

# 景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 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.....	53
7.7 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.....	53
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.9 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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-01-21

### 2.2 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	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
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，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨焱阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896

	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号 嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号 嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		赵如冰	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,840,334.31
本期利润	27,526,555.27
加权平均基金份额本期利润	0.9986
本期加权平均净值利润率	51.03%
本期基金份额净值增长率	64.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31,833,614.44
期末可供分配基金份额利润	1.2955
期末基金资产净值	56,406,570.44
期末基金份额净值	2.2955
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	129.55%

注：1、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。

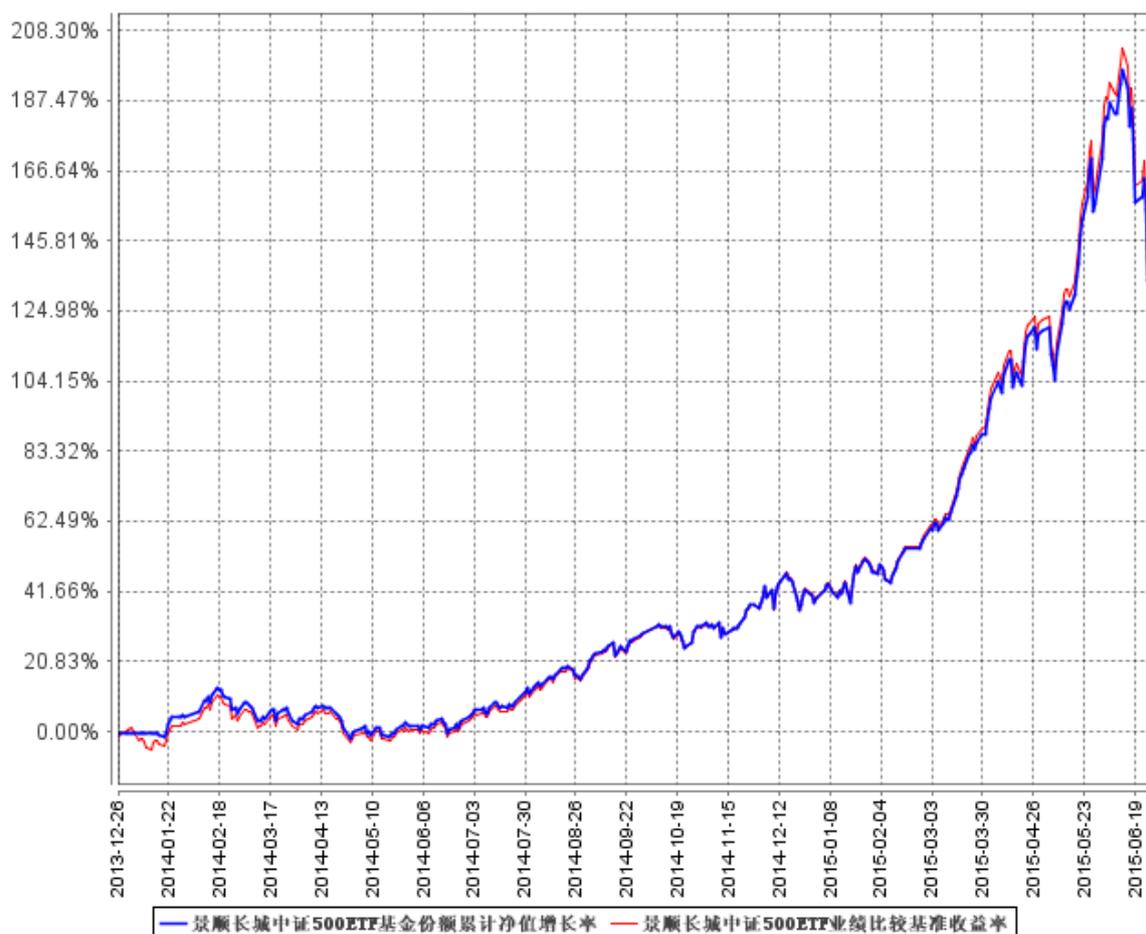
- 2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-10.66%	3.72%	-10.64%	3.79%	-0.02%	-0.07%
过去三个月	21.96%	2.86%	22.79%	2.90%	-0.83%	-0.04%
过去六个月	64.65%	2.25%	67.32%	2.28%	-2.67%	-0.03%
过去一年	120.32%	1.79%	126.91%	1.81%	-6.59%	-0.02%
自基金合同生效起至今	129.55%	1.60%	133.85%	1.65%	-4.30%	-0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，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 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2015 年 6 月 30 日, 景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 46 只开放式基金, 包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF)、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金 (LOF)、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 800 食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式, 即通过整个投资部门全体人员的共同努力, 争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江科宏	景顺长城沪深 300 等权重 ETF、景顺长城中证 500ETF、	2013 年 12 月 26 日	2015 年 1 月 26 日	8	经济学硕士, CFA。2007 年至 2010 年

	景顺长城中证医药卫生 ETF、景顺长城中证 800 食品饮料 ETF、景顺长城中证 TMT150ETF、景顺长城研究精选股票型基金、景顺长城公司治理股票型基金、景顺长城优势企业基金基金经理				担任本公司风险管理经理职务。2011 年 2 月重新加入本公司,担任研究员等职务;自 2012 年 6 月起担任基金经理。
徐喻军	上证 180 等权重交易型开放式指数基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数基金联接基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2014 年 12 月 27 日	-	5	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司,担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务;自 2014 年 4 月起担任基金经理。

注: 1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期,“离任日期”指根据公司决定的解聘日期(公告前一日);

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;

3、江科宏先生于 2015 年 1 月 26 日离任景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 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,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011

年修订)》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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 1 次，为公司旗下景顺长城量化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年宏观经济整体依然疲弱，PMI 数据小幅企稳，消费和进出口数据不佳，内外需依旧不振，基建和房地产投资增速表现较差。通胀小幅回升，但仍在可控范围内。货币政策依然宽松，央行接连出台降准降息等政策，并通过公开市场操作缓解资金面压力。在增量资金入市的推动下，A 股市场上半年经历了一轮大幅上涨，直到 6 月中旬，在去杠杆和估值泡沫的压力下发生了剧烈调整。

本基金采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，本基金上市以后基金的收益和标的指数收益基本一致。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年，本基金份额净值增长率为 64.65%，低于业绩比较基准收益率 2.67%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，跟踪误差（年化）控制在 2% 以内。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 3 季度，我们认为需求低迷、投资疲弱的情况难以快速转变，在财政政策刺激下，基建投资增速预计会有所企稳，并对经济起到一定的支撑作用。

本基金作为被动指数基金，将继续采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，控制跟踪误差和跟踪偏离度，期望为投资者分享中国经济的长期成长提供投资机会。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律

法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及其适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

## 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

## 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

## 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供在证券交易所上市或挂牌转让的

固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止本报告期末,根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,报告期内本基金未满足收益分配条件,不进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2015 年 1 月 6 日至 2015 年 2 月 16 日,本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

从 2014 年 12 月 11 日至 2015 年 1 月 20 日,及从 2015 年 1 月 22 日至 2015 年 3 月 25 日,本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,414,879.52	1,893,852.47
结算备付金		1,476.11	1,821.28
存出保证金		1,890.70	2,848.57
交易性金融资产	6.4.7.2	55,420,690.79	49,260,401.92
其中：股票投资		55,420,690.79	49,260,401.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		31,353.83	274,478.69
应收利息	6.4.7.5	258.55	233.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		56,870,549.50	51,433,636.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		64,692.32	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		27,082.98	15,391.22
应付托管费		5,416.59	3,078.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,877.17	9,917.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	344,910.00	416,132.57
负债合计		463,979.06	444,519.72
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	24,572,956.00	36,572,956.00
未分配利润	6.4.7.10	31,833,614.44	14,416,160.32
所有者权益合计		56,406,570.44	50,989,116.32
负债和所有者权益总计		56,870,549.50	51,433,636.04

