2.66%

注：基金管理人本报告期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。

7.4.8.4.2 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

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。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	111,381,767.52	1,096,169.77	165,671,954.80	1,404,389.41

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
广发证券股份有限公司	600978	宜华木业	配股认购	3,300.00	13,299.00
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有1,487,852,881.00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97.69%。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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2014年12月31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。

7.4.9.2 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
600240	华业地产	2014-10-16	重大事项	9.99	2015-01-22	7.91	92,300.00	663,637.00	922,077.00	-
600428	中远航运	2014-12-22	重大事项	8.00	2015-01-08	8.30	15,300.00	122,400.00	122,400.00	-
600458	时代新材	2014-10-27	重大事项	12.18	2015-01-05	13.40	48,000.00	584,335.00	584,640.00	-
600487	亨通光电	2014-10-30	重大事项	18.95	2015-01-19	20.60	19,600.00	370,846.00	371,420.00	-
600490	鹏欣资源	2014-12-24	重大事项	10.79	2015-01-12	11.87	12,000.00	129,480.00	129,480.00	-
600575	皖江物流	2014-09-08	重大事项	4.11	-	-	92,300.00	379,353.00	379,353.00	-
600580	卧龙电气	2014-12-08	重大事项	10.48	2015-01-14	11.12	37,200.00	389,856.00	389,856.00	-
600584	长电科技	2014-11-03	重大事项	11.13	2015-01-14	12.24	76,606.00	852,625.27	852,624.78	-
600704	物产中大	2014-10-13	重大事项	10.38	2015-02-13	11.42	64,100.00	665,358.00	665,358.00	-
600754	锦江股份	2014-11-10	重大事项	25.11	2015-01-19	27.00	17,400.00	436,914.00	436,914.00	-
600759	洲际油气	2014-12-24	重大事项	9.90	-	-	10,800.00	106,920.00	106,920.00	-
600844	丹化科技	2014-12-15	重大事项	7.60	2015-01-07	8.25	8,536.00	64,864.61	64,873.60	-
601519	大智慧	2014-07-21	重大事项	5.98	2015-01-23	6.58	84,600.00	505,908.00	505,908.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31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。

7.4.10 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附注7.4.4.5。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年12月31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2,222,258,326.06元，属于第二层级的余额为5,531,824.38元，无属于第三层级的余额(2013年12月31日：第一层级3,055,735,084.94元，第二层级431,886.00元，无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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股票和债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股票和债券的公允价值列入第一层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2.除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	5,533,087.38	0.24
	其中：股票	5,533,087.38	0.24
2	基金投资	2,222,257,063.06	94.56
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	111,381,767.52	4.74
8	其他各项资产	10,988,906.44	0.47
9	合计	2,350,160,824.40	100.00

8.2 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	2,222,257,063.06	95.45

8.3 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,392,894.38	0.10
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	773,541.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	501,753.00	0.02
H	住宿和餐饮业	436,914.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	505,908.00	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	922,077.00	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,533,087.38	0.24

8.4 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

金额单位：人民币元

代码	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	600240	华业地产	92,300	922,077.00	0.04
2	600584	长电科技	76,606	852,624.78	0.04
3	600704	物产中大	64,100	665,358.00	0.03
4	600458	时代新材	48,000	584,640.00	0.03
5	601519	大智慧	84,600	505,908.00	0.02
6	600754	锦江股份	17,400	436,914.00	0.02
7	600580	卧龙电气	37,200	389,856.00	0.02
8	600575	皖江物流	92,300	379,353.00	0.02
9	600487	亨通光电	19,600	371,420.00	0.02
10	600490	鹏欣资源	12,000	129,480.00	0.01
11	600428	中远航运	15,300	122,400.00	0.01

