广发增强债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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2015年10月21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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发增强债券
基金主代码	270009
交易代码	270009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年3月27日
报告期末基金份额总额	882,557,936.14份
投资目标	在保持投资组合低风险和较高流动性的前提下,追求基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债券、可转换公司债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购,持有因可转债转股所形成的股票及该股票派发的权证或可分离交易可转债分离交易的权证等资产,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券品种。因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。本基金不通过二级市场买入股票或权证。本基金债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%,非债券类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 本基金通过利率预测、收益曲线预测、债券类属配置、信用策略和获利机会挖掘构建固定收益类资产投资组合;本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购参与标的、参与规模和退出时机。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,具有低风险,低预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	16,535,341.88
2.本期利润	25,310,036.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0375
4.期末基金资产净值	1,155,092,254.60
5.期末基金份额净值	1.309

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	4.14%	0.11%	2.57%	0.06%	1.57%	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

广发增强债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年3月27日至2015年9月30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
		任职日期	离任日期		
谢军	本基金的基金经理;广发聚源定期债券基金的基金经理;固定收益部副总经理	2008-03-27	-	12年	男,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书和特许金融分析师状(CFA),2003年7月至2006年9月先后任广发基金管理有限公司研究发展部产品设计人员、企业年金和债券研究员,2006年9月12日至2010年4月28日任广发货币基金的基金经理,2008年3月27日起任广发增强债券基金基金经理,2008年4月17日至2012年2月14日先后任广发基金管理有限公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理,2011年3月15日至2014年3月20日任广发聚祥保本混合基金的基金经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2013年5月8日起任广发聚源定期债券基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"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、《广发增强债券型证券投资基金基金合同》和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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"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岗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;稽核岗通过对投资、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投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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运作分析

三季度基本面特点:总需求继续低迷,亮点很少,但下滑速度也没有增快趋势。

3季度,在权益市场大幅震荡后,市场避险情绪驱动,资金大幅流向债市,以中等久期可质押信用债为主,后期开始扩散到长久期利率品种。

整体来看,信用债收益率回到10年7月份低点,利差创新低。特别是交易所可质押信用品种收益率受到追捧。

长端利率也有所下行,但仍然比较纠结。

我们维持了前期中低久期套息的策略,新增资金的配置延续了这个思路,在市场利差极低后,大幅度降低了组合的杠杆。目前纯债部分大约20-30%左右杠杆。

权益市场3季度大幅震荡,趋势继续走低。转债市场估值进一步压缩,但目前仍然处于很高的位置,跟权益市场走势背离。

我们在3季度维持了很低的转债仓位,特别是考虑到转债的高估值后,完全清空了转债品种。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发增强债券型基金的净值增长率为4.14%,同期业绩比较基准收益率为2.57%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们维持此前的观点,中期来看收益率大概率是区间波动,上下都很难有效突破。目前出于避险情绪推动的行情,我们保持谨慎。在利差和利率都压到我们预测的下边缘后,组合适度的降低了杠杆。

股市经过前期大幅度震荡后,风险大幅度释放,我们转为中性观点。但是转债受益于稀缺性,价格普遍较高,估值隐含了极高的牛市预期。即使权益反弹,转债品种的性价比也很低,不适合高仓位配置。我们将根据对权益市场的判断和转债本身的估值来进行相关仓位,目前还是维持极低仓位。

综合考虑,组合目前以较高等级城投和优质企业债为主,中等久期、杠杆适度降低,低配利率品种和转债品种。四季度关注转债市场的风险和机会。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,503,998,745.99	96.09
	其中:债券	1,503,998,745.99	96.09
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	23,158,744.55	1.48
7	其他各项资产	38,013,298.99	2.43
8	合计	1,565,170,789.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,821,000.00	10.46
	其中:政策性金融债	120,821,000.00	10.46
4	企业债券	1,026,125,745.99	88.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	357,052,000.00	30.91
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,503,998,745.99	130.21

