

# 易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基 金

## 2016 年半年度报告

### 2016 年 6 月 30 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：二〇一六年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经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 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 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.....	47
7.8 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.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12	投资组合报告附注 .....	48
8	基金份额持有人信息 .....	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	49
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	50
9	开放式基金份额变动 .....	50
10	重大事件揭示 .....	50
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	50
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4	基金投资策略的改变 .....	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8	其他重大事件 .....	52
11	备查文件目录 .....	53
11.1	备查文件目录 .....	53
11.2	存放地点 .....	53
11.3	查阅方式 .....	53

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
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	1,096,515.00 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	姓名	张南	洪渊
	联系电话	020-85102688	010-66105799

负责人	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
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-912,461.91
本期利润	-2,433,839.25
加权平均基金份额本期利润	-1.7617
本期加权平均净值利润率	-27.75%
本期基金份额净值增长率	-18.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)

期末可供分配利润	-98,434.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0898
期末基金资产净值	7,017,625.37
期末基金份额净值	6.3999
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-1.38%

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.期末可供分配利润，为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。

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

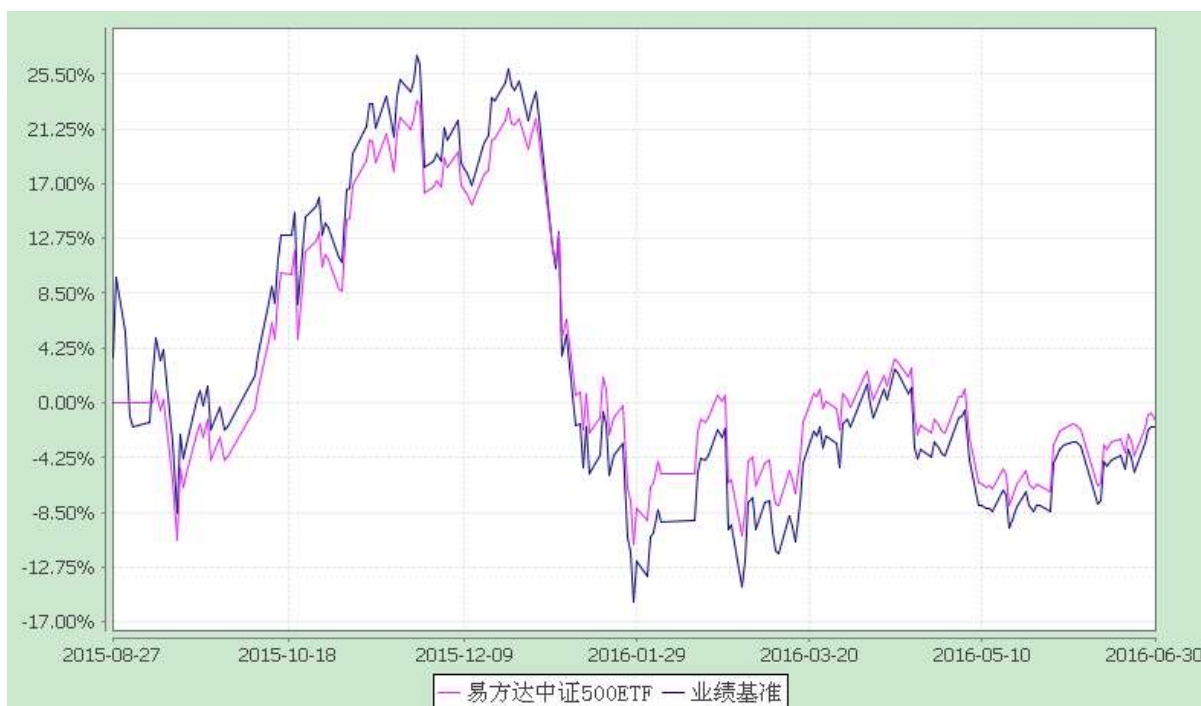
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.94%	1.46%	2.96%	1.55%	-1.02%	-0.09%
过去三个月	-1.65%	1.52%	-0.53%	1.65%	-1.12%	-0.13%
过去六个月	-18.14%	2.20%	-19.61%	2.56%	1.47%	-0.36%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.38%	2.17%	-1.84%	2.56%	0.46%	-0.39%

### 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 2016 年 6 月 30 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-1.38%，同期业绩比较基准收益率为-1.84%。

## 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 2016 年 6 月 30 日，易方达旗下共管理 92 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，管理公募基金总规模 4056.91 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、易方达黄金交易型开放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联接基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2015-08-27	-	8 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。
余海燕	本基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数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 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2016-04-16	-	11 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，林伟斌的“任职日期”为基金合同生效之日，余海燕的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年国内宏观经济基本面下行压力犹存，1-2 月份工业增速延续了前期的下滑态势，随后在财政和信贷政策的支持、补库存、房地产回暖的推动下，3 月份宏观经济企稳回升，景气度明显改善，3 月制造业 PMI 大幅回升至 50.2，随后货币政策重心转向供给侧改革以及工业去产能、企业去杠杆仍持续的背景下，制造业投资继续疲弱，二季度房地产投资较上季度有所放缓，经济增长动能有所减弱，宏观数据显示 6 月财新中国制造业 PMI 降至 48.6，2 季度 GDP 同比增速为 6.7%，创 2009 年 2 季度以来新低。资本市场方面，2016 年伊始 A 股市场大幅波动。年初人民币兑美元即期汇率贬值以及叠加宽松货币政策会收紧的预期，A 股市场在一月份连续大幅下挫；随后中国创历史记录的信贷数据出炉，市场对政府宽松刺激的预期升温，同时在人民币兑美元即期汇率止跌回升、美联储加息趋缓以及中国经济基本面数据好转带动市场风险偏好修复的背景下，A 股市场主要股指自 2 月份开始迎来了反弹。进入二季度后海外市场风险事件不断，期间美联储加息预期不断反复，

美联储一度尝试以出售资产的方式收缩其资产负债表，临近半年末出现黑天鹅事件——英国公投脱欧，导致全球避险情绪持续攀升，美日欧等发达股市暴跌，英镑和欧元大幅贬值，美元指数急升，黄金、日元等避险资产大涨。相较海外市场的不平静，A 股市场在二季度维持窄幅震荡行情，市场波动较前期大幅减弱，期间虽然遭遇权威人士表态“中国经济走势是长期 L 型”、A 股被纳入 MSCI 指数落空、英国公投脱欧等诸多利空因素，在震荡博弈中 A 股市场表现相对较为平稳。最终上半年上证综指以下跌 17.22% 收官，在风格方面，报告期内沪深 300 指数下跌 15.47%，中证 500 指数下跌 19.61%，创业板综指下跌 13.89%；行业方面，仅食品饮料行业录得正收益，有色金属、银行、电子、家用电器等板块跌幅相对较小，传媒、交通运输、商业贸易、休闲服务等板块跌幅较大。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。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### 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 6.3999 元，本报告期份额净值增长率为-18.14%，同期业绩比较基准收益率为-19.61%，日跟踪偏离度的均值为 0.26%，年化跟踪误差为 6.023%，大于合同规定的目标控制范围，主要是由本报告期内成份股停复牌数量较多，标的指数成份股调整以及成份股分红等因素所导致。