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 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	600432	吉恩镍业	4,581,119.04	0.14
2	600587	新华医疗	4,578,764.13	0.14
3	600570	恒生电子	4,475,395.52	0.14
4	600499	科达洁能	4,037,077.06	0.13
5	600557	康缘药业	3,998,754.31	0.12
6	600879	航天电子	3,955,726.99	0.12
7	600872	中炬高新	3,812,857.60	0.12
8	600312	平高电气	3,680,135.16	0.11
9	600388	龙净环保	3,615,265.46	0.11
10	600643	爱建股份	3,602,057.83	0.11
11	600418	江淮汽车	3,561,417.98	0.11
12	600525	长园集团	3,553,677.87	0.11
13	600594	益佰制药	3,539,002.33	0.11
14	600138	中青旅	3,443,943.55	0.11
15	600770	综艺股份	3,363,799.01	0.10
16	600880	博瑞传播	3,206,557.00	0.10
17	600765	中航重机	3,147,601.71	0.10
18	600881	亚泰集团	3,139,666.98	0.10
19	600675	中华企业	3,090,351.80	0.10
20	600522	中天科技	3,070,749.10	0.10

注：本项及下项8.5.2、8.5.3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。

8.5.2 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	600570	恒生电子	8,131,143.93	0.25
2	600587	新华医疗	7,087,874.65	0.22
3	600879	航天电子	6,233,232.92	0.19
4	600312	平高电气	6,188,925.69	0.19
5	600418	江淮汽车	6,182,528.79	0.19
6	600499	科达洁能	6,012,759.56	0.19
7	600388	龙净环保	5,915,465.56	0.18
8	600517	置信电气	5,718,486.20	0.18
9	601929	吉视传媒	5,477,418.58	0.17
10	600525	长园集团	5,430,493.78	0.17
11	600643	爱建股份	5,349,310.01	0.17
12	600594	益佰制药	5,340,796.22	0.17
13	600138	中青旅	5,337,332.91	0.17
14	600557	康缘药业	5,333,258.98	0.17
15	600881	亚泰集团	5,282,813.51	0.16
16	600770	综艺股份	5,250,286.11	0.16
17	600522	中天科技	5,247,939.71	0.16
18	600872	中炬高新	5,198,795.14	0.16
19	600432	吉恩镍业	5,057,462.65	0.16
20	600601	方正科技	4,932,847.50	0.15

8.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	436,094,614.74
卖出股票的收入(成交)总额	704,207,256.02

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.12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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1根据安徽皖江物流（集团）股份有限公司（股票代码：600575）2014年10月11日发布的《安徽皖江物流（集团）股份有限公司关于被中国证券监督管理委员会立案调查的公告》显示，因公司涉嫌信息披露违法违规，被中国证券会进行立案调查。

本基金对该股票的投资逻辑是：第一，皖江物流的子公司淮矿物流已停止经营、相关债务债权已经剥离上市公司，且钢铁价格很难进一步大幅下跌，预计不会有更多的债务风险暴露。第二，皖江物流绝对控股股东为安徽省属国有独资企业淮南矿业，是其旗下唯一上市平台，控股股东会竭尽全力处理公司的危机。

除上述证券外，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，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

8.13.2本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.13.3 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	372,792.06
2	应收证券清算款	9,402,257.78
3	应收股利	-
4	应收利息	21,475.51
5	应收申购款	1,117,016.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	75,364.98
9	合计	10,988,906.44

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600240	华业地产	922,077.00	0.04	重大事项
2	600584	长电科技	852,624.78	0.04	重大事项
3	600704	物产中大	665,358.00	0.03	重大事项
4	600458	时代新材	584,640.00	0.03	重大事项
5	601519	大智慧	505,908.00	0.02	重大事项
6	600754	锦江股份	436,914.00	0.02	重大事项
7	600580	卧龙电气	389,856.00	0.02	重大事项
8	600575	皖江物流	379,353.00	0.02	重大事项
9	600487	亨通光电	371,420.00	0.02	重大事项
10	600490	鹏欣资源	129,480.00	0.01	重大事项

