

# 嘉实中证 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：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 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	55
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	55
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
11.1 备查文件目录.....	61
11.2 存放地点.....	61
11.3 查阅方式.....	61

## § 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	147,131,868.00 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		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金	北京市西城区金融大街 25 号

	中心二期 53 层 09-11 单元	
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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-21,451,906.43
本期利润	-156,447,485.82
加权平均基金份额本期利润	-1.1679
本期加权平均净值利润率	-19.84%
本期基金份额净值增长率	-18.23%
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	370,669,791.97
期末可供分配基金份额利润	2.5193
期末基金资产净值	895,424,773.11
期末基金份额净值	6.0859
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	70.64%

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。

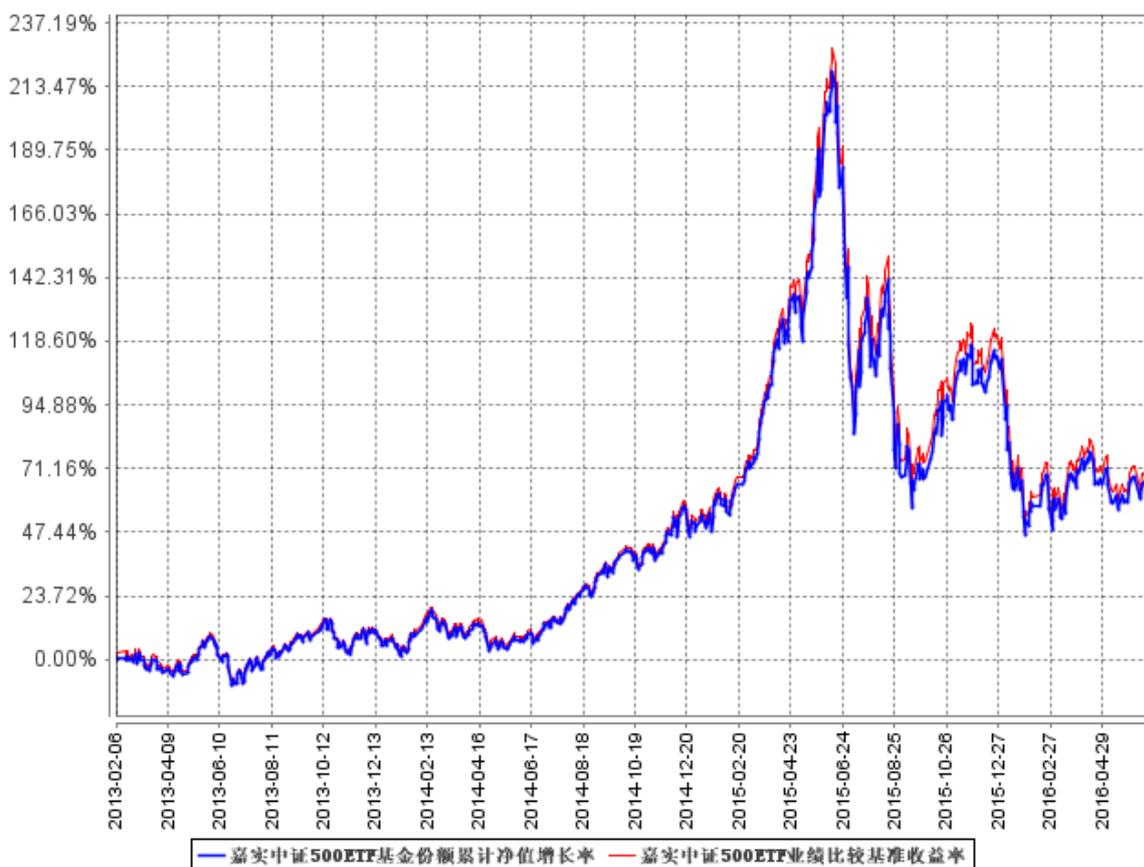
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去一个月	3.37%	1.52%	2.96%	1.55%	0.41%	-0.03%
过去三个月	0.13%	1.65%	-0.53%	1.65%	0.66%	0.00%
过去六个月	-18.23%	2.48%	-19.61%	2.56%	1.38%	-0.08%
过去一年	-30.70%	2.88%	-31.24%	2.92%	0.54%	-0.04%
过去三年	86.99%	2.11%	89.23%	2.13%	-2.24%	-0.02%
自基金合同生效起至今	70.64%	2.05%	73.93%	2.07%	-3.29%	-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 2016 年 6 月 30 日)

注 1：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。

注 2：2016 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职务，聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

## § 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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 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、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。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		
何如	本基金、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 及其联接、嘉实沪深 300ETF 及其联接、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	2016 年 1 月 5 日	-	10 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。
陈正宪	本基金、嘉实基本面 50（LOF）、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实	2016 年 1 月 5 日	-	11 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，

	中创 400ETF 及其联接、嘉实沪深 300ETF 及其联接基金基金经理				具有基金从业资格, 中国台湾籍。
杨宇	本基金、嘉实沪深 300ETF 及其联接、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	2016 年 1 月 5 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) 基金经理杨宇的任职日期是指本基金基金合同生效之日; 基金经理何如、陈正宪的任职日期是指公司作出决定后公告之日, 离任日期是指公司作出决定后公告之日; (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。

## 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 公平交易制度的执行情况

报告期内, 基金管理人严格执行证监会《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; 通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控, 公平对待旗下管理的所有投资组合。

### 4.3.2 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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

#### 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

本报告期内，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 0.2%的限制。

##### 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 6.0859 元；本报告期基金份额净值增长率为-18.23%，业绩比较基准收益率为-19.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，我们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、合规部等部门负责人组成，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。

#### 4.7 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”。收益评价日，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，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 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

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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	24,123,395.96	18,433,885.67
结算备付金		7,444,390.32	6,190,593.02
存出保证金		7,293,786.02	5,176,535.65
交易性金融资产	6.4.7.2	857,712,928.52	838,418,099.14
其中：股票投资		857,582,628.52	838,418,099.14

基金投资		-	-
债券投资		130,300.00	-
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		-	509,373.36
应收利息	6.4.7.5	8,452.11	7,998.90
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		896,582,952.93	868,736,485.74
<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>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		125,500.02	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		358,334.40	472,834.00
应付托管费		71,666.88	94,566.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	214,850.86	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	6.4.7.8	387,827.66	510,112.96
负债合计		1,158,179.82	1,455,445.15
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	524,754,981.14	415,618,173.12
未分配利润	6.4.7.10	370,669,791.97	451,662,867.47
所有者权益合计		895,424,773.11	867,281,040.59
负债和所有者权益总计		896,582,952.93	868,736,485.74

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.0859 元，基金份额总额 147,131,868.00 份。

## 6.2 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：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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
<b>一、收入</b>		-153,278,927.38	338,263,841.57
1.利息收入		135,829.80	31,296.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	135,738.73	31,296.99
债券利息收入		91.07	-
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		-18,358,687.58	210,959,880.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-24,428,174.45	207,461,018.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	88,206.77	-
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	1,384,440.00	-
股利收益	6.4.7.15	4,596,840.10	3,498,862.07
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-134,995,579.39	125,389,702.18
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	-60,490.21	1,882,961.97
<b>减：二、费用</b>		3,168,558.44	3,337,996.47
1. 管理人报酬		1,957,652.60	1,934,479.18
2. 托管费		391,530.55	386,895.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	474,774.37	672,256.97
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	344,600.92	344,364.51
<b>三、利润总额</b>		-156,447,485.82	334,925,845.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-156,447,485.82	334,925,845.10

