

# 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

## 2013 第四季度报告

**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:二〇一四年一月二十二日**

**§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2014年1月17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,也不保证基金份额持有人最低收益,投资者自行承担投资风险。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。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

**§2 基金产品概况**

基金简称	广发中证500ETF
基金代码	162711
交易代码	162711
基金运作方式	上市型开放式
基金合同生效日	2009年11月26日
基金期末基金份额总额	3,758,440,863.96份

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。

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0.45%以内。

(一)资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF,标的指数的成份股、备选成份股,其中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了更本基金在应对申购赎回的流动性,更好地跟踪标的指数。

本基金将根据市场的实际情况,适时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

本基金投资于目标ETF,在基金的日常投资管理中,本基金将主要通过一级市场申购赎回操作跟踪目标ETF的基金份额,主要根据ETF资产比例,同时,本基金可通过二级市场在证券交易所直接买入,买入目标ETF的基金份额,当日买入的基金份额当日即可交易,实现交易方式上的无缝对接,本基金资产和标的基金资产,无论由哪个基金持有人持有。

(三)资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF,标的指数的成份股、备选成份股,其中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了更本基金在应对申购赎回的流动性,更好地跟踪标的指数。

本基金将根据市场的实际情况,适时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。

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-21,446,637.41
2.本期利润	-67,243,052.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0326
4.期末基金资产净值	2,011,987,579.77
5.期末基金份额净值	1.040

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和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据。

(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	-2.99%	1.07%	-3.11%	1.07%	0.12%	0.00%

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

广发沪深300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的历史走势对比图  
(2008年12月30日至2013年12月31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	证券从业年限	说明
陈盛业	本基金的基金经理	2010-12-1	7	男,中国籍,经济学博士,持有证券从业资格,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理财部,2010年8月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作,2010年12月1日起任广发沪深300指数基金基金经理,2013年4月11日起任广发中证500指数基金基金经理,2013年10月1日起任广发中证500ETF联接基金的基金经理。

注:1、“任职日期”和“离任日期”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、《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》和《广发沪深300指数证券投资基金托管协议》及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,在严格控制投资风险的基础上,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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明

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评估分析,保证公平交易原则的实现。

在投资管理方面,公司严格执行投资决策程序,投资决策权限在授权范围内且以自主决策,通过投资权限的授权操作确保投资决策的独立性,在交易执行环节,实行集中交易,公平对待,严格执行“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。监察稽核部风险控制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;稽核岗通过投资、研究及交易等全流程的独立监督稽核,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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

