

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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:广发中证500ETF联接基金(LOF)

场内简称:广证500L

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

报告期末基金份额总额:3,758,440,863.96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。

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收益率的差额控制在0.35%以内,年度跟踪误差控制在4%以内。

(一)基金主要投资策略

本基金主要投资于目标ETF,标的指数成份股,备选成份股,其中投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%。

本基金将通过在二级市场买入或卖出成份股、备选成份股、目标ETF、现金、回购的金融资产等资产,以及在场外合法持有的其他基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在适当的时机下,更好地跟踪标的指数的市场实际,适当调整本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

本基金在日常投资管理中,本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和赎回目标ETF的基金份额,实现指数化投资目标。同时,本基金将通过二级市场在深交所直接买入、卖出目标ETF及目标ETF的现金替代品,以及通过场外交易机制,赎回或交易方式进行更灵活调整,本基金也将根据相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

2.投资组合的调整

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

2.股票组合的调整

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(1)定期调整

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(2)不定期调整

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

针对本基金投资市场股发行限制的限制,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并在一定时间内卖出。

(3)定期停牌

本基金将通过自上而下的宏观分析,结合金融市场政策和利率走势的判定确定投资组合的停牌期限,并根据对个股相对价值的评估,进行股票停牌和复牌。停牌费用的主要是对停牌基金的估值。

(4)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(5)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(6)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(7)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(8)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(9)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(10)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(11)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(12)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(13)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(14)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(15)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(16)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(17)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(18)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(19)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(20)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(21)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(22)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(23)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(24)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(25)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(26)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(27)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(28)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(29)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(30)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(31)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(32)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(33)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(34)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(35)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(36)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(37)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(38)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(39)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(40)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(41)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(42)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(43)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(44)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(45)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(46)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(47)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(48)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(49)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(50)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(51)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(52)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(53)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(54)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(55)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。

(56)定期调仓

本基金将根据指数成份股的行业分布和行业权重,并根据成份股的行业分布及其对投资组合的构建,对投资组合的构成,按照行业指数化投资的框架构建股票组合。