

信息披露 Disclosure

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月二十一日

§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法律责任。

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2015年7月15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,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证500ETF
场内简称	广发500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日期	2013年10月30日
跟踪标的资产净值	1,000,000,000.00
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	中证500指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币型基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数中500股的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
报告期	截至
(2015年4月1日至2015年6月30日)	
1.本期已实现收益	1,487,202,307.16
2.本期利润	71,165,102.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0901
4.期末基金资产净值	2,598,183,779.24
5.期末基金份额净值	2.906

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或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字。

(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。

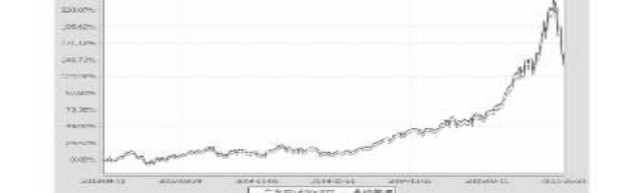
3.2 基金净值表现

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对比

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去三个月	22.95%	2.90%	22.79%	2.90%
			0.16%	0.05%

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

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年4月1日至2015年6月30日)



§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
刘杰	本基金基金经理	任职日期: 2014-04-01 离任日期: -	11年	男,中国籍,工学学士,持有基金从业资格,于2004年7月和2005年11月在广发基金管理有限公司先后担任:广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)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 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明
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,《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制风险的基础上,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 公平交易制度的执行情况
本公司建立科学、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分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作须经投资决策委员会审批。在交易过程中,中央交易室严格执行“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。监察稽核部实时监控投资组合交易行为,对异常交易行为进行实时监控,发现异常交易行为及时报告,实现投资风险的实时监控,稽核通过投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的实时监控。

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公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易的专项说明
本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合除外)或同一投资组合内同一交易日内进行反向交易。如果因对大额赎回等特殊情况进行需要反向交易的,则需经投资决策委员会事先批准。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生反向交易的情况,但成交较少的单边交易未超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.2 报告期内基金业绩表现说明

