

# 易方达中证 500 交易型开放式指数

## 证券投资基金

### 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月二十五日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 2016 年 3 月 22 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 8 月 27 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	易方达中证 500ETF
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,696,515.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 14 日

### 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的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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。在正常市场情况下，本基金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	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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的表现，具有与标的指数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		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	洪渊
	联系电话	020-85102688	010—66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2015 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	21,516,402.48
本期利润	22,467,589.96
加权平均基金份额本期利润	0.5237
本期基金份额净值增长率	20.47%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	1.3281
期末基金资产净值	13,263,023.94
期末基金份额净值	7.8178

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. 本基金合同于 2015 年 8 月 27 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

4. 本基金已于 2015 年 9 月 9 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.15409267。

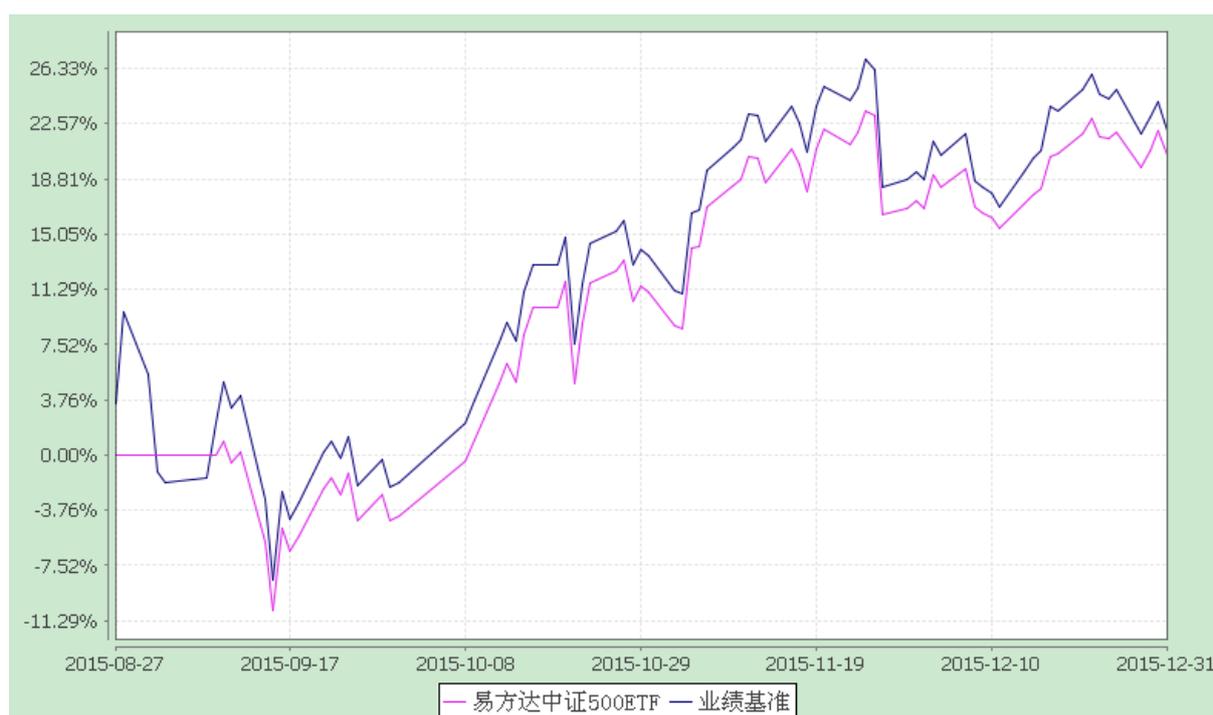
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	25.74%	1.93%	24.40%	2.05%	1.34%	-0.12%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.47%	2.11%	22.11%	2.56%	-1.64%	-0.45%

### 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

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015 年 8 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：1. 本基金合同于 2015 年 8 月 27 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

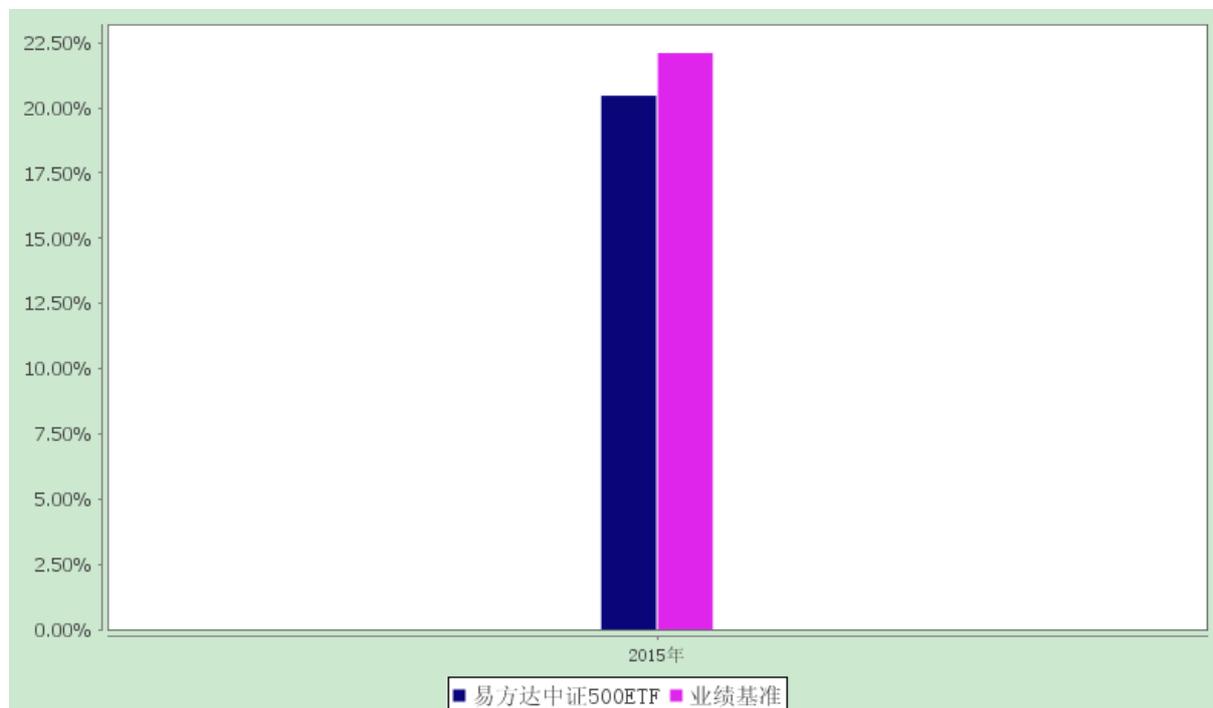
2. 按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3. 自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 20.47%，同期业绩比较基准收益率为 22.11%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 8 月 27 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 1.2 亿元，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务