**§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	7,611,278.05	0.24
2	其中:股票	7,611,278.05	0.24
3	固定收益投资	3,048,555,692.89	94.40
4	其中:债券	-	-
5	其中:资产支持证券	-	-
6	其中:买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	其中:买入返售金融资产	-	-
11	其中:买入返售金融资产	-	-
12	其中:买入返售金融资产	-	-
13	其中:买入返售金融资产	-	-
14	其中:买入返售金融资产	-	-
15	其中:买入返售金融资产	-	-
16	其中:买入返售金融资产	-	-
17	其中:买入返售金融资产	-	-
18	其中:买入返售金融资产	-	-
19	其中:买入返售金融资产	-	-
20	其中:买入返售金融资产	-	-
21	其中:买入返售金融资产	-	-
22	其中:买入返售金融资产	-	-
23	其中:买入返售金融资产	-	-
24	其中:买入返售金融资产	-	-
25	其中:买入返售金融资产	-	-
26	其中:买入返售金融资产	-	-
27	其中:买入返售金融资产	-	-
28	其中:买入返售金融资产	-	-
29	其中:买入返售金融资产	-	-
30	其中:买入返售金融资产	-	-
31	其中:买入返售金融资产	-	-
32	其中:买入返售金融资产	-	-
33	其中:买入返售金融资产	-	-
34	其中:买入返售金融资产	-	-
35	其中:买入返售金融资产	-	-
36	其中:买入返售金融资产	-	-
37	其中:买入返售金融资产	-	-
38	其中:买入返售金融资产	-	-
39	其中:买入返售金融资产	-	-
40	其中:买入返售金融资产	-	-
41	其中:买入返售金融资产	-	-
42	其中:买入返售金融资产	-	-
43	其中:买入返售金融资产	-	-
44	其中:买入返售金融资产	-	-
45	其中:买入返售金融资产	-	-
46	其中:买入返售金融资产	-	-
47	其中:买入返售金融资产	-	-
48	其中:买入返售金融资产	-	-
49	其中:买入返售金融资产	-	-
50	其中:买入返售金融资产	-	-
51	其中:买入返售金融资产	-	-
52	其中:买入返售金融资产	-	-
53	其中:买入返售金融资产	-	-
54	其中:买入返售金融资产	-	-
55	其中:买入返售金融资产	-	-
56	其中:买入返售金融资产	-	-
57	其中:买入返售金融资产	-	-
58	其中:买入返售金融资产	-	-
59	其中:买入返售金融资产	-	-
60	其中:买入返售金融资产	-	-
61	其中:买入返售金融资产	-	-
62	其中:买入返售金融资产	-	-
63	其中:买入返售金融资产	-	-
64	其中:买入返售金融资产	-	-
65	其中:买入返售金融资产	-	-
66	其中:买入返售金融资产	-	-
67	其中:买入返售金融资产	-	-
68	其中:买入返售金融资产	-	-
69	其中:买入返售金融资产	-	-
70	其中:买入返售金融资产	-	-
71	其中:买入返售金融资产	-	-
72	其中:买入返售金融资产	-	-
73	其中:买入返售金融资产	-	-
74	其中:买入返售金融资产	-	-
75	其中:买入返售金融资产	-	-
76	其中:买入返售金融资产	-	-
77	其中:买入返售金融资产	-	-
78	其中:买入返售金融资产	-	-
79	其中:买入返售金融资产	-	-
80	其中:买入返售金融资产	-	-
81	其中:买入返售金融资产	-	-
82	其中:买入返售金融资产	-	-
83	其中:买入返售金融资产	-	-
84	其中:买入返售金融资产	-	-
85	其中:买入返售金融资产	-	-
86	其中:买入返售金融资产	-	-
87	其中:买入返售金融资产	-	-
88	其中:买入返售金融资产	-	-
89	其中:买入返售金融资产	-	-
90	其中:买入返售金融资产	-	-
91	其中:买入返售金融资产	-	-
92	其中:买入返售金融资产	-	-
93	其中:买入返售金融资产	-	-
94	其中:买入返售金融资产	-	-
95	其中:买入返售金融资产	-	-
96	其中:买入返售金融资产	-	-
97	其中:买入返售金融资产	-	-
98	其中:买入返售金融资产	-	-
99	其中:买入返售金融资产	-	-
100	其中:买入返售金融资产	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	14,026,943.31	0.70
B	采矿业	117,296,884.89	5.83
C	制造业	698,326,006.06	34.71
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	60,205,112.26	2.99
E	建筑业	66,454,548.36	3.30
F	批发和零售业	54,250,200.33	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	53,685,379.23	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,534,157.00	2.86
J	金融业	635,917,256.60	31.61
K	房地产业	87,992,210.34	4.37
L	租赁和商业服务业	13,453,700.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,505,657.94	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,121,782.36	0.50
R	文化、体育和娱乐业	18,446,093.46	0.92
S	综合	1,906,215,938.10	94.74

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	601318	中国平安	1,803,429	75,257,092.17	3.74
2	600036	招商银行	6,172,262	67,215,933.18	3.34
3	600016	民生银行	8,420,583	65,006,900.76	3.23
4	601166	兴业银行	4,263,219	43,229,040.66	2.15
5	600030	中信证券	3,267,626	41,662,231.50	2.07
6	600000	浦发银行	4,173,406	39,355,218.58	1.96
7	600837	浦发证券	3,017,555	34,158,722.60	1.70
8	601328	交通银行	7,688,304	29,523,087.36	1.47
9	000061	格力电器	880,816	28,767,450.56	1.43
10	000002	万科A	3,543,157	28,451,550.71	1.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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权证投资明细

