

**广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
(LOF)**

**2021 年第 3 季度报告**

2021 年 9 月 30 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

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

## §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 2021 年 10 月 22 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 2021 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	中证 500LOF
基金主代码	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	1,758,859,687.89 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。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
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	
下属两级基金的基金简称	广发中证 500ETF 联接 (LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
下属两级基金的场内简称	中证 500LOF	-
下属两级基金的交易代码	162711	002903
报告期末下属两级基金的份额总额	922,472,146.75 份	836,387,541.14 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
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	上海证券交易所
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。
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 指数收益率
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。

## §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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)	
	广发中证 500ETF 联接(LOF)A	广发中证 500ETF 联接 C
1.本期已实现收益	66,101,619.61	47,900,632.11
2.本期利润	65,082,394.82	45,823,872.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0711	0.0544
4.期末基金资产净值	1,464,542,201.22	1,057,072,419.27

5.期末基金份额净值	1.5876	1.2639
------------	--------	--------

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 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

##### 1、广发中证 500ETF 联接(LOF)A:

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	4.52%	1.06%	4.14%	1.07%	0.38%	-0.01%
过去六个月	14.64%	0.88%	12.90%	0.89%	1.74%	-0.01%
过去一年	16.48%	1.01%	14.02%	1.01%	2.46%	0.00%
过去三年	51.23%	1.36%	45.72%	1.39%	5.51%	-0.03%
过去五年	19.54%	1.24%	12.30%	1.27%	7.24%	-0.03%
自基金合同生效起至今	58.76%	1.54%	57.32%	1.57%	1.44%	-0.03%

##### 2、广发中证 500ETF 联接 C:

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	4.47%	1.06%	4.14%	1.07%	0.33%	-0.01%
过去六个月	14.54%	0.88%	12.90%	0.89%	1.64%	-0.01%
过去一年	16.26%	1.01%	14.02%	1.01%	2.24%	0.00%
过去三年	50.34%	1.36%	45.72%	1.39%	4.62%	-0.03%
过去五年	18.10%	1.24%	12.30%	1.27%	5.80%	-0.03%

自基金合同生效起至今	26.39%	1.23%	22.77%	1.25%	3.62%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

### 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联接基金(LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009 年 11 月 26 日至 2021 年 9 月 30 日)

#### 1、广发中证 500ETF 联接(LOF)A:



#### 2、广发中证 500ETF 联接 C:



注：自 2013 年 10 月 10 日起，本基金的业绩比较基准由“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率”变更为“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”。

## §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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；	2014-04-01	-	17 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资

	<p>广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理；广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证央企创新</p>				<p>资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生</p>
--	--	--	--	--	---



	驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)的基金经理；指数投资部总经理助理				产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)。
--	--	--	--	--	---

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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。金融工程与风险管理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

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 35 次，其中 33 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 2 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金的业绩基准是中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ ，本基金主要采用完全复制法来跟踪业绩基准。

##### (1) 投资策略

作为 ETF 联接基金，本基金秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证 500ETF 及指数成份股等，间接复制指数，同时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，降低基金的跟踪误差。

##### (2) 运作分析

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是成份股调整、申购赎回和停牌股票估值调整等因素。

2021 年 3 季度，A 股市场表现为区间震荡行情，整个季度沪深 300 指数下跌 6.85%，中证 500 指数上涨 4.34%，创业板指数下跌 6.69%。美股呈现先涨后跌态势，3 季度纳斯达克 100 指数上涨 0.93%，标普 500 指数上涨 0.23%。港股 3 季度呈现下跌趋势，恒生指数下跌 14.75%，恒生国企精明指数下跌 17.10%，恒生中型股指数下跌 13.81%。A 股方面，焦煤、钢材、有色等能源及原材料相关大宗商品的价格在本季度大幅上涨，推高了采掘、公用事业、有色、钢铁和化工等相关板块的股票价格。而消费品制造业利润 8 月同比增速放缓，加之企业原材料、用工等成本继续增加，消费品制造业利润边际走弱压力加大。此外，随着国民疫苗接种速度放缓，医药制造业利润面临一定压力。综上，3 季度消费和医药面临了一定的行情压力。港股方面，受互联网和教育监管政策逐步趋严以及房地产负面消息拖累，港股 3 季度表现相对较差。美股方面，受美国债务违约风险下的市场担忧情绪、通胀压力以及美联储开启 Taper 预期的影响，