资格。截至 2015 年 12 月 31 日，易方达旗下共管理 88 只开放式基金、1 只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，资产管理总规模 8269.58 亿元。

#### 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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2015-08-27	-	7 年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制

其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2015 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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 11 次，其中 8 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易，3 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。

### 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 年是 A 股市场跌宕起伏的一年。从实体经济情况看，中国经济仍处在“三期叠加”状态，

上市公司总体的盈利水平和盈利增速不可避免地呈现下滑趋势。但是在流动性宽松、融资交易、“改革牛”舆论等各种因素作用下，A 股市场从 2014 年下半年的估值修复走向了 2015 年上半年的估值泡沫。上证指数最高摸至 5178 点，静态估值 23 倍，万得全 A 指数（除金融、石油石化）静态估值 66 倍，更是创历史新高。市场在 6 月中旬见顶之后的快速调整，触发了杠杆交易的正反馈效应，引起了 A 股投资者的较大恐慌，市场在 7 月份一度出现流动性危机。尽管监管层采取了相应的市场稳定措施，但三季度上证指数仍然大跌 28.63%，交易量萎缩至第二季度的 60%。A 股市场在四季度出现整体反弹，上证指数上涨 15.93%。最终，上证指数全年仅上涨 9.41%，全年振幅高达 72%。大小盘风格分化明显，上证 50 指数全年下跌 6.23%，沪深 300 指数仅上涨 5.58%，而中证 500 指数和创业板指数分别上涨 43.12%和 84.41%。

本基金于 2015 年 8 月 27 日正式成立，并于 9 月 14 日在上海证券交易所上市交易暨开放日常申购赎回。作为被动型指数基金，报告期内，本基金按照完全复制法紧密跟踪中证 500 指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 7.8178 元，本报告期份额净值增长率为 20.47%，同期业绩比较基准收益率为 22.11%，日跟踪偏离度的均值为 0.45%，日跟踪误差为 1.224%，年化跟踪误差 18.96%。因本报告期包含了本基金合同规定的建仓期，故跟踪误差等指标仍在调整之中，本基金建仓期结束之后的跟踪误差等指标基本处在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换，短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免，这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复苏进程有所反复，宏观经济政策也将在稳增长、保就业的“下限”和防通胀的“上限”之间动态平衡，当经济运行处于预期的合理区间内，则以调结构为主要着力点。就今年中国经济运行实际情况来看，政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险，并加大“区间调控、定向调控和预调微调”的力度。从长期来看，通过供给侧改革、提高全要素生产率，将是中国长期可持续发展的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

作为被动投资的基金，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场的长期高成长提供良好的投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 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。

#### 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

自 2015 年 12 月 21 日至本报告期末，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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，本基金托管人在对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告

等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	1,327,324.70
结算备付金	150,452.91
存出保证金	115,601.35
交易性金融资产	12,015,292.56
其中：股票投资	12,015,292.56
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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	362.29
应收股利	-

应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>13,609,033.81</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 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	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	106,134.39
应付赎回款	-
应付管理人报酬	6,006.11
应付托管费	1,201.22
应付销售服务费	-
应付交易费用	121,881.44
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	110,786.71
<b>负债合计</b>	<b>346,009.87</b>
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	11,009,883.36
未分配利润	2,253,140.58
<b>所有者权益合计</b>	<b>13,263,023.94</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>13,609,033.81</b>

注：1.本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 8 月 27 日至

2015 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.8178 元，基金份额总额 1,696,515.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>23,299,723.35</b>
1.利息收入	179,586.37
其中：存款利息收入	179,586.37
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	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	22,170,006.32
其中：股票投资收益	21,984,380.26
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	146,920.00
股利收益	38,706.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	951,187.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-1,056.82

<b>减：二、费用</b>	<b>832,133.39</b>
1. 管理人报酬	230,934.74
2. 托管费	46,186.94
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	375,194.97
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	179,816.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>22,467,589.96</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>22,467,589.96</b>

注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 8 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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）	295,259,000.00	-	295,259,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,467,589.96	22,467,589.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-284,249,116.64	-20,214,449.38	-304,463,566.02

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-284,249,116.64	-20,214,449.38	-304,463,566.02
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）	11,009,883.36	2,253,140.58	13,263,023.94

注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 8 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

#### (1) 基金合同生效

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]999 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部部函[2015]2176 号《关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达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《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,259,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2015 年 8 月 3 日至 2015 年 8 月 21 日，募集金额总额为人民币

295,259,000.00 元，其中：有效净认购金额为人民币 295,243,000.00 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 16,000.00 元，经安永华明（2015）验字第 60468000\_G34 号验资报告予以审验。

## (2) 基金份额折算

为了与中证 500 指数进行对比，根据《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，易方达基金管理有限公司确定 2015 年 9 月 9 日为本基金的基金份额折算日。当日中证 500 指数收盘值为 6551.01 点，本基金资产净值为 298,052,917.95 元，折算前基金份额总额为 295,259,000 份，折算前基金份额净值为 1.0095 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.15409267，折算后基金份额总额为 45,496,515 份，折算后基金份额净值为 6.5511 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2015 年 9 月 10 日进行了变更登记。

## 7.4.2 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》、《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2015 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购赎回对价现金替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债

券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；

(3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中证指数有限公司独立提供。

(2)对于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),按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 7.4.6 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (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。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,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。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。
- (5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申赎代办券商
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年8月27日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	230,934.74
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年8月27日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	46,186.94	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

#### 7.4.8.3 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债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

无。

#### 7.4.8.5 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	
	2015年8月27日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,327,324.70	124,709.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000028	国药一致	2015-10-21	重大事项停牌	66.15	-	-	3,894	224,689.74	257,588.10	-
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大事项停牌	7.06	2016-03-21	7.77	25,200	140,112.00	177,912.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项停牌	12.22	-	-	19,560	176,896.53	239,023.20	-
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项停牌	13.00	2016-02-22	11.70	1,800	16,870.55	23,400.00	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项停牌	16.72	2016-02-22	15.05	1,200	15,259.87	20,064.00	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项停牌	17.40	-	-	12,500	167,831.81	217,500.00	-
002049	同方国芯	2015-12-11	重大事项停牌	60.15	2016-03-11	54.14	600	25,386.03	36,090.00	-
002143	印纪传媒	2015-12-09	重大事项停牌	40.55	2016-01-05	36.50	500	15,265.70	20,275.00	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项停牌	22.68	2016-01-11	20.41	700	13,923.41	15,876.00	-
002340	格林美	2015-12-29	重大事项停牌	15.20	2016-01-06	14.35	2,500	32,657.23	38,000.00	-
002371	七星电子	2015-10-08	重大事项停牌	19.28	2016-01-11	21.21	7,900	164,558.66	152,312.00	-
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项停牌	42.69	2016-01-18	38.42	700	29,303.00	29,883.00	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事项停牌	17.21	2016-01-19	15.49	500	7,266.08	8,605.00	-
002698	博实股份	2015-12-28	重大事项停牌	29.33	2016-01-05	26.40	500	12,936.58	14,665.00	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项停牌	15.80	-	-	1,500	21,857.79	23,700.00	-
300088	长信科技	2015-12-14	重大事项停牌	14.03	2016-02-29	12.63	1,600	17,120.29	22,448.00	-

