

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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
§5 托管人报告	13
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
8.7 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.....	62
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.....	62
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.....	62

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	63
§9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末上市基金前十名持有人	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§10 开放式基金份额变动	65
§11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	116,531,868.00 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	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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。
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		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010) 65215588	(010) 67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010) 67595096
传真		(010) 65182266	(010) 66275853
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 46 层 06-08 单元	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	100005	100033
法定代表人	邓红国	王洪章

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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	2014 年	2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	232,586,197.15	36,702,856.62	24,454,195.20
本期利润	236,654,186.34	89,901,468.73	34,027,425.03
加权平均基金份额本期利润	1.8867	1.5002	0.0806
本期加权平均净值利润率	25.12%	34.23%	3.55%
本期基金份额净值增长率	40.06%	38.49%	7.58%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	334,354,823.61	67,920,941.06	17,633,620.55
期末可供分配基金份额利润	2.8692	0.9740	0.2703
期末基金资产净值	867,281,040.59	370,524,557.03	250,287,144.92
期末基金份额净值	7.4424	5.3136	3.8369
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	108.67%	48.99%	7.58%

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）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）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。

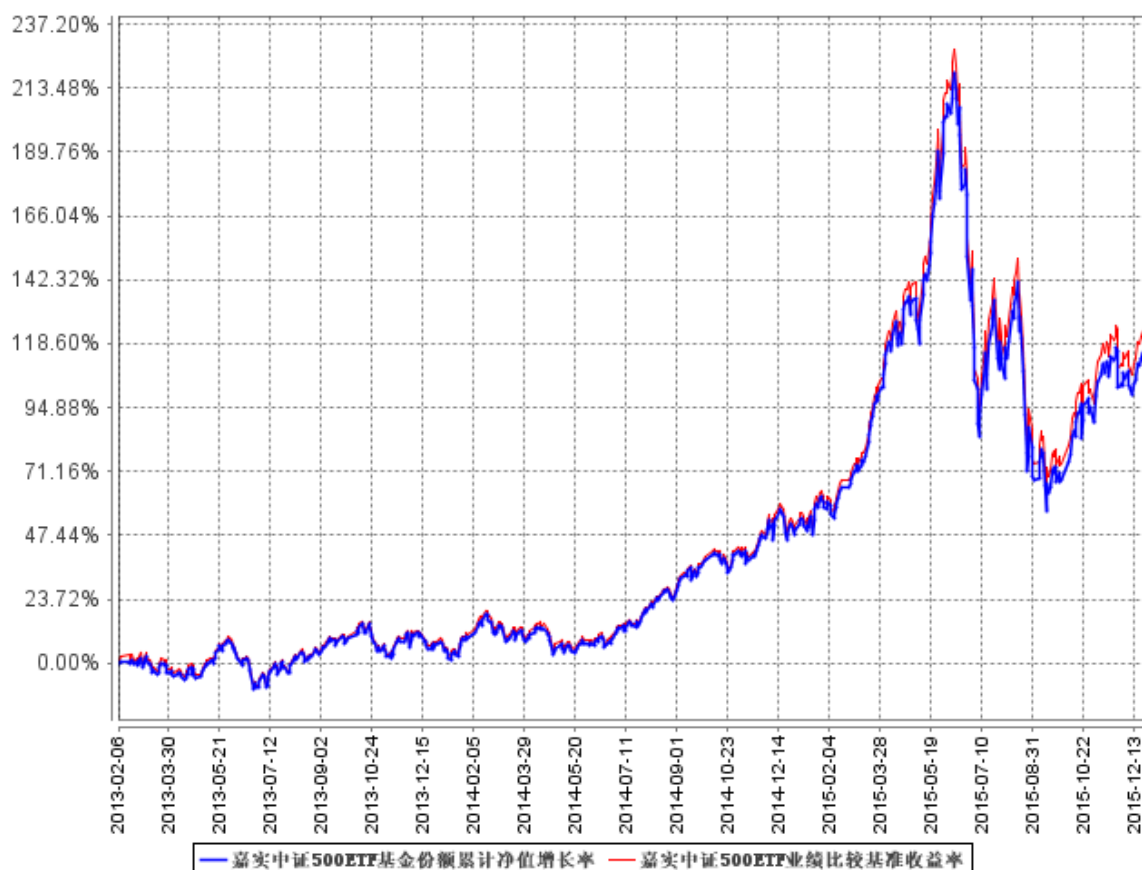
3.2 基金净值表现

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	24.40%	2.08%	24.40%	2.05%	0.00%	0.03%
过去六个月	-15.26%	3.22%	-14.47%	3.23%	-0.79%	-0.01%
过去一年	40.06%	2.81%	43.12%	2.82%	-3.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	108.67%	1.96%	116.37%	1.98%	-7.70%	-0.02%

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

嘉实中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



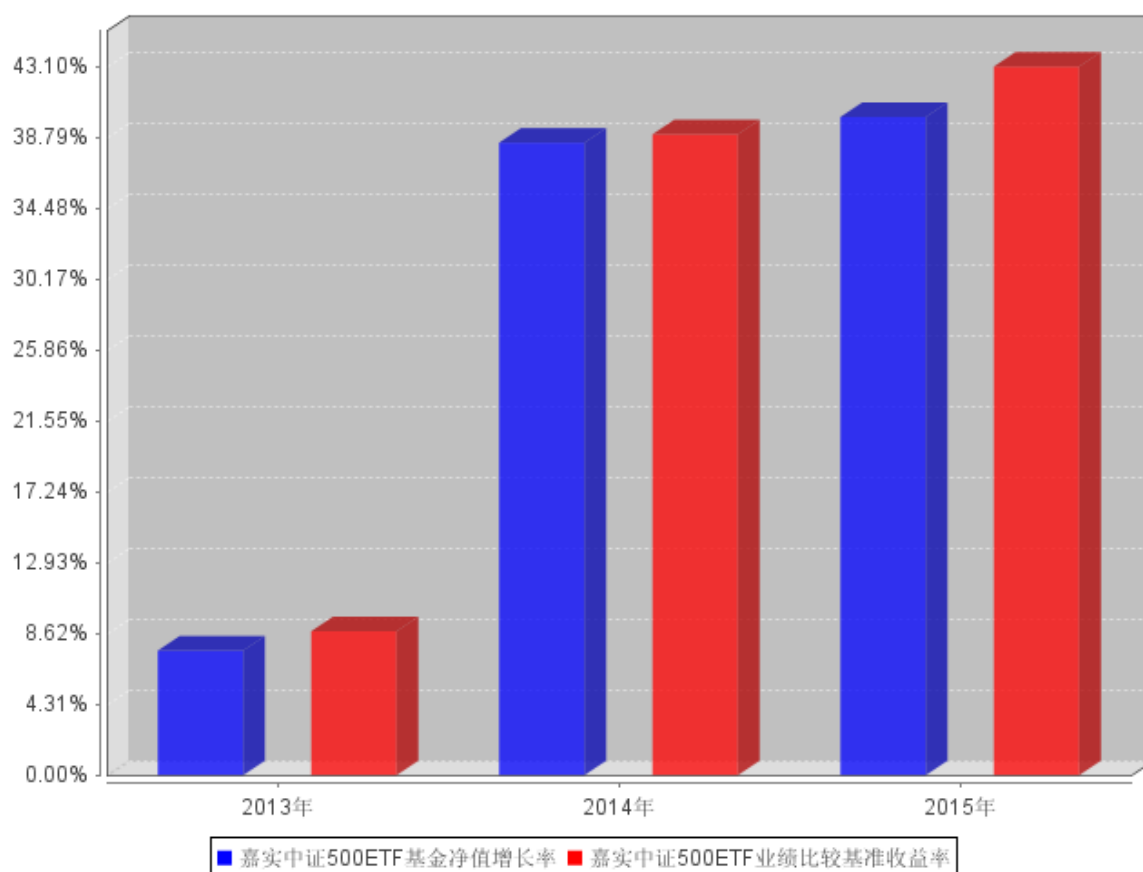
图：嘉实中证 500ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 2 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

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

嘉实中证500ETF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对比图



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，2013 年度的相关数据根据当年实际存续期（2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日）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以来未实施利润分配。