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101452027	14电网MTN002	500,000	51,060,000.00	4.42
2	101575002	15沪城控MTN001(3年期)	500,000	50,925,000.00	4.41
3	1380064	13洪市政债	400,000	41,792,000.00	3.62
4	1382144	13青城投MTN1	400,000	41,364,000.00	3.58
5	101455002	14汉城投MTN001	300,000	36,072,000.00	3.12

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	131,073.63
2	应收证券清算款	5,719,096.35
3	应收股利	-
4	应收利息	28,310,105.16
5	应收申购款	3,853,023.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,013,298.99

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	321,559,085.18
本报告期基金总申购份额	882,396,429.76
减:本报告期基金总赎回份额	321,396,578.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	882,557,936.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

其中2,151,004.84份为分红再投。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发增强债券型证券投资基金募集的文件;

2.《广发增强债券型证券投资基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发增强债券型证券投资基金托管协议》;

5.《广发增强债券型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一五年十月二十六日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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2015年10月21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。

本报告期自2015年7月1日起至9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	2013年4月11日
报告期末基金份额总额	843,038,319.00份
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的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备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。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、债券型基金与货币市场基金。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证500指数的表现,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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-220,824,306.21
2.本期利润	-746,757,294.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8184
4.期末基金资产净值	1,424,174,201.79
5.期末基金份额净值	1.6893

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

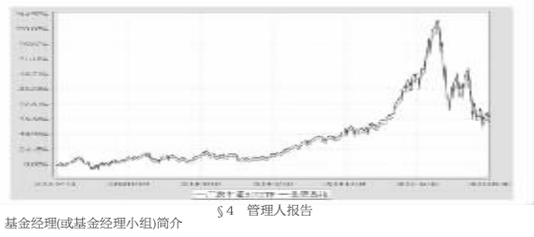
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-32.44%	3.84%	-31.24%	4.03%	-1.20%	-0.19%

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11日至2015年9月30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
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理;广发沪深300指数基金的基金经理;广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理;广发沪深300ETF基金的基金经理	2014-04-01	-	11年	男,中国籍,工学学士,持有基金业执业证书,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司信息技术部工作,2010年11月至2014年3月任广发基金管理有限公司数量投资策略量投资研究员,2014年4月1日起任广发沪深300指数、广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理,2015年8月19日起任广发沪深300ETF基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"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、《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"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岗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;稽核岗通过对投资、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投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,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投资组合。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过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不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嫌疑。

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运作分析

(1)投资策略

作为ETF基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

(2)运作分析

报告期内,本基金交易和申购赎回正常,运作过程中未发生风险事件。

报告期内,本基金日均跟踪误差为0.23%,年化跟踪误差为3.63%,符合要求。

报告期内,本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素,作为ETF基金,申赎影响相对较小且本基金成立以来规模稳步增长,目前的规模水平下,申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

报告期内,本基金经历了整体市场大幅下跌阶段,以及沪深市场停牌股票较多等极端情况,给基金的运作和业绩造成了一定的影响。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为-32.44%,同期业绩比较基准收益率为-31.24%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6月中旬以来,中国股市经历了快速下跌的痛苦阶段,蒸发了巨大的社会财富,尤其对高位入市的投资者造成了巨大的伤害。其中,6月中下旬以及7月份股市大跌,部分原因是杠杆等资金快速推高了整体股市估值水平,以及泡沫快速破灭所带来了系统性风险,引起了恐慌,发生了一些过度的连锁反应;8月中下旬的市场下跌则与全球股市和经济的表现和预期有关;9月份股市表现相对平稳,主要是前期政府的持续救市,流动性注入,配以配资规模、股指期货的有效控制,各板块估值和行情表现进入了稳定阶段。而配资和股指期货的有效治理,未来应该不会再频繁地出现系统性踩踏行情,或者说未来将大概率地避免掉再次恐慌性下跌的情况。

