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:二〇一八年八月二十四日

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

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	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	上海交易所
上市日期	2013年8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,要使跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	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。本基金力争日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。 (一)资产配置策略 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。 (二)目标ETF投资策略 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。 (三)股票投资策略 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。 (四)债券投资策略 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久期及类别配置,并根据对个券利过价值的比较,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。 (五)股指期货及其他金融衍生品的投资策略 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,主要采用跟踪性好、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价值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头期货保值等策略进行股票保值操作。
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	要求跟踪标的指数,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,紧密跟踪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。本基金投资于目标ETF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)66105799
	电子邮箱	dxj@gfhfamc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-83899158	(010)66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gfhfamc.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

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	-180,177,248.89	-82,702,641.09
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%	-12.29%
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

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)本期已实现收益指期基金本期利息收入、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	-12.76%	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%

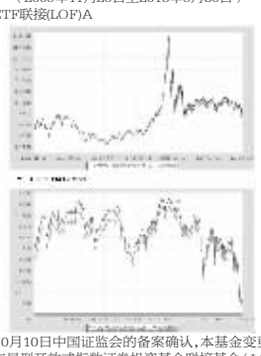
(1)业绩比较基准:95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

(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



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、深圳市前海百汇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(ODII)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;广发沪深300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500ETF联接基金的基金经理;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;广发创业板ETF基金的基金经理;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;广发量化精选混合基金的基金经理;广发趋势增长股票基金的基金经理;广发趋势增长股票基金的基金经理;广发趋势增长股票