§ 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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		
杨宇	本基金、嘉实沪深300ETF、嘉实沪深300ETF 联接（LOF）、嘉实中证500ETF 联接、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实 H 股 指 数（QDII-LOF）、嘉实深证基本面 120ETF 及其联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）基金经理，公司指数投资部总监	2013年2月6日	-	17 年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家（天同）180 指数基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（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）2016 年 1 月 5 日，本基金管理人发布《关于嘉实中证 500ETF 基金经理变更的公告》，杨宇先生不再担任本基金基金经理，聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

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

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.09%，年度化拟合偏离度为 1.49%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35% 的限制。

本基金的跟踪误差主要来源于报告期内指数成份股停牌比例较大、基金的申购赎回、样本股分红以及样本股调整的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 7.4424 元；本报告期基金份额净值增长率为 40.06%，业

绩比较基准收益率为 43.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，其中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势。随着未来中国经济发展更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也将较多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。报告期内，中证 500 指数上涨 43.12%。

作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。重点支持创新业务和新产品拓展。创新是公司永恒的主题，同时应有效防控风险，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则的创新，使之更加符合投资者需求。

(2) 合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查(包括各类产品及业务)，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与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，经基金托管人复核无误后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。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同十八（二）“1. 在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配”。报告期内，基金净值增长率与标的指数增长率的差额未超过 1%，因此本基金报告期内未实施利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 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

无。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2016)第 20319 号

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；
- (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险

评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述嘉实中证 500ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所(特殊普通合伙)

中国 · 上海市

注册会计师

许 康 玮

洪 磊

2016 年 3 月 18 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 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	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	18,433,885.67	2,540,818.65
结算备付金		6,190,593.02	4,431.00
存出保证金		5,176,535.65	3,782.93
交易性金融资产	7.4.7.2	838,418,099.14	368,819,410.29
其中：股票投资		838,418,099.14	368,819,410.29
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		509,373.36	57,883.98
应收利息	7.4.7.5	7,998.90	762.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		868,736,485.74	371,427,089.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		472,834.00	161,362.00
应付托管费		94,566.80	32,272.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	377,931.39	80,267.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	510,112.96	628,630.64
负债合计		1,455,445.15	902,532.68
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	415,618,173.12	248,703,055.05
未分配利润	7.4.7.10	451,662,867.47	121,821,501.98
所有者权益合计		867,281,040.59	370,524,557.03
负债和所有者权益总计		868,736,485.74	371,427,089.71

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.4424 元，基金份额总额 116,531,868.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		244,839,711.06	92,338,291.08
1.利息收入		146,914.81	17,500.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	146,914.81	17,403.62
债券利息收入		-	97.21
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		236,718,383.52	38,921,920.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	235,256,966.66	36,891,153.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	23,266.79
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-3,633,000.00	-
股利收益	7.4.7.15	5,094,416.86	2,007,500.75
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	4,067,989.19	53,198,612.11
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	3,906,423.54	200,257.19
减：二、费用		8,185,524.72	2,436,822.35
1.管理人报酬		4,621,958.04	1,314,104.38
2.托管费		924,391.61	262,820.90
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	1,886,987.19	237,495.51
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	752,187.88	622,401.56
三、利润总额		236,654,186.34	89,901,468.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润		236,654,186.34	89,901,468.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 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)	248,703,055.05	121,821,501.98	370,524,557.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	236,654,186.34	236,654,186.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	166,915,118.07	93,187,179.15	260,102,297.22
其中：1.基金申购款	882,724,181.83	899,095,773.71	1,781,819,955.54
2.基金赎回款	-715,809,063.76	-805,908,594.56	-1,521,717,658.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	415,618,173.12	451,662,867.47	867,281,040.59
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	232,653,524.37	17,633,620.55	250,287,144.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	89,901,468.73	89,901,468.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	16,049,530.68	14,286,412.70	30,335,943.38
其中：1.基金申购款	155,680,446.70	48,106,606.89	203,787,053.59
2.基金赎回款	-139,630,916.02	-33,820,194.19	-173,451,110.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	248,703,055.05	121,821,501.98	370,524,557.03

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：

赵学军

王红

常旭

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 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[2012]1588号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实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《嘉实中证 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 3,108,591,728.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 047 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 137,674.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上 [2013] 83 号文审核同意,本基金 871,631,868.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在深交所挂牌交易。

根据《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》(以下简称“份额折算公告”)的有关规定,本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司确定 2013 年 3 月 5 日为本基金的基金折算处理日。当日基金资产净值为 3,136,108,366.93 元,折算前基金份额总额为 3,108,729,402.00 份,折算前基金份额净值为 1.0088 元。根据份额折算公告中的基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.28038605,折算后基金份额总额为 871,631,868.00 份,折算后基金份额净值为 3.5980 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算,并于 2013 年 3 月 6 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 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,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,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%。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%。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、中小企业私募债、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)。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 联接基金”)。嘉实中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 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、中国基金业协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

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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产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，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

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其他各类应收款项等。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。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债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，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和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和金融负债，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已宣告但尚未发放的现金股利、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

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。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。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。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；于处置时，其处置价格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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长

率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，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) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[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》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2) 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。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

央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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

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),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

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[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》、财税[2015]101 号《关于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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	18,433,885.67	2,540,818.65
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	18,433,885.67	2,540,818.65

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	773,282,468.01	838,418,099.14	65,135,631.13
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	773,282,468.01	838,418,099.14	65,135,631.13
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	306,047,568.35	368,819,410.29	62,771,841.94

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	306,047,568.35	368,819,410.29	62,771,841.94

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	23,452,400.00	-	-	
其中：股指期货投资	23,452,400.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	23,452,400.00	-	-	

注 1：上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

注 2：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1601	中证 500 股指期货 IC1601 合约	17	25,156,600.00	1,704,200.00
总额合计	-	-	-	1,704,200.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,704,200.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,096.75	712.69
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	271.20	48.30
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	3,630.95	1.87
合计	7,998.90	762.86

7.4.7.6 其他资产

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	377,931.39	80,267.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	377,931.39	80,267.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	390,000.00	360,000.00

可退替代款	33,863.06	196,012.45
应付替代款	-	22,618.19
应付指数使用费	86,249.90	50,000.00
其他	-	-
合计	510,112.96	628,630.64

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,731,868.00	248,703,055.05
本期申购	247,500,000.00	882,724,181.83
本期赎回	-200,700,000.00	-715,809,063.76
本期末	116,531,868.00	415,618,173.12

7.4.7.10 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	67,920,941.06	53,900,560.92	121,821,501.98
本期利润	232,586,197.15	4,067,989.19	236,654,186.34
本期基金份额交易产生的变动数	33,847,685.40	59,339,493.75	93,187,179.15
其中：基金申购款	509,281,769.22	389,814,004.49	899,095,773.71
基金赎回款	-475,434,083.82	-330,474,510.74	-805,908,594.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	334,354,823.61	117,308,043.86	451,662,867.47

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	73,865.87	15,155.52
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	36,852.92	2,192.11
其他	36,196.02	55.99
合计	146,914.81	17,403.62

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	95,040,984.89	15,547,133.65
股票投资收益——赎回差价收入	140,215,981.77	21,344,019.76
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	235,256,966.66	36,891,153.41

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
卖出股票成交总额	691,724,890.76	87,154,260.52
减：卖出股票成本总额	596,683,905.87	71,607,126.87
买卖股票差价收入	95,040,984.89	15,547,133.65

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,521,717,658.32	173,451,110.21
减：现金支付赎回款总额	192,290,201.32	-100,518.79
减：赎回股票成本总额	1,189,211,475.23	152,207,609.24
赎回差价收入	140,215,981.77	21,344,019.76

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券	-	155,364.00

到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	-	132,000.00
减:应收利息总额	-	97.21
买卖债券差价收入	-	23,266.79

注:本期(2015年1月1日至2015年12月31日),本基金无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本期(2015年1月1日至2015年12月31日)及上年度可比期间(2014年1月1日至2014年12月31日),本基金无买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
股指期货投资收益	-3,633,000.00	-

注:上年度可比期间(2014年1月1日至2014年12月31日),本基金无股指期货投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
股票投资产生的股利收益	5,094,416.86	2,007,500.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,094,416.86	2,007,500.75

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1.交易性金融资产	2,363,789.19	53,198,612.11
——股票投资	2,363,789.19	53,198,612.11
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2. 衍生工具	1,704,200.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	1,704,200.00	-
3. 其他	-	-
合计	4,067,989.19	53,198,612.11