#### 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，宏观经济增速依然面临下行风险。随着当前政策重心逐步回归“供给侧改革”，前期稳增长措施效果将逐步淡化，房地产增速预计将缓慢回落，下半年经济增长可能会重回增速缓降的局面。A 股市场未来中短期表现及风险方面我们需要关注：经济继续下行带来的信用风险；各种改革措施能否加大力度推进；英国脱欧事件开启的逆全球化浪潮带来的外围不确定性增加；中国货币政策基调和汇率政策目标将由于海外市场动荡加剧而受到更大的挑战。从中长期看改革与创新仍然值得期待，在就业与坏账压力之下，财政政策有望加码，而改革进程，包括国企、财税、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推进；通过供给侧改革、提高全要素生产率，将是中国经济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。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必太悲观。通过资本市场盘活存量、促进创新创业，把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业并购、重组，改善上市公司业绩，A 股市场和产业发展的正反馈仍将重现。

作为被动型投资基金，本基金将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，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，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

本报告期，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元的情形。

自 2016 年 1 月 19 日至 2016 年 3 月 9 日，2016 年 4 月 8 日至本报告期末，本基金均存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元和基金份额持有人数量不满二百人的情形。鉴于基金资产净值和基金份额持有人数量的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

## 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，对易方达中证 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。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未进行利润分配。

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

本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 2016 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	403,898.39	1,327,324.70
结算备付金		1,508.66	150,452.91
存出保证金		2,867.03	115,601.35

交易性金融资产	6.4.7.2	6,874,158.75	12,015,292.56
其中：股票投资		6,873,058.75	12,015,292.56
基金投资		-	-
债券投资		1,100.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	108.27	362.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,282,541.10	13,609,033.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	106,134.39
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,833.34	6,006.11
应付托管费		566.65	1,201.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,665.28	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	6.4.7.8	258,850.46	110,786.71
负债合计		264,915.73	346,009.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	7,116,059.83	11,009,883.36
未分配利润	6.4.7.10	-98,434.46	2,253,140.58
所有者权益合计		7,017,625.37	13,263,023.94
负债和所有者权益总计		7,282,541.10	13,609,033.81

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。

2.报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.3999 元，基金份额总额 1,096,515.00 份。

## 6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-2,088,559.48</b>
1.利息收入		3,450.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,449.19
债券利息收入		1.23
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）		-563,276.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-601,393.09
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,441.85
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	36,674.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,521,377.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,355.85
<b>减：二、费用</b>		<b>345,279.77</b>
1. 管理人报酬		21,963.67
2. 托管费		4,392.72
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	9,883.92
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	309,039.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,433,839.25</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,433,839.25</b>

注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 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。

### 6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,009,883.36	2,253,140.58	13,263,023.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,433,839.25	-2,433,839.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,893,823.53	82,264.21	-3,811,559.32
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-3,893,823.53	82,264.21	-3,811,559.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,116,059.83	-98,434.46	7,017,625.37

注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 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 6.1 至 6.4，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

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 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。

#### (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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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。

#### 6.4.3 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。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	403,898.39
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	403,898.39

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,443,248.61	6,873,058.75	-570,189.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,100.00	0.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,100.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,444,348.61	6,874,158.75	-570,189.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	106.37
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.45
应收债券利息	0.28
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	1.17
合计	108.27

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,665.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,665.28

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,850.46
其他应付款	50,000.00
合计	258,850.46

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,696,515.00	11,009,883.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-600,000.00	-3,893,823.53
本期末	1,096,515.00	7,116,059.83

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,217,748.04	-3,964,607.46	2,253,140.58
本期利润	-912,461.91	-1,521,377.34	-2,433,839.25
本期基金份额交易产生的变动数	-2,079,590.02	2,161,854.23	82,264.21
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,079,590.02	2,161,854.23	82,264.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,225,696.11	-3,324,130.57	-98,434.46

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,788.40
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	103.93
其他	556.86
合计	3,449.19

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-262,271.10
股票投资收益——赎回差价收入	-339,121.99
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-601,393.09

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,862,639.34
减：卖出股票成本总额	5,124,910.44
买卖股票差价收入	-262,271.10

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,677,808.22
减：现金支付赎回款总额	1,846,757.22
减：赎回股票成本总额	2,170,172.99
赎回差价收入	-339,121.99

##### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,442.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,000.00
减：应收利息总额	0.95
买卖债券差价收入	1,441.85

##### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	36,674.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	36,674.53

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-1,521,377.34
——股票投资	-1,521,377.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,521,377.34

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	-7,355.85
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	-7,355.85

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	9,883.92
银行间市场交易费用	-
合计	9,883.92

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	189.00
上市费	29,835.26
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	309,039.46

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

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。

## 6.4.10.1.2 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。

## 6.4.10.1.3 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。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,963.67
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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,392.72

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	403,898.39	2,788.40

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况



本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016-06-08	2016-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	11	1,100.00	1,100.00	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大事项停牌	10.90	2016-07-14	11.32	800	8,346.68	8,720.00	-
000511	*ST 烯碳	2016-04-26	重大事项停牌	8.92	-	-	2,200	25,003.47	19,624.00	-
000517	荣安地产	2016-06-14	重大事项停牌	4.84	2016-07-14	4.98	1,200	6,198.00	5,808.00	-
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项停牌	15.36	-	-	1,100	20,924.03	16,896.00	-
000582	北部湾港	2016-02-29	重大事项停牌	16.32	-	-	300	5,916.24	4,896.00	-
000636	风华高科	2016-03-15	重大事项停牌	8.84	2016-07-13	9.72	1,400	13,560.89	12,376.00	-
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	700	12,897.87	8,750.00	-
000718	苏宁环球	2016-01-04	重大事项停牌	13.09	2016-07-18	11.78	3,700	34,489.91	48,433.00	-
000975	银泰资源	2016-04-19	重大事项停牌	15.00	-	-	900	11,228.51	13,500.00	-
002199	成飞集	2016-04-	重大事	35.44	2016-0	38.98	300	11,359.12	10,632.00	-