### 6.3 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：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）	415,618,173.12	451,662,867.47	867,281,040.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-156,447,485.82	-156,447,485.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	109,136,808.02	75,454,410.32	184,591,218.34
其中：1. 基金申购款	138,025,963.10	94,016,469.01	232,042,432.11
2. 基金赎回款	-28,889,155.08	-18,562,058.69	-47,451,213.77
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）	524,754,981.14	370,669,791.97	895,424,773.11
	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
项目	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）	-	334,925,845.10	334,925,845.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	173,334,930.25	160,467,332.40	333,802,262.65
其中：1. 基金申购款	369,139,203.35	425,337,198.36	794,476,401.71
2. 基金赎回款	-195,804,273.10	-264,869,865.96	-460,674,139.06
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）	422,037,985.30	617,214,679.48	1,039,252,664.78

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：

\_\_\_\_\_  
赵学军  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
王红  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
常旭  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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

成分股(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。

#### 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(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

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。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、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产(质押式、买断式)；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

(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。

## 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	24,123,395.96
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	24,123,395.96

#### 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	927,418,056.78	857,582,628.52	-69,835,428.26
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	130,300.00	130,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	130,300.00	130,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	927,548,356.78	857,712,928.52	-69,835,428.26

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30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	34,580,720.00	-	-	
其中：股指期货投资	34,580,720.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	34,580,720.00	-	-	

注：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
IC1607	中证 500 股指期货 IC1607 合约	30	36,260,400.00	1,679,680.00
总额合计				1,679,680.00
减：可抵销期货暂收款				1,679,680.00
股指期货投资净额				-

#### 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

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金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	4,806.25
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	89.74
应收债券利息	32.84
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	3,523.28
合计	8,452.11

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 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	214,850.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	214,850.86

#### 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	323,767.18
可退替代款	-
应付替代款	580.44
应付指数使用费	63,480.04
其他	-
合计	387,827.66

#### 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	116,531,868.00	415,618,173.12
本期申购	38,700,000.00	138,025,963.10
本期赎回	-8,100,000.00	-28,889,155.08
本期末	147,131,868.00	524,754,981.14

#### 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	334,354,823.61	117,308,043.86	451,662,867.47
本期利润	-21,451,906.43	-134,995,579.39	-156,447,485.82
本期基金份额交易产生的变动数	86,370,934.48	-10,916,524.16	75,454,410.32
其中：基金申购款	109,027,638.65	-15,011,169.64	94,016,469.01
基金赎回款	-22,656,704.17	4,094,645.48	-18,562,058.69
本期已分配利润	-	-	-

本期末	399,273,851.66	-28,604,059.69	370,669,791.97
-----	----------------	----------------	----------------

#### 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	82,134.73
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	3,996.57
其他	49,607.43
合计	135,738.73

#### 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	-17,343,401.58
股票投资收益——赎回差价收入	-7,084,772.87
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-24,428,174.45

##### 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	178,099,854.63
减：卖出股票成本总额	195,443,256.21
买卖股票差价收入	-17,343,401.58

##### 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	47,451,213.77
减：现金支付赎回款总额	4,101,143.77

减：赎回股票成本总额	50,434,842.87
赎回差价收入	-7,084,772.87

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	735,265.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	647,000.00
减：应收利息总额	58.23
买卖债券差价收入	88,206.77

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
股指期货投资收益	1,384,440.00

#### 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	4,596,840.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,596,840.10

#### 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	-134,971,059.39
——股票投资	-134,971,059.39

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-24, 520. 00
——权证投资	-
——期货投资	-24, 520. 00
3. 其他	-
合计	-134, 995, 579. 39

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

#### 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	-60, 490. 21
证管费退还	-
其他	-
合计	-60, 490. 21

#### 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	474, 774. 37
银行间市场交易费用	-
合计	474, 774. 37

#### 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	44, 753. 80
信息披露费	149, 178. 12
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	3, 374. 63

指数使用费	117,459.11
上市年费	29,835.26
红利手续费	-
其他	-
合计	344,600.92

## 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，本基金无重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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
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
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

## 6.4.10 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。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

### 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,957,652.60	1,934,479.18
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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	391,530.55	386,895.81

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。

#### 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

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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。

#### 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	84,697,880.00	57.57%	50,497,880.00	43.33%

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	24,123,395.96	82,134.73	18,805,045.72	22,490.49

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本期（2016年1月1日至2016年6月30日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金未实施利润分配。

**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****6.4.12.1.1 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
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	未上市	12.98	12.98	7,078	91,872.44	91,872.44	
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	未上市	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	

**6.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印	2016年6月	2016年	未上市	100.00	100.00	1,303	130,300.00	130,300.00	网上申

	转债	月 8 日	7 月 1 日							购
--	----	-------	---------	--	--	--	--	--	--	---

#### 6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

#### 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 年 4 月 6 日	重大事项停牌	10.90	2016 年 7 月 14 日	11.32	117,400	1,391,189.35	1,279,660.00	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大事项停牌	8.92	-	-	284,090	2,490,824.42	2,534,082.80	-
000517	荣安地产	2016 年 6 月 14 日	重大事项停牌	4.84	2016 年 7 月 14 日	4.98	145,400	740,370.18	703,736.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项停牌	15.36	-	-	171,800	3,549,070.72	2,638,848.00	-
000582	北部湾港	2016 年 2 月 29 日	重大事项停牌	16.32	-	-	17,500	367,027.68	285,600.00	-
000636	风华高科	2016 年 3 月 15 日	重大事项停牌	8.84	2016 年 7 月 13 日	9.72	109,261	1,040,930.81	965,867.24	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项停牌	12.50	-	-	55,900	1,171,355.43	698,750.00	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	重大事项停牌	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	226,590	2,011,360.02	2,966,063.10	-
000975	银泰资源	2016 年 4 月 19 日	重大事项停牌	15.00	-	-	130,124	1,771,758.53	1,951,860.00	-
002190	成飞集成	2016 年 4 月 21 日	重大事项停牌	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	41,900	1,798,299.59	1,484,936.00	-
002249	大洋	2016	重大	11.97	2016	10.77	57,084	623,405.48	683,295.48	-