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权证投资明细

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

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

5.10 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

5.11 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

5.12 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

5.13 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

5.14 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

5.15 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

**§6 开放式基金份额变动**

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	-1.54%	1.32%	-1.06%	1.33%	-0.48%	-0.01%

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

广发沪深300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的历史走势对比图  
(2009年11月26日至2013年12月31日)

**§7 基金管理人承诺**

7.1 基金管理人承诺

7.2 基金管理人承诺

7.3 基金管理人承诺

7.4 基金管理人承诺

7.5 基金管理人承诺

7.6 基金管理人承诺

7.7 基金管理人承诺

7.8 基金管理人承诺

7.9 基金管理人承诺

7.10 基金管理人承诺

7.11 基金管理人承诺

7.12 基金管理人承诺

7.13 基金管理人承诺

7.14 基金管理人承诺

7.15 基金管理人承诺

7.16 基金管理人承诺

7.17 基金管理人承诺

7.18 基金管理人承诺

7.19 基金管理人承诺

7.20 基金管理人承诺

7.21 基金管理人承诺

7.22 基金管理人承诺

7.23 基金管理人承诺

7.24 基金管理人承诺

7.25 基金管理人承诺

7.26 基金管理人承诺

7.27 基金管理人承诺

7.28 基金管理人承诺

7.29 基金管理人承诺

7.30 基金管理人承诺

7.31 基金管理人承诺

7.32 基金管理人承诺

7.33 基金管理人承诺

7.34 基金管理人承诺

7.35 基金管理人承诺

7.36 基金管理人承诺

7.37 基金管理人承诺

7.38 基金管理人承诺

7.39 基金管理人承诺

7.40 基金管理人承诺

7.41 基金管理人承诺

7.42 基金管理人承诺

7.43 基金管理人承诺

7.44 基金管理人承诺

7.45 基金管理人承诺

7.46 基金管理人承诺

7.47 基金管理人承诺

7.48 基金管理人承诺

7.49 基金管理人承诺

7.50 基金管理人承诺

7.51 基金管理人承诺

7.52 基金管理人承诺

7.53 基金管理人承诺

7.54 基金管理人承诺

7.55 基金管理人承诺

7.56 基金管理人承诺

7.57 基金管理人承诺

7.58 基金管理人承诺

7.59 基金管理人承诺

7.60 基金管理人承诺

7.61 基金管理人承诺

7.62 基金管理人承诺

7.63 基金管理人承诺

7.64 基金管理人承诺

7.65 基金管理人承诺

7.66 基金管理人承诺

7.67 基金管理人承诺

7.68 基金管理人承诺

7.69 基金管理人承诺

7.70 基金管理人承诺

7.71 基金管理人承诺

7.72 基金管理人承诺

7.73 基金管理人承诺

7.74 基金管理人承诺

7.75 基金管理人承诺

7.76 基金管理人承诺

7.77 基金管理人承诺

7.78 基金管理人承诺

7.79 基金管理人承诺

7.80 基金管理人承诺

7.81 基金管理人承诺

7.82 基金管理人承诺

7.83 基金管理人承诺

7.84 基金管理人承诺

7.85 基金管理人承诺

7.86 基金管理人承诺