0	成	-21	项停牌		7-12						
002249	大洋电机	2016-06-08	重大事项停牌	11.97	2016-07-28	10.77	334	3,826.30	3,997.98	-	
002266	浙富控股	2016-05-25	重大事项停牌	5.35	-	-	2,700	21,130.83	14,445.00	-	
002373	千方科技	2016-05-12	重大事项停牌	14.94	2016-08-16	16.43	868	16,345.47	12,967.92	-	
002512	达华智能	2016-06-21	重大事项停牌	20.28	2016-07-21	19.38	830	16,300.28	16,832.40	-	
002663	普邦园林	2016-04-28	重大事项停牌	7.36	-	-	1,400	10,619.34	10,304.00	-	
002672	东江环保	2016-05-23	重大事项停牌	17.33	2016-07-15	19.06	673	12,116.31	11,663.09	-	
300032	金龙机电	2016-06-28	重大事项停牌	20.10	2016-07-07	19.80	659	11,740.56	13,245.90	-	
600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项停牌	5.52	2016-07-01	5.62	3,957	21,777.35	21,842.64	-	
600497	驰宏锌锗	2016-06-13	重大事项停牌	9.97	2016-07-11	10.97	1,644	17,094.79	16,390.68	-	
600511	国药股份	2016-02-18	重大事项停牌	27.42	2016-08-04	30.16	400	13,247.97	10,968.00	-	
600545	新疆城建	2016-05-31	重大事项停牌	6.91	-	-	1,100	12,034.93	7,601.00	-	
600614	鼎立股份	2016-04-26	重大事项停牌	8.14	-	-	1,200	11,860.39	9,768.00	-	
600640	号百控股	2016-04-18	重大事项停牌	16.79	2016-08-22	18.44	400	7,804.68	6,716.00	-	
600654	中安消	2016-05-19	重大事项停牌	18.54	2016-08-08	20.39	1,513	47,944.59	28,051.02	-	
600751	天海投资	2016-02-15	重大事项停牌	6.11	2016-07-26	6.72	700	6,300.70	4,277.00	-	
600759	洲际油气	2016-06-27	重大事项停牌	7.58	2016-07-11	8.10	1,973	15,121.54	14,955.34	-	
600773	西藏城投	2016-06-30	重大事项停牌	15.67	-	-	824	13,701.79	12,912.08	-	
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大事项停牌	2.52	-	-	3,700	12,258.57	9,324.00	-	
601168	西部矿业	2016-02-01	重大事项停牌	5.93	2016-07-22	6.52	2,800	19,267.92	16,604.00	-	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合, 全面管理、专业分工”的思路, 将风险控制嵌入到全公司的组织架构中, 对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看, 投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控, 并根据其不同权限实施风险控制; 从岗位职能的分工上看, 基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理; 从投资管理的流程看, 已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金, 预期风险与收益水平高于混合基金、债券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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司, 在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2016 年 6 月 30 日, 本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2015 年 12 月 31 日: 0.00%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注: 1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短

期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	1,100.28	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,100.28	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型的基金。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	403,898.39	-	-	-	403,898.39
结算备付金	1,508.66	-	-	-	1,508.66
存出保证金	2,867.03	-	-	-	2,867.03
交易性金融资产	-	-	1,100.00	6,873,058.75	6,874,158.75
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	-	-	-	108.27	108.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	408,274.08	-	1,100.00	6,873,167.02	7,282,541.10
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	-	-	-	2,833.34	2,833.34
应付托管费	-	-	-	566.65	566.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,665.28	2,665.28
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	258,850.46	258,850.46
负债总计	-	-	-	264,915.73	264,915.73
利率敏感度缺口	408,274.08	-	1,100.00	6,608,251.29	7,017,625.37
上年度末					
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	1,327,324.70	-	-	-	1,327,324.70
结算备付金	150,452.91	-	-	-	150,452.91
存出保证金	115,601.35	-	-	-	115,601.35
交易性金融资产	-	-	-	12,015,292.56	12,015,292.56
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	362.29
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,593,378.96	-	-	12,015,654.85	13,609,033.81
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	-	-	-	106,134.39	106,134.39
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,006.11	6,006.11
应付托管费	-	-	-	1,201.22	1,201.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	121,881.44	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	110,786.71
负债总计	-	-	-	346,009.87	346,009.87
利率敏感度缺口	1,593,378.96	-	-	11,669,644.98	13,263,023.94

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	6,873,058.75	97.94	12,015,292.56	90.59
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	6,873,058.75	97.94	12,015,292.56	90.59

## 6.4.13.4.3.2 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	341,665.61	609,166.88
	2.业绩比较基准下降 5%	-341,665.61	-609,166.88

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1)公允价值

## (a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b)持续的以公允价值计量的金融工具

## (i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 6,481,657.70 元，属于第二层次的余额为 392,501.05 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 10,092,144.26 元，第二层次 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。

(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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,873,058.75	94.38
	其中：股票	6,873,058.75	94.38
2	固定收益投资	1,100.00	0.02
	其中：债券	1,100.00	0.02
	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	405,407.05	5.57
7	其他各项资产	2,975.30	0.04
8	合计	7,282,541.10	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。



## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 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	135,125.53	1.93
B	采矿业	267,172.79	3.81
C	制造业	4,045,593.55	57.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,225.76	2.78
E	建筑业	201,905.25	2.88
F	批发和零售业	437,476.78	6.23
G	交通运输、仓储和邮政业	186,074.97	2.65
H	住宿和餐饮业	14,354.34	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	471,237.83	6.72
J	金融业	32,534.34	0.46
K	房地产业	488,583.15	6.96
L	租赁和商务服务业	98,753.99	1.41
M	科学研究和技术服务业	27,964.93	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	46,245.37	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,325.10	0.23
R	文化、体育和娱乐业	123,586.37	1.76
S	综合	84,898.70	1.21
	合计	6,873,058.75	97.94

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000718	苏宁环球	3,700	48,433.00	0.69
2	600120	浙江东方	2,100	45,591.00	0.65
3	002466	天齐锂业	989	42,220.41	0.60
4	600584	长电科技	1,814	36,806.06	0.52