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2955 元，基金份额总额 24,572,956.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		28,033,985.00	30,276,428.18
1.利息收入		5,738.87	532,571.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,738.87	171,417.89
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	361,153.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,226,883.28	28,229,592.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,047,128.93	28,005,425.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	179,754.35	224,166.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,686,220.96	1,522,253.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	115,141.89	-7,989.12
<b>减：二、费用</b>		507,429.73	1,230,862.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	133,393.17	296,080.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,678.60	59,216.14
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	38,676.69	555,461.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	308,681.27	320,103.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		27,526,555.27	29,045,565.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		27,526,555.27	29,045,565.58

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,572,956.00	14,416,160.32	50,989,116.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,526,555.27	27,526,555.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	-10,109,101.15	-22,109,101.15
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	10,769,910.85	22,769,910.85
2. 基金赎回款	-24,000,000.00	-20,879,012.00	-44,879,012.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	24,572,956.00	31,833,614.44	56,406,570.44
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	512,572,956.00	-2,004,240.06	510,568,715.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,045,565.58	29,045,565.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-460,000,000.00	-24,838,387.70	-484,838,387.70
其中：1. 基金申购款	29,000,000.00	688,119.63	29,688,119.63
2. 基金赎回款	-489,000,000.00	-25,526,507.33	-514,526,507.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	52,572,956.00	2,202,937.82	54,775,893.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 许义明 \_\_\_\_\_ 吴建军 \_\_\_\_\_ 邵媛媛  
 基金管理人负责人                  主管会计工作负责人                  会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,538,347.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]第 17 号文审核同意，本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，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 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2015 年 8 月 27 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2015 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,414,879.52
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,414,879.52

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,362,271.10	55,420,690.79	13,058,419.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	42,362,271.10	55,420,690.79	13,058,419.69

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本期末的买入返售金融资产项目余额为零。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	257.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.63
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.72
合计	258.55

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	21,877.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	21,877.17

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,271.27
应付指数使用费	50,000.00
应付替代款	86,638.73
合计	344,910.00

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,572,956.00	36,572,956.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-24,000,000.00	-24,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	24,572,956.00	24,572,956.00

注：投资者申购赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,373,458.01	-4,957,297.69	14,416,160.32
本期利润	18,840,334.31	8,686,220.96	27,526,555.27
本期基金份额交易产生的变动数	-5,843,229.28	-4,265,871.87	-10,109,101.15
其中：基金申购款	9,334,925.33	1,434,985.52	10,769,910.85
基金赎回款	-15,178,154.61	-5,700,857.39	-20,879,012.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,370,563.04	-536,948.60	31,833,614.44

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	5,278.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	451.19
其他	9.64
合计	5,738.87

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,811,302.06
股票投资收益——赎回差价收入	13,235,826.87
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	19,047,128.93

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	12,060,243.66

减：卖出股票成本总额	6,248,941.60
买卖股票差价收入	5,811,302.06

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
赎回基金份额对价总额	44,879,012.00
减：现金支付赎回款总额	1,292,141.00
减：赎回股票成本总额	30,351,044.13
赎回差价收入	13,235,826.87

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期债券投资收益无发生额。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期的衍生工具收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	179,754.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	179,754.35

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	8,686,220.96
——股票投资	8,686,220.96
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

合计	8,686,220.96
----	--------------

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	115,141.89
合计	115,141.89

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	38,676.69
银行间市场交易费用	-
合计	38,676.69

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	410.00
合计	308,681.27

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	13,126,642.87	50.33%	17,975,563.60	3.43%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

长城证券	11,950.60	50.33%	11,041.86	50.47%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	16,365.77	3.43%	5,240.13	56.44%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	133,393.17	296,080.72
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,678.60	59,216.14

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,414,879.52	5,278.04	2,337,863.07	162,728.67

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300147	香雪制药	2015年6月18日	2015年7月2日	配股	10.46	30.80	1,260	13,179.60	38,808.00	

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日	停牌原	期末估	复牌日	复牌开	数量	期末	期末估值	备注
------	-----	-----	-----	-----	-----	-----	----	----	------	----

码	称	期	因	值单价	期	盘单价	(股)	成本总额	总额	
002183	怡亚通	2015年6月1日	因重大事件停牌	73.15	-	-	5,682	88,450.32	415,638.30	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	因重大事件停牌	22.44	-	-	13,800	120,268.01	309,672.00	-
600410	华胜天成	2015年5月28日	因重大事件停牌	47.84	2015年7月22日	43.06	6,288	126,286.08	300,817.92	-
601718	际华集团	2015年6月17日	因重大事件停牌	15.12	2015年7月2日	13.61	17,947	106,551.92	271,358.64	-
000748	长城信息	2015年6月18日	因重大事件停牌	34.88	-	-	7,600	171,300.80	265,088.00	-
000566	海南海药	2015年6月18日	因重大事件停牌	49.97	-	-	5,059	110,347.83	252,798.23	-
600645	中源协和	2015年4月27日	因重大事件停牌	79.34	-	-	3,130	144,020.97	248,334.20	-
300144	宋城演艺	2015年6月18日	因重大事件停牌	76.47	2015年7月20日	68.82	3,200	173,218.34	244,704.00	-
002018	华信国际	2015年6月15日	因重大事件停牌	44.08	-	-	5,461	94,580.81	240,720.88	-
600654	中安消	2015年6月29日	因重大事件停牌	30.91	-	-	7,436	111,621.18	229,846.76	-
002223	鱼跃医疗	2015年6月25日	因重大事件停牌	67.20	2015年7月13日	60.48	3,384	127,531.55	227,404.80	-
600879	航天电子	2015年5月15日	因重大事件停牌	24.50	-	-	8,796	128,951.15	215,502.00	-
600872	中炬高新	2015年5月4日	因重大事件停牌	21.62	-	-	9,950	126,412.70	215,119.00	-
000592	平潭发展	2015年6月30日	因重大事件停牌	29.76	2015年7月14日	30.00	6,900	304,580.00	205,344.00	-
002191	劲嘉股份	2015年6月18日	因重大事件停牌	19.22	-	-	10,474	96,053.94	201,310.28	-
600499	科达洁能	2015年6月10日	因重大事件停牌	29.64	-	-	6,700	136,259.34	198,588.00	-
600643	爱建股份	2015年6月30日	因重大事件停牌	16.73	-	-	11,678	136,164.26	195,372.94	-
600110	中科英华	2015年6月26日	因重大事件停牌	13.73	-	-	13,834	97,040.05	189,940.82	-
002276	万马股份	2015年6月30日	因重大事件停牌	34.15	2015年7月20日	30.74	5,452	74,807.31	186,185.80	-
600312	平高电气	2015年6月23日	因重大事件停牌	22.58	-	-	7,800	131,243.34	176,124.00	-
600587	新华医疗	2015年5月22日	因重大事件停牌	58.63	2015年7月3日	52.77	2,896	102,575.81	169,792.48	-

