

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：二〇一二年三月二十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事和监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、完整性、及时性承担个别及连带责任。本基金年度报告已被三分之一以上独立董事签字确认。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定，于2012年3月21日收到本基金的财务报表，包括但不限于资产负债表、利润表、净值表现、费用表、资产净值变动表、投资组合报告等信息，对本基金年度报告进行了复核。

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。

基金年度报告是基金管理人对基金编制的定期报告，投资者应及时阅读基金定期报告了解基金运作情况。

本年度报告摘要根据年度报告，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2011年1月1日起至2012年1月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 广发中证500指数(LOF)

基金简称 广发中证500指数(LOF)

基金代码 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

报告期基金份额总额 3,885,836,712.17

基金类别 不定期

基金上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2010年1月8日

2.2 基金产品说明

采用被动式投资策略，通过严格的投资政策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误差

投资目标 稳定并力求超越业绩比较基准

投资策略 本基金将采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其所占比重进行组合，并根据标的指数成份股及其重要的变动进行相应调整。

当本期期初股票发生成份股变动、增发、分红等行为时，以及发生其他可能影响成份股在基金中的比例时，基金管理人会根据实际情况对基金的股票投资比例进行调整，降低跟踪误差。

业绩比较基准 95%×中证500指数收益+4%×银行存款利率(税后)

风险收益特征 高风险、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。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露义务人 谭晓峰

联系电话 020-83966098

电子邮箱 dxy@funds.com.cn

客户服务电话 05105828_020-83969999

传真 020-8899158

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文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层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

2011年期间数据和指标 2010年

本期实现收益 -44,944,995.38

加权平均基金份额本期利润 -1,345,823,312.87

本期平均基金份额利润率 -30.56%

本期末基金资产净值 -36.86%

本期末基金份额净值 -12.51%

本期末基金份额净值增长率 -8.52%

本期末可供分配利润 -0.2609

期末可供分配基金份额利润 -0.0900

期末可供分配利润 -2,872,015,789.50

期末可供分配利润 -3,743,533,954.54

期末可供分配利润 -8,714,819,488.77

期末可供分配利润 -0.739

本期末可供分配利润 -1.095

本期末可供分配利润 -1.009

3.1.3 期末利润分配情况

2011年末 -26.10%

2010年末 -9.50%

2009年末 -0.90%

注：1.本基金截至2010年4月19日生效，从2010年4月20日起开始进入募集期，因此本报告期未实际取得收益。

2.上述基本绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费率后实际收益水平将低于所列数字。

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，即为本期可供分配利润，其中利息收入指报告期利息收入减去报告期利息支出，以定期存款利息收入为主。

4.期末可供分配利润，以固定收益类基金的报告期利润除以报告期末固定收益类基金的净资产值乘以100%计算得出。

5.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

6.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

7.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

8.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

9.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

10.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

11.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

12.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

13.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

14.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

15.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

16.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

17.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

18.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

19.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

20.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

21.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

22.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

23.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

24.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

25.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

26.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

27.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

28.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

29.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

30.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

31.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

32.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

33.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

34.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

35.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

36.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

37.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

38.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

39.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

40.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

41.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

42.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

43.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

44.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

45.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

46.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

47.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

48.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

49.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

50.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

51.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

52.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

53.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

54.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

55.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

56.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

57.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

58.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

59.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

60.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

61.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

62.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

63.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

64.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

65.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

66.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

67.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

68.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

69.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

70.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

71.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

72.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

73.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

74.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

75.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

76.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

77.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

78.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

79.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

80.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

81.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

82.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

83.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

84.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

85.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

86.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

87.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

88.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

89.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

90.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

91.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

92.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

93.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。

94.本期可供分配利润，以定期存款利息收入为主。</p