5	002405	四维图新	1,484	36,506.40	0.52
6	600522	中天科技	3,538	34,672.40	0.49
7	002340	格林美	3,552	31,151.04	0.44
8	002085	万丰奥威	1,744	29,979.36	0.43
9	600699	均胜电子	758	29,031.40	0.41
10	002049	紫光国芯	659	28,963.05	0.41
11	600654	中安消	1,513	28,051.02	0.40
12	002508	老板电器	758	27,871.66	0.40
13	002572	索菲亚	495	27,729.90	0.40
14	600219	南山铝业	3,700	27,380.00	0.39
15	300072	三聚环保	989	27,335.96	0.39
16	600201	生物股份	989	27,029.37	0.39
17	600503	华丽家族	2,900	26,593.00	0.38
18	600079	人福医药	1,580	26,496.60	0.38
19	600525	长园集团	1,876	25,982.60	0.37
20	002273	水晶光电	922	25,806.78	0.37
21	000988	华工科技	1,251	25,082.55	0.36
22	000997	新大陆	1,251	25,070.04	0.36
23	300113	顺网科技	659	25,015.64	0.36
24	601012	隆基股份	1,908	24,899.40	0.35
25	600482	中国动力	758	24,839.66	0.35
26	002400	省广股份	1,744	24,642.72	0.35
27	600879	航天电子	1,580	24,616.40	0.35
28	000748	长城信息	1,251	24,544.62	0.35
29	300253	卫宁健康	989	24,428.30	0.35
30	002426	胜利精密	2,473	24,359.05	0.35
31	600521	华海药业	989	24,052.48	0.34
32	002299	圣农发展	922	23,879.80	0.34
33	000998	隆平高科	1,251	23,743.98	0.34
34	600682	南京新百	824	23,459.28	0.33
35	600978	宜华生活	2,073	23,093.22	0.33
36	000970	中科三环	1,580	22,925.80	0.33
37	002030	达安基因	824	22,907.20	0.33
38	002701	奥瑞金	2,566	22,657.78	0.32
39	600664	哈药股份	2,730	22,631.70	0.32
40	002004	华邦健康	2,473	22,578.49	0.32
41	002131	利欧股份	1,319	22,541.71	0.32
42	600498	烽火通信	922	22,386.16	0.32
43	600436	片仔癀	495	22,279.95	0.32
44	600158	中体产业	1,251	22,205.25	0.32
45	600122	宏图高科	1,649	22,063.62	0.31
46	000887	中鼎股份	989	21,866.79	0.31
47	600166	福田汽车	3,957	21,842.64	0.31
48	002714	牧原股份	429	21,677.37	0.31

49	000983	西山煤电	2,638	21,499.70	0.31
50	002179	中航光电	495	21,443.40	0.31
51	600635	大众公用	3,552	21,418.56	0.31
52	002439	启明星辰	824	21,283.92	0.30
53	002573	清新环境	1,251	21,166.92	0.30
54	000697	炼石有色	922	21,067.70	0.30
55	300088	长信科技	1,415	21,041.05	0.30
56	600200	江苏吴中	1,086	21,035.82	0.30
57	000078	海王生物	2,830	21,026.90	0.30
58	002001	新 和 成	989	20,897.57	0.30
59	000050	深天马 A	989	20,640.43	0.29
60	600266	北京城建	1,649	20,596.01	0.29
61	600643	爱建集团	2,073	20,253.21	0.29
62	600143	金发科技	3,133	20,176.52	0.29
63	000656	金科股份	5,276	20,154.32	0.29
64	600418	江淮汽车	1,580	20,034.40	0.29
65	600594	益佰制药	1,251	19,990.98	0.28
66	000012	南 玻 A	1,744	19,986.24	0.28
67	002168	深圳惠程	1,415	19,923.20	0.28
68	600478	科力远	1,649	19,903.43	0.28
69	002038	双鹭药业	659	19,888.62	0.28
70	600487	亨通光电	1,580	19,876.40	0.28
71	600388	龙净环保	1,580	19,844.80	0.28
72	300055	万邦达	1,086	19,776.06	0.28
73	603019	中科曙光	495	19,710.90	0.28
74	002310	东方园林	824	19,710.08	0.28
75	002595	豪迈科技	922	19,703.14	0.28
76	600198	大唐电信	989	19,661.32	0.28
77	000511	*ST 烯碳	2,200	19,624.00	0.28
78	002276	万马股份	989	19,592.09	0.28
79	600312	平高电气	1,251	19,590.66	0.28
80	002074	国轩高科	495	19,537.65	0.28
81	000930	中粮生化	1,744	19,149.12	0.27
82	600673	东阳光科	3,059	19,118.75	0.27
83	002191	劲嘉股份	1,649	19,111.91	0.27
84	600138	中青旅	989	19,107.48	0.27
85	300115	长盈精密	922	18,993.20	0.27
86	600259	广晟有色	330	18,895.80	0.27
87	600171	上海贝岭	1,086	18,863.82	0.27
88	600435	北方导航	1,416	18,846.96	0.27
89	600851	海欣股份	1,415	18,833.65	0.27
90	300199	翰宇药业	922	18,762.70	0.27
91	000762	西藏矿业	758	18,737.76	0.27
92	300274	阳光电源	758	18,495.20	0.26

93	600499	科达洁能	1,086	18,364.26	0.26
94	002657	中科金财	330	18,130.20	0.26
95	600094	大名城	1,908	18,126.00	0.26
96	600366	宁波韵升	758	18,093.46	0.26
97	002221	东华能源	1,484	18,089.96	0.26
98	000860	顺鑫农业	758	18,025.24	0.26
99	002371	七星电子	429	17,940.78	0.26
100	600655	豫园商城	1,649	17,875.16	0.25
101	600151	航天机电	1,580	17,854.00	0.25
102	002308	威创股份	1,086	17,842.98	0.25
103	300291	华录百纳	758	17,835.74	0.25
104	600410	华胜天成	1,580	17,727.60	0.25
105	002268	卫士通	495	17,691.30	0.25
106	300273	和佳股份	922	17,656.30	0.25
107	600770	综艺股份	1,415	17,630.90	0.25
108	000661	长春高新	165	17,602.20	0.25
109	002366	台海核电	330	17,592.30	0.25
110	600240	华业资本	1,744	17,474.88	0.25
111	600516	方大炭素	1,908	17,439.12	0.25
112	600645	中源协和	495	17,394.30	0.25
113	002048	宁波华翔	758	17,335.46	0.25
114	300010	立思辰	824	17,287.52	0.25
115	600500	中化国际	1,908	17,248.32	0.25
116	000566	海南海药	1,580	17,237.80	0.25
117	002311	海大集团	1,086	17,126.22	0.24
118	000031	中粮地产	1,814	17,106.02	0.24
119	600811	东方集团	2,566	17,089.56	0.24
120	600884	杉杉股份	989	17,020.69	0.24
121	000547	航天发展	1,100	16,896.00	0.24
122	002512	达华智能	830	16,832.40	0.24
123	600160	巨化股份	1,580	16,795.40	0.24
124	000979	中弘股份	6,100	16,714.00	0.24
125	600176	中国巨石	1,744	16,690.08	0.24
126	600601	方正科技	3,881	16,688.30	0.24
127	000671	阳光城	2,803	16,649.82	0.24
128	002217	合力泰	1,086	16,615.80	0.24
129	000581	威孚高科	824	16,611.84	0.24
130	601168	西部矿业	2,800	16,604.00	0.24
131	000598	兴蓉环境	3,133	16,542.24	0.24
132	600694	大商股份	429	16,525.08	0.24
133	002410	广联达	1,154	16,502.20	0.24
134	600216	浙江医药	1,251	16,500.69	0.24
135	600755	厦门国贸	2,073	16,480.35	0.23
136	002155	湖南黄金	1,251	16,475.67	0.23