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转出费收入	-	-
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
替代损益	3,906,423.54	200,257.19
证管费退还	-	-
其他	-	-
合计	3,906,423.54	200,257.19

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
交易所市场交易费用	1,886,987.19	237,495.51
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,886,987.19	237,495.51

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	90,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	-	-
银行划款手续费	7,433.87	2,401.56
指数使用费	294,754.01	200,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
红利手续费	-	-

其他	-	-
合计	752,187.88	622,401.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 联接”）	本基金的联接基金

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,621,958.04	1,314,104.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人嘉实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×0.5% / 当年天数。

7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	924,391.61	262,820.90

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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×0.1% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
嘉实中证 500ETF 联接	50,497,880.00	43.33%	46,260,132.00	66.34%

7.4.10.5 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	18,433,885.67	73,865.87	2,540,818.65	15,155.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015年1月1日至2015年12月31日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本期（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	未上市	8.50	8.50	500	4,250.00	4,250.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2015年12月31日），本基金未持有流通受限的债券。

7.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2015年12月31日），本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.12.2 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年10月21日	重大事项停牌	66.15	-	-	35,942	2,189,218.84	2,377,563.30	-
000066	长城电脑	2015年6月18日	重大事项停牌	21.54	2016年3月10日	19.39	156,735	1,947,435.40	3,376,071.90	-
000426	兴业矿业	2015年10月28日	重大事项停牌	7.06	-	-	204,840	1,289,867.09	1,446,170.40	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大事项停牌	34.88	2016年3月10日	31.39	154,500	3,701,601.78	5,388,960.00	-
000829	天音控	2015年11月9日	重大事项	12.22	-	-	221,462	2,582,052.93	2,706,265.64	-

	股		停牌								
000973	佛塑科技	2015 年 12 月 18 日	重大事项停牌	13.00	2016 年 2 月 22 日	11.70	147,961	1,157,012.03	1,923,493.00	-	
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项停牌	4.64	2016 年 2 月 25 日	5.10	86,520	413,747.29	401,452.80	-	
002011	盾安环境	2015 年 12 月 28 日	重大事项停牌	16.72	2016 年 2 月 22 日	15.05	93,707	1,288,506.77	1,566,781.04	-	
002018	华信国际	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	44.08	-	-	116,500	2,027,724.55	5,135,320.00	-	
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大事项停牌	17.40	-	-	137,303	2,380,479.77	2,389,072.20	-	
002049	同方国芯	2015 年 12 月 11 日	重大事项停牌	60.15	2016 年 3 月 11 日	54.14	76,700	3,690,683.69	4,613,505.00	-	
002143	印纪传媒	2015 年 12 月 9 日	重大事项停牌	40.55	2016 年 1 月 5 日	36.50	70,400	2,173,495.97	2,854,720.00	-	
002174	游族网络	2015 年 7 月 23 日	重大事项停牌	89.53	2016 年 2 月 15 日	80.58	14,800	1,206,187.93	1,325,044.00	-	
002219	恒康医疗	2015 年 7 月 8 日	重大事项停牌	14.90	-	-	204,618	2,620,160.62	3,048,808.20	-	
002242	九阳股份	2015 年 12 月 24 日	重大事项停牌	22.68	2016 年 1 月 11 日	20.41	56,817	1,082,661.77	1,288,609.56	-	
002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事项停牌	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	188,983	2,588,716.68	2,872,541.60	-	
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项停牌	19.28	2016 年 1 月 11 日	21.21	42,500	1,177,300.65	819,400.00	-	
002568	百润股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	42.69	2016 年 1 月 18 日	38.42	50,600	2,144,869.96	2,160,114.00	-	
002678	珠江钢琴	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	17.21	2016 年 1 月 19 日	15.49	38,917	594,496.73	669,761.57	-	
002698	博实股份	2015 年 12 月 28 日	重大事项停牌	29.33	2016 年 1 月 5 日	26.40	37,840	909,311.12	1,109,847.20	-	
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项停牌	15.80	-	-	118,900	2,004,710.91	1,878,620.00	-	
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大事项停牌	14.03	2016 年 2 月 29 日	12.63	226,300	2,605,189.59	3,174,989.00	-	
600120	浙江东方	2015 年 10 月 12 日	重大事项停牌	19.86	-	-	71,807	1,737,292.55	1,426,087.02	-	
600122	宏图高科	2015 年 12 月 25 日	重大事项停牌	19.42	-	-	169,085	1,872,182.90	3,283,630.70	-	
600200	江苏吴中	2015 年 11 月 26 日	重大事项停牌	27.89	2016 年 3 月 16 日	25.10	171,302	3,439,687.76	4,777,612.78	-	
600219	南山铝业	2015 年 9 月 29 日	重大事项停牌	6.58	2016 年 1 月 25 日	7.00	484,400	4,415,055.96	3,187,352.00	-	

600282	南钢股份	2015 年 12 月 30 日	重大事项 停牌	3.17	2016 年 1 月 12 日	3.24	369,000	1,152,923.35	1,169,730.00	-
600429	三元股份	2015 年 9 月 21 日	重大事项 停牌	7.29	2016 年 1 月 27 日	7.49	107,400	1,009,334.26	782,946.00	-
600572	康恩贝	2015 年 12 月 28 日	重大事项 停牌	13.36	2016 年 1 月 4 日	13.18	124,199	1,600,500.75	1,659,298.64	-
600584	长电科技	2015 年 11 月 30 日	重大事项 停牌	22.02	-	-	242,104	3,910,198.19	5,331,130.08	-
600645	中源协和	2015 年 12 月 30 日	重大事项 停牌	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	50,300	2,544,264.25	3,270,003.00	-
600654	中安消	2015 年 12 月 14 日	重大事项 停牌	28.84	-	-	212,153	4,442,448.99	6,118,492.52	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大事项 停牌	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	69,887	2,175,852.86	2,183,968.75	-
600729	重庆百货	2015 年 7 月 24 日	重大事项 停牌	32.39	2016 年 1 月 4 日	29.90	57,946	1,588,992.48	1,876,870.94	-
600759	洲际油气	2015 年 9 月 21 日	重大事项 停牌	7.85	-	-	266,625	2,683,854.53	2,093,006.25	-
600851	海欣股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项 停牌	14.70	2016 年 1 月 19 日	13.23	135,294	1,402,021.24	1,988,821.80	-
600859	王府井	2015 年 12 月 21 日	重大事项 停牌	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	52,700	1,288,410.55	1,434,494.00	-
600864	哈投股份	2015 年 10 月 9 日	重大事项 停牌	10.88	2016 年 1 月 14 日	11.97	77,352	1,021,641.48	841,589.76	-
600880	博瑞传播	2015 年 9 月 16 日	重大事项 停牌	7.50	2016 年 1 月 18 日	8.25	180,300	3,012,879.52	1,352,250.00	-
600978	宜华木业	2015 年 6 月 18 日	重大事项 停牌	22.33	2016 年 1 月 21 日	20.10	280,549	2,817,925.44	6,264,659.17	-
601000	唐山港	2015 年 10 月 29 日	重大事项 停牌	8.25	2016 年 2 月 17 日	7.98	308,872	2,869,676.73	2,548,194.00	-
601678	滨化股份	2015 年 12 月 31 日	重大事项 停牌	8.02	2016 年 1 月 5 日	7.22	129,322	995,948.45	1,037,162.44	-
601717	郑煤机	2015 年 12 月 18 日	重大事项 停牌	7.52	-	-	190,771	1,488,801.22	1,434,597.92	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。

7.4.13.2 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之发行人出现违约、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。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

7.4.13.3 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。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

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独立的风险管理部门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