600120	浙江东方	2015-10-12	重大事项停牌	19.86	-	-	2,400	48,668.14	47,664.00	-
600122	宏图高科	2015-12-25	重大事项停牌	19.42	-	-	2,300	30,955.39	44,666.00	-
600200	江苏吴中	2015-11-26	重大事项停牌	27.89	2016-03-16	25.10	600	9,666.78	16,734.00	-
600219	南山铝业	2015-09-29	重大事项停牌	6.58	2016-01-25	7.00	3,300	22,446.47	21,714.00	-
600282	南钢股份	2015-12-30	重大事项停牌	3.17	2016-01-12	3.24	4,800	14,666.00	15,216.00	-
600429	三元股份	2015-09-21	重大事项停牌	7.29	2016-01-27	7.49	4,600	36,133.11	33,534.00	-
600572	康恩贝	2015-12-29	重大事项停牌	13.36	2016-01-04	13.18	1,600	20,560.78	21,376.00	-
600584	长电科技	2015-11-30	重大事项停牌	22.02	-	-	1,900	33,487.76	41,838.00	-
600645	中源协和	2015-12-30	重大事项停牌	65.01	2016-01-04	63.90	700	37,637.40	45,507.00	-
600654	中安消	2015-12-14	重大事项停牌	28.84	-	-	1,400	45,659.48	40,376.00	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项停牌	31.25	2016-03-10	29.00	588	15,129.00	18,375.00	-
600759	洲际油气	2015-09-21	重大事项停牌	7.85	-	-	9,100	69,744.55	71,435.00	-
600851	海欣股份	2015-12-21	重大事项停牌	14.70	2016-01-19	13.23	1,700	19,065.05	24,990.00	-
600859	王府井	2015-12-21	重大事项停牌	27.22	2016-01-04	27.22	700	16,633.86	19,054.00	-
600864	哈投股份	2015-10-09	重大事项停牌	10.88	2016-01-14	11.97	7,900	90,878.51	85,952.00	-
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大事项停牌	7.50	2016-01-18	8.25	3,100	29,177.21	23,250.00	-
601000	唐山港	2015-10-29	重大事项停牌	8.25	2016-02-17	7.98	3,000	23,301.68	24,750.00	-
601678	滨化股份	2015-12-31	重大事项停牌	8.02	2016-01-05	7.22	1,600	11,983.11	12,832.00	-
601717	郑煤机	2015-12-18	重大事项停牌	7.52	-	-	2,200	15,684.15	16,544.00	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 7.4.10 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 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 10,092,144.26 元，属于第二层次的余额为 1,923,148.30 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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。对于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），本基金于 2015 年 3 月 19 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

##### (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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (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)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	12,015,292.56	88.29
	其中：股票	12,015,292.56	88.29
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	1,477,777.61	10.86
7	其他各项资产	115,963.64	0.85
8	合计	13,609,033.81	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	203,564.00	1.53
B	采矿业	495,188.00	3.73
C	制造业	6,773,289.26	51.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	411,677.00	3.10
E	建筑业	294,462.00	2.22
F	批发和零售业	1,207,839.30	9.11
G	交通运输、仓储和邮政业	325,433.00	2.45
H	住宿和餐饮业	25,660.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	712,385.00	5.37
J	金融业	113,029.00	0.85
K	房地产业	763,524.00	5.76
L	租赁和商务服务业	207,186.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	63,612.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	91,964.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	34,770.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	162,609.00	1.23
S	综合	129,101.00	0.97
	合计	12,015,292.56	90.59

## 8.3 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

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	000028	国药一致	3,894	257,588.10	1.94
2	000829	天音控股	19,560	239,023.20	1.80
3	002048	宁波华翔	12,500	217,500.00	1.64
4	000426	兴业矿业	25,200	177,912.00	1.34
5	002371	七星电子	7,900	152,312.00	1.15
6	600864	哈投股份	7,900	85,952.00	0.65
7	600759	洲际油气	9,100	71,435.00	0.54

8	002466	天齐锂业	500	70,375.00	0.53
9	002405	四维图新	1,400	54,320.00	0.41
10	600160	巨化股份	2,300	53,981.00	0.41

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn) 网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601718	际华集团	1,718,695.00	12.96
2	600895	张江高科	1,401,895.00	10.57
3	600655	豫园商城	1,361,066.00	10.26
4	002183	怡亚通	1,341,050.00	10.11
5	000998	隆平高科	1,305,798.50	9.85
6	600816	安信信托	1,284,393.00	9.68
7	002701	奥瑞金	1,262,451.60	9.52
8	600737	中粮屯河	1,244,713.00	9.38
9	600079	人福医药	1,244,568.00	9.38
10	600021	上海电力	1,236,778.00	9.33
11	600635	大众公用	1,220,559.00	9.20
12	600037	歌华有线	1,201,183.00	9.06
13	002405	四维图新	1,196,867.38	9.02
14	002400	省广股份	1,173,621.00	8.85
15	600601	方正科技	1,154,827.00	8.71
16	600201	生物股份	1,148,212.41	8.66
17	000031	中粮地产	1,110,658.45	8.37
18	000997	新大陆	1,106,458.00	8.34
19	000012	南玻 A	1,102,808.04	8.31
20	600219	南山铝业	1,099,339.06	8.29
21	600435	北方导航	1,095,274.00	8.26
22	600158	中体产业	1,093,820.00	8.25
23	600881	亚泰集团	1,089,557.00	8.21
24	600664	哈药股份	1,076,582.02	8.12
25	600498	烽火通信	1,069,406.00	8.06
26	002004	华邦健康	1,062,621.75	8.01
27	600811	东方集团	1,049,046.00	7.91
28	300072	三聚环保	1,044,487.00	7.88
29	300253	卫宁软件	1,037,221.22	7.82