000066	长城电 脑	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	21.54	-	-	7,542	66,463.86	162,454.68	-
000887	中鼎股 份	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	24.75	-	-	6,508	113,298.07	161,073.00	-
000732	泰禾集 团	2015 年 6 月 25 日	因重大事 项停牌	34.20	2015 年 7 月 2 日	30.78	4,637	98,292.99	158,585.40	-
300291	华录百 纳	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	37.76	2015 年 7 月 13 日	34.65	4,100	217,778.93	154,816.00	-
000543	皖能电 力	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	21.36	2015 年 7 月 14 日	19.22	7,224	90,110.74	154,304.64	-
000650	仁和药 业	2015 年 6 月 12 日	因重大事 项停牌	17.17	-	-	8,986	65,918.45	154,289.62	-
002325	洪涛股 份	2015 年 6 月 3 日	因重大事 项停牌	31.15	-	-	4,846	74,876.10	150,952.90	-
002368	太极股 份	2015 年 5 月 14 日	因重大事 项停牌	65.52	-	-	2,280	68,389.50	149,385.60	-
600175	美都能 源	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	10.64	2015 年 7 月 20 日	9.58	14,015	90,778.69	149,119.60	-
600967	北方创 业	2015 年 4 月 13 日	因重大事 项停牌	17.12	-	-	8,501	123,870.75	145,537.12	-
002308	威创股 份	2015 年 6 月 12 日	因重大事 项停牌	31.00	-	-	4,593	52,101.42	142,383.00	-
600482	风帆股 份	2015 年 5 月 28 日	因重大事 项停牌	42.38	-	-	3,285	45,017.86	139,218.30	-
001696	宗申动 力	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	17.25	2015 年 8 月 24 日	15.53	8,000	93,051.25	138,000.00	-
601311	骆驼股 份	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	28.20	2015 年 7 月 15 日	25.38	4,876	88,490.11	137,503.20	-
600366	宁波韵 升	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	35.09	2015 年 8 月 12 日	31.58	3,845	65,088.54	134,921.05	-
000786	北新建 材	2015 年 4 月 10 日	因重大事 项停牌	18.58	-	-	7,038	84,648.51	130,766.04	-
000959	首钢股 份	2015 年 4 月 23 日	因重大事 项停牌	6.15	-	-	19,800	92,758.94	121,770.00	-
002309	中利科 技	2015 年 6 月 2 日	因重大事 项停牌	33.39	2015 年 7 月 21 日	30.05	3,600	78,360.67	120,204.00	-
000979	中弘股 份	2015 年 5 月 25 日	因重大事 项停牌	6.04	-	-	19,690	50,208.53	118,927.60	-
002665	首航节 能	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	27.70	2015 年 7 月 1 日	30.00	4,150	86,011.21	114,955.00	-
000519	江南红 箭	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	26.06	-	-	4,200	83,287.66	109,452.00	-
600416	湘电股	2015 年 5	因重大事	22.64	2015 年 7	20.35	4,532	53,608.33	102,604.48	-

	份	月 22 日	项停牌		月 20 日						
002414	高德红 外	2015 年 5 月 13 日	因重大事 项停牌	39.36	-	-	2,592	56,510.30	102,021.12	-	
002106	莱宝高 科	2015 年 4 月 7 日	因重大事 项停牌	16.42	-	-	6,200	87,715.80	101,804.00	-	
000697	炼石有 色	2015 年 5 月 18 日	因重大事 项停牌	33.83	-	-	2,922	51,467.98	98,851.26	-	
000669	金鸿能 源	2015 年 5 月 4 日	因重大事 项停牌	37.72	2015 年 7 月 23 日	33.95	2,470	65,304.56	93,168.40	-	
002269	美邦服 饰	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	11.86	2015 年 7 月 2 日	10.67	7,500	35,433.37	88,950.00	-	
000788	北大医 药	2015 年 5 月 25 日	因重大事 项停牌	20.72	2015 年 7 月 21 日	18.65	4,277	67,639.65	88,619.44	-	
600790	轻纺城	2015 年 5 月 25 日	因重大事 项停牌	13.38	2015 年 8 月 18 日	12.04	6,474	40,119.01	86,622.12	-	
002143	印纪传 媒	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	32.01	2015 年 7 月 1 日	33.50	2,500	99,401.00	80,025.00	-	
600702	沱牌舍 得	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	26.11	2015 年 8 月 20 日	28.00	3,064	54,485.46	80,001.04	-	
002727	一心堂	2015 年 4 月 13 日	因重大事 项停牌	78.24	2015 年 8 月 17 日	70.42	1,000	53,269.78	78,240.00	-	
600335	国机汽 车	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	37.93	2015 年 7 月 21 日	34.14	2,001	42,145.67	75,897.93	-	
600078	澄星股 份	2015 年 6 月 9 日	因重大事 项停牌	15.23	2015 年 7 月 1 日	13.71	4,800	38,314.22	73,104.00	-	
000688	建新矿 业	2015 年 6 月 10 日	因重大事 项停牌	17.07	-	-	4,153	33,064.45	70,891.71	-	
002242	九阳股 份	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	19.45	2015 年 7 月 7 日	17.51	3,449	42,647.80	67,083.05	-	
002345	潮宏基	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	19.58	-	-	3,380	32,095.71	66,180.40	-	
002461	珠江啤 酒	2015 年 6 月 4 日	因重大事 项停牌	26.40	2015 年 7 月 24 日	23.76	2,498	39,398.11	65,947.20	-	
000850	华茂股 份	2015 年 5 月 7 日	因重大事 项停牌	10.98	-	-	5,875	37,608.45	64,507.50	-	
002574	明牌珠 宝	2015 年 6 月 4 日	因重大事 项停牌	22.90	-	-	2,680	34,739.54	61,372.00	-	
600869	智慧能 源	2015 年 5 月 11 日	因重大事 项停牌	29.14	2015 年 7 月 31 日	26.23	2,036	20,519.63	59,329.04	-	
002069	獐子 岛	2015 年 6 月 1 日	因重大事 项停牌	19.76	-	-	2,971	40,392.95	58,706.96	-	
002226	江南化 工	2015 年 6 月 8 日	因重大事 项停牌	13.18	-	-	3,958	29,223.47	52,166.44	-	

002194	武汉凡谷	2015年6月18日	因重大事项停牌	26.98	2015年7月24日	24.28	1,893	25,078.10	51,073.14	-
000693	华泽钴镍	2015年6月30日	因重大事项停牌	20.57	2015年8月18日	22.63	2,442	72,763.92	50,231.94	-
002203	海亮股份	2015年4月27日	因重大事项停牌	12.71	-	-	3,768	26,405.80	47,891.28	-
002091	江苏国泰	2015年6月1日	因重大事项停牌	26.22	-	-	1,800	27,591.73	47,196.00	-
002238	天威视讯	2015年6月29日	因重大事项停牌	23.76	-	-	1,722	24,159.28	40,914.72	-
002557	洽洽食品	2015年6月29日	因重大事项停牌	16.38	2015年8月24日	14.74	2,347	33,170.95	38,443.86	-
600333	长春燃气	2015年5月29日	因重大事项停牌	11.97	2015年7月9日	10.77	2,704	21,282.44	32,366.88	-
002662	京威股份	2015年5月15日	因重大事项停牌	17.84	2015年8月13日	16.06	1,695	19,476.92	30,238.80	-
600575	皖江物流	2014年9月9日	因重大事项停牌	4.11	-	-	4,546	16,441.53	18,684.06	-
000982	中银绒业	2014年8月25日	因重大事项停牌	4.64	-	-	2,604	11,688.51	12,082.56	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与

标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理岗设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证

券在证券交易所上市,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理的价格适时变现。

于 2015 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式,流动性风险相对较低。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,414,879.52	-	-	-	-	-	1,414,879.52
结算备付金	1,476.11	-	-	-	-	-	1,476.11
存出保证金	1,890.70	-	-	-	-	-	1,890.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,420,690.79	55,420,690.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-	31,353.83	31,353.83
应收利息	-	-	-	-	-	258.55	258.55
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,418,246.33	-	-	-	-	55,452,303.17	56,870,549.50
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	64,692.32	64,692.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,082.98	27,082.98
应付托管费	-	-	-	-	-	5,416.59	5,416.59

