

诺安中证 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：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 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.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
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.....	9
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.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
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.....	15
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
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	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	诺安中证 500ETF
场内简称	诺安 500
基金主代码	510520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 7 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	107,090,964.00 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	2014-03-10

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金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。

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		诺安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	王永民
	联系电话	0755-83026688	010-66594896
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95566
传真		0755-83026677	010-66594942
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		秦维舟	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 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	-8,188,512.35
本期利润	-37,353,430.09
加权平均基金份额本期利润	-0.3482
本期加权平均净值利润率	-22.34%
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	64,845,890.60
期末可供分配基金份额利润	0.6055
期末基金资产净值	171,936,854.60
期末基金份额净值	1.6055
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	60.55%

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申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 期末可供分配利润是采用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

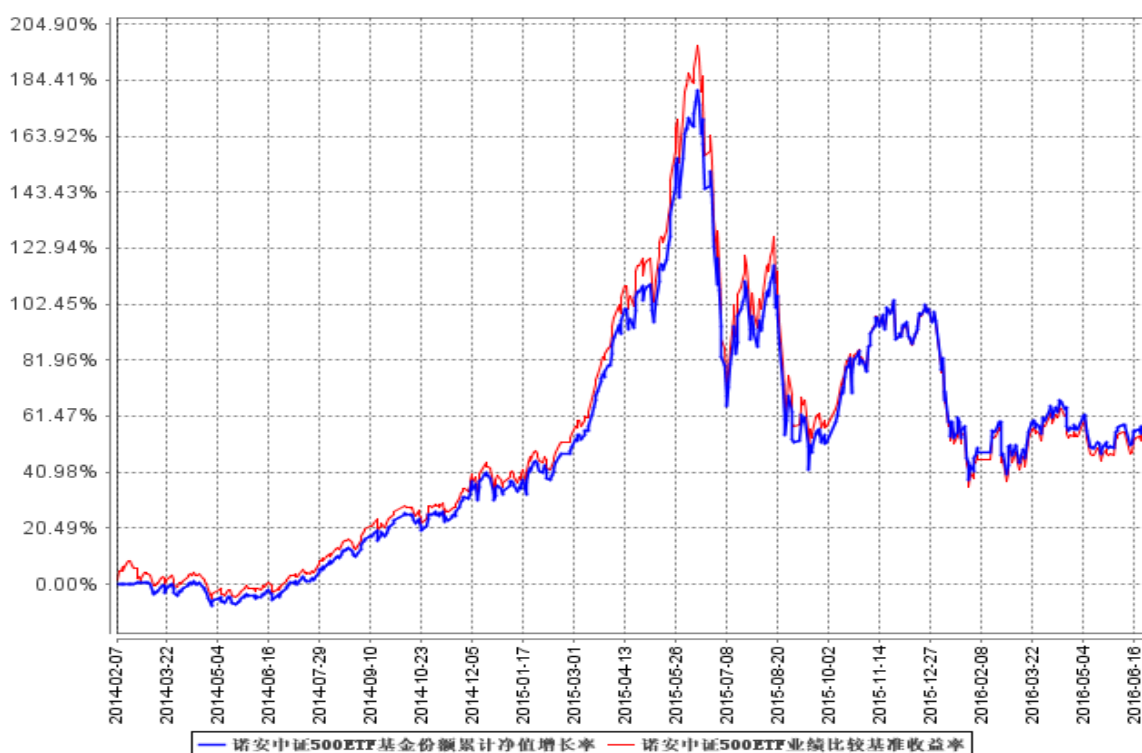
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.06%	1.48%	2.96%	1.55%	0.10%	-0.07%

过去三个月	-0.18%	1.59%	-0.53%	1.65%	0.35%	-0.06%
过去六个月	-18.23%	2.46%	-19.61%	2.56%	1.38%	-0.10%
过去一年	-26.71%	2.84%	-31.24%	2.92%	4.53%	-0.08%
自基金合同生效起至今	60.55%	2.19%	57.60%	2.28%	2.95%	-0.09%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的建仓期为 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型

开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金。

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		
梅律吾	指数组负责人，诺安中证 100 指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金	2014 年 2 月 7 日	-	19	硕士，具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司；2005 年 3 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监，现任指数组负责人。曾于 2007 年 11 月至 2009 年 10 月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2009 年 3 月至 2010 年 10 月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011 年 9 月至 2012 年 12 月担任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理，2012 年 7 月起任诺安中证 100 指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，

	基金经理				2014 年 2 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	------	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的

交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内，本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整，原因是在较小的最小申赎单位下，申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比产生了一定差异。

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 1.6055 元。本报告期基金份额净值增长率为-18.23%，同期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

