广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证环保ETF
基金主代码	512580
交易代码	512580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年1月25日
报告期末基金份额总额	2,351,071,654.00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90%且不低于非现金基金资产的80%。
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证环保产业指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。
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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-34,294,242.28
2.本期利润	-179,988,181.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0798
4.期末基金资产净值	1,733,034,251.44
5.期末基金份额净值	0.7371

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	-10.10%	1.78%	-11.09%	1.88%	0.99%	-0.10%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

广发中证环保产业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历史走势对比图
(2017年1月25日至2019年6月30日)

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘杰	本基金的基金经理;广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理;广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证环境产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理;广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理;广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理;指数投资部总经理助理	2017-01-25	-	15年	刘杰先生,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书,曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2018年4月25日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自2017年4月5日至2018年11月30日)。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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。金融工程与风险管理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(完全复制指数组合及量化组合除外)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。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金业绩基准是中证环保产业指数,主要采用完全复制法来跟踪业绩基准。

(1)投资策略

作为ETF基金,本基金秉承指数化被动投资策略,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,降低基金的跟踪误差。

(2)运作分析

报告期内,本基金交易和申购赎回正常,运作过程中未发生风险事件。本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素。

随着中美贸易问题的反复,二季度整体市场震荡向下,中证环保下跌11.09%,沪深300下跌1.21%,中证500下跌10.76%,创业板指下跌10.75%,上证综指下跌3.62%,同时1至5月固定资产投资累计增速5.6%,前值6.1%,结束了自去年9月起的连续改善。而3月社融数据增速再次企稳回升,企业中长期贷款增速波动较大,同期科创板开板、MSCI和富时A股权重提升,中长期提升外资投资A股比例。总体上,二季度A股市场多空信号交错。受累于中美贸易摩擦升级,市场整体风险偏好震荡向下。

国内经济处于转型期,根据发达国家经验,环保行业是经济转型过程中的重要抓手,未来随着国家政策逐步向环保行业倾斜,环保行业有望得到持续的投入,环保指数基金存在中长期的投资价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-10.10%,同期业绩比较基准收益率为-11.09%。

§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	1,631,875,617.41	93.81
	其中:股票	1,631,875,617.41	93.81
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	104,035,736.16	5.98
7	其他资产	3,655,061.33	0.21
8	合计	1,739,566,414.90	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

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	69,184.69	0.00
B	采矿业	363,431.25	0.02
C	制造业	1,071,523,037.08	61.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	288,536,076.55	16.65
E	建筑业	52,784,831.04	3.05
F	批发和零售业	66,934.21	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	50,057.84	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,409,621.26	1.06
J	金融业	418,665.90	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,951,311.93	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	182,326,869.22	10.52
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	23,106.60	0.00
S	综合	379,009.84	0.02
	合计	1,631,902,137.41	94.16

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

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	601200	上海环境	1,551,646	21,117,902.06	1.22
2	002531	天顺风能	3,374,400	20,381,376.00	1.18
3	300014	亿纬锂能	661,546	20,150,691.16	1.16
4	002202	金风科技	1,605,046	19,950,721.78	1.15
5	000826	启迪桑德	1,678,808	19,793,146.32	1.14
6	002372	伟星新材	1,130,753	19,675,102.20	1.14
7	002080	中材科技	2,150,917	19,487,308.02	1.12
8	000035	中国天楹	3,221,900	19,331,400.00	1.12
9	300232	洲明科技	1,975,939	19,127,089.52	1.10
10	601012	隆基股份	820,797	18,968,618.67	1.09

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序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。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

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)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	77,802.77
2	应收证券清算款	3,408,094.87
3	应收股利	-
4	应收利息	17,931.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	151,232.48
8	其他	-
9	合计	3,655,061.33

5.11.4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。

5.11.5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	2,231,071,654.00
本报告期基金总申购份额	246,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	126,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,351,071,654.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20190401-20190630	1,579,903,341.00	304,366,300.00	209,639,200.00	1,674,630,441.00	71.23%
产品持有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的持有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。						

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2.《广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3.《广发中证环保产业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

9.2 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

9.3 查阅方式

1.书面查阅:投资者可在营业时间免费查阅,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。

广发基金管理有限公司
二〇一九年七月十八日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十八日

§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2019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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