	电机	年 6 月 8 日	事项 停牌		年 7 月 28 日						
002266	浙富 控股	2016 年 5 月 25 日	重大 事项 停牌	5.35	-	-	337,357	2,614,122.67	1,804,859.95	-	
002373	千方 科技	2016 年 5 月 12 日	重大 事项 停牌	14.94	2016 年 8 月 16 日	16.43	108,068	2,333,084.33	1,614,535.92	-	
002512	达华 智能	2016 年 6 月 21 日	重大 事项 停牌	20.28	2016 年 7 月 21 日	19.38	100,100	1,967,478.64	2,030,028.00	-	
002663	普邦 园林	2016 年 4 月 27 日	重大 事项 停牌	7.36	-	-	167,092	1,289,550.05	1,229,797.12	-	
002672	东江 环保	2016 年 5 月 23 日	重大 事项 停牌	17.33	2016 年 7 月 15 日	19.06	99,700	1,767,075.67	1,727,801.00	-	
300032	金龙 机电	2016 年 6 月 28 日	重大 事项 停牌	20.10	2016 年 7 月 7 日	19.80	77,200	1,402,757.55	1,551,720.00	-	
300166	东方 国信	2016 年 6 月 8 日	重大 事项 停牌	27.47	-	-	49,900	1,334,920.15	1,370,753.00	-	
600166	福田 汽车	2016 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	5.52	2016 年 7 月 1 日	5.62	533,700	2,925,748.41	2,946,024.00	-	
600497	驰宏 锌锗	2016 年 6 月 13 日	重大 事项 停牌	9.97	2016 年 7 月 11 日	10.97	197,523	2,082,854.82	1,969,304.31	-	
600511	国药 股份	2016 年 2 月 18 日	重大 事项 停牌	27.42	2016 年 8 月 4 日	30.16	58,209	1,954,623.69	1,596,090.78	-	
600545	新疆 城建	2016 年 5 月 31 日	重大 事项 停牌	6.91	-	-	131,683	1,428,908.54	909,929.53	-	
600614	鼎立 股份	2016 年 4 月 25 日	重大 事项 停牌	8.14	-	-	147,002	1,476,596.49	1,196,596.28	-	
600640	号百 控股	2016 年 4 月 18 日	重大 事项 停牌	16.79	2016 年 8 月 22 日	18.44	51,500	1,021,082.46	864,685.00	-	
600654	中安 消	2016 年 5 月 19 日	重大 事项 停牌	18.54	2016 年 8 月 8 日	20.39	186,153	3,990,533.30	3,451,276.62	-	

600751	天海投资	2016年2月15日	重大事项停牌	6.11	2016年7月26日	6.72	62,500	587,410.27	381,875.00	-
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大事项停牌	7.58	2016年7月11日	8.10	258,425	2,537,086.34	1,958,861.50	-
600773	西藏城投	2016年6月30日	重大事项停牌	15.67	-	-	99,984	1,504,376.06	1,566,749.28	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大事项停牌	2.52	-	-	480,600	1,751,604.91	1,211,112.00	-
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大事项停牌	5.93	2016年7月22日	6.52	379,700	2,716,576.52	2,251,621.00	-
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	22,084	76,631.48	461,997.28	-

### 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

本期末（2016年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 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工作流程、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。

#### **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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%(上年度末：无)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

针对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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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 6.4.12.3 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。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

##### 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	24,123,395.96	-	-	-	24,123,395.96
结算备付金	7,444,390.32	-	-	-	7,444,390.32
存出保证金	41,706.02	-	-	7,252,080.00	7,293,786.02
交易性金融资产	-	-	130,300.00	857,582,628.52	857,712,928.52
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	-	-	-	8,452.11	8,452.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,609,492.30	-	130,300.00	864,843,160.63	896,582,952.93
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	-	-	-	125,500.02	125,500.02

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	358,334.40	358,334.40
应付托管费	-	-	-	71,666.88	71,666.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	214,850.86	214,850.86
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	387,827.66	387,827.66
负债总计	-	-	-	1,158,179.82	1,158,179.82
利率敏感度缺口	31,609,492.30	-	130,300.00	863,684,980.81	895,424,773.11
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	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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01% (2015 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 (2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

##### 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	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	857,582,628.52	95.77	838,418,099.14	96.67
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	857,582,628.52	95.77	838,418,099.14	96.67

#### 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）
	业绩比较基准上升 5%	44,144,441.31	43,201,692.56
	业绩比较基准下降 5%	-44,144,441.31	-43,201,692.56

#### 6.4.13.4.4 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。

#### 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 809,173,900.81 元，属于第二层次的余额为 48,539,027.71 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 731,824,840.96 元，第二层次 106,593,258.18 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，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。

## § 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	857,582,628.52	95.65
	其中：股票	857,582,628.52	95.65
2	固定收益投资	130,300.00	0.01
	其中：债券	130,300.00	0.01
	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	31,567,786.28	3.52
7	其他各项资产	7,302,238.13	0.81
	合计	896,582,952.93	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	16,206,953.99	1.81
B	采矿业	32,805,019.43	3.66
C	制造业	505,496,299.27	56.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,230,837.95	2.71
E	建筑业	25,688,917.44	2.87
F	批发和零售业	51,065,488.80	5.70
G	交通运输、仓储和邮政业	22,793,251.04	2.55
H	住宿和餐饮业	1,488,970.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,619,282.75	6.32
J	金融业	4,122,446.94	0.46
K	房地产业	56,327,746.81	6.29
L	租赁和商务服务业	12,176,469.28	1.36
M	科学研究和技术服务业	3,981,038.32	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	5,729,825.22	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,474,621.32	0.28
R	文化、体育和娱乐业	15,104,903.22	1.69
S	综合	10,218,084.68	1.14
	合计	846,530,156.46	94.54

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	698,750.00	0.08
C	制造业	3,098,166.56	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产	-	-

	和供应业		
E	建筑业	461,997.28	0.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	285,600.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,521,769.02	0.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,966,063.10	0.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	11,052,472.06	1.23

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	136,360	5,821,208.40	0.65
2	600584	长电科技	237,004	4,808,811.16	0.54
3	002405	四维图新	195,179	4,801,403.40	0.54
4	600522	DR 中天科	418,103	4,097,409.40	0.46
5	002340	格林美	466,166	4,088,275.82	0.46
6	300072	三聚环保	135,598	3,747,928.72	0.42
7	002049	紫光国芯	83,300	3,661,035.00	0.41
8	002085	万丰奥威	208,400	3,582,396.00	0.40
9	600201	生物股份	130,976	3,579,574.08	0.40
10	300113	顺网科技	93,476	3,548,348.96	0.40
11	600079	人福医药	205,900	3,452,943.00	0.39
12	600521	华海药业	141,508	3,441,474.56	0.38
13	002572	索菲亚	60,500	3,389,210.00	0.38
14	600503	华丽家族	366,600	3,361,722.00	0.38