30	600086	东方金钰	1,017,128.00	7.67
31	600143	金发科技	1,016,890.22	7.67
32	002250	联化科技	1,015,726.16	7.66
33	600584	长电科技	1,014,817.55	7.65
34	002466	天齐锂业	1,014,180.60	7.65
35	600500	中化国际	1,011,445.00	7.63
36	600376	首开股份	1,001,240.00	7.55
37	300244	迪安诊断	994,734.50	7.50
38	000547	航天发展	990,123.00	7.47
39	600522	中天科技	976,564.00	7.36
40	600410	华胜天成	976,078.00	7.36
41	002573	清新环境	971,314.00	7.32
42	002266	浙富控股	968,287.00	7.30
43	600704	物产中大	966,948.00	7.29
44	300144	宋城演艺	959,998.04	7.24
45	000930	中粮生化	951,727.00	7.18
46	000415	渤海租赁	947,164.00	7.14
47	601012	隆基股份	936,060.00	7.06
48	600320	振华重工	919,811.00	6.94
49	600872	中炬高新	915,325.00	6.90
50	600521	华海药业	914,445.73	6.89
51	000616	海航投资	913,850.00	6.89
52	600594	益佰制药	912,457.06	6.88
53	600160	巨化股份	903,773.00	6.81
54	600240	华业资本	902,186.00	6.80
55	002030	达安基因	895,121.00	6.75
56	600138	中青旅	894,276.00	6.74
57	000006	深振业 A	879,623.69	6.63
58	002022	科华生物	879,301.42	6.63
59	000690	宝新能源	877,495.00	6.62
60	600694	大商股份	867,930.00	6.54
61	000661	长春高新	864,892.41	6.52
62	002508	老板电器	861,924.00	6.50
63	600176	中国巨石	861,800.00	6.50
64	600064	南京高科	842,655.00	6.35
65	600835	上海机电	839,779.00	6.33
66	600675	中华企业	839,685.00	6.33
67	600879	航天电子	839,008.00	6.33
68	600436	片仔癀	837,952.18	6.32
69	002340	格林美	836,509.00	6.31
70	600787	中储股份	829,980.00	6.26
71	002179	中航光电	825,350.00	6.22
72	002595	豪迈科技	823,519.92	6.21
73	000592	平潭发展	822,601.00	6.20

74	002424	贵州百灵	821,905.00	6.20
75	300267	尔康制药	821,695.00	6.20
76	600685	中船防务	819,837.00	6.18
77	600017	日照港	807,130.59	6.09
78	600169	太原重工	804,358.99	6.06
79	000667	美好集团	800,032.38	6.03
80	000732	泰禾集团	798,198.67	6.02
81	000758	中色股份	797,627.55	6.01
82	000540	中天城投	796,564.00	6.01
83	002223	鱼跃医疗	791,368.00	5.97
84	600755	厦门国贸	784,436.00	5.91
85	600418	江淮汽车	783,425.00	5.91
86	600511	国药股份	779,169.00	5.87
87	600797	浙大网新	773,714.00	5.83
88	300033	同花顺	771,903.00	5.82
89	000656	金科股份	771,614.97	5.82
90	600808	马钢股份	769,572.00	5.80
91	600122	宏图高科	769,517.00	5.80
92	000078	海王生物	746,518.00	5.63
93	002271	东方雨虹	746,366.00	5.63
94	002013	中航机电	741,940.00	5.59
95	600422	昆药集团	739,126.00	5.57
96	600611	大众交通	738,990.00	5.57
97	600198	大唐电信	729,974.00	5.50
98	600750	江中药业	726,628.00	5.48
99	300273	和佳股份	725,821.00	5.47
100	000543	皖能电力	724,528.00	5.46
101	600200	江苏吴中	722,453.00	5.45
102	300199	翰宇药业	722,311.00	5.45
103	600006	东风汽车	719,280.00	5.42
104	600067	冠城大通	718,640.22	5.42
105	002049	同方国芯	716,216.56	5.40
106	600426	华鲁恒升	716,081.00	5.40
107	600056	中国医药	712,634.00	5.37
108	600487	亨通光电	710,969.00	5.36
109	600770	综艺股份	710,478.00	5.36
110	300274	阳光电源	709,493.67	5.35
111	300291	华录百纳	708,031.00	5.34
112	600557	康缘药业	705,669.00	5.32
113	600446	金证股份	705,584.00	5.32
114	002311	海大集团	703,093.41	5.30
115	600125	铁龙物流	702,870.84	5.30
116	001696	宗申动力	702,786.00	5.30
117	601608	中信重工	701,641.00	5.29

118	600805	悦达投资	698,189.00	5.26
119	002276	万马股份	698,004.00	5.26
120	300115	长盈精密	697,967.37	5.26
121	000541	佛山照明	694,599.00	5.24
122	600151	航天机电	692,898.95	5.22
123	600528	中铁二局	689,058.00	5.20
124	600572	康恩贝	686,499.15	5.18
125	000718	苏宁环球	686,451.26	5.18
126	600628	新世界	685,822.00	5.17
127	600183	生益科技	685,736.00	5.17
128	600587	新华医疗	684,239.00	5.16
129	600062	华润双鹤	682,714.00	5.15
130	600517	置信电气	680,747.00	5.13
131	600525	长园集团	678,666.00	5.12
132	002073	软控股份	677,816.00	5.11
133	002665	首航节能	677,784.91	5.11
134	600039	四川路桥	674,761.00	5.09
135	600481	双良节能	673,309.33	5.08
136	002161	远望谷	671,283.00	5.06
137	600187	国中水务	667,721.00	5.03
138	600885	宏发股份	667,664.00	5.03
139	600325	华发股份	667,591.29	5.03
140	600759	洲际油气	667,555.00	5.03
141	600220	江苏阳光	664,936.93	5.01
142	600654	中安消	664,539.00	5.01
143	600645	中源协和	663,041.00	5.00
144	300147	香雪制药	661,711.61	4.99
145	600270	外运发展	658,780.97	4.97
146	000988	华工科技	658,177.00	4.96
147	600673	东阳光科	658,167.00	4.96
148	000671	阳光城	650,578.00	4.91
149	000587	金叶珠宝	649,197.00	4.89
150	002444	巨星科技	648,907.00	4.89
151	600765	中航重机	645,583.00	4.87
152	002063	远光软件	644,382.00	4.86
153	600171	上海贝岭	642,989.00	4.85
154	002195	二三四五	640,962.00	4.83
155	600289	亿阳信通	639,399.00	4.82
156	600651	飞乐音响	627,347.00	4.73
157	002285	世联行	626,310.15	4.72
158	002489	浙江永强	625,249.00	4.71
159	002299	圣农发展	623,675.00	4.70
160	600482	风帆股份	621,958.00	4.69
161	600161	天坛生物	619,333.46	4.67