4.4.3 报告期内基金业绩表现说明
4.4.4 报告期内基金业绩表现说明

4.4.5 报告期内基金业绩表现说明
4.4.6 报告期内基金业绩表现说明

4.4.7 报告期内基金业绩表现说明
4.4.8 报告期内基金业绩表现说明

4.4.9 报告期内基金业绩表现说明
4.4.10 报告期内基金业绩表现说明

4.4.11 报告期内基金业绩表现说明
4.4.12 报告期内基金业绩表现说明

4.4.13 报告期内基金业绩表现说明
4.4.14 报告期内基金业绩表现说明

4.4.15 报告期内基金业绩表现说明
4.4.16 报告期内基金业绩表现说明

4.4.17 报告期内基金业绩表现说明
4.4.18 报告期内基金业绩表现说明

4.4.19 报告期内基金业绩表现说明
4.4.20 报告期内基金业绩表现说明

4.4.21 报告期内基金业绩表现说明
4.4.22 报告期内基金业绩表现说明

4.4.23 报告期内基金业绩表现说明
4.4.24 报告期内基金业绩表现说明

4.4.25 报告期内基金业绩表现说明
4.4.26 报告期内基金业绩表现说明

4.4.27 报告期内基金业绩表现说明
4.4.28 报告期内基金业绩表现说明

4.4.29 报告期内基金业绩表现说明
4.4.30 报告期内基金业绩表现说明

4.4.31 报告期内基金业绩表现说明
4.4.32 报告期内基金业绩表现说明

4.4.33 报告期内基金业绩表现说明
4.4.34 报告期内基金业绩表现说明

4.4.35 报告期内基金业绩表现说明
4.4.36 报告期内基金业绩表现说明

4.4.37 报告期内基金业绩表现说明
4.4.38 报告期内基金业绩表现说明

4.4.39 报告期内基金业绩表现说明
4.4.40 报告期内基金业绩表现说明

4.4.41 报告期内基金业绩表现说明
4.4.42 报告期内基金业绩表现说明

4.4.43 报告期内基金业绩表现说明
4.4.44 报告期内基金业绩表现说明

4.4.45 报告期内基金业绩表现说明
4.4.46 报告期内基金业绩表现说明

4.4.47 报告期内基金业绩表现说明
4.4.48 报告期内基金业绩表现说明

4.4.49 报告期内基金业绩表现说明
4.4.50 报告期内基金业绩表现说明

4.4.51 报告期内基金业绩表现说明
4.4.52 报告期内基金业绩表现说明

4.4.53 报告期内基金业绩表现说明
4.4.54 报告期内基金业绩表现说明

4.4.55 报告期内基金业绩表现说明
4.4.56 报告期内基金业绩表现说明

4.4.57 报告期内基金业绩表现说明
4.4.58 报告期内基金业绩表现说明

4.4.59 报告期内基金业绩表现说明
4.4.60 报告期内基金业绩表现说明

4.4.61 报告期内基金业绩表现说明
4.4.62 报告期内基金业绩表现说明

4.4.63 报告期内基金业绩表现说明
4.4.64 报告期内基金业绩表现说明

4.4.65 报告期内基金业绩表现说明
4.4.66 报告期内基金业绩表现说明

4.4.67 报告期内基金业绩表现说明
4.4.68 报告期内基金业绩表现说明

4.4.69 报告期内基金业绩表现说明
4.4.70 报告期内基金业绩表现说明

4.4.71 报告期内基金业绩表现说明
4.4.72 报告期内基金业绩表现说明

4.4.73 报告期内基金业绩表现说明
4.4.74 报告期内基金业绩表现说明

4.4.75 报告期内基金业绩表现说明
4.4.76 报告期内基金业绩表现说明

4.4.77 报告期内基金业绩表现说明
4.4.78 报告期内基金业绩表现说明

4.4.79 报告期内基金业绩表现说明
4.4.80 报告期内基金业绩表现说明

4.4.81 报告期内基金业绩表现说明
4.4.82 报告期内基金业绩表现说明

4.4.83 报告期内基金业绩表现说明
4.4.84 报告期内基金业绩表现说明

4.4.85 报告期内基金业绩表现说明
4.4.86 报告期内基金业绩表现说明

4.4.87 报告期内基金业绩表现说明
4.4.88 报告期内基金业绩表现说明

4.4.89 报告期内基金业绩表现说明
4.4.90 报告期内基金业绩表现说明

4.4.91 报告期内基金业绩表现说明
4.4.92 报告期内基金业绩表现说明

4.4.93 报告期内基金业绩表现说明
4.4.94 报告期内基金业绩表现说明

4.4.95 报告期内基金业绩表现说明
4.4.96 报告期内基金业绩表现说明

4.4.97 报告期内基金业绩表现说明
4.4.98 报告期内基金业绩表现说明

4.4.99 报告期内基金业绩表现说明
4.4.100 报告期内基金业绩表现说明

4.4.101 报告期内基金业绩表现说明
4.4.102 报告期内基金业绩表现说明