展望未来一年，从技术角度，不要轻易看多大盘，也不应轻易看空小盘行情；从基本面角度，业绩的持续性确保了上市公司业绩大幅度变动的可能性很小，但是这并不意味着行情没有大的波动。

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》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本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务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、财务综合部、合规与风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组

会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定,本基金的收益分配原则为:每份基金份额享有同等分配权;基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,基金管理人有权进行收益分配;在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年至多分配 12 次,每次基金收益分配数额的确定原则为:使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率;本基金收益分配采取现金方式;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期末未有收益分配事项。

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

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安中证 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	6,903,740.12	8,631,379.13
结算备付金		17,187.17	143,586.45
存出保证金		24,451.76	101,310.14
交易性金融资产	6.4.7.2	165,377,904.03	197,566,607.87
其中：股票投资		165,377,904.03	197,566,607.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,718,062.20
应收利息	6.4.7.5	1,344.26	2,515.15
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		172,324,627.34	211,163,460.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
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		-	3,708,526.93
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		69,804.80	97,172.34
应付托管费		13,960.94	19,434.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	48,451.90	199,509.79
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	255,555.10	794,667.85
负债合计		387,772.74	4,819,311.39
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	107,090,964.00	105,090,964.00
未分配利润	6.4.7.10	64,845,890.60	101,253,185.55
所有者权益合计		171,936,854.60	206,344,149.55
负债和所有者权益总计		172,324,627.34	211,163,460.94

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6055 元，基金份额总额 107,090,964.00 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中证 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
一、收入		-36,481,891.77	15,735,143.20
1.利息收入		25,022.70	5,731.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,022.70	5,731.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,395,561.84	16,919,994.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,305,236.74	16,862,222.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	909,674.90	57,772.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-29,164,917.74	-1,395,533.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	53,565.11	204,950.43
减：二、费用		871,538.32	360,395.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	416,144.89	70,708.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	83,228.94	14,141.59
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	122,365.89	84,472.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	249,798.60	191,072.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,353,430.09	15,374,747.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,353,430.09	15,374,747.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中证 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）	105,090,964.00	101,253,185.55	206,344,149.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-37,353,430.09	-37,353,430.09
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）	2,000,000.00	946,135.14	2,946,135.14
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	3,241,342.35	9,241,342.35
2. 基金赎回款	-4,000,000.00	-2,295,207.21	-6,295,207.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	107,090,964.00	64,845,890.60	171,936,854.60
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	51,090,964.00	17,267,124.10	68,358,088.10

安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

(2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。

(3) 对证券投资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，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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	6,903,740.12
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,903,740.12

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	192,013,794.62	165,377,904.03	-26,635,890.59

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	192,013,794.62	165,377,904.03	-26,635,890.59

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	1,327.16
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	7.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.90
合计	1,344.26

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

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	48,451.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	48,451.90

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	148,622.80
指数使用费	100,000.00
可退替代款	6,932.30
合计	255,555.10

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	105,090,964.00	105,090,964.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-4,000,000.00	-4,000,000.00
本期末	107,090,964.00	107,090,964.00

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	115,766,520.33	-14,513,334.78	101,253,185.55
本期利润	-8,188,512.35	-29,164,917.74	-37,353,430.09
本期基金份额交易产生的变动数	2,290,159.86	-1,344,024.72	946,135.14
其中：基金申购款	6,498,694.62	-3,257,352.27	3,241,342.35
基金赎回款	-4,208,534.76	1,913,327.55	-2,295,207.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	109,868,167.84	-45,022,277.24	64,845,890.60

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	23,497.99
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	922.79
其他	601.92
合计	25,022.70

注：本报告期内“其他”为保证金利息收入。

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	-7,584,750.16
股票投资收益——赎回差价收入	-720,486.58
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-8,305,236.74

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	38,915,576.58
减：卖出股票成本总额	46,500,326.74
买卖股票差价收入	-7,584,750.16

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	6,295,207.21
减：现金支付赎回款总额	3,314,884.21
减：赎回股票成本总额	3,700,809.58
赎回差价收入	-720,486.58

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	909,674.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	909,674.90

6.4.7.17 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	-29,164,917.74
——股票投资	-29,164,917.74
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-29,164,917.74

6.4.7.18 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	-
替代损益	53,565.11
合计	53,565.11

注：替代损益是指投资者采用现金替代股票方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或未补票强制退款的替代股票在强制退款日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 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	122,365.89
银行间市场交易费用	-

合计	122,365.89
----	------------

6.4.7.20 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	19,890.78
信息披露费	98,896.76
上市费	29,835.26
银行汇划费	1,175.80
指数使用费	100,000.00
合计	249,798.60

注：（1）“上市费”为上交所向本基金征收，包括上市初费和上市年费。上市初费=基金总份额×0.01%(最高不超过 30,000.00 元)。上市年费为每月 5,000.00 元。

（2）指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000.00 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