162	000572	海马汽车	610,055.00	4.60
163	002221	东华能源	607,469.00	4.58
164	000887	中鼎股份	605,864.00	4.57
165	600536	中国软件	604,830.00	4.56
166	002244	滨江集团	604,576.00	4.56
167	600409	三友化工	604,106.40	4.55
168	002437	誉衡药业	603,203.00	4.55
169	601311	骆驼股份	602,497.38	4.54
170	600433	冠豪高新	601,704.00	4.54
171	600380	健康元	600,647.68	4.53
172	600284	浦东建设	599,458.00	4.52
173	000528	柳 工	594,505.00	4.48
174	601717	郑煤机	593,341.00	4.47
175	601000	唐山港	589,860.00	4.45
176	600614	鼎立股份	588,400.00	4.44
177	300039	上海凯宝	588,215.00	4.43
178	300043	互动娱乐	586,639.00	4.42
179	000869	张 裕 A	584,482.34	4.41
180	000685	中山公用	584,221.60	4.40
181	600261	阳光照明	577,683.00	4.36
182	600851	海欣股份	572,489.00	4.32
183	002050	三花股份	566,512.00	4.27
184	000830	鲁西化工	563,243.00	4.25
185	000777	中核科技	562,808.00	4.24
186	600175	美都能源	562,302.00	4.24
187	000652	泰达股份	559,328.00	4.22
188	600580	卧龙电气	555,764.00	4.19
189	002269	美邦服饰	555,599.00	4.19
190	600880	博瑞传播	554,367.00	4.18
191	000488	晨鸣纸业	553,179.00	4.17
192	600884	杉杉股份	549,857.00	4.15
193	000028	国药一致	548,164.50	4.13
194	000021	深科技	547,675.00	4.13
195	002440	闰土股份	543,070.00	4.09
196	603766	隆鑫通用	542,993.00	4.09
197	600566	济川药业	539,386.67	4.07
198	000848	承德露露	539,054.00	4.06
199	000422	湖北宜化	537,880.00	4.06
200	002672	东江环保	537,339.13	4.05
201	000062	深圳华强	536,694.00	4.05
202	600458	时代新材	534,467.62	4.03
203	002642	荣之联	533,732.80	4.02
204	000566	海南海药	531,560.00	4.01
205	600970	中材国际	529,968.96	4.00

206	000681	视觉中国	529,218.00	3.99
207	600351	亚宝药业	527,503.00	3.98
208	600366	宁波韵升	525,435.00	3.96
209	600112	天成控股	521,710.00	3.93
210	000897	津滨发展	521,258.92	3.93
211	000088	盐田港	520,901.00	3.93
212	600859	王府井	519,470.00	3.92
213	600216	浙江医药	518,872.00	3.91
214	000650	仁和药业	518,264.00	3.91
215	600545	新疆城建	517,025.00	3.90
216	002588	史丹利	516,940.80	3.90
217	002308	威创股份	514,098.00	3.88
218	600267	海正药业	513,045.00	3.87
219	600499	科达洁能	510,629.60	3.85
220	601666	平煤股份	510,543.94	3.85
221	300088	长信科技	510,453.00	3.85
222	601880	大连港	510,307.00	3.85
223	002249	大洋电机	509,925.00	3.84
224	000816	智慧农业	509,122.00	3.84
225	000099	中信海直	508,625.00	3.83
226	002390	信邦制药	508,504.00	3.83
227	002155	湖南黄金	508,454.41	3.83
228	002254	泰和新材	508,325.59	3.83
229	002048	宁波华翔	508,162.00	3.83
230	600639	浦东金桥	505,861.00	3.81
231	603077	和邦生物	504,880.00	3.81
232	600699	均胜电子	504,300.00	3.80
233	002315	焦点科技	504,105.00	3.80
234	002237	恒邦股份	503,407.10	3.80
235	002041	登海种业	502,158.74	3.79
236	002168	深圳惠程	497,836.00	3.75
237	600416	湘电股份	496,837.00	3.75
238	600004	白云机场	496,355.00	3.74
239	600823	世茂股份	495,694.61	3.74
240	600180	瑞茂通	494,464.00	3.73
241	002190	成飞集成	494,280.00	3.73
242	000090	天健集团	493,022.00	3.72
243	600757	长江传媒	491,564.00	3.71
244	000829	天音控股	488,838.31	3.69
245	601126	四方股份	487,308.62	3.67
246	600967	北方创业	487,276.00	3.67
247	600120	浙江东方	486,941.93	3.67
248	600894	广日股份	483,671.00	3.65
249	002011	盾安环境	483,327.00	3.64

250	000900	现代投资	483,167.00	3.64
251	000926	福星股份	482,796.61	3.64
252	000973	佛塑科技	481,577.00	3.63
253	601139	深圳燃气	481,347.00	3.63
254	600478	科力远	480,044.45	3.62
255	000726	鲁 泰 A	478,811.50	3.61
256	002025	航天电器	477,028.00	3.60
257	000969	安泰科技	476,520.12	3.59
258	000735	罗 牛 山	474,111.00	3.57
259	002373	千方科技	473,235.34	3.57
260	000620	新华联	471,073.00	3.55
261	600993	马应龙	470,694.22	3.55
262	002143	印纪传媒	467,363.00	3.52
263	002273	水晶光电	467,333.05	3.52
264	000680	山推股份	463,989.00	3.50
265	600292	中电远达	463,475.40	3.49
266	000550	江铃汽车	461,309.00	3.48
267	603019	中科曙光	461,135.00	3.48
268	002064	华峰氨纶	459,661.66	3.47
269	002317	众生药业	459,136.37	3.46
270	600298	安琪酵母	458,129.00	3.45
271	600812	华北制药	455,060.00	3.43
272	000933	神火股份	454,215.64	3.42
273	002428	云南锗业	454,009.00	3.42
274	600790	轻纺城	452,755.40	3.41
275	000600	建投能源	452,204.00	3.41
276	600761	安徽合力	450,367.00	3.40
277	600825	新华传媒	446,051.00	3.36
278	000401	冀东水泥	443,204.00	3.34
279	002093	国脉科技	442,792.00	3.34
280	603699	纽威股份	441,995.00	3.33
281	600329	中新药业	441,860.00	3.33
282	601678	滨化股份	441,303.00	3.33
283	002681	奋达科技	440,020.95	3.32
284	000975	银泰资源	439,892.00	3.32
285	600337	美克家居	439,371.00	3.31
286	600496	精工钢构	437,342.20	3.30
287	600831	广电网络	436,500.00	3.29
288	000669	金鸿能源	434,273.00	3.27
289	002482	广田股份	433,528.00	3.27
290	600747	大连控股	429,496.00	3.24
291	002122	天马股份	429,417.00	3.24
292	600563	法拉电子	429,392.36	3.24
293	002242	九阳股份	429,303.00	3.24