4.4.103 报告期内基金业绩表现说明
4.4.104 报告期内基金业绩表现说明

4.4.105 报告期内基金业绩表现说明
4.4.106 报告期内基金业绩表现说明

4.4.107 报告期内基金业绩表现说明
4.4.108 报告期内基金业绩表现说明

4.4.109 报告期内基金业绩表现说明
4.4.110 报告期内基金业绩表现说明

4.4.111 报告期内基金业绩表现说明
4.4.112 报告期内基金业绩表现说明

4.4.113 报告期内基金业绩表现说明
4.4.114 报告期内基金业绩表现说明

4.4.115 报告期内基金业绩表现说明
4.4.116 报告期内基金业绩表现说明

4.4.117 报告期内基金业绩表现说明
4.4.118 报告期内基金业绩表现说明

4.4.119 报告期内基金业绩表现说明
4.4.120 报告期内基金业绩表现说明

4.4.121 报告期内基金业绩表现说明
4.4.122 报告期内基金业绩表现说明

4.4.123 报告期内基金业绩表现说明
4.4.124 报告期内基金业绩表现说明

4.4.125 报告期内基金业绩表现说明
4.4.126 报告期内基金业绩表现说明

4.4.127 报告期内基金业绩表现说明
4.4.128 报告期内基金业绩表现说明

4.4.129 报告期内基金业绩表现说明
4.4.130 报告期内基金业绩表现说明

4.4.131 报告期内基金业绩表现说明
4.4.132 报告期内基金业绩表现说明

4.4.133 报告期内基金业绩表现说明
4.4.134 报告期内基金业绩表现说明

4.4.135 报告期内基金业绩表现说明
4.4.136 报告期内基金业绩表现说明

4.4.137 报告期内基金业绩表现说明
4.4.138 报告期内基金业绩表现说明

4.4.139 报告期内基金业绩表现说明
4.4.140 报告期内基金业绩表现说明

4.4.141 报告期内基金业绩表现说明
4.4.142 报告期内基金业绩表现说明

4.4.143 报告期内基金业绩表现说明
4.4.144 报告期内基金业绩表现说明

4.4.145 报告期内基金业绩表现说明
4.4.146 报告期内基金业绩表现说明

4.4.147 报告期内基金业绩表现说明
4.4.148 报告期内基金业绩表现说明

4.4.149 报告期内基金业绩表现说明
4.4.150 报告期内基金业绩表现说明

4.4.151 报告期内基金业绩表现说明
4.4.152 报告期内基金业绩表现说明

4.4.153 报告期内基金业绩表现说明
4.4.154 报告期内基金业绩表现说明

4.4.155 报告期内基金业绩表现说明
4.4.156 报告期内基金业绩表现说明

4.4.157 报告期内基金业绩表现说明
4.4.158 报告期内基金业绩表现说明

4.4.159 报告期内基金业绩表现说明
4.4.160 报告期内基金业绩表现说明

4.4.161 报告期内基金业绩表现说明
4.4.162 报告期内基金业绩表现说明

4.4.163 报告期内基金业绩表现说明
4.4.164 报告期内基金业绩表现说明

4.4.165 报告期内基金业绩表现说明
4.4.166 报告期内基金业绩表现说明

4.4.167 报告期内基金业绩表现说明
4.4.168 报告期内基金业绩表现说明

4.4.169 报告期内基金业绩表现说明
4.4.170 报告期内基金业绩表现说明

4.4.171 报告期内基金业绩表现说明
4.4.172 报告期内基金业绩表现说明

4.4.173 报告期内基金业绩表现说明
4.4.174 报告期内基金业绩表现说明

4.4.175 报告期内基金业绩表现说明
4.4.176 报告期内基金业绩表现说明

4.4.177 报告期内基金业绩表现说明
4.4.178 报告期内基金业绩表现说明

4.4.179 报告期内基金业绩表现说明
4.4.180 报告期内基金业绩表现说明

4.4.181 报告期内基金业绩表现说明
4.4.182 报告期内基金业绩表现说明

4.4.183 报告期内基金业绩表现说明
4.4.184 报告期内基金业绩表现说明

4.4.185 报告期内基金业绩表现说明
4.4.186 报告期内基金业绩表现说明

4.4.187 报告期内基金业绩表现说明
4.4.188 报告期内基金业绩表现说明

4.4.189 报告期内基金业绩表现说明
4.4.190 报告期内基金业绩表现说明

4.4.191 报告期内基金业绩表现说明
4.4.192 报告期内基金业绩表现说明

4.4.193 报告期内基金业绩表现说明
4.4.194 报告期内基金业绩表现说明

4.4.195 报告期内基金业绩表现说明
4.4.196 报告期内基金业绩表现说明

4.4.197 报告期内基金业绩表现说明