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
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记及过户机构、直销机构
中国银行股份有限公司	托管人、代销机构
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金

注：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 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	416,144.89	70,708.13
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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5 \% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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、公休日等，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	上年度可比期间 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	83,228.94	14,141.59

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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
诺安中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金联接基金	100,000,000.00	93.3786%	98,000,000.00	93.2525%

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		上年度可比期间 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
中国银行股份有限公司	6,903,740.12	23,497.99	952,010.38	5,255.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按适用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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000718	苏宁 环球	2016 年 1 月 4 日	重大事项	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	51,460	495,660.08	673,611.40	-
600654	中安 消	2016 年 5 月 19 日	重大资产重组	18.54	2016 年 8 月 8 日	20.39	35,500	967,892.42	658,170.00	-
000547	航天 发展	2016 年 4 月 19 日	重大资产重组	15.36	-	-	35,900	781,327.57	551,424.00	-
600166	福田 汽车	2016 年 6 月 30 日	重大事项	5.52	2016 年 7 月 1 日	5.62	99,200	541,825.11	547,584.00	-
601168	西部 矿业	2016 年 2 月 1 日	重大资产重组	5.93	2016 年 7 月 22 日	6.52	88,300	625,108.44	523,619.00	-
000511	*ST 烯 碳	2016 年 4 月 26 日	重大事项	8.92	-	-	56,400	489,587.92	503,088.00	-
600497	驰宏 锌锗	2016 年 6 月 13 日	重大事项	9.97	2016 年 7 月 11 日	10.97	47,600	487,433.41	474,572.00	-
600511	国药 股份	2016 年 2 月 18 日	重大资产重组	27.42	2016 年 8 月 4 日	30.16	15,354	579,786.80	421,006.68	-
002512	达华 智能	2016 年 6 月 21 日	重大资产重组	20.28	2016 年 7 月 21 日	19.38	20,300	399,731.00	411,684.00	-
600759	洲际 油气	2016 年 6 月 27 日	重大资产重组	7.58	2016 年 7 月 11 日	8.10	50,967	492,475.13	386,329.86	-
000975	银泰 资源	2016 年 4 月 19 日	重大资产重组	15.00	-	-	25,700	341,175.97	385,500.00	-
002266	浙富	2016 年 5 月	重大事项	5.35	-	-	68,600	663,395.60	367,010.00	-

	控股	25 日									
002672	东江环保	2016 年 5 月 23 日	重大事项	17.33	2016 年 7 月 15 日	19.06	21,025	392,961.69	364,363.25	-	
002190	成飞集成	2016 年 4 月 21 日	重大事项	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	10,200	462,852.79	361,488.00	-	
600773	西藏城投	2016 年 6 月 30 日	重大资产重组	15.67	-	-	19,767	366,196.90	309,748.89	-	
300032	金龙机电	2016 年 6 月 28 日	重大事项	20.10	2016 年 7 月 7 日	19.80	14,900	266,233.59	299,490.00	-	
002373	千方科技	2016 年 5 月 12 日	重大资产重组	14.94	2016 年 8 月 16 日	16.43	18,800	368,647.07	280,872.00	-	
000401	冀东水泥	2016 年 4 月 6 日	重大资产重组	10.90	2016 年 7 月 14 日	11.32	25,500	296,661.70	277,950.00	-	
600614	鼎立股份	2016 年 4 月 26 日	重大事项	8.14	-	-	29,500	340,847.61	240,130.00	-	
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	重大资产重组	2.52	-	-	93,900	297,722.72	236,628.00	-	
002663	普邦园林	2016 年 4 月 28 日	重大事项	7.36	-	-	30,896	265,767.90	227,394.56	-	
000636	风华高科	2016 年 3 月 15 日	重大资产重组	8.84	2016 年 7 月 13 日	9.72	25,700	271,731.74	227,188.00	-	
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	15,000	252,883.18	187,500.00	-	
600545	新疆城建	2016 年 5 月 31 日	重大资产重组	6.91	-	-	26,400	361,385.05	182,424.00	-	
600640	号百控股	2016 年 4 月 18 日	重大资产重组	16.79	2016 年 8 月 22 日	18.44	10,300	248,094.99	172,937.00	-	
000517	荣安地产	2016 年 6 月 14 日	重大资产重组	4.84	2016 年 7 月 14 日	4.98	30,700	164,737.49	148,588.00	-	
002249	大洋电机	2016 年 6 月 8 日	重大资产重组	11.97	2016 年 7 月 28 日	10.77	10,500	131,263.03	125,685.00	-	
600751	天海投资	2016 年 2 月 15 日	重大事项	6.11	2016 年 7 月 26 日	6.72	15,500	144,980.98	94,705.00	-	
000582	北部湾港	2016 年 2 月 29 日	重大资产重组	16.32	-	-	5,100	99,391.76	83,232.00	-	