基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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如下表所示：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,433,885.67	-	-	-	18,433,885.67
结算备付金	6,190,593.02	-	-	-	6,190,593.02
存出保证金	145,215.65	-	-	5,031,320.00	5,176,535.65
交易性金融资产	-	-	-	838,418,099.14	838,418,099.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	509,373.36	509,373.36
应收利息	-	-	-	7,998.90	7,998.90
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,769,694.34	-	-	843,966,791.40	868,736,485.74
负债	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	472,834.00	472,834.00
应付托管费	-	-	-	94,566.80	94,566.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	377,931.39	377,931.39
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	510,112.96	510,112.96
负债总计	-	-	-	1,455,445.15	1,455,445.15
利率敏感度缺口	24,769,694.34	-	-	842,511,346.25	867,281,040.59
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	2,540,818.65	-	-	-	2,540,818.65
结算备付金	4,431.00	-	-	-	4,431.00
存出保证金	3,782.93	-	-	-	3,782.93
交易性金融资产	-	-	-	368,819,410.29	368,819,410.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	57,883.98	57,883.98
应收利息	-	-	-	762.86	762.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,549,032.58	-	-	368,878,057.13	371,427,089.71

负债					
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	161,362.00	161,362.00
应付托管费	-	-	-	32,272.41	32,272.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	80,267.63	80,267.63
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	628,630.64	628,630.64
负债总计	-	-	-	902,532.68	902,532.68
利率敏感度缺口	2,549,032.58	-	-	367,975,524.45	370,524,557.03

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：无），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：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，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。

本基金采取完全复制法，即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，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指

数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31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	838,418,099.14	96.67	368,819,410.29	99.54
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	838,418,099.14	96.67	368,819,410.29	99.54

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	43,201,692.56	18,399,223.73
	业绩比较基准下降5%	-43,201,692.56	-18,399,223.73

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 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

于本报告期末，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 731,824,840.96 元，属于第二层次的余额为 106,593,258.18 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 341,261,822.76 元，第二层次 27,557,587.53 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和债券，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，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和债券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，确定相关股票和债券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 31 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（附注 7.4.5.2），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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(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	838,418,099.14	96.51
	其中：股票	838,418,099.14	96.51
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	24,624,478.69	2.83
7	其他各项资产	5,693,907.91	0.66
	合计	868,736,485.74	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	15,044,762.72	1.73
B	采矿业	24,786,106.25	2.86
C	制造业	497,961,964.89	57.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,420,220.37	2.82
E	建筑业	21,522,821.20	2.48
F	批发和零售业	54,347,982.74	6.27
G	交通运输、仓储和邮政业	24,832,791.99	2.86
H	住宿和餐饮业	1,857,784.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,818,323.25	6.32
J	金融业	8,653,608.39	1.00
K	房地产业	55,757,423.05	6.43

L	租赁和商务服务业	16,824,007.20	1.94
M	科学研究和技术服务业	4,351,483.00	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	6,165,394.88	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,102,194.20	0.24
R	文化、体育和娱乐业	11,267,478.71	1.30
S	综合	13,282,635.50	1.53
	合计	837,996,982.34	96.62

8.2.2 期末积极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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	405,702.80	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,685.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	424,387.80	0.05

8.3 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

8.3.1 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	600978	宜华木业	280,549	6,264,659.17	0.72
2	600654	中安消	212,153	6,118,492.52	0.71
3	000748	长城信息	154,500	5,388,960.00	0.62
4	600584	长电科技	242,104	5,331,130.08	0.61
5	002018	华信国际	116,500	5,135,320.00	0.59
6	600200	江苏吴中	171,302	4,777,612.78	0.55
7	002049	同方国芯	76,700	4,613,505.00	0.53
8	002466	天齐锂业	29,300	4,123,975.00	0.48
9	002405	四维图新	106,186	4,120,016.80	0.48
10	600160	巨化股份	169,036	3,967,274.92	0.46
11	600201	生物股份	106,876	3,951,205.72	0.46
12	600816	安信信托	165,223	3,762,127.71	0.43
13	600079	人福医药	168,100	3,741,906.00	0.43
14	600635	大众公用	368,578	3,634,179.08	0.42
15	002030	达安基因	86,180	3,548,892.40	0.41
16	002004	华邦健康	246,148	3,482,994.20	0.40
17	002439	启明星辰	108,500	3,472,000.00	0.40
18	002400	省广股份	135,200	3,400,280.00	0.39
19	000066	长城电脑	156,735	3,376,071.90	0.39
20	002368	太极股份	49,650	3,331,515.00	0.38
21	600482	风帆股份	70,056	3,296,134.80	0.38
22	600673	东阳光科	322,694	3,288,251.86	0.38
23	600158	中体产业	125,983	3,285,636.64	0.38
24	600122	宏图高科	169,085	3,283,630.70	0.38
25	600503	华丽家族	239,400	3,279,780.00	0.38
26	600645	中源协和	50,300	3,270,003.00	0.38
27	600219	南山铝业	484,400	3,187,352.00	0.37
28	600410	华胜天成	119,841	3,176,984.91	0.37
29	300088	长信科技	226,300	3,174,989.00	0.37

30	002276	万马股份	105,211	3,166,851.10	0.37
31	000566	海南海药	81,360	3,161,649.60	0.36
32	600643	爱建集团	214,716	3,145,589.40	0.36
33	600522	中天科技	136,521	3,126,330.90	0.36
34	002701	奥瑞金	109,967	3,107,667.42	0.36
35	000997	新大陆	122,680	3,106,257.60	0.36
36	000998	隆平高科	130,165	3,091,418.75	0.36
37	600525	长园集团	162,930	3,067,971.90	0.35
38	002219	恒康医疗	204,618	3,048,808.20	0.35
39	600655	豫园商城	187,900	3,036,464.00	0.35
40	000718	苏宁环球	226,590	2,988,722.10	0.34
41	300253	卫宁软件	71,350	2,988,138.00	0.34
42	000887	中鼎股份	124,941	2,948,607.60	0.34
43	002340	格林美	188,983	2,872,541.60	0.33
44	002143	印纪传媒	70,400	2,854,720.00	0.33
45	600694	大商股份	54,738	2,826,122.94	0.33
46	600074	保千里	169,200	2,786,724.00	0.32
47	600498	烽火通信	97,525	2,780,437.75	0.32
48	600879	航天电子	155,242	2,774,174.54	0.32
49	600388	龙净环保	159,700	2,759,616.00	0.32
50	000829	天音控股	221,462	2,706,265.64	0.31
51	000078	海王生物	112,401	2,693,127.96	0.31
52	601012	隆基股份	196,953	2,688,408.45	0.31
53	002308	威创股份	108,940	2,685,371.00	0.31
54	002573	清新环境	119,400	2,679,336.00	0.31
55	000930	中粮生化	180,027	2,660,799.06	0.31
56	600770	综艺股份	145,621	2,660,495.67	0.31
57	600478	科力远	121,239	2,657,558.88	0.31
58	002191	劲嘉股份	171,952	2,641,182.72	0.30
59	601168	西部矿业	356,100	2,631,579.00	0.30
60	000012	南玻A	196,200	2,619,270.00	0.30
61	600376	首开股份	209,400	2,617,500.00	0.30
62	600487	亨通光电	162,260	2,586,424.40	0.30
63	600436	片仔癀	37,500	2,579,625.00	0.30
64	002085	万丰奥威	80,100	2,577,618.00	0.30
65	600664	哈药股份	214,800	2,562,564.00	0.30
66	601000	唐山港	308,872	2,548,194.00	0.29
67	000547	航天发展	133,500	2,543,175.00	0.29
68	300182	捷成股份	105,700	2,536,800.00	0.29