应付交易费用	-	-	-	-	-	21,877.17	21,877.17
其他负债	-	-	-	-	-	344,910.00	344,910.00
负债总计	-	-	-	-	-	463,979.06	463,979.06
利率敏感度缺口	1,418,246.33	-	-	-	-	-	-
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,893,852.47	-	-	-	-	-	1,893,852.47
结算备付金	1,821.28	-	-	-	-	-	1,821.28
存出保证金	2,848.57	-	-	-	-	-	2,848.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-49,260,401.92	49,260,401.92
应收利息	-	-	-	-	-	233.11	233.11
其他资产	-	-	-	-	-	274,478.69	274,478.69
资产总计	1,898,522.32	-	-	-	-	-49,535,113.72	51,433,636.04
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,391.22	15,391.22
应付托管费	-	-	-	-	-	3,078.25	3,078.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,917.68	9,917.68
其他负债	-	-	-	-	-	416,132.57	416,132.57
负债总计	-	-	-	-	-	444,519.72	444,519.72
利率敏感度缺口	1,898,522.32	-	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资（2014 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指

数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中,中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%;本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	55,420,690.79	98.25	49,260,401.92	96.61
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	55,420,690.79	98.25	49,260,401.92	96.61

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“中证 500 指数”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2015年6月30日)	上年度末(2014年12月31日)
	中证 500 指数上升 5%	2,763,921.95	2,472,972.14
中证 500 指数下降 5%	-2,763,921.95	-2,472,972.14	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 45,388,384.66 元，属于第二层次的余额为 10,032,306.13 元，无属于第三层次的余额(于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 46,373,239.55 元，属于第二层次的余额为 2,887,162.37 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

于 2015 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 22,769,910.85 元，其中包括以股票支付的申购款 20,039,073.30 元和以现金支付的申购款 2,730,837.55 元(2014 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 29,688,119.63 元，其中包括以股票支付的申购款 27,293,285.00 元

和以现金支付的申购款 2,394,834.63 元。)

(3)除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	55,420,690.79	97.45
	其中：股票	55,420,690.79	97.45
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	1,416,355.63	2.49
7	其他各项资产	33,503.08	0.06
8	合计	56,870,549.50	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	844,427.56	1.50
B	采矿业	1,480,370.77	2.62
C	制造业	32,779,440.51	58.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,739,942.33	3.08
E	建筑业	1,240,315.36	2.20
F	批发和零售业	3,764,075.92	6.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,748,319.52	3.10
H	住宿和餐饮业	65,589.80	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,177,379.90	5.63
J	金融业	457,291.22	0.81
K	房地产业	4,018,715.84	7.12
L	租赁和商务服务业	1,438,822.74	2.55
M	科学研究和技术服务业	325,178.20	0.58

N	水利、环境和公共设施管理业	314,151.57	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	159,486.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,096,364.32	1.94
S	综合	770,819.23	1.37
	合计	55,420,690.79	98.25

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002183	怡亚通	5,682	415,638.30	0.74
2	600978	宜华木业	13,800	309,672.00	0.55
3	600410	华胜天成	6,288	300,817.92	0.53
4	002405	四维图新	6,419	281,152.20	0.50
5	601718	际华集团	17,947	271,358.64	0.48
6	600881	亚泰集团	21,110	268,308.10	0.48
7	000748	长城信息	7,600	265,088.00	0.47
8	600895	张江高科	9,000	261,990.00	0.46
9	600037	歌华有线	8,077	254,425.50	0.45
10	000566	海南海药	5,059	252,798.23	0.45
11	000540	中天城投	20,003	252,037.80	0.45
12	600376	首开股份	12,982	250,422.78	0.44
13	600645	中源协和	3,130	248,334.20	0.44
14	600737	中粮屯河	11,912	247,888.72	0.44
15	300144	宋城演艺	3,200	244,704.00	0.43
16	002018	华信国际	5,461	240,720.88	0.43
17	002030	达安基因	5,380	238,334.00	0.42
18	600435	北方导航	5,210	236,377.70	0.42
19	600201	金宇集团	3,321	236,189.52	0.42
20	600601	方正科技	25,512	232,159.20	0.41
21	600219	南山铝业	23,000	232,070.00	0.41
22	600654	中安消	7,436	229,846.76	0.41

23	002223	鱼跃医疗	3,384	227,404.80	0.40
24	600635	大众公用	22,900	223,962.00	0.40
25	600446	金证股份	1,814	223,956.44	0.40
26	600158	中体产业	7,801	223,498.65	0.40
27	000998	隆平高科	8,122	220,106.20	0.39
28	600879	航天电子	8,796	215,502.00	0.38
29	600872	中炬高新	9,950	215,119.00	0.38
30	600594	益佰制药	3,700	215,081.00	0.38
31	300033	同花顺	2,500	214,975.00	0.38
32	002400	省广股份	8,400	212,184.00	0.38
33	600143	金发科技	17,800	212,176.00	0.38
34	600200	江苏吴中	5,766	211,900.50	0.38
35	600500	中化国际	12,100	211,508.00	0.37
36	600525	长园集团	10,266	211,171.62	0.37
37	600021	上海电力	9,900	208,890.00	0.37
38	000547	闽福发 A	7,700	205,436.00	0.36
39	000592	平潭发展	6,900	205,344.00	0.36
40	600026	中海发展	15,870	203,770.80	0.36
41	000997	新大陆	7,652	203,543.20	0.36
42	600320	振华重工	19,345	203,122.50	0.36
43	000012	南玻 A	15,200	202,768.00	0.36
44	002191	劲嘉股份	10,474	201,310.28	0.36
45	002022	科华生物	4,700	200,502.00	0.36
46	600499	科达洁能	6,700	198,588.00	0.35
47	300253	卫宁软件	3,800	197,600.00	0.35
48	000031	中粮地产	10,357	195,643.73	0.35
49	600643	爱建股份	11,678	195,372.94	0.35
50	600079	人福医药	5,200	192,660.00	0.34
51	601012	隆基股份	12,200	192,028.00	0.34
52	600811	东方集团	15,500	191,115.00	0.34
53	600110	中科英华	13,834	189,940.82	0.34
54	600694	大商股份	3,400	187,952.00	0.33
55	600655	豫园商城	11,700	187,785.00	0.33
56	002276	万马股份	5,452	186,185.80	0.33
57	600816	安信信托	3,704	184,533.28	0.33
58	600198	大唐电信	5,135	181,984.40	0.32
59	600797	浙大网新	9,522	179,870.58	0.32
60	600770	综艺股份	9,100	177,814.00	0.32
61	000690	宝新能源	14,051	177,745.15	0.32

62	600312	平高电气	7,800	176,124.00	0.31
63	600169	太原重工	19,700	175,330.00	0.31
64	600584	长电科技	9,146	174,780.06	0.31
65	600787	中储股份	10,824	174,266.40	0.31
66	600122	宏图高科	10,611	174,232.62	0.31
67	000616	海航投资	16,635	172,671.30	0.31
68	600675	中华企业	15,143	171,267.33	0.30
69	002004	华邦颖泰	13,110	170,167.80	0.30
70	600587	新华医疗	2,896	169,792.48	0.30
71	002266	浙富控股	12,342	168,838.56	0.30
72	300147	香雪制药	5,460	168,168.00	0.30
73	600521	华海药业	5,375	167,968.75	0.30
74	000930	中粮生化	8,788	165,653.80	0.29
75	600511	国药股份	3,286	165,581.54	0.29
76	300199	翰宇药业	5,100	164,883.00	0.29
77	600651	飞乐音响	8,000	164,560.00	0.29
78	000511	烯碳新材	13,431	164,529.75	0.29
79	600125	铁龙物流	10,587	163,357.41	0.29
80	600704	物产中大	6,840	163,339.20	0.29
81	000066	长城电脑	7,542	162,454.68	0.29
82	600664	哈药股份	13,400	161,336.00	0.29
83	000887	中鼎股份	6,508	161,073.00	0.29
84	600151	航天机电	10,043	160,989.29	0.29
85	600058	五矿发展	4,900	160,083.00	0.28
86	300244	迪安诊断	1,900	159,486.00	0.28
87	600498	烽火通信	6,000	158,760.00	0.28
88	000732	泰禾集团	4,637	158,585.40	0.28
89	002073	软控股份	6,800	157,080.00	0.28
90	600522	中天科技	6,900	156,837.00	0.28
91	600685	中船防务	2,910	156,383.40	0.28
92	600428	中远航运	9,643	156,120.17	0.28
93	000661	长春高新	1,200	156,000.00	0.28
94	601608	中信重工	9,534	155,404.20	0.28
95	002219	恒康医疗	3,494	155,343.24	0.28
96	300291	华录百纳	4,100	154,816.00	0.27
97	300273	和佳股份	5,190	154,610.10	0.27
98	000543	皖能电力	7,224	154,304.64	0.27
99	000650	仁和药业	8,986	154,289.62	0.27
100	600171	上海贝岭	6,302	154,083.90	0.27