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，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，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, 本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险, 并设定适当的投资限额, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成: 第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导; 第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、合规与风险控制部所监控; 第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券, 不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估, 以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大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,因此除在附注‘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,其余均能及时变现。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,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约无固定期限且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响,导致基金收益水平变化而产生的风险,反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲,市场风险是开放式基金面临的重大风险,也往往是众多风险中最基本和最常见,也是最难防范的风险,其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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一定程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	6,903,740.12	-	-	-	-	6,903,740.12
结算备付金	17,187.17	-	-	-	-	17,187.17
存出保证金	24,451.76	-	-	-	-	24,451.76
交易性金融资产	-	-	-	-	165,377,904.03	165,377,904.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	1,344.26	1,344.26

应收申购款						
其他资产						
资产总计	6,945,379.05				-165,379,248.29	172,324,627.34
负债						
应付证券清算款						
应付赎回款						
应付管理人报酬					69,804.80	69,804.80
应付托管费					13,960.94	13,960.94
应付交易费用					48,451.90	48,451.90
其他负债					255,555.10	255,555.10
负债总计					387,772.74	387,772.74
利率敏感度缺口	6,945,379.05				-164,991,475.55	171,936,854.60
上年度末 2015 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	8,631,379.13					8,631,379.13
结算备付金	143,586.45					143,586.45
存出保证金	101,310.14					101,310.14
交易性金融资产					-197,566,607.87	197,566,607.87
应收证券清算款					4,718,062.20	4,718,062.20
应收利息					2,515.15	2,515.15
应收申购款						
其他资产						
资产总计	8,876,275.72				-202,287,185.22	211,163,460.94
负债						
应付证券清算款					3,708,526.93	3,708,526.93
应付赎回款						
应付管理人报酬					97,172.34	97,172.34
应付托管费					19,434.48	19,434.48
应付交易费用					199,509.79	199,509.79
其他负债					794,667.85	794,667.85
负债总计					4,819,311.39	4,819,311.39
利率敏感度缺口	8,876,275.72				-197,467,873.83	206,344,149.55

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无债券投资,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

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具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）。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资，本基金有效降低了投资组合的其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	165,377,904.03	96.19	197,566,607.87	95.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	165,377,904.03	96.19	197,566,607.87	95.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化 其他市场变量保持不变		
	分析	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
相关风险变量的变动		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%	8,277,532.56	10,717,585.78

	2. 业绩比较基准下降 5%	-8,277,532.56	-10,717,585.78
--	----------------	---------------	----------------

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布, 在 95%的置信度下, 使用过去一年的历史数据, 按照 VaR 正态算法, 计算未来一个交易日里, 基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信度 :95%		
	2. 观察期 :一年		
分析	风险价值 (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)
	基金投资组合的风险价值	5,669,207.30	10,574,610.56
	合计	5,669,207.30	10,574,610.56

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

(1) 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, 其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

②各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 156,201,565.39 元, 属于第二层级的余额为 9,176,338.64 元, 无属于第三层级的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层级 179,723,920.26 元, 第二层级 17,842,687.61 元, 无属于第三层级的余额)。

③公允价值所属层级间的重大变动

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、或属于非公开发行等情况, 本基金分别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二层级或第三层级, 上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

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	165,377,904.03	95.97
	其中：股票	165,377,904.03	95.97
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,920,927.29	4.02
7	其他各项资产	25,796.02	0.01
8	合计	172,324,627.34	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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	3,130,179.00	1.82
B	采矿业	6,755,577.86	3.93
C	制造业	96,823,434.93	56.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,599,905.53	2.68
E	建筑业	4,778,033.22	2.78
F	批发和零售业	9,887,816.00	5.75
G	交通运输、仓储和邮政业	4,546,765.07	2.64
H	住宿和餐饮业	334,600.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,700,086.87	6.22
J	金融业	799,996.80	0.47
K	房地产业	10,693,273.03	6.22
L	租赁和商务服务业	2,346,702.07	1.36

M	科学研究和技术服务业	792,988.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	1,245,975.25	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	484,806.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	2,997,061.90	1.74
S	综合	2,014,086.00	1.17
	合计	162,931,287.53	94.76

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	187,500.00	0.11
C	制造业	844,103.10	0.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	83,232.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	658,170.00	0.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	673,611.40	0.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,446,616.50	1.42