15	600219	南山铝业	454,100	3,360,340.00	0.38
16	600525	长园集团	241,256	3,341,395.60	0.37
17	000661	长春高新	31,068	3,314,334.24	0.37
18	002426	胜利精密	333,600	3,285,960.00	0.37
19	600682	南京新百	113,600	3,234,192.00	0.36
20	002030	达安基因	116,088	3,227,246.40	0.36
21	300253	卫宁健康	130,070	3,212,729.00	0.36
22	601012	隆基股份	243,553	3,178,366.65	0.35
23	002439	启明星辰	120,300	3,107,349.00	0.35
24	600436	片仔癀	68,946	3,103,259.46	0.35
25	000887	中鼎股份	139,141	3,076,407.51	0.34
26	002508	老板电器	83,432	3,067,794.64	0.34
27	002400	省广股份	215,290	3,042,047.70	0.34
28	600978	宜华生活	271,349	3,022,827.86	0.34
29	600699	均胜电子	78,787	3,017,542.10	0.34
30	000997	新大陆	150,280	3,011,611.20	0.34
31	002179	中航光电	68,880	2,983,881.60	0.33
32	002004	华邦健康	325,848	2,974,992.24	0.33
33	600879	航天电子	190,242	2,963,970.36	0.33
34	002131	利欧股份	172,600	2,949,734.00	0.33
35	600166	福田汽车	533,700	2,946,024.00	0.33
36	000983	西山煤电	360,500	2,938,075.00	0.33
37	002273	水晶光电	104,850	2,934,751.50	0.33
38	000748	长城信息	149,100	2,925,342.00	0.33
39	600498	烽火通信	119,725	2,906,923.00	0.32
40	600482	中国动力	88,256	2,892,149.12	0.32
41	000988	华工科技	142,724	2,861,616.20	0.32
42	002701	奥瑞金	323,341	2,855,101.03	0.32
43	600664	哈药股份	342,210	2,836,920.90	0.32
44	002038	双鹭药业	94,000	2,836,920.00	0.32
45	000970	中科三环	194,900	2,827,999.00	0.32
46	600122	宏图高科	210,485	2,816,289.30	0.31
47	002310	东方园林	115,400	2,760,368.00	0.31
48	300088	长信科技	184,800	2,747,976.00	0.31
49	600158	中体产业	154,383	2,740,298.25	0.31
50	603019	中科曙光	68,600	2,731,652.00	0.31
51	000998	隆平高科	143,665	2,726,761.70	0.30
52	600635	大众公用	451,578	2,723,015.34	0.30
53	600478	科力远	224,509	2,709,823.63	0.30

54	000078	海王生物	363,253	2,698,969.79	0.30
55	600266	北京城建	215,100	2,686,599.00	0.30
56	000050	深天马 A	128,200	2,675,534.00	0.30
57	000656	金科股份	692,860	2,646,725.20	0.30
58	600143	金发科技	410,000	2,640,400.00	0.29
59	000547	航天发展	171,800	2,638,848.00	0.29
60	002299	圣农发展	101,600	2,631,440.00	0.29
61	002001	新 和 成	124,500	2,630,685.00	0.29
62	600643	爱建集团	263,016	2,569,666.32	0.29
63	600138	中青旅	132,440	2,558,740.80	0.29
64	002276	万马股份	128,911	2,553,726.91	0.29
65	600418	江淮汽车	200,786	2,545,966.48	0.28
66	300055	万邦达	138,500	2,522,085.00	0.28
67	002168	深圳惠程	178,625	2,515,040.00	0.28
68	600487	亨通光电	198,760	2,500,400.80	0.28
69	600655	豫园商城	230,200	2,495,368.00	0.28
70	600645	中源协和	70,600	2,480,884.00	0.28
71	300244	迪安诊断	75,034	2,474,621.32	0.28
72	002573	清新环境	146,200	2,473,704.00	0.28
73	600673	东阳光科	395,394	2,471,212.50	0.28
74	002191	劲嘉股份	212,352	2,461,159.68	0.27
75	600388	龙净环保	195,600	2,456,736.00	0.27
76	600312	平高电气	156,106	2,444,619.96	0.27
77	002223	鱼跃医疗	76,386	2,422,963.92	0.27
78	000930	中粮生化	220,627	2,422,484.46	0.27
79	000012	南 玻 A	210,200	2,408,892.00	0.27
80	600198	大唐电信	121,012	2,405,718.56	0.27
81	002714	牧原股份	47,300	2,390,069.00	0.27
82	600200	江苏吴中	122,502	2,372,863.74	0.26
83	002074	国轩高科	60,100	2,372,147.00	0.26
84	600094	大名城	248,800	2,363,600.00	0.26
85	000762	西藏矿业	95,239	2,354,308.08	0.26
86	000031	中粮地产	248,963	2,347,721.09	0.26
87	002595	豪迈科技	109,734	2,345,015.58	0.26
88	000697	炼石有色	102,435	2,340,639.75	0.26
89	002221	东华能源	190,972	2,327,948.68	0.26
90	600594	益佰制药	144,900	2,315,502.00	0.26
91	000581	威孚高科	114,800	2,314,368.00	0.26
92	600410	华胜天成	205,538	2,306,136.36	0.26

93	600240	华业资本	228,081	2,285,371.62	0.26
94	600435	北方导航	170,310	2,266,826.10	0.25
95	600151	航天机电	200,173	2,261,954.90	0.25
96	000979	中弘股份	822,752	2,254,340.48	0.25
97	601168	西部矿业	379,700	2,251,621.00	0.25
98	600851	海欣股份	168,894	2,247,979.14	0.25
99	002311	海大集团	140,984	2,223,317.68	0.25
100	600770	综艺股份	178,421	2,223,125.66	0.25
101	002048	宁波华翔	97,203	2,223,032.61	0.25
102	600687	刚泰控股	136,200	2,214,612.00	0.25
103	600884	杉杉股份	128,444	2,210,521.24	0.25
104	300274	阳光电源	90,300	2,203,320.00	0.25
105	600160	巨化股份	207,136	2,201,855.68	0.25
106	000671	阳光城	370,490	2,200,710.60	0.25
107	300010	立思辰	104,800	2,198,704.00	0.25
108	002308	威创股份	133,740	2,197,348.20	0.25
109	002410	广联达	153,600	2,196,480.00	0.25
110	600499	科达洁能	129,100	2,183,081.00	0.24
111	000566	海南海药	199,620	2,177,854.20	0.24
112	600811	东方集团	326,871	2,176,960.86	0.24
113	000860	顺鑫农业	91,347	2,172,231.66	0.24
114	000598	兴蓉环境	409,900	2,164,272.00	0.24
115	600601	方正科技	502,214	2,159,520.20	0.24
116	600516	方大炭素	236,000	2,157,040.00	0.24
117	600500	中化国际	238,300	2,154,232.00	0.24
118	600171	上海贝岭	123,275	2,141,286.75	0.24
119	002477	雏鹰农牧	358,661	2,141,206.17	0.24
120	000400	许继电气	138,400	2,136,896.00	0.24
121	002665	首航节能	270,515	2,134,363.35	0.24
122	600176	中国巨石	222,548	2,129,784.36	0.24
123	600366	宁波韵升	89,067	2,126,029.29	0.24
124	002657	中科金财	38,600	2,120,684.00	0.24
125	002268	卫士通	59,300	2,119,382.00	0.24
126	600755	厦门国贸	266,553	2,119,096.35	0.24
127	600392	盛和资源	129,100	2,114,658.00	0.24
128	300115	长盈精密	102,520	2,111,912.00	0.24
129	002353	杰瑞股份	109,500	2,111,160.00	0.24
130	002366	台海核电	39,600	2,111,076.00	0.24
131	000758	中色股份	270,300	2,094,825.00	0.23