101	600436	片仔癀	2,300	153,341.00	0.27
102	000415	渤海租赁	16,184	153,100.64	0.27
103	600759	洲际油气	9,933	151,776.24	0.27
104	600755	厦门国贸	13,502	151,762.48	0.27
105	300072	三聚环保	4,500	151,650.00	0.27
106	002325	洪涛股份	4,846	150,952.90	0.27
107	002573	清新环境	7,300	150,891.00	0.27
108	600240	华业地产	9,881	150,784.06	0.27
109	000006	深振业 A	11,019	149,527.83	0.27
110	002250	联化科技	6,674	149,497.60	0.27
111	002368	太极股份	2,280	149,385.60	0.26
112	600175	美都能源	14,015	149,119.60	0.26
113	002013	中航机电	5,324	148,273.40	0.26
114	600765	中航重机	5,389	147,820.27	0.26
115	000078	海王生物	6,700	147,400.00	0.26
116	002161	远望谷	6,758	147,054.08	0.26
117	002340	格林美	9,593	145,909.53	0.26
118	600967	北方创业	8,501	145,537.12	0.26
119	600017	日照港	17,880	145,006.80	0.26
120	600086	东方金钰	2,683	144,264.91	0.26
121	600808	马钢股份	27,100	144,172.00	0.26
122	300267	尔康制药	4,200	143,178.00	0.25
123	002308	威创股份	4,593	142,383.00	0.25
124	002701	奥瑞金	5,450	141,863.50	0.25
125	600426	华鲁恒升	7,626	141,538.56	0.25
126	000718	苏宁环球	9,800	141,414.00	0.25
127	002285	世联行	6,588	141,246.72	0.25
128	600056	中国医药	5,798	141,123.32	0.25
129	600611	大众交通	8,458	140,825.70	0.25
130	000897	津滨发展	14,699	140,228.46	0.25
131	600528	中铁二局	8,343	139,912.11	0.25
132	601000	唐山港	10,204	139,692.76	0.25
133	600482	风帆股份	3,285	139,218.30	0.25
134	600673	东阳光科	14,000	138,460.00	0.25
135	600880	博瑞传播	8,900	138,217.00	0.25
136	001696	宗申动力	8,000	138,000.00	0.24
137	002005	德豪润达	12,000	137,760.00	0.24
138	300274	阳光电源	4,500	137,565.00	0.24
139	601311	骆驼股份	4,876	137,503.20	0.24

140	600220	江苏阳光	16,581	137,456.49	0.24
141	000667	美好集团	20,400	137,088.00	0.24
142	600433	冠豪高新	8,846	136,139.94	0.24
143	600176	中国巨石	5,010	135,570.60	0.24
144	000758	中色股份	6,900	135,447.00	0.24
145	002424	贵州百灵	2,164	135,379.84	0.24
146	600325	华发股份	7,462	135,062.20	0.24
147	600366	宁波韵升	3,845	134,921.05	0.24
148	002049	同方国芯	2,800	134,400.00	0.24
149	002489	浙江永强	3,541	133,495.70	0.24
150	600517	置信电气	8,503	133,071.95	0.24
151	002063	远光软件	4,240	132,584.80	0.24
152	600187	国中水务	16,900	131,820.00	0.23
153	000062	深圳华强	2,300	131,261.00	0.23
154	600478	科力远	7,700	131,054.00	0.23
155	000786	北新建材	7,038	130,766.04	0.23
156	000021	深科技	8,530	130,082.50	0.23
157	000656	金科股份	18,800	129,908.00	0.23
158	000988	华工科技	7,259	129,282.79	0.23
159	000681	视觉中国	3,100	127,286.00	0.23
160	000939	凯迪电力	8,604	126,048.60	0.22
161	600138	中青旅	5,926	125,157.12	0.22
162	000671	阳光城	6,016	125,012.48	0.22
163	002195	二三四五	3,000	124,680.00	0.22
164	000088	盐田港	8,800	124,608.00	0.22
165	600536	中国软件	3,467	123,009.16	0.22
166	600487	亨通光电	3,333	122,654.40	0.22
167	000933	神火股份	13,000	122,460.00	0.22
168	002428	云南锗业	5,196	122,157.96	0.22
169	000959	首钢股份	19,800	121,770.00	0.22
170	600835	上海机电	3,694	121,680.36	0.22
171	002271	东方雨虹	4,732	121,612.40	0.22
172	600270	外运发展	4,160	121,305.60	0.22
173	600805	悦达投资	7,759	121,273.17	0.21
174	002309	中利科技	3,600	120,204.00	0.21
175	600064	南京高科	6,161	120,139.50	0.21
176	601717	郑煤机	11,010	120,119.10	0.21
177	000652	泰达股份	11,765	119,767.70	0.21
178	000979	中弘股份	19,690	118,927.60	0.21

179	002595	豪迈科技	5,500	118,690.00	0.21
180	600409	三友化工	10,494	118,582.20	0.21
181	600418	江淮汽车	8,362	117,736.96	0.21
182	600067	冠城大通	11,797	117,026.24	0.21
183	000830	鲁西化工	11,707	116,601.72	0.21
184	600120	浙江东方	3,434	116,378.26	0.21
185	603766	隆鑫通用	4,619	115,936.90	0.21
186	600422	昆药集团	3,132	115,664.76	0.21
187	600006	东风汽车	9,100	115,388.00	0.20
188	600557	康缘药业	4,145	115,355.35	0.20
189	002244	滨江集团	6,262	115,283.42	0.20
190	600183	生益科技	11,310	115,248.90	0.20
191	002665	首航节能	4,150	114,955.00	0.20
192	002179	中航光电	3,467	114,411.00	0.20
193	600458	时代新材	4,553	114,280.30	0.20
194	600160	巨化股份	10,300	113,506.00	0.20
195	002092	中泰化学	11,100	113,109.00	0.20
196	600812	华北制药	9,284	112,707.76	0.20
197	600161	天坛生物	2,990	112,603.40	0.20
198	600614	鼎立股份	3,766	112,528.08	0.20
199	000829	天音控股	7,568	112,384.80	0.20
200	600699	均胜电子	2,928	112,171.68	0.20
201	600580	卧龙电气	6,277	111,918.91	0.20
202	600039	四川路桥	17,139	111,917.67	0.20
203	002466	天齐锂业	1,800	111,240.00	0.20
204	600481	双良节能	4,611	110,433.45	0.20
205	300088	长信科技	4,000	110,000.00	0.20
206	000572	海马汽车	13,100	109,909.00	0.19
207	000519	江南红箭	4,200	109,452.00	0.19
208	002029	七匹狼	5,179	108,759.00	0.19
209	002642	荣之联	1,900	108,585.00	0.19
210	002168	深圳惠程	6,920	107,398.40	0.19
211	002444	巨星科技	5,811	107,387.28	0.19
212	600380	健康元	7,068	107,150.88	0.19
213	000028	国药一致	1,438	107,145.38	0.19
214	300115	长盈精密	3,200	106,592.00	0.19
215	000090	天健集团	4,388	106,409.00	0.19
216	000528	柳工	9,000	106,380.00	0.19
217	600851	海欣股份	8,400	106,344.00	0.19