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
90,761	22,163.69	100,132,180.17	4.98%	1,911,466,427.42	95.02%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	上海同济协力建设工程咨询有限公司	2,000,000.00	3.34%
2	高琪	1,482,817.00	2.48%
3	张正邦	1,010,480.00	1.69%
4	蔡惠生	1,000,000.00	1.67%
5	倪泓	1,000,000.00	1.67%
6	李惠玲	882,000.00	1.47%
7	蒋波道	603,344.00	1.01%
8	钱慎	600,018.00	1.00%
9	张群娣	600,000.00	1.00%
10	刘健强	569,000.00	0.95%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,520,298.83	0.1253%

9.4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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

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	3,758,440,863.96
本报告期基金总申购份额	1,468,452,614.43
减：本报告期基金总赎回份额	3,215,294,870.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,011,598,607.59

§11 重大事件揭示

11.1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。

11.2 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

2014年8月8日，陈伯军因工作调动不再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日，本基金管理人聘任包林生为公司副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	
安信证券	5	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	119,646,175.11	10.49%	108,926.73	10.53%	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	130,950.00	0.01%	119.22	0.01%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	11,547,251.83	1.01%	8,203.22	0.79%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	减少1个
东兴证券	2	-	-	-	-	减少1个
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	3	270,924,646.18	23.76%	246,652.59	23.84%	-
广发证券	7	18,064,936.50	1.58%	16,443.28	1.59%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国信证券	4	52,950,452.21	4.64%	48,206.10	4.66%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	262,278,103.29	23.00%	238,779.04	23.08%	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	4,990,754.17	0.44%	3,545.46	0.34%	-
华宝证券	1	166,680.00	0.01%	151.74	0.01%	-
华创证券	1	11,489,169.53	1.01%	10,459.52	1.01%	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	新增1个
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	0	-	-	-	-	减少1个
上海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	3	1,230,445.82	0.11%	1,120.21	0.11%	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	241,871,141.38	21.21%	220,199.97	21.28%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	3	1,725,519.80	0.15%	1,570.92	0.15%	-
英大证券	2	-	-	-	-	新增1个
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	3,736,256.02	0.33%	3,309.19	0.32%	-
招商证券	3	118,937,928.76	10.43%	108,282.05	10.47%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	0	-	-	-	-	减少1个
中金公司	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	4	1,337,945.00	0.12%	1,218.07	0.12%	-
中信证券	3	19,243,226.16	1.69%	17,519.11	1.69%	-
中信证券(浙江)	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中原证券	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财富证券	-	-	-	-	-	-	75,564,140.23	3.66%
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	180,829,529.61	8.76%
东海证券	-	-	-	-	-	-	49,567,645.03	2.40%
光大证券	-	-	-	-	-	-	203,756,574.90	9.87%
广发证券	-	-	-	-	-	-	77,528,778.83	3.75%
国信证券	-	-	-	-	-	-	164,297,802.65	7.96%
海通证券	-	-	-	-	-	-	698,817,821.99	33.84%
宏源证券	-	-	-	-	-	-	93,311,038.56	4.52%
华安证券	-	-	-	-	-	-	40,971,432.75	1.98%
华宝证券	-	-	-	-	-	-	9,777,436.19	0.47%
华创证券	-	-	-	-	-	-	62,836,904.07	3.04%
申银万国	-	-	-	-	-	-	21,456,233.20	1.04%
世纪证券	-	-	-	-	-	-	9,571,501.63	0.46%
万联证券	-	-	-	-	-	-	67,656,885.40	3.28%
长江证券	-	-	-	-	-	-	18,829,796.35	0.91%
招商证券	-	-	-	-	-	-	195,306,023.30	9.46%
中信证券	-	-	-	-	-	-	95,224,330.47	4.61%

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据广发基金管理有限公司2014年度股东会第四次会议决议，公司的注册资本由人民币12000万元增加至人民币12688万元，公司股东广发证券股份有限公司认购全部新增注册资本688万元。自此，广发证券股份有限公司的持股比例由原来的48.33%增加至51.13%，其他股东的持股比例相应调整。详见2014年8月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和广发基金管理有限公司网站（http://www.gffunds.com.cn）上刊登的《广发基金管理有限公司关于注册资本及股东出资比例变更的公告》。

广发基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日