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	24,760	1,057,004.40	0.61
2	002405	四维图新	38,279	941,663.40	0.55
3	600584	长电科技	45,359	920,334.11	0.54
4	002340	格林美	91,000	798,070.00	0.46
5	300113	顺网科技	19,700	747,812.00	0.43
6	600522	DR 中天科	75,500	739,900.00	0.43
7	300072	三聚环保	25,364	701,060.96	0.41
8	600219	南山铝业	94,400	698,560.00	0.41
9	002085	万丰奥威	40,600	697,914.00	0.41
10	600201	生物股份	25,005	683,386.65	0.40
11	600079	人福医药	40,400	677,508.00	0.39
12	600436	片仔癀	15,000	675,150.00	0.39
13	600525	长园集团	48,600	673,110.00	0.39
14	002049	紫光国芯	14,922	655,821.90	0.38
15	002179	中航光电	15,040	651,532.80	0.38
16	002439	启明星辰	25,118	648,797.94	0.38
17	600503	华丽家族	68,900	631,813.00	0.37
18	300253	卫宁健康	25,340	625,898.00	0.36
19	002030	达安基因	22,363	621,691.40	0.36
20	600521	华海药业	25,320	615,782.40	0.36
21	002426	胜利精密	62,200	612,670.00	0.36
22	000997	新大陆	30,460	610,418.40	0.36
23	600498	烽火通信	25,000	607,000.00	0.35
24	002038	双鹭药业	19,900	600,582.00	0.35
25	601012	隆基股份	45,600	595,080.00	0.35
26	002131	利欧股份	34,500	589,605.00	0.34
27	603019	中科曙光	14,800	589,336.00	0.34
28	600699	均胜电子	15,191	581,815.30	0.34
29	000748	长城信息	29,400	576,828.00	0.34
30	600478	科力远	47,155	569,160.85	0.33
31	002400	省广股份	40,187	567,842.31	0.33
32	002273	水晶光电	20,150	563,998.50	0.33
33	600978	宜华生活	50,600	563,684.00	0.33
34	600682	南京新百	19,700	560,859.00	0.33
35	000983	西山煤电	68,700	559,905.00	0.33
36	000887	中鼎股份	25,300	559,383.00	0.33
37	002508	老板电器	15,037	552,910.49	0.32
38	000547	航天发展	35,900	551,424.00	0.32
39	002572	索菲亚	9,800	548,996.00	0.32

40	600166	福田汽车	99,200	547,584.00	0.32
41	600879	航天电子	35,100	546,858.00	0.32
42	002004	华邦健康	59,600	544,148.00	0.32
43	600664	哈药股份	65,060	539,347.40	0.31
44	600158	中体产业	30,300	537,825.00	0.31
45	000661	长春高新	5,030	536,600.40	0.31
46	600122	宏图高科	40,000	535,200.00	0.31
47	002001	新和成	25,300	534,589.00	0.31
48	002701	奥瑞金	60,316	532,590.28	0.31
49	300088	长信科技	35,400	526,398.00	0.31
50	000050	深天马 A	25,100	523,837.00	0.30
51	601168	西部矿业	88,300	523,619.00	0.30
52	300043	互动娱乐	36,900	522,873.00	0.30
53	002366	台海核电	9,800	522,438.00	0.30
54	002299	圣农发展	20,100	520,590.00	0.30
55	600635	大众公用	86,261	520,153.83	0.30
56	600645	中源协和	14,800	520,072.00	0.30
57	002573	清新环境	30,460	515,383.20	0.30
58	600611	大众交通	75,650	515,176.50	0.30
59	600418	江淮汽车	40,400	512,272.00	0.30
60	000970	中科三环	35,200	510,752.00	0.30
61	000988	华工科技	25,400	509,270.00	0.30
62	600143	金发科技	78,900	508,116.00	0.30
63	600487	亨通光电	40,050	503,829.00	0.29
64	002276	万马股份	25,400	503,174.00	0.29
65	002168	深圳惠程	35,600	501,248.00	0.29
66	000762	西藏矿业	20,175	498,726.00	0.29
67	600266	北京城建	39,900	498,351.00	0.29
68	600482	中国动力	15,200	498,104.00	0.29
69	600198	大唐电信	25,000	497,000.00	0.29
70	002714	牧原股份	9,800	495,194.00	0.29
71	600643	爱建集团	50,640	494,752.80	0.29
72	600200	江苏吴中	25,400	491,998.00	0.29
73	000078	海王生物	66,150	491,494.50	0.29
74	600655	豫园商城	45,300	491,052.00	0.29
75	600138	中青旅	25,338	489,530.16	0.28
76	000656	金科股份	127,400	486,668.00	0.28
77	300244	迪安诊断	14,700	484,806.00	0.28
78	000998	隆平高科	25,200	478,296.00	0.28