218	000973	佛塑科技	8,793	105,516.00	0.19
219	002440	闰土股份	4,400	105,468.00	0.19
220	000685	中山公用	3,580	105,359.40	0.19
221	002508	老板电器	2,746	105,336.56	0.19
222	600284	浦东建设	6,353	103,617.43	0.18
223	002299	圣农发展	5,100	103,530.00	0.18
224	600267	海正药业	5,500	103,345.00	0.18
225	600416	湘电股份	4,532	102,604.48	0.18
226	600289	亿阳信通	5,146	102,559.78	0.18
227	000587	金叶珠宝	4,417	102,165.21	0.18
228	002414	高德红外	2,592	102,021.12	0.18
229	002190	成飞集成	2,000	101,980.00	0.18
230	002390	信邦制药	5,700	101,916.00	0.18
231	002106	莱宝高科	6,200	101,804.00	0.18
232	600062	华润双鹤	3,900	101,556.00	0.18
233	600572	康恩贝	4,470	101,469.00	0.18
234	601666	平煤股份	13,400	101,438.00	0.18
235	300202	聚龙股份	2,500	101,000.00	0.18
236	600859	王府井	3,200	100,800.00	0.18
237	002050	三花股份	8,750	100,537.50	0.18
238	000680	山推股份	11,304	100,266.48	0.18
239	000777	中核科技	3,045	100,028.25	0.18
240	002048	宁波华翔	4,811	100,020.69	0.18
241	000816	智慧农业	9,650	99,781.00	0.18
242	000697	炼石有色	2,922	98,851.26	0.18
243	600825	新华传媒	5,954	98,776.86	0.18
244	600216	浙江医药	7,400	98,272.00	0.17
245	002273	水晶光电	3,092	96,625.00	0.17
246	002437	誉衡药业	3,325	96,591.25	0.17
247	600747	大连控股	12,151	96,357.43	0.17
248	600300	维维股份	9,480	96,222.00	0.17
249	600546	山煤国际	11,300	96,163.00	0.17
250	002155	湖南黄金	7,700	95,711.00	0.17
251	600757	长江传媒	6,869	95,479.10	0.17
252	002396	星网锐捷	2,971	95,369.10	0.17
253	002311	海大集团	6,860	94,599.40	0.17
254	600387	海越股份	3,701	94,449.52	0.17
255	000422	湖北宜化	10,200	94,146.00	0.17
256	002221	东华能源	3,152	94,024.16	0.17

257	000735	罗牛山	10,000	93,900.00	0.17
258	002078	太阳纸业	11,726	93,808.00	0.17
259	600885	宏发股份	2,991	93,737.94	0.17
260	000848	承德露露	5,145	93,639.00	0.17
261	000669	金鸿能源	2,470	93,168.40	0.17
262	600545	新疆城建	6,195	92,986.95	0.16
263	000541	佛山照明	8,072	92,585.84	0.16
264	600884	杉杉股份	3,236	92,549.60	0.16
265	600736	苏州高新	8,112	92,395.68	0.16
266	002551	尚荣医疗	2,129	92,377.31	0.16
267	600826	兰生股份	2,382	92,016.66	0.16
268	000926	福星股份	6,490	91,573.90	0.16
269	002477	雏鹰农牧	4,759	91,372.80	0.16
270	600970	中材国际	6,200	90,644.00	0.16
271	000488	晨鸣纸业	10,097	90,570.09	0.16
272	002431	棕榈园林	3,100	89,962.00	0.16
273	000600	建投能源	6,100	89,548.00	0.16
274	000612	焦作万方	8,181	89,336.52	0.16
275	600260	凯乐科技	5,408	88,961.60	0.16
276	002269	美邦服饰	7,500	88,950.00	0.16
277	600004	白云机场	5,259	88,877.10	0.16
278	300039	上海凯宝	5,710	88,790.50	0.16
279	600112	天成控股	4,672	88,768.00	0.16
280	000788	北大医药	4,277	88,619.44	0.16
281	000620	新华联	6,500	88,530.00	0.16
282	600628	新世界	5,267	88,222.25	0.16
283	600259	广晟有色	1,500	87,990.00	0.16
284	601233	桐昆股份	4,400	87,824.00	0.16
285	601001	大同煤业	9,500	87,780.00	0.16
286	000861	海印股份	4,068	87,421.32	0.15
287	600509	天富能源	6,200	87,234.00	0.15
288	002251	步步高	3,562	86,912.80	0.15
289	000550	江铃汽车	2,367	86,868.90	0.15
290	601369	陕鼓动力	7,416	86,841.36	0.15
291	000931	中关村	6,166	86,693.96	0.15
292	600596	新安股份	6,214	86,623.16	0.15
293	600790	轻纺城	6,474	86,622.12	0.15
294	603019	中科曙光	1,000	86,590.00	0.15
295	002122	天马股份	8,118	86,456.70	0.15

296	002237	恒邦股份	7,204	86,231.88	0.15
297	002064	华峰氨纶	9,500	86,165.00	0.15
298	600351	亚宝药业	6,342	85,870.68	0.15
299	600180	瑞茂通	2,986	85,578.76	0.15
300	300043	互动娱乐	5,700	85,557.00	0.15
301	000975	银泰资源	4,960	85,460.80	0.15
302	000099	中信海直	4,790	85,166.20	0.15
303	601002	晋亿实业	5,377	85,064.14	0.15
304	600993	马应龙	2,644	84,845.96	0.15
305	000969	安泰科技	5,884	84,611.92	0.15
306	002384	东山精密	3,813	84,305.43	0.15
307	600059	古越龙山	5,500	84,260.00	0.15
308	002011	盾安环境	5,792	83,926.08	0.15
309	300134	大富科技	3,000	83,850.00	0.15
310	601908	京运通	3,959	83,059.82	0.15
311	002482	广田股份	3,037	82,910.10	0.15
312	601880	大连港	11,508	82,857.60	0.15
313	000900	现代投资	8,042	82,510.92	0.15
314	600761	安徽合力	4,929	82,462.17	0.15
315	000877	天山股份	6,995	81,981.40	0.15
316	600292	中电远达	2,683	81,938.82	0.15
317	000762	西藏矿业	4,296	81,624.00	0.14
318	002672	东江环保	3,845	81,321.75	0.14
319	600261	阳光照明	9,899	80,478.87	0.14
320	000636	风华高科	6,443	80,408.64	0.14
321	000401	冀东水泥	6,100	80,215.00	0.14
322	002143	印纪传媒	2,500	80,025.00	0.14
323	600702	沱牌舍得	3,064	80,001.04	0.14
324	600298	安琪酵母	2,300	79,994.00	0.14
325	000961	中南建设	4,000	79,880.00	0.14
326	600566	济川药业	2,700	79,596.00	0.14
327	002463	沪电股份	9,499	79,316.65	0.14
328	600460	士兰微	8,542	78,842.66	0.14
329	600894	广日股份	3,943	78,702.28	0.14
330	000513	丽珠集团	1,160	78,682.80	0.14
331	002025	航天电器	2,990	78,338.00	0.14
332	002093	国脉科技	4,891	78,256.00	0.14
333	002727	一心堂	1,000	78,240.00	0.14
334	600823	世茂股份	6,000	78,180.00	0.14