294	601369	陕鼓动力	428,060.68	3.23
295	600251	冠农股份	426,616.00	3.22
296	000877	天山股份	425,217.87	3.21
297	600509	天富能源	425,180.00	3.21
298	600748	上实发展	424,372.00	3.20
299	002663	普邦园林	423,242.00	3.19
300	002078	太阳纸业	419,322.00	3.16
301	600312	平高电气	415,317.00	3.13
302	601005	重庆钢铁	415,230.01	3.13
303	000030	富奥股份	414,208.99	3.12
304	600300	维维股份	410,493.00	3.10
305	000931	中关村	409,973.00	3.09
306	002251	步步高	409,599.00	3.09
307	000417	合肥百货	409,318.00	3.09
308	002028	思源电气	408,345.00	3.08
309	601908	京运通	408,303.00	3.08
310	000860	顺鑫农业	408,040.00	3.08
311	002029	七匹狼	407,358.00	3.07
312	000501	鄂武商 A	406,531.00	3.07
313	601001	大同煤业	405,884.00	3.06
314	000979	中弘股份	404,248.00	3.05
315	600720	祁连山	404,170.00	3.05
316	002396	星网锐捷	401,837.96	3.03
317	002277	友阿股份	401,567.00	3.03
318	600460	士兰微	400,662.00	3.02
319	601801	皖新传媒	400,655.00	3.02
320	000049	德赛电池	399,066.00	3.01
321	600826	兰生股份	397,350.00	3.00
322	000612	焦作万方	397,104.78	2.99
323	000762	西藏矿业	396,994.00	2.99
324	000631	顺发恒业	395,633.00	2.98
325	000563	陕国投 A	395,253.00	2.98
326	000636	风华高科	392,208.00	2.96
327	600546	山煤国际	392,169.00	2.96
328	002325	洪涛股份	391,469.00	2.95
329	002358	森源电气	391,387.00	2.95
330	601233	桐昆股份	390,410.00	2.94
331	000861	海印股份	389,882.00	2.94
332	002267	陕天然气	389,176.00	2.93
333	002342	巨力索具	383,692.06	2.89
334	600059	古越龙山	383,325.00	2.89
335	600586	金晶科技	382,822.00	2.89
336	600617	国新能源	380,989.00	2.87
337	002727	一心堂	379,944.00	2.86

338	600260	凯乐科技	378,484.01	2.85
339	002118	紫鑫药业	374,838.00	2.83
340	601886	江河创建	374,621.02	2.82
341	000961	中南建设	373,126.00	2.81
342	002293	罗莱生活	368,782.00	2.78
343	002408	齐翔腾达	367,783.00	2.77
344	600596	新安股份	366,401.00	2.76
345	600869	智慧能源	365,979.00	2.76
346	000919	金陵药业	365,446.67	2.76
347	300202	聚龙股份	365,111.00	2.75
348	601010	文峰股份	364,176.00	2.75
349	000418	小天鹅 A	363,961.00	2.74
350	002479	富春环保	361,120.00	2.72
351	002463	沪电股份	360,594.00	2.72
352	002309	中利科技	356,145.00	2.69
353	600874	创业环保	351,867.00	2.65
354	002181	粤传媒	351,469.00	2.65
355	601002	晋亿实业	351,067.00	2.65
356	600657	信达地产	348,633.00	2.63
357	002332	仙琚制药	348,198.00	2.63
358	600395	盘江股份	348,008.00	2.62
359	002551	尚荣医疗	347,530.80	2.62
360	000788	北大医药	344,232.00	2.60
361	002140	东华科技	343,317.00	2.59
362	600773	西藏城投	342,448.00	2.58
363	002056	横店东磁	338,626.52	2.55
364	600702	沱牌舍得	338,068.60	2.55
365	000939	凯迪生态	335,975.00	2.53
366	603188	亚邦股份	334,542.00	2.52
367	002480	新筑股份	332,565.00	2.51
368	600132	重庆啤酒	331,337.00	2.50
369	000603	盛达矿业	329,831.24	2.49
370	601777	力帆股份	328,941.00	2.48
371	002327	富安娜	324,804.00	2.45
372	002414	高德红外	323,614.00	2.44
373	600088	中视传媒	323,384.30	2.44
374	000786	北新建材	320,357.00	2.42
375	002646	青青稞酒	319,084.00	2.41
376	000697	炼石有色	318,055.95	2.40
377	600864	哈投股份	317,720.00	2.40
378	600387	海越股份	312,441.00	2.36
379	002698	博实股份	311,873.00	2.35
380	600488	天药股份	311,035.00	2.35
381	002635	安洁科技	310,867.00	2.34