近期,人民币汇率、股票市场均出现企稳迹象,同时全球股市也处于回升修复阶段;10月10日,央行推广信贷资产质押再贷款试点政策,股市终于站上了3200点。

目前,国内经济依然处在转型过程中,稳增长、调结构的过程也将是崎岖曲折的,这也是中国未来经济持续增长的必经之路,中国经济长期是看好的。对于股市来说,国内股市主要还是受信心、国内政策和国际股市等因素综合影响,整体上国内股市经历了前期调整和监管整治,近期市场情绪的明显处于好转过程中,市场风险偏好逐步在修复;展望10月份中下旬以及更长一段时间,国内股市将继续处于企稳阶段,并大概率处于修复回升行情;中证500指数在众多指数中,属于高波动高收益指数,中长期收益相对大部分指数而言,存在明显优势,而在短期表现,往往被誉为"反弹急先锋",我们认为,对于未来的修复行情,投资者若进行中短期的反弹波段操作,可关注中证500指数基金。

§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	1,405,238,904.95	98.02
	其中:股票	1,405,238,904.95	98.02
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	27,581,840.99	1.92
7	其他各项资产	808,335.49	0.06
8	合计	1,433,629,081.43	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,689,827.83	1.31
B	采矿业	33,524,542.32	2.35
C	制造业	836,554,010.47	58.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,116,553.99	3.10
E	建筑业	29,429,375.86	2.07
F	批发和零售业	89,223,204.70	6.26
G	交通运输、仓储和邮政业	45,442,735.28	3.19
H	住宿和餐饮业	2,351,524.11	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,278,354.40	5.22
J	金融业	13,000,318.96	0.91
K	房地产业	94,826,119.73	6.66
L	租赁和商务服务业	55,319,838.39	3.88
M	科学研究和技术服务业	10,218,380.74	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	9,208,868.04	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,413,773.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	23,505,587.16	1.65
S	综合	21,135,888.77	1.48
	合计	1,405,238,903.75	98.67

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	002183	怡亚通	419,307	30,672,307.05	2.15
2	002018	华信国际	293,690	12,945,855.20	0.91
3	000748	长城信息	348,936	12,170,887.68	0.85
4	000566	海南海药	232,789	11,632,466.33	0.82
5	600978	宜华木业	478,799	10,691,581.67	0.75
6	002191	劲嘉股份	489,168	9,401,808.96	0.66
7	002368	太极股份	139,108	9,114,356.16	0.64
8	600645	中源协和	104,331	8,277,621.54	0.58
9	600499	科达洁能	266,600	7,902,024.00	0.55
10	000066	长城电脑	355,247	7,652,020.38	0.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-43,613,877.93
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值主要目的。在构建股票投资组合的同时,通过卖出股指期货对冲市场下行风险,降低系统风险损失,提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	787,900.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,310.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.17
8	其他	-
9	合计	808,335.49

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	30,672,307.05	2.15	重大事项
2	002018	华信国际	12,945,855.20	0.91	重大事项
3	000748	长城信息	12,170,887.68	0.85	重大事项
4	000566	海南海药	11,632,466.33	0.82	重大事项
5	600978	宜华木业	10,691,581.67	0.75	重大事项
6	002191	劲嘉股份	9,401,808.96	0.66	重大事项
7	002368	太极股份	9,114,356.16	0.64	重大事项
8	600645	中源协和	8,277,621.54	0.58	重大事项
9	600499	科达洁能	7,902,024.00	0.55	重大事项
10	000066	长城电脑	7,652,020.38	0.54	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期基金总申购份额	1,039,038,319.00
减:本报告期基金总赎回份额	1,036,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	843,038,319.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3.《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一五年十月二十六日

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

【2015】第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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2015年10月21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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	广发中证500ETF联接(LOF)
场内简称	广发500L
基金主代码	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	1,076,676,090.70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。
投资策略	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4%以内。 (一)资产配置策略 本基金将根据市场的实际情况,适当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 本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方式。 (三)股票投资策略 根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。 (四)债券投资策略 本基金将通过自上而下的宏观分析,结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置,并根据对个券相对价值的比较,进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。 (五)股指期货及其他金融衍生品的投资策略 本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	广发中证500ETF
基金主代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月11日
基金份额上市的证券交易所	上海交易所
上市日期	2013年5月24日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

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。