335	603077	和邦股份	3,758	78,166.40	0.14
336	000869	张裕A	1,600	78,064.00	0.14
337	601886	江河创建	5,239	77,956.32	0.14
338	002277	友阿股份	4,533	77,786.28	0.14
339	600586	金晶科技	11,300	77,744.00	0.14
340	601139	深圳燃气	7,400	77,700.00	0.14
341	600748	上实发展	4,958	77,592.70	0.14
342	000563	陕国投A	5,500	77,385.00	0.14
343	002358	森源电气	3,600	77,328.00	0.14
344	002181	粤传媒	5,258	77,292.60	0.14
345	002028	思源电气	4,200	77,280.00	0.14
346	002479	富春环保	4,200	77,070.00	0.14
347	002588	史丹利	2,676	76,935.00	0.14
348	000417	合肥百货	6,252	76,587.00	0.14
349	002056	横店东磁	2,441	76,354.48	0.14
350	600335	国机汽车	2,001	75,897.93	0.13
351	002371	七星电子	1,995	75,810.00	0.13
352	601005	重庆钢铁	13,300	75,677.00	0.13
353	600831	广电网络	4,445	75,431.65	0.13
354	002408	齐翔腾达	4,399	75,398.86	0.13
355	600496	精工钢构	10,298	75,278.38	0.13
356	002249	大洋电机	5,857	75,086.74	0.13
357	600720	祁连山	7,078	74,956.02	0.13
358	002698	博实股份	1,412	74,553.60	0.13
359	600729	重庆百货	2,300	74,014.00	0.13
360	600251	冠农股份	5,322	73,603.26	0.13
361	002373	千方科技	1,700	73,593.00	0.13
362	600639	浦东金桥	3,012	73,161.48	0.13
363	600078	澄星股份	4,800	73,104.00	0.13
364	002342	巨力索具	7,671	72,644.37	0.13
365	600776	东方通信	4,381	72,242.69	0.13
366	002317	众生药业	2,550	71,884.50	0.13
367	002041	登海种业	4,040	71,467.60	0.13
368	002480	新筑股份	4,384	71,283.84	0.13
369	601678	滨化股份	7,916	71,006.52	0.13
370	002663	普邦园林	7,315	70,955.50	0.13
371	000603	盛达矿业	2,845	70,954.30	0.13
372	000688	建新矿业	4,153	70,891.71	0.13
373	601126	四方股份	2,322	70,821.00	0.13

374	000726	鲁 泰 A	5,080	70,612.00	0.13
375	002233	塔牌集团	4,081	70,438.06	0.12
376	600640	号百控股	2,428	70,120.64	0.12
377	601777	力帆股份	4,429	69,933.91	0.12
378	002332	仙琚制药	4,030	69,799.60	0.12
379	002315	焦点科技	726	69,696.00	0.12
380	600073	上海梅林	5,300	68,582.00	0.12
381	000049	德赛电池	1,437	68,544.90	0.12
382	600195	中牧股份	2,406	67,608.60	0.12
383	002242	九阳股份	3,449	67,083.05	0.12
384	002503	搜于特	3,538	66,797.44	0.12
385	000919	金陵药业	3,415	66,524.20	0.12
386	002345	潮宏基	3,380	66,180.40	0.12
387	000030	富奥股份	5,711	66,076.27	0.12
388	002461	珠江啤酒	2,498	65,947.20	0.12
389	600337	美克家居	4,400	65,736.00	0.12
390	002254	泰和新材	4,082	65,720.20	0.12
391	600754	锦江股份	2,201	65,589.80	0.12
392	603699	纽威股份	2,600	64,974.00	0.12
393	600750	江中药业	2,016	64,895.04	0.12
394	600850	华东电脑	1,165	64,529.35	0.11
395	000850	华茂股份	5,875	64,507.50	0.11
396	600456	宝钛股份	2,469	64,366.83	0.11
397	600488	天药股份	6,593	63,886.17	0.11
398	600874	创业环保	4,979	63,482.25	0.11
399	000596	古井贡酒	1,354	63,204.72	0.11
400	601101	吴华能源	5,472	62,380.80	0.11
401	600141	兴发集团	3,600	62,028.00	0.11
402	600132	重庆啤酒	2,751	61,952.52	0.11
403	600329	中新药业	2,455	61,841.45	0.11
404	600199	金种子酒	4,400	61,600.00	0.11
405	600425	青松建化	6,265	61,522.30	0.11
406	002128	露天煤业	3,731	61,486.88	0.11
407	601010	文峰股份	6,293	61,482.61	0.11
408	002574	明牌珠宝	2,680	61,372.00	0.11
409	600088	中视传媒	1,900	61,313.00	0.11
410	000501	鄂武商 A	2,961	60,700.50	0.11
411	600636	三爱富	2,991	60,657.48	0.11
412	000418	小天鹅 A	2,534	60,562.60	0.11

413	002646	青青稞酒	2,069	60,373.42	0.11
414	600997	开滦股份	7,000	60,340.00	0.11
415	000860	顺鑫农业	2,626	60,161.66	0.11
416	600864	哈投股份	3,701	59,956.20	0.11
417	600537	亿晶光电	3,342	59,821.80	0.11
418	600869	智慧能源	2,036	59,329.04	0.11
419	002681	奋达科技	2,160	59,313.60	0.11
420	601801	皖新传媒	2,029	59,185.93	0.10
421	002267	陕天然气	3,796	58,800.04	0.10
422	002204	大连重工	4,400	58,784.00	0.10
423	002392	北京利尔	6,802	58,769.28	0.10
424	002069	獐子岛	2,971	58,706.96	0.10
425	600773	西藏城投	3,304	58,183.44	0.10
426	600803	新奥股份	3,400	58,174.00	0.10
427	600429	三元股份	5,103	57,612.87	0.10
428	002140	东华科技	2,575	57,577.00	0.10
429	600280	中央商场	4,141	57,435.67	0.10
430	603188	亚邦股份	2,000	57,320.00	0.10
431	000823	超声电子	4,238	57,043.48	0.10
432	600657	信达地产	6,910	56,938.40	0.10
433	002293	罗莱家纺	3,145	56,893.05	0.10
434	600510	黑牡丹	3,659	56,787.68	0.10
435	603555	贵人鸟	1,357	56,695.46	0.10
436	600617	国新能源	3,100	56,637.00	0.10
437	000510	*ST 金路	7,554	55,899.60	0.10
438	002174	游族网络	600	55,656.00	0.10
439	600392	盛和资源	2,171	55,382.21	0.10
440	000426	兴业矿业	3,344	55,209.44	0.10
441	000951	中国重汽	1,900	54,758.00	0.10
442	000852	江钻股份	1,606	54,363.10	0.10
443	600507	方大特钢	6,000	54,240.00	0.10
444	000631	顺发恒业	6,657	53,855.13	0.10
445	002216	三全食品	3,662	53,831.40	0.10
446	603366	日出东方	3,640	53,508.00	0.09
447	002240	威华股份	3,900	52,884.00	0.09
448	002275	桂林三金	2,043	52,219.08	0.09
449	002226	江南化工	3,958	52,166.44	0.09
450	600971	恒源煤电	5,680	51,972.00	0.09
451	601515	东风股份	2,569	51,893.80	0.09

