

信息披露

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2014年半年度报告摘要

根据本基金合同中“基金的投资与配置”之“基金资产配置原则”的相关规定,本基金报告期内未进行资产配置,符合合同约定。

5.1 报告期内基金管理人遵守情况说明

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

5.2 管理人对于报告期内本基金投资运作遵守情况、净值计算、利润分配等情况的说明
 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。
 5.3 管理人对于报告期内本基金投资运作遵守情况、净值计算、利润分配等情况的说明
 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.1 资产负债表

单位:人民币元

资产	2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
银行存款	140,722,289.07	165,671,954.80
结算备付金	36,501.07	13,933.40
存出保证金	721,791.92	710,194.41
交易性金融资产	2,528,258,385.59	3,056,166,970.94
其中:股票投资	3,808,189.76	7,611,278.15
债券投资	2,524,450,195.83	3,048,555,692.89

资产支持证券

单位:人民币元

资产支持证券	2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
待摊费用	—	—
应收利息	24,837.95	33,266.19
应收股利	—	—
其他资产	246,878.08	684,176.16
其他资产	—	—
资产总计	2,670,336,663.68	3,229,500,983.87

负债和所有者权益

单位:人民币元

负债和所有者权益	2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:	—	—
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
应付账款	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他负债	—	—
所有者权益:	—	—
实收资本	3,063,379,835.70	3,063,379,835.70
未分配利润	—	—
所有者权益合计	3,063,379,835.70	3,063,379,835.70

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.2 利润表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.4 现金流量表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、经营活动产生的现金流量	—	—
1.销售商品、提供劳务收到的现金	—	—
2.收到的税费返还	—	—
3.收到其他与经营活动有关的现金	—	—
其中:收到其他与经营活动有关的现金	—	—
二、投资活动产生的现金流量	—	—
1.收回投资收到的现金	—	—
2.取得投资收益收到的现金	—	—
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	—	—
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	—	—
5.收到其他与投资活动有关的现金	—	—
其中:收到其他与投资活动有关的现金	—	—
三、筹资活动产生的现金流量	—	—
1.吸收投资收到的现金	—	—
2.发行债券收到的现金	—	—
3.取得借款收到的现金	—	—
4.收到其他与筹资活动有关的现金	—	—
其中:收到其他与筹资活动有关的现金	—	—
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	—	—
五、现金及现金等价物净增加额	—	—
六、期初现金及现金等价物余额	—	—
七、期末现金及现金等价物余额	—	—

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.5 利润分配表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、可供分配利润	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.6 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.7 现金流量表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、经营活动产生的现金流量	—	—
1.销售商品、提供劳务收到的现金	—	—
2.收到的税费返还	—	—
3.收到其他与经营活动有关的现金	—	—
其中:收到其他与经营活动有关的现金	—	—
二、投资活动产生的现金流量	—	—
1.收回投资收到的现金	—	—
2.取得投资收益收到的现金	—	—
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	—	—
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	—	—
5.收到其他与投资活动有关的现金	—	—
其中:收到其他与投资活动有关的现金	—	—
三、筹资活动产生的现金流量	—	—
1.吸收投资收到的现金	—	—
2.发行债券收到的现金	—	—
3.取得借款收到的现金	—	—
4.收到其他与筹资活动有关的现金	—	—
其中:收到其他与筹资活动有关的现金	—	—
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	—	—
五、现金及现金等价物净增加额	—	—
六、期初现金及现金等价物余额	—	—
七、期末现金及现金等价物余额	—	—

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.8 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.9 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.10 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,487,195.50	71,003,247.46
1.利息收入	659,573.18	715,920.69
其中:存款利息收入	659,573.18	715,920.69
资产支持证券利息收入	—	67.40
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,432,511.38	-90,159,526.52
其中:股票投资收益	76,243.18	-109,217,042.46
基金投资收益	-8,196,625.57	—
债券投资收益	—	121,110.94
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
利息收入	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	2,318,906.93	15,681,693.13
1.管理人报酬	44,937.34	10,898,595.87
2.托管费	88,792.42	2,011,719.20
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	1,528,396.19	3,374,897.79
其中:支付给基金管理人报酬	—	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	96,168,288.57	55,321,549.33

注:报告期内基金管理人遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金管理人应尽的义务。

6.11 所有者权益(基金净值)变动表