

## 广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

## 2014 年半年度报告摘要

## 1 重要提示

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：二〇一四年八月二十九日

1.4 相关提示

基金管理人的董事、董事会、监事保证本报告所披露信息不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。本半年度报告经审计，并由注册会计师出具标准无保留意见的审计报告。

基金托管人对本基金年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容进行复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏。

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。

基金过往业绩并不代表基金未来表现，投资需谨慎。投资人投资在本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新报告。

本半年度报告摘要附载于半年报全文，投资人欲了解详细内容，应阅读半年报全文。

本报告所载内容除非另有说明，均以人民币元为单位。

本报告期自2014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

基金名称 广发中证500ETF

基金代码 510510

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2013年4月1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

报告期末基金资产总额 2,315,083,919.09份

不适用

基金合同存续期间 2013年2月4日

2.2 基金产品说明

投资目标 密密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要选取完全复制指数的成份股构成及其权重重构指数化投资组合，并根据指数的成份股分布及其权重变动进行定期的调整，本基金投资目标的指数成份股及权重构造的规则以标的指数基金资产的95%。

业绩比较基准 中证500指数

风险收益特征 本基金为交易型开放式指数基金，风险收益特征与标的指数相似，具有与标的指数一致的收益风险特征。

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

姓名 彭文军 赵军会

信息披露负责人 联系电话 020-83936666 010-66105799

电子邮箱 dcs@sfzsfund.com.cn csndsfy@sfzsfund.com

客户服务电话 95105828/020-83936999 95588

传真 020-80991158 010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人及披露网站 <http://www.gffund.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

金额单位：人民币元

3.1 本期期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期末基金资产净值 20,096,585.93

本期利润 108,610,551.18

加权平均基金份额本期利润 0.0406

本期基金份额净值增长率 2.69%

3.1.2 本期末基金资产净值 报告期(2014年6月30日)

基金资产净值 0.0588

期末基金资产净值 2,559,981,649.63

期末基金资产净值增长率 1.0588

注：(1) 上述基金净值增长率不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算公式见报告期首尾日基金资产净值之差除以报告期首尾日的份额数，本期利润为本期已实现收益加上本期未实现收益扣除相关费用后的余额，本期利润率为本期已实现收益占本期资产净值的百分比。

(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)扣除与相关的费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期未实现收益。

(3) 本期可供分配利润指采用“期末可供分配利润”与“未分配利润”孰低的孰低原则计算的可供分配利润，为期末余额，不是当期利润。

3.2 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.3.1 本期期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位：人民币元

项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日

上年度可比期间 2013年4月1日至2013年6月30日

年初至报告期期初基金资产净值 121,631,381.30

本期利润 3,403,332.78

本期利润 109,252.75

年初至报告期期初基金资产净值 107,669.18

本期利润 87,995.38

期末至报告期期初基金资产净值 1,583.57

本期利润 0

期末至报告期期初基金资产净值 0

本期利润 0