452	000525	红太阳	2,300	51,451.00	0.09
453	002194	武汉凡谷	1,893	51,073.14	0.09
454	002118	紫鑫药业	2,910	50,343.00	0.09
455	600780	通宝能源	5,175	50,249.25	0.09
456	000693	华泽钴镍	2,442	50,231.94	0.09
457	000921	海信科龙	4,082	49,800.40	0.09
458	000703	恒逸石化	3,900	49,764.00	0.09
459	600551	时代出版	2,285	49,607.35	0.09
460	600743	华远地产	6,150	49,384.50	0.09
461	601208	东材科技	4,201	47,975.42	0.09
462	002393	力生制药	1,050	47,964.00	0.09
463	002203	海亮股份	3,768	47,891.28	0.08
464	002327	富安娜	3,860	47,632.40	0.08
465	600468	百利电气	2,034	47,412.54	0.08
466	002091	江苏国泰	1,800	47,196.00	0.08
467	600563	法拉电子	1,519	47,013.05	0.08
468	002419	天虹商场	2,700	45,900.00	0.08
469	000962	东方铝业	3,045	45,066.00	0.08
470	002281	光迅科技	923	44,377.84	0.08
471	603001	奥康国际	1,396	43,583.12	0.08
472	600397	安源煤业	4,500	43,515.00	0.08
473	002678	珠江钢琴	2,143	43,460.04	0.08
474	000780	平庄能源	4,647	43,310.04	0.08
475	601965	中国汽研	3,300	42,933.00	0.08
476	002648	卫星石化	2,780	42,089.20	0.07
477	600983	惠而浦	2,620	41,631.80	0.07
478	601226	华电重工	2,600	41,366.00	0.07
479	002238	天威视讯	1,722	40,914.72	0.07
480	603169	兰石重装	2,200	40,678.00	0.07
481	603005	晶方科技	800	39,128.00	0.07
482	002635	安洁科技	1,600	38,960.00	0.07
483	600184	光电股份	1,380	38,860.80	0.07
484	002557	洽洽食品	2,347	38,443.86	0.07
485	002225	濮耐股份	4,020	38,029.20	0.07
486	002430	杭氧股份	2,834	37,465.48	0.07
487	002490	山东墨龙	3,034	36,438.34	0.06
488	000552	靖远煤电	2,560	36,096.00	0.06
489	601999	出版传媒	2,530	35,976.60	0.06
490	603698	航天工程	900	35,478.00	0.06

491	600389	江山股份	1,127	35,207.48	0.06
492	600618	氯碱化工	2,517	34,180.86	0.06
493	600403	大有能源	3,800	33,972.00	0.06
494	603328	依顿电子	1,100	33,726.00	0.06
495	600333	长春燃气	2,704	32,366.88	0.06
496	000719	大地传媒	1,389	31,002.48	0.05
497	002662	京威股份	1,695	30,238.80	0.05
498	002705	新宝股份	1,500	28,200.00	0.05
499	603899	晨光文具	700	28,042.00	0.05
500	603369	今世缘	674	24,998.66	0.04
501	600917	重庆燃气	1,900	24,016.00	0.04
502	600801	华新水泥	2,165	22,884.05	0.04
503	000582	北部湾港	1,000	21,270.00	0.04
504	600575	皖江物流	4,546	18,684.06	0.03
505	000982	中银绒业	2,604	12,082.56	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600446	金证股份	399,552.22	0.78
2	000592	平潭发展	304,580.00	0.60
3	600500	中化国际	295,048.00	0.58
4	300033	同花顺	289,445.00	0.57
5	600143	金发科技	289,319.00	0.57
6	002400	省广股份	288,484.90	0.57
7	600655	豫园商城	286,671.00	0.56
8	600079	人福医药	271,606.00	0.53
9	600594	益佰制药	269,907.00	0.53
10	300199	翰宇药业	256,045.00	0.50
11	000547	闽福发 A	255,259.00	0.50
12	300244	迪安诊断	232,430.00	0.46

13	600498	烽火通信	229,615.00	0.45
14	300291	华录百纳	217,778.93	0.43
15	600880	博瑞传播	209,561.00	0.41
16	300274	阳光电源	204,857.00	0.40
17	600664	哈药股份	201,244.00	0.39
18	600058	五矿发展	193,311.00	0.38
19	002195	二三四五	188,686.10	0.37
20	600436	片仔癀	184,300.00	0.36

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	1,223,937.04	2.40
2	300168	万达信息	640,514.00	1.26
3	601099	太平洋	477,585.10	0.94
4	600820	隧道股份	397,490.94	0.78
5	601519	大智慧	317,285.23	0.62
6	000977	浪潮信息	250,768.80	0.49
7	000712	锦龙股份	243,799.60	0.48
8	601872	招商轮船	242,223.28	0.48
9	600490	鹏欣资源	204,354.95	0.40
10	600266	北京城建	201,636.00	0.40
11	600098	广州发展	189,154.00	0.37
12	600317	营口港	185,666.00	0.36
13	002690	美亚光电	184,283.44	0.36
14	600582	天地科技	175,683.86	0.34
15	000050	深天马 A	147,846.23	0.29
16	600432	吉恩镍业	143,827.60	0.28
17	002052	同洲电子	127,827.00	0.25
18	000627	天茂集团	121,319.12	0.24
19	000555	神州信息	113,377.00	0.22
20	600239	云南城投	110,843.46	0.22

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,034,980.34
卖出股票收入（成交）总额	12,060,243.66

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 7.5 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。

## 7.6 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。

## 7.7 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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

1、吉林亚泰（集团）股份有限公司（下称：亚泰集团，股票代码：600881）于 2014 年 9 月 10 日发布公告，其控股子公司—吉林亚泰集团水泥销售有限公司因与具有竞争关系的经营者达成并实施了价格垄断协议的行为，收到吉林省物价局《行政处罚决定书》（吉省价处【2014】9 号）。吉林亚泰集团水泥销售有限公司被处以 2012 年度销售额 30.02 亿元 2%的罚款 6004 万元，占公司 2013 年度经审计归属于母公司所有者净利润的 20.42%（已扣除少数股东损益）。

因本报告期末亚泰集团属于中证 500 指数成分股，而本基金通过完全复制中证 500 指数成分股进行被动式指数化投资，因此持有亚泰集团。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,890.70
2	应收证券清算款	31,353.83
3	应收股利	-
4	应收利息	258.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,503.08

### 7.12.4 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。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	415,638.30	0.74	因重大事项停牌
2	600978	宜华木业	309,672.00	0.55	因重大事项停牌
3	600410	华胜天成	300,817.92	0.53	因重大事项停牌
4	601718	际华集团	271,358.64	0.48	因重大事项停牌
5	000748	长城信息	265,088.00	0.47	因重大事项停牌
6	000566	海南海药	252,798.23	0.45	因重大事项停牌

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
221	111,189.85	20,391,384.00	82.98%	4,181,572.00	17.02%

**8.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	阳光人寿保险股份有限公司-传统保险产品	5,000,000.00	20.35%
2	新华人寿保险股份有限公司	4,800,000.00	19.53%
3	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	4,510,000.00	18.35%
4	工银安盛人寿保险有限公司	3,331,100.00	13.56%
5	李更	1,580,000.00	6.43%
6	中信证券股份有限公司	1,040,983.00	4.24%
7	湖南省电力公司企业年金计划-中国光大银行股份有限公司	983,200.00	4.00%
8	贾建军	538,300.00	2.19%
9	中国银河证券股份有限公司	400,000.00	1.63%

10	上海龙苍投资有限公司	309,000.00	1.26%
----	------------	------------	-------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月26日）基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	36,572,956.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	24,572,956.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于 2015 年 1 月 23 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意王鹏辉先生辞去本公司副总经理一职。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

2、2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券股份有限公司	2	13,126,642.87	50.33%	11,950.60	50.33%	-
中国银河证券股份有限公司	1	12,955,401.53	49.67%	11,794.67	49.67%	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本期交易单元未变更。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准：

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 22 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 23 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 27 日
4	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 2 月 9 日
5	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 1 号更	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2015 年 2 月 9 日

	新招募说明书	金管理人网站	
6	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 31 日
7	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 31 日
8	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司  
2015 年 8 月 29 日