7.87 基金管理人承诺

7.88 基金管理人承诺

7.89 基金管理人承诺

7.90 基金管理人承诺

7.91 基金管理人承诺

7.92 基金管理人承诺

7.93 基金管理人承诺

7.94 基金管理人承诺

7.95 基金管理人承诺

7.96 基金管理人承诺

7.97 基金管理人承诺

7.98 基金管理人承诺

7.99 基金管理人承诺

7.100 基金管理人承诺

**§8 基金管理人承诺**

8.1 基金管理人承诺

8.2 基金管理人承诺

8.3 基金管理人承诺

8.4 基金管理人承诺

8.5 基金管理人承诺

8.6 基金管理人承诺

8.7 基金管理人承诺

8.8 基金管理人承诺

8.9 基金管理人承诺

8.10 基金管理人承诺

8.11 基金管理人承诺

8.12 基金管理人承诺

8.13 基金管理人承诺

8.14 基金管理人承诺

8.15 基金管理人承诺

8.16 基金管理人承诺

8.17 基金管理人承诺

8.18 基金管理人承诺

8.19 基金管理人承诺

8.20 基金管理人承诺

8.21 基金管理人承诺

8.22 基金管理人承诺

8.23 基金管理人承诺

8.24 基金管理人承诺

8.25 基金管理人承诺

8.26 基金管理人承诺

8.27 基金管理人承诺

8.28 基金管理人承诺

8.29 基金管理人承诺

8.30 基金管理人承诺

8.31 基金管理人承诺

8.32 基金管理人承诺

8.33 基金管理人承诺

8.34 基金管理人承诺

8.35 基金管理人承诺

8.36 基金管理人承诺

8.37 基金管理人承诺

8.38 基金管理人承诺

8.39 基金管理人承诺

8.40 基金管理人承诺

8.41 基金管理人承诺

8.42 基金管理人承诺

8.43 基金管理人承诺

8.44 基金管理人承诺

8.45 基金管理人承诺

8.46 基金管理人承诺

8.47 基金管理人承诺

8.48 基金管理人承诺

8.49 基金管理人承诺

8.50 基金管理人承诺

8.51 基金管理人承诺

8.52 基金管理人承诺

8.53 基金管理人承诺

8.54 基金管理人承诺

8.55 基金管理人承诺

8.56 基金管理人承诺

8.57 基金管理人承诺

8.58 基金管理人承诺

8.59 基金管理人承诺

8.60 基金管理人承诺

8.61 基金管理人承诺

8.62 基金管理人承诺

8.63 基金管理人承诺

8.64 基金管理人承诺

8.65 基金管理人承诺

8.66 基金管理人承诺

8.67 基金管理人承诺

8.68 基金管理人承诺

8.69 基金管理人承诺

8.70 基金管理人承诺

8.71 基金管理人承诺

8.72 基金管理人承诺

8.73 基金管理人承诺

8.74 基金管理人承诺

8.75 基金管理人承诺

8.76 基金管理人承诺

8.77 基金管理人承诺

8.78 基金管理人承诺

8.79 基金管理人承诺

8.80 基金管理人承诺

8.81 基金管理人承诺

8.82 基金管理人承诺

8.83 基金管理人承诺

8.84 基金管理人承诺

8.85 基金管理人承诺

8.86 基金管理人承诺

8.87 基金管理人承诺

8.88 基金管理人承诺

8.89 基金管理人承诺

8.90 基金管理人承诺

8.91 基金管理人承诺

8.92 基金管理人承诺

8.93 基金管理人承诺

8.94 基金管理人承诺

8.95 基金管理人承诺

8.96 基金管理人承诺

8.97 基金管理人承诺

8.98 基金管理人承诺

8.99 基金管理人承诺

8.100 基金管理人承诺

**§9 基金管理人承诺**

9.1 基金管理人承诺

9.2 基金管理人承诺

9.3 基金管理人承诺

9.4 基金管理人承诺

9.5 基金管理人承诺

9.6 基金管理人承诺

9.7 基金管理人承诺

9.8 基金管理人承诺

9.9 基金管理人承诺

9.10 基金管理人承诺

9.11 基金管理人承诺

9.12 基金管理人承诺

9.13 基金管理人承诺

9.14 基金管理人承诺

9.15 基金管理人承诺

9.16 基金管理人承诺

9.17 基金管理人承诺

9.18 基金管理人承诺

9.19 基金管理人承诺

9.20 基金管理人承诺

9.21 基金管理人承诺

9.22 基金管理人承诺

9.23 基金管理人承诺

9.24 基金管理人承诺

9.25 基金管理人承诺

9.26 基金管理人承诺

9.27 基金管理人承诺

9.28 基金管理人承诺

9.29 基金管理人承诺</