137	600528	中铁二局	1,415	16,428.15	0.23
138	600497	驰宏锌锗	1,644	16,390.68	0.23
139	300244	迪安诊断	495	16,325.10	0.23
140	000690	宝新能源	2,402	16,285.56	0.23
141	600064	南京高科	1,086	16,235.70	0.23
142	002051	中工国际	824	16,208.08	0.23
143	600392	盛和资源	989	16,199.82	0.23
144	002624	完美环球	429	16,194.75	0.23
145	000008	神州高铁	1,484	16,160.76	0.23
146	002022	科华生物	758	16,152.98	0.23
147	002092	中泰化学	1,908	16,141.68	0.23
148	600687	刚泰控股	989	16,081.14	0.23
149	000758	中色股份	2,072	16,058.00	0.23
150	600565	迪马股份	2,473	15,975.58	0.23
151	000066	长城电脑	1,251	15,950.25	0.23
152	002477	雏鹰农牧	2,666	15,916.02	0.23
153	002353	杰瑞股份	824	15,886.72	0.23
154	002271	东方雨虹	922	15,886.06	0.23
155	002428	云南锗业	922	15,839.96	0.23
156	600651	飞乐音响	1,251	15,837.66	0.23
157	300182	捷成股份	922	15,775.42	0.22
158	002223	鱼跃医疗	495	15,701.40	0.22
159	601929	吉视传媒	3,881	15,640.43	0.22
160	002665	首航节能	1,978	15,606.42	0.22
161	002013	中航机电	1,154	15,555.92	0.22
162	002250	联化科技	1,086	15,551.52	0.22
163	600881	亚泰集团	3,223	15,534.86	0.22
164	603766	隆鑫通用	758	15,326.76	0.22
165	000400	许继电气	989	15,270.16	0.22
166	002368	太极股份	429	15,242.37	0.22
167	600611	大众交通	2,237	15,233.97	0.22
168	000727	华东科技	4,616	15,232.80	0.22
169	002489	浙江永强	1,908	15,111.36	0.22
170	000878	云南铜业	1,484	15,107.12	0.22
171	600260	凯乐科技	922	15,083.92	0.21
172	002073	软控股份	1,251	15,074.55	0.21
173	601311	骆驼股份	758	15,046.30	0.21
174	600759	洲际油气	1,973	14,955.34	0.21
175	600633	浙报传媒	989	14,874.56	0.21
176	300134	大富科技	495	14,830.20	0.21
177	600422	昆药集团	1,086	14,813.04	0.21
178	000973	佛塑科技	1,415	14,772.60	0.21
179	002603	以岭药业	922	14,669.02	0.21
180	600056	中国医药	922	14,622.92	0.21

181	600557	康缘药业	890	14,533.70	0.21
182	002325	洪涛股份	1,580	14,520.20	0.21
183	000829	天音控股	1,086	14,498.10	0.21
184	000021	深科技	1,315	14,478.15	0.21
185	002266	浙富控股	2,700	14,445.00	0.21
186	002354	天神娱乐	165	14,401.20	0.21
187	002431	棕榈股份	1,251	14,386.50	0.21
188	600754	锦江股份	429	14,354.34	0.20
189	300026	红日药业	824	14,329.36	0.20
190	002699	美盛文化	429	14,324.31	0.20
191	300001	特锐德	659	14,293.71	0.20
192	600348	阳泉煤业	2,237	14,249.69	0.20
193	600058	五矿发展	758	14,227.66	0.20
194	601880	大连港	2,402	14,195.82	0.20
195	600026	中海发展	2,402	14,171.80	0.20
196	300043	互动娱乐	989	14,014.13	0.20
197	000418	小天鹅 A	429	13,993.98	0.20
198	600572	康恩贝	2,143	13,886.64	0.20
199	600325	华发股份	1,251	13,848.57	0.20
200	600062	华润双鹤	758	13,810.76	0.20
201	600108	亚盛集团	2,730	13,786.50	0.20
202	600597	光明乳业	1,086	13,770.48	0.20
203	600067	冠城大通	1,908	13,756.68	0.20
204	600161	天坛生物	495	13,756.05	0.20
205	002437	誉衡药业	1,580	13,746.00	0.20
206	601155	新城控股	1,484	13,741.84	0.20
207	002161	远望谷	922	13,728.58	0.20
208	000616	海航投资	2,566	13,702.44	0.20
209	002440	闰土股份	922	13,691.70	0.20
210	000685	中山公用	1,319	13,691.22	0.20
211	001696	宗申动力	1,251	13,660.92	0.19
212	002050	三花股份	1,415	13,654.75	0.19
213	600750	江中药业	429	13,642.20	0.19
214	000543	皖能电力	1,908	13,623.12	0.19
215	603188	亚邦股份	758	13,613.68	0.19
216	601777	力帆股份	1,154	13,582.58	0.19
217	300147	香雪制药	922	13,581.06	0.19
218	600298	安琪酵母	758	13,522.72	0.19
219	000975	银泰资源	900	13,500.00	0.19
220	600787	中储股份	1,814	13,478.02	0.19
221	000786	北新建材	1,484	13,474.72	0.19
222	600765	中航重机	922	13,442.76	0.19
223	000592	平潭发展	1,978	13,410.84	0.19
224	600872	中炬高新	1,086	13,401.24	0.19