69	000511	烯碳新材	216,590	2,536,268.90	0.29
70	600601	方正科技	409,914	2,533,268.52	0.29
71	600138	中青旅	108,040	2,518,412.40	0.29
72	601929	吉视传媒	406,700	2,513,406.00	0.29
73	600594	益佰制药	118,300	2,507,960.00	0.29
74	600500	中化国际	194,500	2,491,545.00	0.29
75	600312	平高电气	127,406	2,484,417.00	0.29
76	300257	开山股份	80,000	2,468,000.00	0.28
77	000988	华工科技	116,524	2,467,978.32	0.28
78	600143	金发科技	286,900	2,467,340.00	0.28
79	300072	三聚环保	72,600	2,466,222.00	0.28
80	002161	远望谷	110,567	2,465,644.10	0.28
81	600881	亚泰集团	339,859	2,460,579.16	0.28
82	000656	金科股份	463,360	2,446,540.80	0.28
83	600198	大唐电信	98,812	2,437,692.04	0.28
84	600516	方大炭素	192,600	2,409,426.00	0.28
85	600240	华业资本	159,581	2,401,694.05	0.28
86	600026	中海发展	259,596	2,398,667.04	0.28
87	600418	江淮汽车	163,986	2,392,555.74	0.28
88	600611	大众交通	155,659	2,389,365.65	0.28
89	002048	宁波华翔	137,303	2,389,072.20	0.28
90	600499	科达洁能	105,400	2,385,202.00	0.28
91	000031	中粮地产	169,335	2,379,156.75	0.27
92	000028	国药一致	35,942	2,377,563.30	0.27
93	002657	中科金财	29,600	2,367,704.00	0.27
94	300291	华录百纳	66,172	2,355,723.20	0.27
95	002444	巨星科技	113,610	2,351,727.00	0.27
96	000661	长春高新	19,452	2,342,993.40	0.27
97	000697	炼石有色	83,535	2,323,943.70	0.27
98	002273	水晶光电	57,000	2,314,200.00	0.27
99	600521	华海药业	88,875	2,256,536.25	0.26
100	600017	日照港	344,610	2,253,749.40	0.26
101	000050	深天马A	105,600	2,239,776.00	0.26
102	000970	中科三环	159,200	2,233,576.00	0.26
103	002022	科华生物	76,487	2,225,771.70	0.26
104	000690	宝新能源	225,661	2,206,964.58	0.25
105	600797	浙大网新	153,430	2,206,323.40	0.25
106	002489	浙江永强	203,139	2,202,026.76	0.25
107	000671	阳光城	243,490	2,198,714.70	0.25

108	300085	银之杰	39,200	2,191,280.00	0.25
109	600699	均胜电子	69,887	2,183,968.75	0.25
110	600967	北方创业	122,936	2,182,114.00	0.25
111	600704	物产中大	123,732	2,180,157.84	0.25
112	300122	智飞生物	59,700	2,171,886.00	0.25
113	300147	香雪制药	86,450	2,162,114.50	0.25
114	600811	东方集团	248,971	2,161,068.28	0.25
115	002568	百润股份	50,600	2,160,114.00	0.25
116	000592	平潭发展	108,100	2,159,838.00	0.25
117	600094	大名城	203,100	2,156,922.00	0.25
118	000541	佛山照明	127,943	2,136,648.10	0.25
119	600108	亚盛集团	290,900	2,135,206.00	0.25
120	600325	华发股份	130,943	2,134,370.90	0.25
121	002179	中航光电	56,180	2,132,592.80	0.25
122	600171	上海贝岭	100,575	2,131,184.25	0.25
123	002271	东方雨虹	108,392	2,116,895.76	0.24
124	002266	浙富控股	258,657	2,105,467.98	0.24
125	600884	杉杉股份	53,622	2,104,127.28	0.24
126	300244	迪安诊断	30,230	2,102,194.20	0.24
127	000616	海航投资	267,070	2,099,170.20	0.24
128	002223	鱼跃医疗	54,486	2,094,986.70	0.24
129	600759	洲际油气	266,625	2,093,006.25	0.24
130	300055	万邦达	96,100	2,086,331.00	0.24
131	002665	首航节能	68,150	2,078,575.00	0.24
132	600176	中国巨石	81,431	2,069,161.71	0.24
133	002073	软控股份	122,260	2,066,194.00	0.24
134	600497	驰宏锌锗	186,900	2,063,376.00	0.24
135	600787	中储股份	205,470	2,062,918.80	0.24
136	002250	联化科技	109,185	2,060,320.95	0.24
137	600422	昆药集团	51,528	2,051,844.96	0.24
138	002325	洪涛股份	130,889	2,045,795.07	0.24
139	300199	翰宇药业	83,000	2,044,290.00	0.24
140	600380	健康元	147,851	2,043,300.82	0.24
141	002508	老板电器	45,388	2,040,190.60	0.24
142	002595	豪迈科技	89,634	2,033,795.46	0.23
143	600511	国药股份	53,609	2,032,853.28	0.23
144	000006	深振业A	176,457	2,031,020.07	0.23
145	600755	厦门国贸	217,553	2,027,593.96	0.23
146	000939	凯迪生态	140,744	2,026,713.60	0.23

147	300274	阳光电源	73,700	2,020,854.00	0.23
148	600151	航天机电	163,473	2,020,526.28	0.23
149	002390	信邦制药	140,150	2,011,152.50	0.23
150	600435	北方导航	69,555	1,996,228.50	0.23
151	600536	中国软件	55,318	1,995,873.44	0.23
152	600851	海欣股份	135,294	1,988,821.80	0.23
153	000681	视觉中国	52,300	1,987,923.00	0.23
154	002013	中航机电	86,914	1,969,471.24	0.23
155	600528	中铁二局	136,853	1,961,103.49	0.23
156	300267	尔康制药	57,500	1,932,000.00	0.22
157	600587	新华医疗	53,038	1,926,870.54	0.22
158	000973	佛塑科技	147,961	1,923,493.00	0.22
159	600064	南京高科	101,140	1,916,603.00	0.22
160	600651	飞乐音响	129,486	1,909,918.50	0.22
161	000667	美好集团	382,438	1,896,892.48	0.22
162	002373	千方科技	41,200	1,884,900.00	0.22
163	002063	远光软件	89,110	1,883,785.40	0.22
164	300043	互动娱乐	118,900	1,878,620.00	0.22
165	600729	重庆百货	57,946	1,876,870.94	0.22
166	600316	洪都航空	80,300	1,874,202.00	0.22
167	000762	西藏矿业	71,039	1,868,325.70	0.22
168	600754	锦江股份	36,200	1,857,784.00	0.21
169	603766	隆鑫通用	78,100	1,853,313.00	0.21
170	600320	振华重工	310,213	1,851,971.61	0.21
171	002498	汉缆股份	248,500	1,848,840.00	0.21
172	300273	和佳股份	88,320	1,845,888.00	0.21
173	002005	德豪润达	181,655	1,841,981.70	0.21
174	002642	荣之联	31,700	1,835,113.00	0.21
175	600270	外运发展	67,644	1,830,446.64	0.21
176	600597	光明乳业	114,900	1,829,208.00	0.21
177	600835	上海机电	60,275	1,826,935.25	0.21
178	002299	圣农发展	82,900	1,822,971.00	0.21
179	600169	太原重工	316,824	1,818,569.76	0.21
180	600058	五矿发展	80,000	1,816,000.00	0.21
181	002217	合力泰	106,200	1,800,090.00	0.21
182	600426	华鲁恒升	124,637	1,798,511.91	0.21
183	000777	中核科技	57,233	1,796,543.87	0.21
184	000926	福星股份	106,398	1,791,742.32	0.21
185	001696	宗申动力	128,271	1,772,705.22	0.20

186	002001	新 和 成	101,600	1,771,904.00	0.20
187	000816	智慧农业	211,964	1,767,779.76	0.20
188	600517	置信电气	139,382	1,764,576.12	0.20
189	600808	马钢股份	557,300	1,755,495.00	0.20
190	002285	世联行	107,928	1,751,671.44	0.20
191	000563	陕国投A	115,469	1,745,891.28	0.20
192	002050	三花股份	163,896	1,745,492.40	0.20
193	300115	长盈精密	51,800	1,738,926.00	0.20
194	601311	骆驼股份	79,419	1,733,716.77	0.20
195	002428	云南锗业	85,435	1,732,621.80	0.20
196	600039	四川路桥	338,384	1,725,758.40	0.20
197	600267	海正药业	108,100	1,713,385.00	0.20
198	600765	中航重机	87,207	1,712,745.48	0.20
199	000650	仁和药业	161,929	1,711,589.53	0.20
200	000732	泰禾集团	69,718	1,708,091.00	0.20
201	002168	深圳惠程	144,325	1,707,364.75	0.20
202	002714	牧原股份	36,200	1,703,934.00	0.20
203	000543	皖能电力	200,547	1,698,633.09	0.20
204	600067	冠城大通	193,872	1,694,441.28	0.20
205	600187	国中水务	271,854	1,688,213.34	0.19
206	000587	金叶珠宝	79,241	1,683,871.25	0.19
207	600557	康缘药业	67,169	1,680,568.38	0.19
208	600161	天坛生物	48,060	1,678,735.80	0.19
209	600086	东方金钰	135,760	1,671,205.60	0.19
210	600289	亿阳信通	84,502	1,664,689.40	0.19
211	600572	康恩贝	124,199	1,659,298.64	0.19
212	000021	深科技	137,356	1,656,513.36	0.19
213	002437	誉衡药业	54,703	1,654,765.75	0.19
214	600175	美都能源	228,815	1,654,332.45	0.19
215	300202	聚龙股份	51,300	1,651,347.00	0.19
216	002477	雏鹰农牧	97,587	1,650,196.17	0.19
217	002431	棕榈园林	61,300	1,645,292.00	0.19
218	000758	中色股份	110,300	1,641,264.00	0.19
219	000519	江南红箭	96,640	1,640,947.20	0.19
220	002440	闰土股份	85,977	1,637,861.85	0.19
221	600433	冠豪高新	142,400	1,631,904.00	0.19
222	600872	中炬高新	104,116	1,629,415.40	0.19
223	000861	海印股份	210,070	1,623,841.10	0.19
224	600428	中远航运	157,852	1,619,561.52	0.19

