

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金 2017年年度报告摘要

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：二〇一八年三月二十七日

1.1 重要提示

本报告期内，本基金管理人恪守诚信原则，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事审核同意，并由本独立董事签字确认，并由董事长签发。
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2018年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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、勤勉尽责的原则履行受托职责，但不保证基金一定盈利，基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读基金的投资说明书及其摘要。

本报告正文同时刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上，投资者欲了解本报告全文，应阅读年度报告正文。本报告自2017年11月1日起至12月31日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况	2.2 基金管理人
基金名称 广发中证500ETF	广发基金管理有限公司
基金简称 中证500	广发基金
基金代码 151010	005010
交易代码 151010	005010
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	
截至期末基金份额总额 828,128,070.99份	
基金份额净值 1.0000	
基金合同存续期限 不定期	
上市日期 2013年10月24日	

2.3 基金业绩说明
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。
投资策略 本基金采用完全复制法，跟踪标的指数的构成及其权重，并根据标的指数成分股及其权重进行资产配置，并适时进行投资组合调整，以实现对标的指数的有效跟踪。本基金采用被动投资策略，力求跟踪标的指数的表现，力争实现与标的指数的收益水平相一致。
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、债券型基金及货币型基金。本基金为股票型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场和个股相类似的风险收益特征。

2.4 基金管理人及基金托管人

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
负责人姓名	林广生	姜建清
信息披露负责人	魏超	张宁
电子邮箱	020-63306666	010-66105799
电话	020-63306666	010-66105799
客户服务热线	9510588; 020-63306666	95588
传真	020-88889158	010-66105798
基金管理人网站	http://www.gffund.com.cn	
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 主要会计数据和财务指标	2017年	2016年	金额单位：人民币元
本期已实现收益	39,401,767.42	-216,866,403.57	1,489,072,527.79
本期公允价值变动收益	30,006,134.49	-264,572,628.02	1,077,402,640.41
加回公允价值基金份额本期利	0.032%	-0.282%	0.0030%
期末基金份额净值增长率	0.76%	-16.79%	38.79%
3.1.2 期末基金份额净值	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利	0.7301	0.7257	1.0728
期末基金份额净值	1,434,458,124.90	1,365,129,465.08	1,660,385,897.48
期末基金份额净值	1.7301	1.7257	2.0728

注：(1) 本基金业绩指标不包括持有买入返购基金份额的交易费用，计入费用后实际收益水平有所降低。
(2) 本期3.1.2项下基金份额净值增长率，是指基金份额净值增长率，不含公允价值变动收益。
(3) 本期可供分配利润是指期末可供基金份额持有人分配的利润，已实现收益的孰低值，是当期收益。

3.2 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	份额净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去3个月	-6.06%	0.08%	-6.14%	0.08%	-0.06%
过去6个月	21.23%	0.09%	19.14%	0.09%	-0.03%
过去一年	0.76%	0.09%	-0.20%	0.09%	-0.03%
过去三年	16.44%	1.96%	14.48%	2.03%	-0.05%
自基金合同生效至报告期末	72.01%	1.77%	70.24%	1.81%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为中证500指数收益率。
3.2.2基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较

7.4.1.1 投资策略

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.2 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.3 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.4 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.5 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.6 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.7 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.8 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.9 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.10 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.11 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.12 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.13 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.14 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.15 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.16 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.17 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.18 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.19 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.20 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.21 关联交易

关联方名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	占当期股票成交金额的比例
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81
广发证券股份有限公司	294,403,463.33	15.12%	900,160,866.81

7.4.1.22 关联交易

002004	华邦健康	2017-12-14	重大资产重组停牌	6.73	2018-03-14	7.30	463,600.00	4,294,985.47	3,120,028.00	-
002505	达华	2017-	重大事	18.02	2018-03-	16.26	180,	3,095,	3,284,407.00	-