225	002444	巨星科技	659	13,390.88	0.19
226	002414	高德红外	495	13,350.15	0.19
227	600967	北方创业	1,251	13,298.13	0.19
228	600270	外运发展	758	13,257.42	0.19
229	300287	飞利信	989	13,252.60	0.19
230	300032	金龙机电	659	13,245.90	0.19
231	600073	上海梅林	1,154	13,213.30	0.19
232	600267	海正药业	1,086	13,194.90	0.19
233	002589	瑞康医药	429	13,174.59	0.19
234	002384	东山精密	659	13,087.74	0.19
235	600426	华鲁恒升	1,484	13,074.04	0.19
236	600017	日照港	3,223	13,053.15	0.19
237	002375	亚厦股份	1,154	13,040.20	0.19
238	002642	荣之联	495	13,023.45	0.19
239	002315	焦点科技	193	13,019.78	0.19
240	600380	健康元	1,415	12,989.70	0.19
241	000848	承德露露	1,086	12,977.70	0.18
242	002373	千方科技	868	12,967.92	0.18
243	600580	卧龙电气	1,154	12,936.34	0.18
244	601699	潞安环能	1,978	12,936.12	0.18
245	000969	安泰科技	922	12,935.66	0.18
246	600773	西藏城投	824	12,912.08	0.18
247	600289	亿阳信通	922	12,898.78	0.18
248	600717	天津港	1,484	12,895.96	0.18
249	002056	横店东磁	758	12,886.00	0.18
250	600869	智慧能源	1,251	12,885.30	0.18
251	600316	洪都航空	659	12,857.09	0.18
252	000006	深振业 A	1,744	12,853.28	0.18
253	002681	奋达科技	758	12,795.04	0.18
254	000926	福星股份	1,086	12,738.78	0.18
255	002063	远光软件	822	12,699.90	0.18
256	600039	四川路桥	3,223	12,698.62	0.18
257	000667	美好集团	3,552	12,680.64	0.18
258	002635	安洁科技	330	12,665.40	0.18
259	000939	凯迪生态	1,415	12,664.25	0.18
260	600006	东风汽车	1,415	12,551.05	0.18
261	000488	晨鸣纸业	1,580	12,545.20	0.18
262	600808	马钢股份	5,196	12,522.36	0.18
263	002002	鸿达兴业	659	12,389.20	0.18
264	000636	风华高科	1,400	12,376.00	0.18
265	600639	浦东金桥	495	12,365.10	0.18
266	600536	中国软件	495	12,335.40	0.18
267	002285	世联行	1,580	12,308.20	0.18
268	600850	华东电脑	429	12,308.01	0.18

269	600320	振华重工	2,895	12,303.75	0.18
270	000563	陕国投 A	2,237	12,281.13	0.18
271	600729	重庆百货	495	12,276.00	0.17
272	000816	智慧农业	2,073	12,251.43	0.17
273	002011	盾安环境	1,086	12,250.08	0.17
274	600433	冠豪高新	1,415	12,225.60	0.17
275	002025	航天电器	495	12,221.55	0.17
276	600086	东方金钰	1,251	12,109.68	0.17
277	600880	博瑞传播	1,415	12,041.65	0.17
278	600970	中材国际	1,908	12,020.40	0.17
279	300202	聚龙股份	495	11,983.95	0.17
280	600169	太原重工	3,059	11,930.10	0.17
281	000810	创维数字	659	11,908.13	0.17
282	600517	置信电气	1,251	11,897.01	0.17
283	600458	时代新材	758	11,809.64	0.17
284	002041	登海种业	758	11,779.32	0.17
285	600409	三友化工	1,744	11,754.56	0.17
286	000519	江南红箭	922	11,718.62	0.17
287	000681	视觉中国	495	11,706.75	0.17
288	600220	江苏阳光	2,566	11,700.96	0.17
289	000587	金洲慈航	758	11,695.94	0.17
290	002358	森源电气	758	11,695.94	0.17
291	002244	滨江集团	1,744	11,684.80	0.17
292	002672	东江环保	673	11,663.09	0.17
293	000777	中核科技	495	11,662.20	0.17
294	600175	美都能源	2,473	11,623.10	0.17
295	002640	跨境通	659	11,611.58	0.17
296	000062	深圳华强	429	11,583.00	0.17
297	002390	信邦制药	1,251	11,559.24	0.16
298	600187	国中水务	2,566	11,444.36	0.16
299	002093	国脉科技	922	11,442.02	0.16
300	600537	亿晶光电	1,484	11,441.64	0.16
301	600587	新华医疗	495	11,429.55	0.16
302	600736	苏州高新	1,251	11,421.63	0.16
303	002261	拓维信息	824	11,395.92	0.16
304	002588	史丹利	922	11,386.70	0.16
305	600284	浦东建设	1,086	11,337.84	0.16
306	600004	白云机场	922	11,303.72	0.16
307	601000	唐山港	2,895	11,232.60	0.16
308	600826	兰生股份	429	11,231.22	0.16
309	600460	士兰微	1,415	11,220.95	0.16
310	000541	佛山照明	1,086	11,174.94	0.16
311	601010	文峰股份	2,143	11,122.17	0.16
312	600125	铁龙物流	1,744	11,109.28	0.16



313	000961	中南建设	1,978	11,096.58	0.16
314	002317	众生药业	922	11,054.78	0.16
315	000669	金鸿能源	659	11,005.30	0.16
316	600809	山西汾酒	495	10,979.10	0.16
317	600511	国药股份	400	10,968.00	0.16
318	002106	莱宝高科	922	10,953.36	0.16
319	002505	大康农业	2,803	10,931.70	0.16
320	000600	建投能源	1,251	10,921.23	0.16
321	600351	亚宝药业	1,086	10,892.58	0.16
322	300257	开山股份	659	10,886.68	0.16
323	600805	悦达投资	1,251	10,858.68	0.15
324	600277	亿利洁能	1,814	10,793.30	0.15
325	002242	九阳股份	593	10,780.74	0.15
326	000572	海马汽车	2,073	10,758.87	0.15
327	000028	国药一致	165	10,741.50	0.15
328	002727	一心堂	429	10,725.00	0.15
329	600575	皖江物流	2,473	10,708.09	0.15
330	600183	生益科技	1,154	10,697.58	0.15
331	002190	成飞集成	300	10,632.00	0.15
332	002309	中利科技	593	10,620.63	0.15
333	000612	焦作万方	1,484	10,595.76	0.15
334	002281	光迅科技	165	10,593.00	0.15
335	002344	海宁皮城	1,086	10,588.50	0.15
336	002078	太阳纸业	2,143	10,457.84	0.15
337	000550	江铃汽车	429	10,450.44	0.15
338	002498	汉缆股份	2,402	10,424.68	0.15
339	002254	泰和新材	758	10,399.76	0.15
340	002479	富春环保	922	10,354.06	0.15
341	600395	盘江股份	1,251	10,333.26	0.15
342	600993	马应龙	495	10,310.85	0.15
343	002005	德豪润达	1,744	10,307.04	0.15
344	002663	普邦园林	1,400	10,304.00	0.15
345	600112	天成控股	922	10,289.52	0.15
346	600416	湘电股份	824	10,275.28	0.15
347	000726	鲁泰 A	922	10,243.42	0.15
348	000861	海印股份	2,073	10,240.62	0.15
349	600894	广日股份	758	10,104.14	0.14
350	600859	王府井	659	10,043.16	0.14
351	002551	尚荣医疗	429	10,030.02	0.14
352	601717	郑煤机	1,744	9,940.80	0.14
353	000620	新华联	1,086	9,936.90	0.14
354	000099	中信海直	758	9,854.00	0.14
355	002269	美邦服饰	2,237	9,842.80	0.14
356	600831	广电网络	758	9,823.68	0.14