225	600805	悦达投资	127,034	1,608,250.44	0.19
226	002244	滨江集团	201,970	1,607,681.20	0.19
227	600351	亚宝药业	102,817	1,606,001.54	0.19
228	002311	海大集团	114,884	1,604,929.48	0.19
229	600894	广日股份	80,249	1,604,177.51	0.18
230	002344	海宁皮城	104,500	1,603,030.00	0.18
231	002092	中泰化学	181,772	1,599,593.60	0.18
232	600580	卧龙电气	103,619	1,597,804.98	0.18
233	000860	顺鑫农业	74,547	1,587,851.10	0.18
234	002269	美邦服饰	235,900	1,582,889.00	0.18
235	300026	红日药业	75,000	1,582,500.00	0.18
236	600056	中国医药	94,519	1,571,850.97	0.18
237	600125	铁龙物流	170,590	1,567,722.10	0.18
238	002011	盾安环境	93,707	1,566,781.04	0.18
239	600970	中材国际	131,018	1,565,665.10	0.18
240	000685	中山公用	110,159	1,558,749.85	0.18
241	600062	华润双鹤	67,619	1,542,389.39	0.18
242	600220	江苏阳光	266,450	1,529,423.00	0.18
243	600366	宁波韵升	69,867	1,525,895.28	0.18
244	002603	以岭药业	84,100	1,524,733.00	0.18
245	603019	中科曙光	16,700	1,522,539.00	0.18
246	002681	奋达科技	34,640	1,513,768.00	0.17
247	600216	浙江医药	122,300	1,512,851.00	0.17
248	002672	东江环保	75,000	1,512,750.00	0.17
249	002221	东华能源	64,636	1,511,189.68	0.17
250	600292	中电远达	72,866	1,506,868.88	0.17
251	601880	大连港	251,208	1,497,199.68	0.17
252	600736	苏州高新	135,288	1,488,168.00	0.17
253	000062	深圳华强	40,630	1,487,058.00	0.17
254	000488	晨鸣纸业	166,275	1,483,173.00	0.17
255	600885	宏发股份	49,600	1,482,544.00	0.17
256	002180	艾派克	31,900	1,472,185.00	0.17
257	300134	大富科技	48,760	1,467,676.00	0.17
258	002051	中工国际	57,700	1,461,541.00	0.17
259	002396	星网锐捷	60,450	1,459,867.50	0.17
260	600348	阳泉煤业	224,500	1,450,270.00	0.17
261	000426	兴业矿业	204,840	1,446,170.40	0.17
262	603188	亚邦股份	64,500	1,443,510.00	0.17
263	600416	湘电股份	69,383	1,438,309.59	0.17

264	600628	新世界	79,386	1,436,092.74	0.17
265	601717	郑煤机	190,771	1,434,597.92	0.17
266	600859	王府井	52,700	1,434,494.00	0.17
267	000600	建投能源	133,900	1,427,374.00	0.16
268	600120	浙江东方	71,807	1,426,087.02	0.16
269	002064	华峰氨纶	219,170	1,422,413.30	0.16
270	000680	山推股份	185,403	1,418,332.95	0.16
271	002588	史丹利	43,540	1,416,356.20	0.16
272	600284	浦东建设	103,450	1,416,230.50	0.16
273	002463	沪电股份	218,855	1,413,803.30	0.16
274	002190	成飞集成	32,200	1,409,072.00	0.16
275	000848	承德露露	84,261	1,390,306.50	0.16
276	000979	中弘股份	344,352	1,377,408.00	0.16
277	000897	津滨发展	241,563	1,376,909.10	0.16
278	000572	海马汽车	215,011	1,376,070.40	0.16
279	002181	粤传媒	86,778	1,375,431.30	0.16
280	000652	泰达股份	192,864	1,375,120.32	0.16
281	002505	大康牧业	161,800	1,373,682.00	0.16
282	002309	中利科技	72,972	1,370,414.16	0.16
283	600481	双良节能	151,240	1,370,234.40	0.16
284	002414	高德红外	44,778	1,364,385.66	0.16
285	002384	东山精密	68,117	1,363,702.34	0.16
286	002482	广田股份	46,593	1,362,845.25	0.16
287	000090	天健集团	79,857	1,359,166.14	0.16
288	600880	博瑞传播	180,300	1,352,250.00	0.16
289	600826	兰生股份	39,199	1,350,013.56	0.16
290	000961	中南建设	87,240	1,348,730.40	0.16
291	002551	尚荣医疗	40,684	1,341,351.48	0.15
292	000513	丽珠集团	23,317	1,339,095.31	0.15
293	600409	三友化工	172,756	1,338,859.00	0.15
294	002345	潮宏基	78,857	1,331,106.16	0.15
295	600183	生益科技	134,285	1,328,078.65	0.15
296	000830	鲁西化工	191,483	1,326,977.19	0.15
297	002174	游族网络	14,800	1,325,044.00	0.15
298	002653	海思科	60,500	1,324,345.00	0.15
299	600006	东风汽车	149,332	1,323,081.52	0.15
300	600458	时代新材	74,112	1,311,782.40	0.15
301	600812	华北制药	152,259	1,310,949.99	0.15
302	000049	德赛电池	23,002	1,306,053.56	0.15

303	600260	凯乐科技	87,169	1,302,304.86	0.15
304	600614	鼎立股份	111,402	1,295,605.26	0.15
305	300039	上海凯宝	93,370	1,294,108.20	0.15
306	002028	思源电气	81,171	1,289,807.19	0.15
307	002242	九阳股份	56,817	1,288,609.56	0.15
308	000786	北新建材	107,796	1,282,772.40	0.15
309	000931	中关村	100,759	1,279,639.30	0.15
310	600112	天成控股	76,014	1,273,994.64	0.15
311	002254	泰和新材	79,748	1,267,195.72	0.15
312	000975	银泰资源	100,924	1,263,568.48	0.15
313	600180	瑞茂通	56,950	1,257,456.00	0.14
314	000969	安泰科技	96,635	1,254,322.30	0.14
315	601010	文峰股份	172,518	1,254,205.86	0.14
316	603369	今世缘	37,400	1,254,022.00	0.14
317	000088	盐田港	145,025	1,250,115.50	0.14
318	002025	航天电器	48,076	1,249,495.24	0.14
319	603077	和邦生物	185,531	1,248,623.63	0.14
320	600757	长江传媒	113,316	1,244,209.68	0.14
321	600993	马应龙	56,307	1,239,880.14	0.14
322	600850	华东电脑	24,000	1,239,600.00	0.14
323	600073	上海梅林	87,529	1,238,535.35	0.14
324	600460	士兰微	139,729	1,236,601.65	0.14
325	002106	莱宝高科	92,260	1,230,748.40	0.14
326	600004	白云机场	85,917	1,222,598.91	0.14
327	601777	力帆股份	70,376	1,220,319.84	0.14
328	000528	柳工	147,071	1,219,218.59	0.14
329	600566	济川药业	43,800	1,211,508.00	0.14
330	600823	世茂股份	98,700	1,207,101.00	0.14
331	000636	风华高科	105,461	1,203,310.01	0.14
332	002093	国脉科技	80,700	1,200,816.00	0.14
333	000612	焦作万方	157,364	1,200,687.32	0.14
334	601005	重庆钢铁	364,000	1,197,560.00	0.14
335	600280	中央商场	107,134	1,196,686.78	0.14
336	002479	富春环保	89,183	1,195,052.20	0.14
337	600496	精工钢构	197,459	1,186,728.59	0.14
338	600750	江中药业	33,603	1,185,849.87	0.14
339	002251	步步高	72,699	1,184,993.70	0.14
340	000099	中信海直	79,208	1,170,694.24	0.13
341	600282	南钢股份	369,000	1,169,730.00	0.13