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	
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	4,340,432,833.21份	
投资目标	本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,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。本基金力争将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。	
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。	
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	
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
报告期末下属两级基金的份额总额	1,502,614,882.39份	2,837,817,950.82份

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	广发中证500交易型开放式指数证券投资基金
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	上海证券交易所
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

2.1.2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的90%且不低于非现金基金资产的80%。
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证500指数。本基金的业绩比较基准为同期标的指数收益率。
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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,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。

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接(LOF)C
1.本期已实现收益	-2,197,229.74	-3,230,204.06
2.本期利润	-172,595,498.91	-220,399,516.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1173	-0.0912
4.期末基金资产净值	1,629,227,973.09	2,460,546,146.78
5.期末基金份额净值	1.0843	0.8671

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

1、广发中证500ETF联接(LOF)A:

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	-9.61%	1.68%	-10.22%	1.72%	0.61%	-0.04%

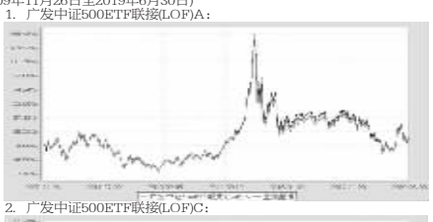
2、广发中证500ETF联接(LOF)C:

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	-9.66%	1.68%	-10.22%	1.72%	0.56%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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)
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2019年6月30日)

1. 广发中证500ETF联接(LOF)A:



2. 广发中证500ETF联接(LOF)C:

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘杰	本基金的基金经理;广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证环境产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理;广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理;广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理;指数投资部总经理助理	2014-04-01	-	13年	刘杰先生,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2018年4月25日)。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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。金融工程与风险管理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(完全复制指数组合及量化组合除外)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。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,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。

4.4报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为-15.53%,C类基金份额净值增长率为-15.47%,同期业绩比较基准收益率为-16.90%。

§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	11,895,991.86	1.96
	其中:股票	11,895,991.86	1.96
2	基金投资	548,002,801.62	90.21
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	46,239,500.34	7.61
8	其他资产	1,323,396.59	0.22
9	合计	607,461,690.41	100.00

5.2期末投资目标基金明细

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	3,776,863,155.11	92.35

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	235,598.00	0.01
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	1,978.60	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	10,215.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	247,791.60	0.01

5.3.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.4 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	600875	东方电气	15,000	159,300.00	0.00
2	600141	兴发集团	4,000	41,120.00	0.00
3	601777	力帆股份	8,200	35,178.00	0.00
4	600757	长江传媒	1,500	10,215.00	0.00
5	600179	ST安通	500	1,465.00	0.00
6	600717	天津港	80	513.60	0.00

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					1,781,322.12
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-2,300,138.16

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是ETF联接基金,主要投资目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股,同时可以部分投资股指期货。

本基金投资股指期货,可以更好地应对申购和赎回,更好地进行流动性管理。本基金尽量选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整带来的交易成本和跟踪误差,力争实现更好地跟踪标的指数的效果。

5.11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。

5.12投资组合报告附注

5.12.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.12.2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。

5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	862,743.69
2	应收证券清算款	337.62
3	应收股利	-
4	应收利息	77,028.87
5	应收申购款	57,175,427.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	2,160,651.84
9	合计	60,276,189.65

5.12.4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。

5.12.5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

项目	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接(LOF)C
本报告期期初基金份额总额	1,478,313,782.20	2,366,213,050.46
本报告期基金总申购份额	254,030,938.30	2,026,280,866.94
减:本报告期基金总赎回份额	229,729,838.11	1,554,675,966.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,502,614,882.39	2,837,817,950.82

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接(LOF)C
报告期期初管理人持有的本基金份额	32,422,670.38	-
本报告期期间买入/申购总份额	-	-
本报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	32,422,670.38	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.75	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会《关于核准广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议的批复》

2.《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》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《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》

5.法律意见书

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

8.2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

8.3查阅方式

1.书面查阅:投资者可在营业时间免费查阅,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。

广发基金管理有限公司
二〇一九年七月十八日

广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十八日

§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2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和