382	002128	露天煤业	309,431.96	2.33
383	002371	七星电子	306,966.00	2.31
384	002216	三全食品	304,771.00	2.30
385	002275	桂林三金	304,475.00	2.30
386	002005	德豪润达	302,386.00	2.28
387	600636	三爱富	302,058.00	2.28
388	601515	东风股份	301,310.00	2.27
389	603366	日出东方	301,215.00	2.27
390	002233	塔牌集团	300,812.00	2.27
391	600640	号百控股	300,288.00	2.26
392	002204	大连重工	299,019.00	2.25
393	600575	皖江物流	298,331.00	2.25
394	603899	晨光文具	293,025.00	2.21
395	600850	华东电脑	292,998.00	2.21
396	601226	华电重工	292,215.50	2.20
397	600997	开滦股份	291,164.00	2.20
398	600510	黑牡丹	289,001.00	2.18
399	000596	古井贡酒	288,177.00	2.17
400	002281	光迅科技	287,892.00	2.17
401	600780	通宝能源	286,510.00	2.16
402	600803	新奥股份	286,072.00	2.16
403	600507	方大特钢	285,702.00	2.15
404	600551	时代出版	285,690.00	2.15
405	000823	超声电子	284,019.00	2.14
406	600776	东方通信	281,929.25	2.13
407	600743	华远地产	279,918.00	2.11
408	600199	金种子酒	279,173.80	2.10
409	002503	搜于特	278,830.00	2.10
410	600971	恒源煤电	272,806.00	2.06
411	600429	三元股份	271,783.80	2.05
412	002393	力生制药	269,682.00	2.03
413	600335	国机汽车	267,717.00	2.02
414	601101	昊华能源	267,348.00	2.02
415	000693	华泽钴镍	266,954.00	2.01
416	002419	天虹商场	266,473.00	2.01
417	002662	京威股份	266,400.90	2.01
418	000921	海信科龙	266,363.00	2.01
419	603169	兰石重装	266,045.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	002405	四维图新	1,466,853.85	11.06
2	002466	天齐锂业	1,463,347.16	11.03
3	002701	奥瑞金	1,337,542.98	10.08
4	002183	怡亚通	1,313,819.00	9.91
5	002400	省广股份	1,290,573.16	9.73
6	000998	隆平高科	1,227,316.00	9.25
7	002004	华邦健康	1,186,017.46	8.94
8	000997	新大陆	1,176,004.66	8.87
9	300144	宋城演艺	1,169,016.80	8.81
10	300253	卫宁软件	1,152,511.00	8.69
11	300033	同花顺	1,128,329.00	8.51
12	300244	迪安诊断	1,101,678.00	8.31
13	000547	航天发展	1,098,609.70	8.28
14	000012	南玻A	1,081,054.00	8.15
15	002424	贵州百灵	1,077,433.20	8.12
16	002573	清新环境	1,076,831.49	8.12
17	000031	中粮地产	1,061,795.00	8.01
18	300072	三聚环保	1,035,934.24	7.81
19	000930	中粮生化	1,033,325.00	7.79
20	000415	渤海租赁	980,697.19	7.39
21	002250	联化科技	980,038.20	7.39
22	000592	平潭发展	976,626.00	7.36
23	002022	科华生物	957,263.31	7.22
24	002276	万马股份	950,886.19	7.17
25	002266	浙富控股	926,604.98	6.99
26	000616	海航投资	917,861.68	6.92
27	002049	同方国芯	911,701.63	6.87
28	002340	格林美	911,404.48	6.87
29	000661	长春高新	904,493.94	6.82
30	000006	深振业A	899,837.52	6.78
31	002161	远望谷	886,200.00	6.68
32	002030	达安基因	885,910.00	6.68
33	000690	宝新能源	884,023.00	6.67
34	002179	中航光电	878,162.52	6.62
35	002223	鱼跃医疗	877,834.53	6.62
36	002508	老板电器	868,237.34	6.55
37	300291	华录百纳	866,152.02	6.53
38	000078	海王生物	849,899.00	6.41
39	000540	中天城投	829,992.00	6.26
40	300267	尔康制药	826,554.31	6.23
41	300199	翰宇药业	824,182.00	6.21

42	002595	豪迈科技	814,950.22	6.14
43	000718	苏宁环球	803,888.53	6.06
44	300274	阳光电源	802,392.87	6.05
45	002013	中航机电	800,305.57	6.03
46	300273	和佳股份	781,721.78	5.89
47	002489	浙江永强	773,169.86	5.83
48	001696	宗申动力	772,674.58	5.83
49	002073	软控股份	771,485.20	5.82
50	000988	华工科技	771,005.00	5.81
51	300147	香雪制药	770,743.74	5.81
52	000758	中色股份	764,610.66	5.76
53	000732	泰禾集团	759,331.71	5.73
54	000667	美好集团	755,007.80	5.69
55	002665	首航节能	754,165.00	5.69
56	002195	二三四五	738,993.64	5.57
57	000543	皖能电力	735,919.00	5.55
58	002063	远光软件	726,442.24	5.48
59	000656	金科股份	721,381.52	5.44
60	002244	滨江集团	714,448.00	5.39
61	000541	佛山照明	712,068.40	5.37
62	300115	长盈精密	704,179.15	5.31
63	002271	东方雨虹	703,028.04	5.30
64	000777	中核科技	700,490.00	5.28
65	000671	阳光城	699,949.29	5.28
66	002285	世联行	687,214.22	5.18
67	002311	海大集团	685,266.44	5.17
68	002444	巨星科技	678,958.55	5.12
69	002437	誉衡药业	665,011.18	5.01
70	300043	互动娱乐	659,673.27	4.97
71	000681	视觉中国	655,933.00	4.95
72	000587	金叶珠宝	637,519.51	4.81
73	002299	圣农发展	637,024.00	4.80
74	002642	荣之联	633,216.22	4.77
75	002308	威创股份	624,931.45	4.71
76	002050	三花股份	617,424.00	4.66
77	300088	长信科技	609,036.56	4.59
78	000685	中山公用	607,709.96	4.58
79	002221	东华能源	604,507.00	4.56
80	000021	深科技	603,474.00	4.55
81	000488	晨鸣纸业	591,020.00	4.46
82	000816	智慧农业	589,042.00	4.44
83	000572	海马汽车	587,308.00	4.43
84	002373	千方科技	585,530.12	4.41
85	000887	中鼎股份	584,916.00	4.41

86	002273	水晶光电	582,756.00	4.39
87	002315	焦点科技	580,112.74	4.37
88	002588	史丹利	573,752.00	4.33
89	000652	泰达股份	569,898.66	4.30
90	000062	深圳华强	569,397.70	4.29
91	000528	柳 工	568,085.72	4.28
92	002672	东江环保	566,988.59	4.27
93	300039	上海凯宝	564,811.91	4.26
94	000762	西藏矿业	564,592.06	4.26
95	000869	张 裕 A	564,159.00	4.25
96	000973	佛塑科技	561,273.00	4.23
97	000566	海南海药	560,542.00	4.23
98	000650	仁和药业	556,462.00	4.20
99	000099	中信海直	553,712.00	4.17
100	002254	泰和新材	553,684.00	4.17
101	000897	津滨发展	544,670.24	4.11
102	000422	湖北宣化	544,598.00	4.11
103	000830	鲁西化工	544,300.84	4.10
104	000926	福星股份	541,635.52	4.08
105	002011	盾安环境	541,510.97	4.08
106	002025	航天电器	539,033.87	4.06
107	002190	成飞集成	536,461.33	4.04
108	002440	闰土股份	530,415.93	4.00
109	002390	信邦制药	530,019.00	4.00
110	000090	天健集团	526,765.79	3.97
111	000848	承德露露	524,554.00	3.96
112	002249	大洋电机	524,356.67	3.95
113	000088	盐 田 港	523,771.00	3.95
114	600528	中铁二局	520,384.00	3.92
115	002269	美邦服饰	512,406.00	3.86
116	000969	安泰科技	512,222.00	3.86
117	002168	深圳惠程	511,374.00	3.86
118	000680	山推股份	507,368.00	3.83
119	002428	云南锗业	500,353.00	3.77
120	002681	奋达科技	499,391.12	3.77
121	000735	罗 牛 山	497,306.00	3.75
122	002242	九阳股份	495,541.33	3.74
123	002155	湖南黄金	494,744.00	3.73
124	002237	恒邦股份	488,018.00	3.68
125	002093	国脉科技	487,724.00	3.68
126	002325	洪涛股份	482,796.86	3.64
127	002041	登海种业	481,170.12	3.63
128	002358	森源电气	478,505.00	3.61
129	000900	现代投资	473,184.75	3.57