79	002191	劲嘉股份	41,200	477,508.00	0.28
80	002223	鱼跃医疗	15,040	477,068.80	0.28
81	600572	康恩贝	73,400	475,632.00	0.28
82	600673	东阳光科	76,092	475,575.00	0.28
83	600497	驰宏锌锗	47,600	474,572.00	0.28
84	600312	平高电气	30,300	474,498.00	0.28
85	600120	浙江东方	21,600	468,936.00	0.27
86	002310	东方园林	19,600	468,832.00	0.27
87	000012	南玻A	40,700	466,422.00	0.27
88	300055	万邦达	25,400	462,534.00	0.27
89	000697	炼石有色	20,000	457,000.00	0.27
90	600151	航天机电	40,000	452,000.00	0.26
91	600410	华胜天成	40,100	449,922.00	0.26
92	002477	雏鹰农牧	75,300	449,541.00	0.26
93	002048	宁波华翔	19,600	448,252.00	0.26
94	600388	龙净环保	35,600	447,136.00	0.26
95	600240	华业资本	44,500	445,890.00	0.26
96	000930	中粮生化	40,500	444,690.00	0.26
97	600770	综艺股份	35,400	441,084.00	0.26
98	000566	海南海药	40,100	437,491.00	0.25
99	002354	天神娱乐	5,000	436,400.00	0.25
100	600171	上海贝岭	25,000	434,250.00	0.25
101	600094	大名城	45,600	433,200.00	0.25
102	002022	科华生物	20,203	430,525.93	0.25
103	600160	巨化股份	40,467	430,164.21	0.25
104	002595	豪迈科技	20,000	427,400.00	0.25
105	600499	科达洁能	25,200	426,132.00	0.25
106	002221	东华能源	34,900	425,431.00	0.25
107	000979	中弘股份	154,640	423,713.60	0.25
108	000031	中粮地产	44,900	423,407.00	0.25
109	600511	国药股份	15,354	421,006.68	0.24
110	002410	广联达	29,400	420,420.00	0.24
111	002371	七星电子	10,000	418,200.00	0.24
112	300010	立思辰	19,900	417,502.00	0.24
113	000598	兴蓉环境	78,800	416,064.00	0.24
114	002308	威创股份	25,300	415,679.00	0.24
115	300115	长盈精密	20,160	415,296.00	0.24
116	603766	隆鑫通用	20,372	411,921.84	0.24
117	002013	中航机电	30,555	411,881.40	0.24

118	002512	达华智能	20,300	411,684.00	0.24
119	002444	巨星科技	20,255	411,581.60	0.24
120	600516	方大炭素	45,000	411,300.00	0.24
121	000671	阳光城	69,150	410,751.00	0.24
122	600601	方正科技	95,400	410,220.00	0.24
123	600392	盛和资源	24,900	407,862.00	0.24
124	300199	翰宇药业	20,000	407,000.00	0.24
125	600811	东方集团	61,100	406,926.00	0.24
126	600851	海欣股份	30,400	404,624.00	0.24
127	600755	厦门国贸	50,800	403,860.00	0.23
128	601311	骆驼股份	20,249	401,942.65	0.23
129	600594	益佰制药	25,100	401,098.00	0.23
130	600687	刚泰控股	24,600	399,996.00	0.23
131	600216	浙江医药	30,300	399,657.00	0.23
132	600435	北方导航	30,000	399,300.00	0.23
133	002311	海大集团	25,240	398,034.80	0.23
134	000581	威孚高科	19,600	395,136.00	0.23
135	002155	湖南黄金	30,000	395,100.00	0.23
136	600316	洪都航空	20,200	394,102.00	0.23
137	600881	亚泰集团	81,300	391,866.00	0.23
138	002074	国轩高科	9,900	390,753.00	0.23
139	000727	华东科技	118,400	390,720.00	0.23
140	000758	中色股份	50,400	390,600.00	0.23
141	002665	首航节能	49,480	390,397.20	0.23
142	600176	中国巨石	40,700	389,499.00	0.23
143	600694	大商股份	10,100	389,052.00	0.23
144	002092	中泰化学	45,800	387,468.00	0.23
145	600759	洲际油气	50,967	386,329.86	0.22
146	002217	合力泰	25,200	385,560.00	0.22
147	000975	银泰资源	25,700	385,500.00	0.22
148	300273	和佳股份	20,060	384,149.00	0.22
149	002353	杰瑞股份	19,900	383,672.00	0.22
150	600651	飞乐音响	30,300	383,598.00	0.22
151	601929	吉视传媒	95,000	382,850.00	0.22
152	600565	迪马股份	59,200	382,432.00	0.22
153	600064	南京高科	25,400	379,730.00	0.22
154	600058	五矿发展	20,200	379,154.00	0.22
155	000400	许继电气	24,500	378,280.00	0.22
156	600787	中储股份	50,900	378,187.00	0.22