4.4.198 报告期内基金业绩表现说明

4.4.199 报告期内基金业绩表现说明
4.4.200 报告期内基金业绩表现说明

4.4.201 报告期内基金业绩表现说明
4.4.202 报告期内基金业绩表现说明

4.4.203 报告期内基金业绩表现说明
4.4.204 报告期内基金业绩表现说明

4.4.205 报告期内基金业绩表现说明
4.4.206 报告期内基金业绩表现说明

4.4.207 报告期内基金业绩表现说明
4.4.208 报告期内基金业绩表现说明

4.4.209 报告期内基金业绩表现说明
4.4.210 报告期内基金业绩表现说明

4.4.211 报告期内基金业绩表现说明
4.4.212 报告期内基金业绩表现说明

4.4.213 报告期内基金业绩表现说明
4.4.214 报告期内基金业绩表现说明

4.4.215 报告期内基金业绩表现说明
4.4.216 报告期内基金业绩表现说明

4.4.217 报告期内基金业绩表现说明
4.4.218 报告期内基金业绩表现说明

4.4.219 报告期内基金业绩表现说明
4.4.220 报告期内基金业绩表现说明

4.4.221 报告期内基金业绩表现说明
4.4.222 报告期内基金业绩表现说明

4.4.223 报告期内基金业绩表现说明
4.4.224 报告期内基金业绩表现说明

4.4.225 报告期内基金业绩表现说明
4.4.226 报告期内基金业绩表现说明

4.4.227 报告期内基金业绩表现说明
4.4.228 报告期内基金业绩表现说明

4.4.229 报告期内基金业绩表现说明
4.4.230 报告期内基金业绩表现说明

4.4.231 报告期内基金业绩表现说明
4.4.232 报告期内基金业绩表现说明

4.4.233 报告期内基金业绩表现说明
4.4.234 报告期内基金业绩表现说明

4.4.235 报告期内基金业绩表现说明
4.4.236 报告期内基金业绩表现说明

4.4.237 报告期内基金业绩表现说明
4.4.238 报告期内基金业绩表现说明

4.4.239 报告期内基金业绩表现说明
4.4.240 报告期内基金业绩表现说明

4.4.241 报告期内基金业绩表现说明
4.4.242 报告期内基金业绩表现说明

4.4.243 报告期内基金业绩表现说明
4.4.244 报告期内基金业绩表现说明

4.4.245 报告期内基金业绩表现说明
4.4.246 报告期内基金业绩表现说明

4.4.247 报告期内基金业绩表现说明
4.4.248 报告期内基金业绩表现说明

4.4.249 报告期内基金业绩表现说明
4.4.250 报告期内基金业绩表现说明

4.4.251 报告期内基金业绩表现说明
4.4.252 报告期内基金业绩表现说明

4.4.253 报告期内基金业绩表现说明
4.4.254 报告期内基金业绩表现说明

4.4.255 报告期内基金业绩表现说明
4.4.256 报告期内基金业绩表现说明

4.4.257 报告期内基金业绩表现说明
4.4.258 报告期内基金业绩表现说明

4.4.259 报告期内基金业绩表现说明
4.4.260 报告期内基金业绩表现说明

4.4.261 报告期内基金业绩表现说明
4.4.262 报告期内基金业绩表现说明

4.4.263 报告期内基金业绩表现说明
4.4.264 报告期内基金业绩表现说明

4.4.265 报告期内基金业绩表现说明
4.4.266 报告期内基金业绩表现说明

4.4.267 报告期内基金业绩表现说明
4.4.268 报告期内基金业绩表现说明

4.4.269 报告期内基金业绩表现说明
4.4.270 报告期内基金业绩表现说明

4.4.271 报告期内基金业绩表现说明
4.4.272 报告期内基金业绩表现说明

4.4.273 报告期内基金业绩表现说明
4.4.274 报告期内基金业绩表现说明

4.4.275 报告期内基金业绩表现说明
4.4.276 报告期内基金业绩表现说明

4.4.277 报告期内基金业绩表现说明
4.4.278 报告期内基金业绩表现说明

4.4.279 报告期内基金业绩表现说明
4.4.280 报告期内基金业绩表现说明

4.4.281 报告期内基金业绩表现说明
4.4.282 报告期内基金业绩表现说明

4.4.283 报告期内基金业绩表现说明
4.4.284 报告期内基金业绩表现说明

4.4.285 报告期内基金业绩表现说明
4.4.286 报告期内基金业绩表现说明

4.4.287 报告期内基金业绩表现说明
4.4.288 报告期内基金业绩表现说明

4.4.289 报告期内基金业绩表现说明
4.4.290 报告期内基金业绩表现说明

4.4.291 报告期内基金业绩表现说明
4.4.292 报告期内基金业绩表现说明