132	002051	中工国际	106,100	2,086,987.00	0.23
133	600565	迪马股份	322,000	2,080,120.00	0.23
134	300199	翰宇药业	101,800	2,071,630.00	0.23
135	300273	和佳股份	108,120	2,070,498.00	0.23
136	000008	神州高铁	189,300	2,061,477.00	0.23
137	600259	广晟有色	35,911	2,056,263.86	0.23
138	002092	中泰化学	242,872	2,054,697.12	0.23
139	000727	华东科技	621,800	2,051,940.00	0.23
140	002155	湖南黄金	155,325	2,045,630.25	0.23
141	600633	浙报传媒	135,900	2,043,936.00	0.23
142	002512	达华智能	100,100	2,030,028.00	0.23
143	000690	宝新能源	298,661	2,024,921.58	0.23
144	300043	互动娱乐	142,300	2,016,391.00	0.23
145	601929	吉视传媒	499,000	2,010,970.00	0.22
146	600881	亚泰集团	416,359	2,006,850.38	0.22
147	300182	捷成股份	117,200	2,005,292.00	0.22
148	002022	科华生物	93,787	1,998,600.97	0.22
149	300026	红日药业	114,900	1,998,111.00	0.22
150	002444	巨星科技	98,320	1,997,862.40	0.22
151	600651	飞乐音响	157,786	1,997,570.76	0.22
152	002217	合力泰	130,100	1,990,530.00	0.22
153	300001	特锐德	91,700	1,988,973.00	0.22
154	000878	云南铜业	194,400	1,978,992.00	0.22
155	002013	中航机电	146,721	1,977,799.08	0.22
156	600216	浙江医药	149,900	1,977,181.00	0.22
157	002489	浙江永强	248,839	1,970,804.88	0.22
158	600497	驰宏锌锗	197,523	1,969,304.31	0.22
159	002271	东方雨虹	113,992	1,964,082.16	0.22
160	600759	洲际油气	258,425	1,958,861.50	0.22
161	000975	银泰资源	130,124	1,951,860.00	0.22
162	600611	大众交通	286,138	1,948,599.78	0.22
163	600528	中铁二局	166,853	1,937,163.33	0.22
164	603766	隆鑫通用	95,800	1,937,076.00	0.22
165	601311	骆驼股份	97,419	1,933,767.15	0.22
166	000066	长城电脑	151,335	1,929,521.25	0.22
167	600316	洪都航空	98,400	1,919,784.00	0.21
168	002250	联化科技	133,685	1,914,369.20	0.21
169	300291	华录百纳	80,972	1,905,271.16	0.21
170	601155	新城控股	203,200	1,881,632.00	0.21

171	600787	中储股份	251,670	1,869,908.10	0.21
172	600572	康恩贝	287,849	1,865,261.52	0.21
173	000021	深科技	168,256	1,852,498.56	0.21
174	000973	佛塑科技	177,061	1,848,516.84	0.21
175	600064	南京高科	123,640	1,848,418.00	0.21
176	600026	中海发展	312,996	1,846,676.40	0.21
177	600058	五矿发展	98,100	1,841,337.00	0.21
178	600056	中国医药	115,819	1,836,889.34	0.21
179	000028	国药一致	28,142	1,832,044.20	0.20
180	601880	大连港	307,808	1,819,145.28	0.20
181	002431	棕榈股份	157,500	1,811,250.00	0.20
182	002266	浙富控股	337,357	1,804,859.95	0.20
183	002073	软控股份	149,760	1,804,608.00	0.20
184	600108	亚盛集团	356,300	1,799,315.00	0.20
185	000592	平潭发展	265,200	1,798,056.00	0.20
186	002428	云南锗业	104,535	1,795,911.30	0.20
187	601699	潞安环能	273,700	1,789,998.00	0.20
188	300134	大富科技	59,660	1,787,413.60	0.20
189	600597	光明乳业	140,700	1,784,076.00	0.20
190	600325	华发股份	160,443	1,776,104.01	0.20
191	002325	洪涛股份	192,447	1,768,587.93	0.20
192	002161	远望谷	118,467	1,763,973.63	0.20
193	000786	北新建材	194,096	1,762,391.68	0.20
194	300287	飞利信	131,300	1,759,420.00	0.20
195	600426	华鲁恒升	199,588	1,758,370.28	0.20
196	000829	天音控股	131,562	1,756,352.70	0.20
197	000543	皖能电力	245,747	1,754,633.58	0.20
198	600348	阳泉煤业	275,100	1,752,387.00	0.20
199	000685	中山公用	168,759	1,751,718.42	0.20
200	002437	誉衡药业	201,209	1,750,518.30	0.20
201	000616	海航投资	327,170	1,747,087.80	0.20
202	600260	凯乐科技	106,769	1,746,740.84	0.20
203	002354	天神娱乐	20,000	1,745,600.00	0.19
204	002375	亚厦股份	153,000	1,728,900.00	0.19
205	002672	东江环保	99,700	1,727,801.00	0.19
206	600422	昆药集团	126,256	1,722,131.84	0.19
207	600073	上海梅林	150,129	1,718,977.05	0.19
208	600067	冠城大通	238,272	1,717,941.12	0.19
209	002624	完美环球	45,500	1,717,625.00	0.19

210	001696	宗申动力	157,171	1,716,307.32	0.19
211	600017	日照港	422,210	1,709,950.50	0.19
212	002699	美盛文化	51,000	1,702,890.00	0.19
213	601777	力帆股份	143,676	1,691,066.52	0.19
214	600536	中国软件	67,818	1,690,024.56	0.19
215	002368	太极股份	47,450	1,685,898.50	0.19
216	600298	安琪酵母	94,243	1,681,295.12	0.19
217	002371	七星电子	40,200	1,681,164.00	0.19
218	000667	美好集团	468,438	1,672,323.66	0.19
219	002002	鸿达兴业	88,900	1,671,320.00	0.19
220	002063	远光软件	108,110	1,670,299.50	0.19
221	600380	健康元	181,551	1,666,638.18	0.19
222	600717	天津港	191,600	1,665,004.00	0.19
223	600580	卧龙电气	147,419	1,652,566.99	0.18
224	000777	中核科技	70,133	1,652,333.48	0.18
225	000810	创维数字	91,300	1,649,791.00	0.18
226	000969	安泰科技	117,335	1,646,210.05	0.18
227	000418	小天鹅 A	50,449	1,645,646.38	0.18
228	600808	马钢股份	682,700	1,645,307.00	0.18
229	002603	以岭药业	103,200	1,641,912.00	0.18
230	600161	天坛生物	58,960	1,638,498.40	0.18
231	600039	四川路桥	414,484	1,633,066.96	0.18
232	600006	东风汽车	183,032	1,623,493.84	0.18
233	000488	晨鸣纸业	203,775	1,617,973.50	0.18
234	600320	振华重工	380,013	1,615,055.25	0.18
235	002373	千方科技	108,068	1,614,535.92	0.18
236	600557	康缘药业	98,643	1,610,840.19	0.18
237	600267	海正药业	132,500	1,609,875.00	0.18
238	000848	承德露露	134,299	1,604,873.05	0.18
239	600967	北方创业	150,536	1,600,197.68	0.18
240	002056	横店东磁	94,000	1,598,000.00	0.18
241	600511	国药股份	58,209	1,596,090.78	0.18
242	000006	深振业 A	216,157	1,593,077.09	0.18
243	002050	三花股份	164,796	1,590,281.40	0.18
244	600872	中炬高新	127,516	1,573,547.44	0.18
245	600773	西藏城投	99,984	1,566,749.28	0.17
246	002440	闰土股份	105,277	1,563,363.45	0.17
247	300147	香雪制药	105,850	1,559,170.50	0.17
248	600120	浙江东方	71,807	1,558,929.97	0.17