357	600812	华北制药	1,580	9,811.80	0.14
358	600614	鼎立股份	1,200	9,768.00	0.14
359	002396	星网锐捷	495	9,751.50	0.14
360	603328	依顿电子	330	9,748.20	0.14
361	000937	冀中能源	1,814	9,650.48	0.14
362	600292	远达环保	758	9,603.86	0.14
363	600236	桂冠电力	1,415	9,508.80	0.14
364	600835	上海机电	495	9,499.05	0.14
365	600059	古越龙山	922	9,487.38	0.14
366	601886	江河集团	922	9,468.94	0.13
367	002503	搜于特	758	9,414.36	0.13
368	600300	维维股份	1,580	9,385.20	0.13
369	300039	上海凯宝	922	9,376.74	0.13
370	002029	七匹狼	922	9,358.30	0.13
371	601005	重庆钢铁	3,700	9,324.00	0.13
372	000501	鄂武商 A	593	9,304.17	0.13
373	600761	安徽合力	922	9,302.98	0.13
374	000528	柳 工	1,415	9,169.20	0.13
375	000158	常山股份	659	9,153.51	0.13
376	600496	精工钢构	2,143	9,129.18	0.13
377	000088	盐 田 港	1,415	9,112.60	0.13
378	600757	长江传媒	1,086	9,111.54	0.13
379	002028	思源电气	824	9,022.80	0.13
380	600180	瑞茂通	593	8,960.23	0.13
381	600823	世茂股份	1,319	8,956.01	0.13
382	600628	新世界	758	8,944.40	0.13
383	600428	中远航运	1,580	8,863.80	0.13
384	002646	青青稞酒	429	8,841.69	0.13
385	000417	合肥百货	1,086	8,785.74	0.13
386	000652	泰达股份	1,908	8,776.80	0.13
387	000693	ST 华泽	700	8,750.00	0.12
388	002277	友阿股份	758	8,732.16	0.12
389	000401	冀东水泥	800	8,720.00	0.12
390	002118	紫鑫药业	593	8,717.10	0.12
391	002463	沪电股份	1,649	8,706.72	0.12
392	000090	天健集团	989	8,703.20	0.12
393	002128	露天煤业	1,154	8,666.54	0.12
394	000931	中 关 村	1,086	8,666.28	0.12
395	002267	陕天然气	824	8,652.00	0.12
396	600456	宝钛股份	429	8,631.48	0.12
397	000830	鲁西化工	1,908	8,624.16	0.12
398	603806	福斯特	165	8,611.35	0.12
399	000680	山推股份	1,744	8,597.92	0.12
400	603077	和邦生物	1,744	8,580.48	0.12

401	600551	时代出版	429	8,562.84	0.12
402	002332	仙琚制药	758	8,489.60	0.12
403	600509	天富能源	1,154	8,481.90	0.12
404	601666	平煤股份	2,073	8,478.57	0.12
405	000900	现代投资	1,251	8,431.74	0.12
406	600282	南钢股份	3,552	8,347.20	0.12
407	601908	京运通	1,086	8,329.62	0.12
408	600790	轻纺城	1,415	8,306.05	0.12
409	000897	津滨发展	2,143	8,293.41	0.12
410	002698	博实股份	429	8,262.54	0.12
411	601233	桐昆股份	758	8,231.88	0.12
412	603883	老百姓	165	8,207.10	0.12
413	600586	金晶科技	1,908	8,204.40	0.12
414	000426	兴业矿业	1,086	8,166.72	0.12
415	000552	靖远煤电	2,308	8,124.16	0.12
416	002293	罗莱生活	593	8,124.10	0.12
417	600481	双良节能	1,415	8,107.95	0.12
418	601678	滨化股份	1,580	8,042.20	0.11
419	601002	晋亿实业	922	8,021.40	0.11
420	601126	四方股份	758	7,981.74	0.11
421	601369	陕鼓动力	1,251	7,981.38	0.11
422	601001	大同煤业	1,484	7,969.08	0.11
423	600596	新安股份	1,086	7,916.94	0.11
424	002064	华峰氨纶	1,649	7,915.20	0.11
425	000596	古井贡酒	165	7,911.75	0.11
426	600195	中牧股份	429	7,850.70	0.11
427	000919	金陵药业	593	7,762.37	0.11
428	002251	步步高	593	7,691.21	0.11
429	601801	皖新传媒	659	7,690.53	0.11
430	603699	纽威股份	429	7,610.46	0.11
431	000513	丽珠集团	165	7,608.15	0.11
432	600545	新疆城建	1,100	7,601.00	0.11
433	002181	粤传媒	922	7,569.62	0.11
434	600132	重庆啤酒	495	7,519.05	0.11
435	600563	法拉电子	165	7,510.80	0.11
436	002482	广田集团	989	7,496.62	0.11
437	000703	恒逸石化	758	7,481.46	0.11
438	600184	光电股份	330	7,471.20	0.11
439	002345	潮宏基	758	7,413.24	0.11
440	600329	中新药业	429	7,408.83	0.11
441	603169	兰石重装	593	7,388.78	0.11
442	600251	冠农股份	922	7,376.00	0.11
443	603355	莱克电气	193	7,353.30	0.10
444	600280	中央商场	1,086	7,341.36	0.10