342	600586	金晶科技	190,685	1,165,085.35	0.13
343	600825	新华传媒	97,570	1,164,985.80	0.13
344	600831	广电网络	73,646	1,164,343.26	0.13
345	000869	张裕A	25,400	1,162,812.00	0.13
346	002029	七匹狼	84,797	1,159,174.99	0.13
347	000550	江铃汽车	38,635	1,158,277.30	0.13
348	002155	湖南黄金	126,725	1,139,257.75	0.13
349	000726	鲁泰A	83,819	1,133,232.88	0.13
350	600337	美克家居	72,387	1,130,684.94	0.13
351	000603	盛达矿业	62,349	1,125,399.45	0.13
352	600298	安琪酵母	36,817	1,119,973.14	0.13
353	600300	维维股份	156,100	1,119,237.00	0.13
354	600545	新疆城建	100,883	1,116,774.81	0.13
355	000417	合肥百货	101,876	1,113,504.68	0.13
356	600790	轻纺城	136,880	1,112,834.40	0.13
357	601801	皖新传媒	34,018	1,111,708.24	0.13
358	002727	一心堂	19,200	1,110,336.00	0.13
359	002698	博实股份	37,840	1,109,847.20	0.13
360	000900	现代投资	132,209	1,109,233.51	0.13
361	002041	登海种业	65,728	1,107,516.80	0.13
362	000401	冀东水泥	100,600	1,096,540.00	0.13
363	002358	森源电气	59,346	1,094,933.70	0.13
364	002317	众生药业	82,660	1,094,418.40	0.13
365	002342	巨力索具	143,422	1,091,441.42	0.13
366	601886	江河创建	86,217	1,087,196.37	0.13
367	600748	上实发展	80,859	1,085,127.78	0.13
368	000631	顺发恒业	109,357	1,084,821.44	0.13
369	600392	盛和资源	87,900	1,082,049.00	0.12
370	002056	横店东磁	38,300	1,076,613.00	0.12
371	600761	安徽合力	80,563	1,075,516.05	0.12
372	000620	新华联	106,187	1,073,550.57	0.12
373	601369	陕鼓动力	122,336	1,069,216.64	0.12
374	002078	太阳纸业	189,507	1,066,924.41	0.12
375	600639	浦东金桥	47,552	1,064,689.28	0.12
376	000933	神火股份	212,909	1,060,286.82	0.12
377	600869	智慧能源	110,976	1,059,820.80	0.12
378	000501	鄂武商A	49,399	1,057,138.60	0.12
379	603883	老百姓	14,800	1,050,356.00	0.12
380	600563	法拉电子	25,170	1,047,323.70	0.12

381	601678	滨化股份	129,322	1,037,162.44	0.12
382	002332	仙琚制药	68,454	1,037,078.10	0.12
383	600596	新安股份	101,418	1,034,463.60	0.12
384	601515	东风股份	62,259	1,032,254.22	0.12
385	002203	海亮股份	93,583	1,029,413.00	0.12
386	601666	平煤股份	220,400	1,027,064.00	0.12
387	002277	友阿股份	73,917	1,026,707.13	0.12
388	600720	祁连山	116,003	1,024,306.49	0.12
389	601002	晋亿实业	88,793	1,023,783.29	0.12
390	002237	恒邦股份	101,992	1,017,880.16	0.12
391	002354	天神娱乐	10,600	1,017,388.00	0.12
392	600236	桂冠电力	135,900	1,016,532.00	0.12
393	600395	盘江股份	123,600	1,014,756.00	0.12
394	000669	金鸿能源	45,367	1,013,045.11	0.12
395	002663	普邦园林	127,292	1,010,698.48	0.12
396	601126	四方股份	75,926	1,008,297.28	0.12
397	002281	光迅科技	15,541	1,007,523.03	0.12
398	600575	皖江物流	161,600	1,000,304.00	0.12
399	600059	古越龙山	90,634	996,067.66	0.11
400	600509	天富能源	101,426	994,989.06	0.11
401	600251	冠农股份	87,944	993,767.20	0.11
402	000418	小天鹅A	41,249	989,976.00	0.11
403	600773	西藏城投	54,384	989,788.80	0.11
404	600657	信达地产	142,354	989,360.30	0.11
405	600259	广晟有色	24,911	986,475.60	0.11
406	002233	塔牌集团	66,851	979,367.15	0.11
407	600022	山东钢铁	314,500	978,095.00	0.11
408	000919	金陵药业	56,358	969,357.60	0.11
409	002327	富安娜	80,100	963,603.00	0.11
410	000030	富奥股份	94,049	959,299.80	0.11
411	002293	罗莱生活	52,370	955,228.80	0.11
412	601233	桐昆股份	71,908	945,590.20	0.11
413	000693	华泽钴镍	50,700	944,541.00	0.11
414	600809	山西汾酒	48,500	934,595.00	0.11
415	002118	紫鑫药业	47,900	934,529.00	0.11
416	002122	天马股份	110,982	924,480.06	0.11
417	000877	天山股份	115,074	924,044.22	0.11
418	600743	华远地产	135,780	920,588.40	0.11
419	002503	搜于特	58,020	919,036.80	0.11

420	601908	京运通	111,690	918,091.80	0.11
421	603699	纽威股份	42,000	916,440.00	0.11
422	600184	光电股份	31,250	903,437.50	0.10
423	600425	青松建化	154,445	901,958.80	0.10
424	600329	中新药业	42,464	899,387.52	0.10
425	600803	新奥股份	55,117	874,155.62	0.10
426	002392	北京利尔	111,900	870,582.00	0.10
427	601001	大同煤业	156,228	867,065.40	0.10
428	600141	兴发集团	59,300	866,966.00	0.10
429	600195	中牧股份	40,398	863,709.24	0.10
430	600551	时代出版	37,717	858,061.75	0.10
431	600874	创业环保	81,142	856,048.10	0.10
432	600640	号百控股	40,000	848,400.00	0.10
433	603005	晶方科技	16,800	845,040.00	0.10
434	600864	哈投股份	77,352	841,589.76	0.10
435	002315	焦点科技	8,732	838,359.32	0.10
436	600617	国新能源	54,600	837,018.00	0.10
437	600537	亿晶光电	54,870	821,952.60	0.09
438	600546	山煤国际	185,100	819,993.00	0.09
439	002371	七星电子	42,500	819,400.00	0.09
440	600776	东方通信	71,334	816,060.96	0.09
441	600456	宝钛股份	40,170	815,451.00	0.09
442	603567	珍宝岛	15,700	813,260.00	0.09
443	000703	恒逸石化	73,100	812,141.00	0.09
444	603555	贵人鸟	22,900	811,347.00	0.09
445	603328	依顿电子	27,400	808,574.00	0.09
446	600483	福能股份	47,000	807,930.00	0.09
447	002635	安洁科技	28,996	806,088.80	0.09
448	002408	齐翔腾达	60,254	801,980.74	0.09
449	002267	陕天然气	62,350	785,610.00	0.09
450	000596	古井贡酒	21,500	784,750.00	0.09
451	600429	三元股份	107,400	782,946.00	0.09
452	002646	青青稞酒	33,617	767,139.94	0.09
453	600397	安源煤业	129,355	755,433.20	0.09
454	603001	奥康国际	22,445	754,600.90	0.09
455	600088	中视传媒	24,704	743,837.44	0.09
456	601139	深圳燃气	81,300	739,830.00	0.09
457	600132	重庆啤酒	45,200	722,748.00	0.08
458	002204	大连重工	72,073	720,730.00	0.08