249	002640	跨境通	88,400	1,557,608.00	0.17
250	600765	中航重机	106,807	1,557,246.06	0.17
251	002589	瑞康医药	50,700	1,556,997.00	0.17
252	000563	陕国投 A	282,838	1,552,780.62	0.17
253	300032	金龙机电	77,200	1,551,720.00	0.17
254	600694	大商股份	40,238	1,549,967.76	0.17
255	000939	凯迪生态	172,244	1,541,583.80	0.17
256	002384	东山精密	77,517	1,539,487.62	0.17
257	600175	美都能源	327,315	1,538,380.50	0.17
258	002281	光迅科技	23,941	1,537,012.20	0.17
259	601010	文峰股份	295,918	1,535,814.42	0.17
260	000816	智慧农业	259,664	1,534,614.24	0.17
261	002642	荣之联	58,150	1,529,926.50	0.17
262	000926	福星股份	130,298	1,528,395.54	0.17
263	600183	生益科技	164,385	1,523,848.95	0.17
264	300202	聚龙股份	62,800	1,520,388.00	0.17
265	600970	中材国际	240,777	1,516,895.10	0.17
266	000681	视觉中国	64,100	1,515,965.00	0.17
267	600169	太原重工	388,224	1,514,073.60	0.17
268	600062	华润双鹤	82,819	1,508,962.18	0.17
269	600433	冠豪高新	174,500	1,507,680.00	0.17
270	600587	新华医疗	65,038	1,501,727.42	0.17
271	000519	江南红箭	118,110	1,501,178.10	0.17
272	000587	金洲慈航	97,141	1,498,885.63	0.17
273	600736	苏州高新	163,888	1,496,297.44	0.17
274	600086	东方金钰	154,360	1,494,204.80	0.17
275	600880	博瑞传播	175,100	1,490,101.00	0.17
276	600754	锦江股份	44,500	1,488,970.00	0.17
277	600220	江苏阳光	326,350	1,488,156.00	0.17
278	600187	国中水务	333,054	1,485,420.84	0.17
279	002190	成飞集成	41,900	1,484,936.00	0.17
280	600416	湘电股份	118,983	1,483,718.01	0.17
281	002414	高德红外	54,878	1,480,059.66	0.17
282	600517	置信电气	155,082	1,474,829.82	0.16
283	600869	智慧能源	142,976	1,472,652.80	0.16
284	002505	大康农业	376,590	1,468,701.00	0.16
285	002285	世联行	187,159	1,457,968.61	0.16
286	600639	浦东金桥	58,352	1,457,632.96	0.16
287	002396	星网锐捷	73,950	1,456,815.00	0.16

288	002025	航天电器	58,876	1,453,648.44	0.16
289	600537	亿晶光电	188,340	1,452,101.40	0.16
290	600270	外运发展	82,844	1,448,941.56	0.16
291	600289	亿阳信通	103,502	1,447,992.98	0.16
292	600575	皖江物流	333,600	1,444,488.00	0.16
293	002390	信邦制药	155,950	1,440,978.00	0.16
294	600993	马应龙	69,007	1,437,415.81	0.16
295	601000	唐山港	370,389	1,437,109.32	0.16
296	000961	中南建设	255,150	1,431,391.50	0.16
297	002681	奋达科技	84,780	1,431,086.40	0.16
298	002244	滨江集团	213,570	1,430,919.00	0.16
299	000600	建投能源	163,900	1,430,847.00	0.16
300	600458	时代新材	91,812	1,430,430.96	0.16
301	600409	三友化工	211,656	1,426,561.44	0.16
302	600277	亿利洁能	239,000	1,422,050.00	0.16
303	002011	盾安环境	125,907	1,420,230.96	0.16
304	603188	亚邦股份	79,000	1,418,840.00	0.16
305	002078	太阳纸业	290,207	1,416,210.16	0.16
306	600835	上海机电	73,775	1,415,742.25	0.16
307	002261	拓维信息	102,000	1,410,660.00	0.16
308	600563	法拉电子	30,870	1,405,202.40	0.16
309	002358	森源电气	90,946	1,403,296.78	0.16
310	000541	佛山照明	134,443	1,383,418.47	0.15
311	600729	重庆百货	55,746	1,382,500.80	0.15
312	000612	焦作万方	192,564	1,374,906.96	0.15
313	600850	华东电脑	47,810	1,371,668.90	0.15
314	300166	东方国信	49,900	1,370,753.00	0.15
315	000572	海马汽车	263,411	1,367,103.09	0.15
316	002635	安洁科技	35,496	1,362,336.48	0.15
317	600460	士兰微	171,129	1,357,052.97	0.15
318	600805	悦达投资	155,734	1,351,771.12	0.15
319	002106	莱宝高科	112,960	1,341,964.80	0.15
320	002254	泰和新材	97,748	1,341,102.56	0.15
321	000062	深圳华强	49,430	1,334,610.00	0.15
322	600125	铁龙物流	209,090	1,331,903.30	0.15
323	000513	丽珠集团	28,817	1,328,751.87	0.15
324	600284	浦东建设	126,850	1,324,314.00	0.15
325	002005	德豪润达	223,655	1,321,801.05	0.15
326	002498	汉缆股份	304,400	1,321,096.00	0.15

327	002028	思源电气	120,485	1,319,310.75	0.15
328	002588	史丹利	106,680	1,317,498.00	0.15
329	600809	山西汾酒	59,400	1,317,492.00	0.15
330	600894	广日股份	98,349	1,310,992.17	0.15
331	600750	江中药业	41,103	1,307,075.40	0.15
332	600112	天成控股	116,414	1,299,180.24	0.15
333	000669	金鸿能源	77,767	1,298,708.90	0.15
334	300257	开山股份	78,500	1,296,820.00	0.14
335	000937	冀中能源	242,500	1,290,100.00	0.14
336	600004	白云机场	105,217	1,289,960.42	0.14
337	000401	冀东水泥	117,400	1,279,660.00	0.14
338	002242	九阳股份	70,217	1,276,545.06	0.14
339	000861	海印股份	257,370	1,271,407.80	0.14
340	002269	美邦服饰	288,900	1,271,160.00	0.14
341	600351	亚宝药业	126,017	1,263,950.51	0.14
342	000099	中信海直	97,008	1,261,104.00	0.14
343	000596	古井贡酒	26,300	1,261,085.00	0.14
344	600826	兰生股份	48,099	1,259,231.82	0.14
345	601717	郑煤机	220,671	1,257,824.70	0.14
346	600859	王府井	82,500	1,257,300.00	0.14
347	002041	登海种业	80,528	1,251,405.12	0.14
348	600395	盘江股份	151,400	1,250,564.00	0.14
349	000869	张裕A	31,100	1,249,598.00	0.14
350	002344	海宁皮城	128,100	1,248,975.00	0.14
351	600823	世茂股份	183,860	1,248,409.40	0.14
352	002663	普邦园林	167,092	1,229,797.12	0.14
353	002093	国脉科技	98,900	1,227,349.00	0.14
354	002479	富春环保	109,283	1,227,248.09	0.14
355	002317	众生药业	101,360	1,215,306.40	0.14
356	002463	沪电股份	229,755	1,213,106.40	0.14
357	000158	常山股份	87,200	1,211,208.00	0.14
358	601005	重庆钢铁	480,600	1,211,112.00	0.14
359	000090	天健集团	136,940	1,205,072.00	0.13
360	600614	鼎立股份	147,002	1,196,596.28	0.13
361	000620	新华联	130,187	1,191,211.05	0.13
362	002727	一心堂	47,600	1,190,000.00	0.13
363	600496	精工钢构	276,959	1,179,845.34	0.13
364	000049	德赛电池	28,102	1,178,597.88	0.13
365	002309	中利科技	65,372	1,170,812.52	0.13