445	600825	新华传媒	922	7,329.90	0.10
446	600748	上实发展	758	7,307.12	0.10
447	600720	祁连山	1,086	7,287.06	0.10
448	601965	中国汽研	758	7,284.38	0.10
449	002342	巨力索具	1,251	7,255.80	0.10
450	603567	珍宝岛	330	7,210.50	0.10
451	600874	创业环保	922	7,163.94	0.10
452	600657	信达地产	1,415	7,046.70	0.10
453	603001	奥康国际	330	7,015.80	0.10
454	000049	德赛电池	165	6,920.10	0.10
455	600776	东方通信	824	6,913.36	0.10
456	000631	顺发恒业	1,415	6,891.05	0.10
457	002408	齐翔腾达	1,251	6,867.99	0.10
458	600141	兴发集团	593	6,831.36	0.10
459	600617	国新能源	593	6,795.78	0.10
460	002122	天马股份	1,086	6,754.92	0.10
461	600483	福能股份	593	6,730.55	0.10
462	600640	号百控股	400	6,716.00	0.10
463	600425	青松建化	1,580	6,715.00	0.10
464	601515	东风股份	593	6,700.90	0.10
465	600743	华远地产	1,415	6,692.95	0.10
466	600864	哈投股份	593	6,659.39	0.09
467	600335	国机汽车	593	6,647.53	0.09
468	000869	张裕 A	165	6,629.70	0.09
469	000030	富奥股份	922	6,610.74	0.09
470	600466	蓝光发展	758	6,488.48	0.09
471	603025	大豪科技	193	6,479.01	0.09
472	002327	富安娜	758	6,450.58	0.09
473	002194	武汉凡谷	495	6,326.10	0.09
474	603005	晶方科技	165	6,248.55	0.09
475	002602	世纪华通	330	6,114.90	0.09
476	000877	天山股份	989	6,112.02	0.09
477	002233	塔牌集团	758	6,086.74	0.09
478	600468	百利电气	429	6,070.35	0.09
479	601226	华电重工	659	6,043.03	0.09
480	603589	口子窖	165	5,974.65	0.09
481	000517	荣安地产	1,200	5,808.00	0.08
482	600053	九鼎投资	165	5,713.95	0.08
483	600618	氯碱化工	429	5,632.77	0.08
484	002745	木林森	165	5,608.35	0.08
485	600397	安源煤业	1,251	5,529.42	0.08
486	002392	北京利尔	1,086	5,364.84	0.08
487	002678	珠江钢琴	429	5,263.83	0.08
488	600507	方大特钢	1,086	5,212.80	0.07

489	600801	华新水泥	824	5,199.44	0.07
490	600510	黑牡丹	593	5,170.96	0.07
491	002216	三全食品	593	5,099.80	0.07
492	600971	恒源煤电	922	5,089.44	0.07
493	002461	珠江啤酒	429	4,984.98	0.07
494	000582	北部湾港	300	4,896.00	0.07
495	002238	天威视讯	330	4,775.10	0.07
496	603698	航天工程	165	4,527.60	0.06
497	600751	天海投资	700	4,277.00	0.06
498	603555	贵人鸟	165	4,113.45	0.06
499	002249	大洋电机	334	3,997.98	0.06
500	603198	迎驾贡酒	165	3,945.15	0.06
501	600088	中视传媒	165	3,913.80	0.06
502	603568	伟明环保	165	3,811.50	0.05
503	600917	重庆燃气	330	3,283.50	0.05
504	600623	华谊集团	165	3,268.65	0.05

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600978	宜华生活	46,395.00	0.35
2	000748	长城信息	35,240.00	0.27
3	002174	游族网络	29,940.00	0.23
4	600200	江苏吴中	29,703.00	0.22
5	300113	顺网科技	29,244.00	0.22
6	002572	索菲亚	27,548.00	0.21
7	000066	长城电脑	27,149.00	0.20
8	002466	天齐锂业	26,041.00	0.20
9	600729	重庆百货	24,670.00	0.19
10	002426	胜利精密	24,441.00	0.18
11	600682	南京新百	23,911.00	0.18
12	002131	利欧股份	23,231.00	0.18
13	600166	福田汽车	22,014.00	0.17
14	600699	均胜电子	21,235.00	0.16
15	000661	长春高新	21,109.80	0.16
16	002038	双鹭药业	20,919.00	0.16
17	002049	紫光国芯	20,679.00	0.16
18	600266	北京城建	20,653.00	0.16

19	002310	东方园林	20,639.00	0.16
20	002366	台海核电	20,460.00	0.15

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000829	天音控股	276,084.51	2.08
2	000028	国药一致	243,566.82	1.84
3	002048	宁波华翔	202,685.01	1.53
4	000426	兴业矿业	181,862.27	1.37
5	002371	七星电子	177,794.69	1.34
6	600864	哈投股份	90,146.00	0.68
7	002466	天齐锂业	63,363.75	0.48
8	600759	洲际油气	50,590.45	0.38
9	000661	长春高新	39,488.18	0.30
10	300122	智飞生物	32,709.19	0.25
11	300267	尔康制药	31,951.64	0.24
12	002174	游族网络	31,497.00	0.24
13	600429	三元股份	31,112.05	0.23
14	300085	银之杰	28,040.80	0.21
15	600816	安信信托	27,825.00	0.21
16	000887	中鼎股份	27,484.94	0.21
17	600074	保千里	25,534.00	0.19
18	002653	海思科	24,941.39	0.19
19	300244	迪安诊断	23,953.83	0.18
20	600376	首开股份	23,606.00	0.18

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,674,226.96
卖出股票收入（成交）总额	4,862,639.34

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,100.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,100.00	0.02

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127003	海印转债	11	1,100.00	0.02

#### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 本基金为指数型基金，苏宁环球系标的指数成份券，该股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。由于该股票停牌和本基金规模变动，使得该股票权重被动上升至持仓前十名。除苏宁环球外，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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,867.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	108.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,975.30

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000718	苏宁环球	48,433.00	0.69	重大事项停牌



## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
172	6,375.09	203,362.00	18.55%	893,153.00	81.45%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	邓敏妍	308,185.00	28.11%
2	上海申毅投资股份有限公司—申毅多策略量化套利 7 号	190,306.00	17.36%
3	何凤珍	132,635.00	12.10%
4	刘健	63,564.00	5.80%
5	吕爱平	46,000.00	4.20%
6	马坚明	20,000.00	1.82%
7	黄艳玲	16,179.00	1.48%
8	赵小月	15,409.00	1.41%
9	胡凤霞	12,409.00	1.13%
10	赖俊松	10,883.00	0.99%

## 8.3 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%
------------------	------	---------

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

### 9 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
本报告期期初基金份额总额	1,696,515.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,096,515.00

### 10 重大事件揭示

#### 10.1 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。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	4,197,269.11	49.21%	2,099.09	49.21%	-
中信建投	3	2,614,293.09	30.65%	1,307.46	30.65%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	1,717,243.30	20.13%	858.75	20.13%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
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,新增东北证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、

华西证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各一个交易单元。

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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	10,442.80	100.00%	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金场内申赎等业务开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-05
3	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
4	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及	中国证券报、上海证券	2016-01-28

	时更新身份证件或者身份证明文件的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
5	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-16
6	易方达基金管理有限公司关于停止办理旗下部分交易型开放式指数基金场外基金份额之间转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
7	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 基金增加华宝证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-16

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

二〇一六年八月二十四日