157	000690	宝新能源	55,600	376,968.00	0.22
158	000066	长城电脑	29,400	374,850.00	0.22
159	600633	浙报传媒	24,900	374,496.00	0.22
160	600536	中国软件	15,000	373,800.00	0.22
161	000008	神州高铁	34,300	373,527.00	0.22
162	002624	完美环球	9,894	373,498.50	0.22
163	601155	新城控股	39,900	369,474.00	0.21
164	000973	佛塑科技	35,300	368,532.00	0.21
165	300274	阳光电源	15,100	368,440.00	0.21
166	002266	浙富控股	68,600	367,010.00	0.21
167	002672	东江环保	21,025	364,363.25	0.21
168	002489	浙江永强	45,784	362,609.28	0.21
169	002250	联化科技	25,300	362,296.00	0.21
170	002073	软控股份	30,000	361,500.00	0.21
171	002190	成飞集成	10,200	361,488.00	0.21
172	000777	中核科技	15,270	359,761.20	0.21
173	000860	顺鑫农业	15,100	359,078.00	0.21
174	600298	安琪酵母	20,100	358,584.00	0.21
175	600026	中海发展	60,700	358,130.00	0.21
176	600366	宁波韵升	15,000	358,050.00	0.21
177	601880	大连港	60,500	357,555.00	0.21
178	002368	太极股份	10,000	355,300.00	0.21
179	000878	云南铜业	34,900	355,282.00	0.21
180	002051	中工国际	17,960	353,273.20	0.21
181	300291	华录百纳	15,000	352,950.00	0.21
182	002437	誉衡药业	40,400	351,480.00	0.20
183	002431	棕榈股份	30,550	351,325.00	0.20
184	300026	红日药业	20,200	351,278.00	0.20
185	002640	跨境通	19,900	350,638.00	0.20
186	002268	卫士通	9,800	350,252.00	0.20
187	600426	华鲁恒升	39,630	349,140.30	0.20
188	600884	杉杉股份	20,260	348,674.60	0.20
189	600528	中铁二局	30,000	348,300.00	0.20
190	002428	云南锗业	20,100	345,318.00	0.20
191	002271	东方雨虹	20,000	344,600.00	0.20
192	600422	昆药集团	25,228	344,109.92	0.20
193	002056	横店东磁	20,240	344,080.00	0.20
194	600073	上海梅林	29,900	342,355.00	0.20
195	300182	捷成股份	20,000	342,200.00	0.20

196	000592	平潭发展	50,200	340,356.00	0.20
197	000829	天音控股	25,400	339,090.00	0.20
198	002315	焦点科技	5,000	337,300.00	0.20
199	000021	深科技	30,400	334,704.00	0.19
200	600754	锦江股份	10,000	334,600.00	0.19
201	002375	亚厦股份	29,500	333,350.00	0.19
202	600580	卧龙电气	29,639	332,253.19	0.19
203	600325	华发股份	30,000	332,100.00	0.19
204	001696	宗申动力	30,300	330,876.00	0.19
205	000028	国药一致	5,080	330,708.00	0.19
206	002699	美盛文化	9,900	330,561.00	0.19
207	600108	亚盛集团	65,200	329,260.00	0.19
208	600067	冠城大通	45,600	328,776.00	0.19
209	300287	飞利信	24,500	328,300.00	0.19
210	600260	凯乐科技	20,000	327,200.00	0.19
211	000418	小天鹅 A	10,000	326,200.00	0.19
212	000616	海航投资	61,000	325,740.00	0.19
213	002281	光迅科技	5,072	325,622.40	0.19
214	600380	健康元	35,400	324,972.00	0.19
215	002325	洪涛股份	35,340	324,774.60	0.19
216	000667	美好集团	90,900	324,513.00	0.19
217	600017	日照港	80,000	324,000.00	0.19
218	600348	阳泉煤业	50,800	323,596.00	0.19
219	601699	潞安环能	49,400	323,076.00	0.19
220	000543	皖能电力	45,240	323,013.60	0.19
221	300001	特锐德	14,829	321,641.01	0.19
222	002603	以岭药业	20,200	321,382.00	0.19
223	600967	北方创业	30,100	319,963.00	0.19
224	600597	光明乳业	25,200	319,536.00	0.19
225	600056	中国医药	20,100	318,786.00	0.19
226	600750	江中药业	10,000	318,000.00	0.19
227	000488	晨鸣纸业	40,000	317,600.00	0.18
228	600039	四川路桥	80,500	317,170.00	0.18
229	600808	马钢股份	131,200	316,192.00	0.18
230	000786	北新建材	34,530	313,532.40	0.18
231	000939	凯迪生态	35,000	313,250.00	0.18
232	600872	中炬高新	25,365	313,004.10	0.18
233	600993	马应龙	15,014	312,741.62	0.18
234	600006	XD 东风汽	35,000	310,450.00	0.18