366	600831	广电网络	90,246	1,169,588.16	0.13
367	000528	柳工	180,171	1,167,508.08	0.13
368	600757	长江传媒	138,816	1,164,666.24	0.13
369	002551	尚荣医疗	49,784	1,163,949.92	0.13
370	600812	华北制药	186,559	1,158,531.39	0.13
371	300039	上海凯宝	113,870	1,158,057.90	0.13
372	000550	江铃汽车	47,435	1,155,516.60	0.13
373	002503	搜于特	92,436	1,148,055.12	0.13
374	600628	新世界	97,286	1,147,974.80	0.13
375	000897	津滨发展	295,963	1,145,376.81	0.13
376	000088	盐田港	177,725	1,144,549.00	0.13
377	000726	鲁泰A	102,819	1,142,319.09	0.13
378	600059	古越龙山	110,934	1,141,510.86	0.13
379	600300	维维股份	191,200	1,135,728.00	0.13
380	600292	远达环保	89,266	1,131,000.22	0.13
381	002128	露天煤业	149,536	1,123,015.36	0.13
382	002277	友阿股份	97,217	1,119,939.84	0.13
383	000680	山推股份	227,103	1,119,617.79	0.13
384	603077	和邦生物	227,331	1,118,468.52	0.12
385	600236	桂冠电力	166,400	1,118,208.00	0.12
386	000552	靖远煤电	313,900	1,104,928.00	0.12
387	002064	华峰氨纶	230,170	1,104,816.00	0.12
388	601666	平煤股份	270,100	1,104,709.00	0.12
389	600428	中远航运	196,452	1,102,095.72	0.12
390	000900	现代投资	162,009	1,091,940.66	0.12
391	000652	泰达股份	236,264	1,086,814.40	0.12
392	601886	江河集团	105,617	1,084,686.59	0.12
393	002118	紫鑫药业	73,200	1,076,040.00	0.12
394	002482	广田集团	141,883	1,075,473.14	0.12
395	002267	陕天然气	101,750	1,068,375.00	0.12
396	600509	天富能源	145,026	1,065,941.10	0.12
397	600282	南钢股份	453,200	1,065,020.00	0.12
398	000501	鄂武商A	67,699	1,062,197.31	0.12
399	600481	双良节能	185,340	1,061,998.20	0.12
400	000830	鲁西化工	234,583	1,060,315.16	0.12
401	600180	瑞茂通	69,750	1,053,922.50	0.12
402	002029	七匹狼	103,697	1,052,524.55	0.12
403	601908	京运通	137,090	1,051,480.30	0.12
404	600053	九鼎投资	29,700	1,028,511.00	0.11

405	601001	大同煤业	191,428	1,027,968.36	0.11
406	000426	兴业矿业	136,540	1,026,780.80	0.11
407	000417	合肥百货	124,876	1,010,246.84	0.11
408	600586	金晶科技	233,585	1,004,415.50	0.11
409	600761	安徽合力	98,763	996,518.67	0.11
410	603328	依顿电子	33,500	989,590.00	0.11
411	600456	宝钛股份	49,170	989,300.40	0.11
412	000931	中关村	123,459	985,202.82	0.11
413	600790	轻纺城	167,680	984,281.60	0.11
414	601126	四方股份	93,026	979,563.78	0.11
415	601801	皖新传媒	83,236	971,364.12	0.11
416	601678	滨化股份	190,187	968,051.83	0.11
417	000636	风华高科	109,261	965,867.24	0.11
418	601369	陕鼓动力	149,936	956,591.68	0.11
419	603806	福斯特	18,300	955,077.00	0.11
420	600720	祁连山	142,003	952,840.13	0.11
421	600825	新华传媒	119,470	949,786.50	0.11
422	601002	晋亿实业	108,793	946,499.10	0.11
423	002345	潮宏基	96,657	945,305.46	0.11
424	002332	仙琚制药	83,854	939,164.80	0.10
425	600748	上实发展	97,359	938,540.76	0.10
426	601233	桐昆股份	85,308	926,444.88	0.10
427	600551	时代出版	46,317	924,487.32	0.10
428	002251	步步高	71,199	923,451.03	0.10
429	600776	东方通信	109,334	917,312.26	0.10
430	603699	纽威股份	51,400	911,836.00	0.10
431	603883	老百姓	18,300	910,242.00	0.10
432	600545	新疆城建	131,683	909,929.53	0.10
433	600596	新安股份	124,318	906,278.22	0.10
434	000919	金陵药业	69,158	905,278.22	0.10
435	002698	博实股份	46,740	900,212.40	0.10
436	600329	中新药业	52,064	899,145.28	0.10
437	600195	中牧股份	49,098	898,493.40	0.10
438	002408	齐翔腾达	162,431	891,746.19	0.10
439	002342	巨力索具	153,722	891,587.60	0.10
440	600280	中央商场	131,334	887,817.84	0.10
441	000703	恒逸石化	89,600	884,352.00	0.10
442	002293	罗莱生活	64,170	879,129.00	0.10
443	603169	兰石重装	70,300	875,938.00	0.10

444	000877	天山股份	141,174	872,455.32	0.10
445	002181	粤传媒	106,178	871,721.38	0.10
446	002602	世纪华通	47,000	870,910.00	0.10
447	600657	信达地产	174,354	868,282.92	0.10
448	600640	号百控股	51,500	864,685.00	0.10
449	600251	冠农股份	107,744	861,952.00	0.10
450	601515	东风股份	76,259	861,726.70	0.10
451	603567	珍宝岛	38,900	849,965.00	0.09
452	002646	青青稞酒	41,117	847,421.37	0.09
453	002122	天马股份	135,882	845,186.04	0.09
454	601965	中国汽研	87,926	844,968.86	0.09
455	600864	哈投股份	74,952	841,710.96	0.09
456	600132	重庆啤酒	55,300	840,007.00	0.09
457	600141	兴发集团	72,700	837,504.00	0.09
458	600466	蓝光发展	97,700	836,312.00	0.09
459	000030	富奥股份	115,149	825,618.33	0.09
460	000631	顺发恒业	166,916	812,880.92	0.09
461	002194	武汉凡谷	63,594	812,731.32	0.09
462	002327	富安娜	95,400	811,854.00	0.09
463	600483	福能股份	71,000	805,850.00	0.09
464	600425	青松建化	189,245	804,291.25	0.09
465	600184	光电股份	34,850	789,004.00	0.09
466	600743	华远地产	166,280	786,504.40	0.09
467	603005	晶方科技	20,700	783,909.00	0.09
468	603001	奥康国际	36,745	781,198.70	0.09
469	603698	航天工程	28,203	773,890.32	0.09
470	600874	创业环保	99,442	772,664.34	0.09
471	600617	国新能源	66,900	766,674.00	0.09
472	601226	华电重工	79,200	726,264.00	0.08
473	002315	焦点科技	10,732	723,980.72	0.08
474	600335	国机汽车	64,550	723,605.50	0.08
475	600088	中视传媒	30,304	718,810.88	0.08
476	000517	荣安地产	145,400	703,736.00	0.08
477	600801	华新水泥	111,256	702,025.36	0.08
478	600397	安源煤业	158,555	700,813.10	0.08
479	600468	百利电气	49,451	699,731.65	0.08
480	603555	贵人鸟	28,000	698,040.00	0.08
481	002249	大洋电机	57,084	683,295.48	0.08
482	002392	北京利尔	137,100	677,274.00	0.08