9 月中旬美股开始逐步进行小幅调整，市场情绪受到一定压制。

中证 500 指数有着高波动、高收益的特征。就中长期表现而言，中证 500 指数收益相较大部分市场宽基指数存在一定优势；就短期表现而言，其往往被誉为“反弹急先锋”，值得投资者关注。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 4.52%，C 类基金份额净值增长率为 4.47%，同期业绩比较基准收益率为 4.14%。

## §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	30,774,629.46	1.19
	其中：股票	30,774,629.46	1.19
2	基金投资	2,292,066,009.33	89.00
3	固定收益投资	19,281.60	0.00
	其中：债券	19,281.60	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	215,611,429.32	8.37
8	其他资产	36,930,892.77	1.43
9	合计	2,575,402,242.48	100.00

### 5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	2,292,066,009.33	90.90

### 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	361,370.00	0.01
B	采矿业	738,300.00	0.03
C	制造业	15,708,118.33	0.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,662,725.22	0.26
E	建筑业	136,670.00	0.01
F	批发和零售业	399,473.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	104,431.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,938,411.91	0.16
J	金融业	906,724.00	0.04
K	房地产业	488,152.00	0.02
L	租赁和商务服务业	359,700.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	33,250.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	272,730.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	88,710.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	249,804.00	0.01

S	综合	326,060.00	0.01
	合计	30,774,629.46	1.22

### 5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 5.4 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	600905	三峡能源	907,763	6,299,875.22	0.25
2	601728	中国电信	394,011	1,556,343.45	0.06
3	002709	天赐材料	4,040	614,564.80	0.02
4	603290	斯达半导	1,300	529,906.00	0.02
5	603444	吉比特	1,300	508,664.00	0.02
6	002340	格林美	32,000	357,760.00	0.01
7	000799	酒鬼酒	1,400	346,822.00	0.01
8	002074	国轩高科	7,000	332,430.00	0.01
9	000009	中国宝安	17,000	326,060.00	0.01
10	300207	欣旺达	7,000	261,800.00	0.01

### 5.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	19,281.60	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,281.60	0.00

### 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	113048	晶科转债	80	12,148.80	0.00
2	127046	百润转债	55	5,500.00	0.00
3	113621	彤程转债	10	1,632.80	0.00

### 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。

### 5.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.9 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.10.1 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
IC2110	IC2110	44.00	62,460,640.00	-3,015,919.08	买入的股指期货是现货股票指数的对应期货品种，相关性较高，用期货进行较小比例的现货股票替代，能够更好地实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
IC2111	IC2111	28.00	39,372,480.00	-418,080.00	买入的股指期货是现货

					股票指数的对应期货品种, 相关性较高, 用期货进行较小比例的现货股票替代, 能够较好地实现流动性管理以及降低调仓成本等, 也能保持整体持仓风险特征前后一致。
公允价值变动总额合计(元)					-3,433,999.08
股指期货投资本期收益(元)					10,148,071.66
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-3,948,873.80

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 联接基金, 主要投资目标 ETF 基金、标的指数成份股及备选成份股, 同时可以投资股指期货。

本基金投资股指期货, 可以更好地应对申购和赎回, 进行流动性管理。本基金尽量选择流动性好、交易活跃的股指期货合约, 利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整带来的交易成本和跟踪误差, 力争更好地跟踪标的指数。

### 5.11 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。

### 5.12 投资组合报告附注

**5.12.1** 报告期内, 本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

**5.12.2** 本报告期内, 基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,395,694.05
2	应收证券清算款	9,675,861.08
3	应收股利	-
4	应收利息	21,659.27
5	应收申购款	8,452,029.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	3,385,648.78
9	合计	36,930,892.77

#### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113621	彤程转债	1,632.80	0.00

#### 5.12.5 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	600905	三峡能源	6,299,875.22	0.25	新股流通受限
2	601728	中国电信	1,556,343.45	0.06	新股流通受限

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证500ETF联接(LOF)A	广发中证500ETF联接C
报告期期初基金份额总额	892,754,842.24	822,878,559.47



报告期期间基金总申购份额	152,258,092.21	287,800,965.71
减：报告期期间基金总赎回份额	122,540,787.70	274,291,984.04
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	922,472,146.75	836,387,541.14

## §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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 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《关于核准广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议的批复》
- 2.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、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：投资者可在营业时间免费查阅，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>。

广发基金管理有限公司  
二〇二一年十月二十六日