130	000931	中 关 村	466,281.00	3.52
131	000620	新华联	465,632.27	3.51
132	000669	金鸿能源	464,864.00	3.50
133	002482	广田股份	460,605.00	3.47
134	002317	众生药业	459,677.22	3.47
135	002122	天马股份	458,489.00	3.46
136	002143	印纪传媒	456,736.04	3.44
137	000726	鲁 泰 A	450,526.00	3.40
138	000550	江铃汽车	447,606.84	3.37
139	000933	神火股份	438,123.00	3.30
140	000600	建投能源	438,118.41	3.30
141	000401	冀东水泥	437,593.17	3.30
142	002396	星网锐捷	435,613.18	3.28
143	002663	普邦园林	432,075.00	3.26
144	000877	天山股份	429,348.80	3.24
145	002029	七 匹 狼	429,047.00	3.23
146	002251	步 步 高	427,419.37	3.22
147	000636	风华高科	427,071.96	3.22
148	000975	银泰资源	426,265.00	3.21
149	002078	太阳纸业	426,218.00	3.21
150	002064	华峰氨纶	423,833.48	3.20
151	000861	海印股份	421,388.00	3.18
152	002698	博实股份	419,041.94	3.16
153	000049	德赛电池	418,061.98	3.15
154	000417	合肥百货	416,157.00	3.14
155	002181	粤 传 媒	415,382.44	3.13
156	300202	聚龙股份	414,187.08	3.12
157	002028	思源电气	414,122.23	3.12
158	002277	友阿股份	407,694.07	3.07
159	002551	尚荣医疗	405,020.86	3.05
160	000501	鄂武商 A	400,396.00	3.02
161	002727	一心堂	400,013.00	3.02
162	002118	紫鑫药业	399,733.00	3.01
163	000788	北大医药	397,882.00	3.00
164	002342	巨力索具	396,847.00	2.99
165	002414	高德红外	396,557.24	2.99
166	000563	陕国投 A	395,969.95	2.99
167	000961	中南建设	395,749.00	2.98
168	000631	顺发恒业	395,690.00	2.98
169	000030	富奥股份	395,223.00	2.98
170	000860	顺鑫农业	392,198.32	2.96
171	000979	中弘股份	388,451.00	2.93
172	002479	富春环保	388,348.96	2.93
173	002293	罗莱生活	386,360.00	2.91

174	000612	焦作万方	380,130.00	2.87
175	002332	仙琚制药	379,364.00	2.86
176	600086	东方金钰	377,616.31	2.85
177	002267	陕天然气	375,712.00	2.83
178	000919	金陵药业	374,120.47	2.82
179	000603	盛达矿业	370,049.00	2.79
180	002480	新筑股份	369,030.98	2.78
181	000697	炼石有色	368,239.37	2.78
182	002463	沪电股份	368,150.64	2.78
183	002309	中利科技	367,483.23	2.77
184	002408	齐翔腾达	366,353.19	2.76
185	002056	横店东磁	363,463.99	2.74
186	002140	东华科技	358,160.42	2.70
187	000939	凯迪生态	357,670.00	2.70
188	002048	宁波华翔	354,376.00	2.67
189	000418	小天鹅 A	344,846.96	2.60
190	002635	安洁科技	340,289.02	2.57
191	000028	国药一致	327,969.66	2.47
192	002503	搜于特	323,806.24	2.44
193	002281	光迅科技	322,026.82	2.43
194	002327	富安娜	314,712.00	2.37
195	000829	天音控股	313,833.20	2.37
196	002646	青青稞酒	313,260.00	2.36
197	002275	桂林三金	307,538.00	2.32
198	000823	超声电子	305,033.74	2.30
199	002216	三全食品	300,164.00	2.26
200	002069	獐子岛	299,690.46	2.26
201	002393	力生制药	299,342.38	2.26
202	002233	塔牌集团	295,259.00	2.23
203	002204	大连重工	294,268.52	2.22
204	002662	京威股份	293,489.91	2.21
205	002128	露天煤业	292,941.00	2.21
206	000786	北新建材	290,522.00	2.19
207	000693	华泽钴镍	288,606.94	2.18
208	000703	恒逸石化	274,780.49	2.07
209	002005	德豪润达	273,236.80	2.06
210	000852	石化机械	270,138.00	2.04
211	000596	古井贡酒	270,079.98	2.04
212	002419	天虹商场	267,096.00	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	260,789,075.64
卖出股票收入（成交）总额	139,268,326.82

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					146,920.00
股指期货投资本期公允价值变动					-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	115,601.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	362.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,963.64

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末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	000028	国药一致	257,588.10	1.94	重大事项停牌
2	000829	天音控股	239,023.20	1.80	重大事项停牌
3	002048	宁波华翔	217,500.00	1.64	重大事项停牌
4	000426	兴业矿业	177,912.00	1.34	重大事项停牌
5	002371	七星电子	152,312.00	1.15	重大事项停牌
6	600864	哈投股份	85,952.00	0.65	重大事项停牌
7	600759	洲际油气	71,435.00	0.54	重大事项停牌

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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
185	9,170.35	337,609.00	19.90%	1,358,906.00	80.10%

## 9.2 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	龚军平	446,528.00	26.32%
2	邓敏妍	308,185.00	18.17%
3	上海申毅投资股份有限公司—申毅多策略量化套利 7 号	231,812.00	13.66%
4	刘健	63,564.00	3.75%
5	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	60,000.00	3.54%
6	程希庆	53,932.00	3.18%
7	吕爱平	50,000.00	2.95%
8	马坚明	40,000.00	2.36%
9	招商证券股份有限公司	32,741.00	1.93%
10	杨嵘	30,000.00	1.77%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

## 9.4 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 8 月 27 日)基金份额总额	295,259,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	43,800,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-249,762,485.00
本报告期期末基金份额总额	1,696,515.00

注：本基金合同生效日为 2015 年 08 月 27 日。拆分变动份额包括份额折算份额。

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 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

2015 年 6 月 2 日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 60,000.00 元。

## 11.6 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和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	134,296,424.48	33.57%	67,154.45	33.57%	-
中信建投	2	142,841,612.03	35.71%	71,421.44	35.70%	-
安信证券	1	122,919,365.95	30.73%	61,466.30	30.73%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增安信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司各一个交易单元；新增中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司各两个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 11.7.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一六年三月二十五日