459	600510	黑牡丹	59,315	713,559.45	0.08
460	002140	东华科技	33,269	708,629.70	0.08
461	002493	荣盛石化	45,700	708,350.00	0.08
462	002194	武汉凡谷	41,494	705,398.00	0.08
463	601101	昊华能源	89,600	704,256.00	0.08
464	002216	三全食品	59,888	682,124.32	0.08
465	600618	氯碱化工	41,946	677,008.44	0.08
466	601965	中国汽研	71,726	673,507.14	0.08
467	002678	珠江钢琴	38,917	669,761.57	0.08
468	600335	国机汽车	35,100	657,774.00	0.08
469	603169	兰石重装	35,300	644,225.00	0.07
470	000921	海信科龙	67,400	642,322.00	0.07
471	000525	红太阳	37,811	640,518.34	0.07
472	002238	天威视讯	28,806	639,493.20	0.07
473	600997	开滦股份	114,254	637,537.32	0.07
474	603366	日出东方	59,660	632,396.00	0.07
475	600780	通宝能源	85,640	607,187.60	0.07
476	002419	天虹商场	44,781	604,543.50	0.07
477	600507	方大特钢	99,000	603,900.00	0.07
478	600468	百利电气	34,051	603,383.72	0.07
479	600971	恒源煤电	93,353	587,190.37	0.07
480	002461	珠江啤酒	38,018	580,534.86	0.07
481	000951	中国重汽	31,332	567,109.20	0.07
482	603806	福斯特	11,200	559,888.00	0.06
483	600751	天海投资	57,600	554,112.00	0.06
484	000852	石化机械	25,781	550,682.16	0.06
485	601226	华电重工	43,100	545,215.00	0.06
486	603698	航天工程	15,300	536,265.00	0.06
487	002430	杭氧股份	46,580	535,670.00	0.06
488	002128	露天煤业	61,036	515,754.20	0.06
489	002249	大洋电机	38,484	510,297.84	0.06
490	603899	晨光文具	11,900	500,514.00	0.06
491	600917	重庆燃气	31,900	484,561.00	0.06
492	002648	卫星石化	44,762	483,877.22	0.06
493	603589	口子窖	11,100	476,634.00	0.05
494	603568	伟明环保	9,200	466,440.00	0.05
495	000719	大地传媒	21,999	448,779.60	0.05
496	000552	靖远煤电	42,700	430,416.00	0.05
497	603355	莱克电气	8,200	382,940.00	0.04

498	603025	大豪科技	9,100	372,281.00	0.04
499	002745	木林森	9,000	368,370.00	0.04
500	000582	北部湾港	15,900	357,909.00	0.04
501	600801	华新水泥	36,156	294,671.40	0.03

8.3.2 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

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	000982	中银绒业	86,520	401,452.80	0.05
2	002781	奇信股份	500	18,685.00	0.00
3	002778	高科石化	500	4,250.00	0.00

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	10,043,212.90	2.71
2	300059	东方财富	8,837,482.60	2.39
3	000592	平潭发展	7,824,663.00	2.11
4	600594	益佰制药	7,598,457.00	2.05
5	600143	金发科技	7,009,000.92	1.89
6	600655	豫园商城	6,926,585.45	1.87
7	600500	中化国际	6,905,304.62	1.86
8	600079	人福医药	6,541,933.72	1.77
9	300033	同花顺	6,538,684.34	1.76
10	000547	航天发展	6,429,488.00	1.74
11	300291	华录百纳	6,157,562.28	1.66
12	002400	省广股份	5,976,857.86	1.61
13	002439	启明星辰	5,797,923.23	1.56
14	600664	哈药股份	5,599,402.80	1.51
15	300244	迪安诊断	5,470,985.20	1.48
16	600498	烽火通信	5,283,812.47	1.43
17	300267	尔康制药	5,140,532.52	1.39

18	002049	同方国芯	5,135,201.45	1.39
19	300199	翰宇药业	5,011,249.21	1.35
20	600808	马钢股份	5,009,891.58	1.35

8.4.2 累计卖出金额前 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	22,491,086.54	6.07
2	300168	万达信息	12,137,265.95	3.28
3	601099	太平洋	9,873,500.62	2.66
4	600895	张江高科	8,782,067.12	2.37
5	002183	怡亚通	8,515,947.29	2.30
6	601718	际华集团	8,079,181.70	2.18
7	600820	隧道股份	7,784,044.16	2.10
8	000540	中天城投	7,390,648.58	1.99
9	600446	金证股份	7,166,727.36	1.93
10	300144	宋城演艺	6,720,953.32	1.81
11	600037	歌华有线	6,701,058.58	1.81
12	300033	同花顺	6,543,936.47	1.77
13	600737	中粮屯河	6,496,939.69	1.75
14	002424	贵州百灵	5,651,414.10	1.53
15	601519	大智慧	5,329,782.25	1.44
16	600021	上海电力	5,203,342.99	1.40
17	000977	浪潮信息	5,077,238.05	1.37
18	601872	招商轮船	5,028,011.27	1.36
19	000712	锦龙股份	4,951,124.96	1.34
20	000415	渤海租赁	4,611,754.46	1.24

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	791,248,144.90
卖出股票收入（成交）总额	691,724,890.76

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

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(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1601	中证 500 股指期货 IC1601 合约	17	25,156,600.00	1,704,200.00	-
公允价值变动总额合计(元)					1,704,200.00
股指期货投资本期收益(元)					-3,633,000.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,704,200.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。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，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	5,176,535.65
2	应收证券清算款	509,373.36
3	应收股利	-
4	应收利息	7,998.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	5,693,907.91

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金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

8.12.5.1 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	600978	宜华木业	6,264,659.17	0.72	重大事项停牌
2	600654	中安消	6,118,492.52	0.71	重大事项停牌
3	000748	长城信息	5,388,960.00	0.62	重大事项停牌
4	600584	长电科技	5,331,130.08	0.61	重大事项停牌
5	002018	华信国际	5,135,320.00	0.59	重大事项停牌
6	600200	江苏吴中	4,777,612.78	0.55	重大事项停牌
7	002049	同方国芯	4,613,505.00	0.53	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000982	中银绒业	401,452.80	0.05	重大事项停牌
2	002778	高科石化	4,250.00	0.00	新股未上市

§ 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

9.1.1 本基金的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
2,092	55,703.57	99,206,535.00	85.13%	17,325,333.00	14.87%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例
嘉实中证 500ETF 联接	50,497,880.00	43.33%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中国证券金融股份有限公司	40,950,000.00	35.14%
2	海通国际控股有限公司—客户资金 (交易所)	2,419,995.00	2.08%
3	天津珍熙美容实业有限公司	1,943,905.00	1.67%
4	百年人寿保险股份有限公司—传统 保险产品	1,500,000.00	1.29%
5	张鹤林	1,058,200.00	0.91%
6	朱婕	920,600.00	0.79%
7	中国银河证券股份有限公司	735,539.00	0.63%
8	聂凤霞	578,000.00	0.50%
9	杨碧茹	409,124.00	0.35%
10	开封市汴和耐火材料有限公司	400,000.00	0.34%

11	中国建设银行股份有限公司—嘉实 中证 500 交易型开放式指数证券投 资基金联接基金	50,497,880.00	43.33%
----	--	---------------	--------

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%

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（2013 年 2 月 6 日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	69,731,868.00
本报告期基金总申购份额	247,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	200,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	116,531,868.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 90,000.00 元，该审计机构已连续 3 年提供审计服务。

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

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	

申万宏源证券 有限公司	2	1,000,009,766.22	67.45%	700,016.82	67.45%	-
招商证券股份 有限公司	1	244,316,444.79	16.48%	171,029.34	16.48%	-
华泰证券股份 有限公司	1	231,396,756.00	15.61%	161,977.47	15.61%	-
中信证券股份 有限公司	1	4,742,174.20	0.32%	3,319.57	0.32%	-
中信建投证券 股份有限公司	2	2,216,138.45	0.15%	1,551.30	0.15%	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。”

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

11.8 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	嘉实基金管理有限公司关于增加华	中国证券报、上海证	2015 年 3 月 12 日

	泰证券股份有限公司为嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 申购赎回代理券商的公告	券报、证券时报、管理人网站	
2	嘉实基金管理有限公司关于增加长城证券有限责任公司为嘉实中证 500ETF 申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 14 日
3	嘉实基金管理有限公司关于增加齐鲁证券等公司为嘉实中证 500ETF、嘉实 300ETF 基金申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 30 日
4	关于增加宏信证券为嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 23 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

- (1) 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司
- (2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

12.3 查阅方式

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

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016 年 3 月 29 日