483	600618	氯碱化工	51,446	675,485.98	0.08
484	002233	塔牌集团	81,851	657,263.53	0.07
485	002216	三全食品	73,588	632,856.80	0.07
486	600971	恒源煤电	114,353	631,228.56	0.07
487	600510	黑牡丹	71,815	626,226.80	0.07
488	002745	木林森	18,100	615,219.00	0.07
489	002238	天威视讯	42,347	612,761.09	0.07
490	600507	方大特钢	121,300	582,240.00	0.07
491	002461	珠江啤酒	46,618	541,701.16	0.06
492	002678	珠江钢琴	43,717	536,407.59	0.06
493	603589	口子窖	13,700	496,077.00	0.06
494	603198	迎驾贡酒	18,300	437,553.00	0.05
495	603568	伟明环保	17,200	397,320.00	0.04
496	600917	重庆燃气	39,100	389,045.00	0.04
497	600751	天海投资	62,500	381,875.00	0.04
498	603355	莱克电气	10,000	381,000.00	0.04
499	603025	大豪科技	11,200	375,984.00	0.04
500	600623	华谊集团	17,100	338,751.00	0.04

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

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	600654	中安消	186,153	3,451,276.62	0.39
2	000718	苏宁环球	226,590	2,966,063.10	0.33
3	000511	*ST 烯碳	284,090	2,534,082.80	0.28
4	000693	ST 华泽	55,900	698,750.00	0.08
5	601611	中国核建	22,084	461,997.28	0.05
6	000582	北部湾港	17,500	285,600.00	0.03
7	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
8	601966	玲珑轮胎	7,078	91,872.44	0.01
9	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
10	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
11	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
12	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
13	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
14	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
15	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00

16	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
17	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
18	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 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	300113	顺网科技	3,917,428.42	0.45
2	002426	胜利精密	3,273,266.24	0.38
3	002572	索菲亚	3,272,450.22	0.38
4	600682	南京新百	3,059,325.00	0.35
5	600166	福田汽车	2,934,729.15	0.34
6	002131	利欧股份	2,881,863.01	0.33
7	002038	双鹭药业	2,779,272.55	0.32
8	000983	西山煤电	2,689,179.96	0.31
9	002310	东方园林	2,677,684.34	0.31
10	600266	北京城建	2,574,132.00	0.30
11	000008	神州高铁	2,255,611.41	0.26
12	600687	刚泰控股	2,247,924.20	0.26
13	002353	杰瑞股份	2,238,995.17	0.26
14	000581	威孚高科	2,229,216.83	0.26
15	000598	兴蓉环境	2,199,792.88	0.25
16	002074	国轩高科	2,183,662.60	0.25
17	600565	迪马股份	2,165,183.00	0.25
18	600633	浙报传媒	2,130,566.11	0.25
19	000727	华东科技	2,114,706.61	0.24
20	000400	许继电气	2,098,912.67	0.24

### 7.4.2 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	600816	安信信托	3,784,932.99	0.44
2	600074	保千里	3,373,297.57	0.39
3	002018	华信国际	3,144,864.76	0.36
4	600376	首开股份	3,094,419.74	0.36
5	002174	游族网络	2,665,868.31	0.31
6	002143	印纪传媒	2,402,317.95	0.28
7	300122	智飞生物	2,391,327.59	0.28
8	300267	尔康制药	2,295,315.48	0.26
9	600797	浙大网新	2,290,090.60	0.26
10	002219	恒康医疗	2,260,650.20	0.26
11	300085	银之杰	2,235,385.59	0.26
12	600704	物产中大	2,110,707.41	0.24
13	600885	宏发股份	2,070,730.03	0.24
14	002180	艾派克	2,036,828.74	0.23
15	000732	泰禾集团	1,866,992.82	0.22
16	603369	今世缘	1,790,580.28	0.21
17	000650	仁和药业	1,686,538.15	0.19
18	002237	恒邦股份	1,676,479.82	0.19
19	600200	江苏吴中	1,587,489.00	0.18
20	002568	百润股份	1,576,048.09	0.18

### 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	189,306,090.25
卖出股票收入（成交）总额	178,099,854.63

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 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。

### 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）	130,300.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	130,300.00	0.01

## 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	1,303	130,300.00	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

## 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IC1607	中证 500 股指期货 IC1607 合约	30	36,260,400.00	1,679,680.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,679,680.00
股指期货投资本期收益（元）					1,384,440.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-24,520.00

### 7.10.2 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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。

#### 7.12.2

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。

#### 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	7,293,786.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,452.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	7,302,238.13

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-------	----------

				净值比例 (%)	
1	600654	中安消	3,451,276.62	0.39	重大事项停牌
2	000718	苏宁环球	2,966,063.10	0.33	重大事项停牌
3	000511	*ST 烯碳	2,534,082.80	0.28	重大事项停牌
4	000693	ST 华泽	698,750.00	0.08	重大事项停牌
5	601611	中国核建	461,997.28	0.05	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

#### 8.1.1 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
2,093	70,297.12	130,737,716.00	88.86%	16,394,152.00	11.14%

#### 8.1.2 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	84,697,880.00	57.57%

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。

### 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	中国证券金融股份有限公司	40,950,000.00	27.83%
2	天津珍熙美容实业有限公司	2,084,005.00	1.42%
3	百年人寿保险股份有限公司—传统 保险产品	1,500,000.00	1.02%
4	张鹤林	846,600.00	0.58%
5	中国银河证券股份有限公司	510,069.00	0.35%
6	朱婕	467,203.00	0.32%
7	杨碧茹	409,124.00	0.28%
8	开封市汴和耐火材料有限公司	400,000.00	0.27%
9	聂凤霞	378,000.00	0.26%
10	马玉敏	309,999.00	0.21%
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	84,697,880.00	57.57%

	资基金联接基金	
--	---------	--

### 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%

### 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、基金投资和相关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（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	116,531,868.00
本报告期基金总申购份额	38,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,100,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	147,131,868.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

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职务，聘请何如女士、陈正宪先生担任本基金基金经理职务。

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告，戴京焦女士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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
中信建投证券股份有限公司	2	365,694,795.64	100.00%	255,995.40	100.00%	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

### 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
中信建投证券股份有限公司	735,265.00	100.00%	-	-	-	-

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：宏源证券股份有限公司更名为申万宏源西部证券有限公司。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实中证 500ETF 基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 5 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 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

### 11.3 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 8 月 27 日