235	002063	远光软件	20,063	309,973.35	0.18
236	600773	西藏城投	19,767	309,748.89	0.18
237	000587	金洲慈航	20,000	308,600.00	0.18
238	000685	中山公用	29,675	308,026.50	0.18
239	600416	湘电股份	24,700	308,009.00	0.18
240	600433	冠豪高新	35,600	307,584.00	0.18
241	000563	陕国投 A	55,600	305,244.00	0.18
242	600267	海正药业	25,100	304,965.00	0.18
243	002384	东山精密	15,232	302,507.52	0.18
244	000848	承德露露	25,312	302,478.40	0.18
245	600717	天津港	34,700	301,543.00	0.18
246	002440	闰土股份	20,300	301,455.00	0.18
247	002589	瑞康医药	9,800	300,958.00	0.18
248	000816	智慧农业	50,800	300,228.00	0.17
249	300134	大富科技	10,020	300,199.20	0.17
250	300032	金龙机电	14,900	299,490.00	0.17
251	300147	香雪制药	20,260	298,429.80	0.17
252	002161	远望谷	20,020	298,097.80	0.17
253	000926	福星股份	25,400	297,942.00	0.17
254	600320	振华重工	70,100	297,925.00	0.17
255	600557	康缘药业	18,240	297,859.20	0.17
256	600880	博瑞传播	35,000	297,850.00	0.17
257	000006	深振业 A	40,300	297,011.00	0.17
258	600169	太原重工	76,100	296,790.00	0.17
259	601801	皖新传媒	25,400	296,418.00	0.17
260	600765	中航重机	20,300	295,974.00	0.17
261	002396	星网锐捷	15,000	295,500.00	0.17
262	002050	三花股份	30,500	294,325.00	0.17
263	601777	力帆股份	24,900	293,073.00	0.17
264	600187	国中水务	65,500	292,130.00	0.17
265	000612	焦作万方	40,880	291,883.20	0.17
266	600835	上海机电	15,200	291,688.00	0.17
267	600086	东方金钰	30,100	291,368.00	0.17
268	600175	美都能源	61,100	287,170.00	0.17
269	600259	广晟有色	5,000	286,300.00	0.17
270	600517	置信电气	30,000	285,300.00	0.17
271	000969	安泰科技	20,300	284,809.00	0.17
272	002505	大康农业	72,780	283,842.00	0.17
273	600970	中材国际	45,000	283,500.00	0.16

274	600183	生益科技	30,500	282,735.00	0.16
275	600289	亿阳信通	20,200	282,598.00	0.16
276	600575	皖江物流	64,900	281,017.00	0.16
277	002373	千方科技	18,800	280,872.00	0.16
278	000961	中南建设	50,000	280,500.00	0.16
279	002390	信邦制药	30,300	279,972.00	0.16
280	601010	XD 文峰股	53,900	279,741.00	0.16
281	002254	泰和新材	20,340	279,064.80	0.16
282	600736	苏州高新	30,500	278,465.00	0.16
283	000401	冀东水泥	25,500	277,950.00	0.16
284	600161	天坛生物	10,000	277,900.00	0.16
285	600220	江苏阳光	60,800	277,248.00	0.16
286	600062	华润双鹤	15,200	276,944.00	0.16
287	002002	鸿达兴业	14,700	276,360.00	0.16
288	002011	盾安环境	24,500	276,360.00	0.16
289	002285	世联行	35,476	276,358.04	0.16
290	601000	唐山港	70,920	275,169.60	0.16
291	002657	中科金财	5,000	274,700.00	0.16
292	002242	九阳股份	15,100	274,518.00	0.16
293	002261	拓维信息	19,800	273,834.00	0.16
294	603188	亚邦股份	15,200	272,992.00	0.16
295	000062	深圳华强	10,100	272,700.00	0.16
296	002028	思源电气	24,720	270,684.00	0.16
297	002244	滨江集团	40,300	270,010.00	0.16
298	002414	高德红外	10,000	269,700.00	0.16
299	600409	三友化工	40,000	269,600.00	0.16
300	600537	亿晶光电	34,600	266,766.00	0.16
301	600894	广日股份	20,000	266,600.00	0.16
302	600277	亿利洁能	44,800	266,560.00	0.16
303	000810	创维数字	14,700	265,629.00	0.15
304	000600	建投能源	30,400	265,392.00	0.15
305	600805	悦达投资	30,500	264,740.00	0.15
306	600270	外运发展	15,100	264,099.00	0.15
307	002078	太阳纸业	54,100	264,008.00	0.15
308	600284	浦东建设	25,200	263,088.00	0.15
309	600826	兰生股份	10,000	261,800.00	0.15
310	603806	福斯特	5,000	260,950.00	0.15
311	000099	中信海直	20,000	260,000.00	0.15
312	600869	智慧能源	25,202	259,580.60	0.15

313	000572	海马汽车	50,000	259,500.00	0.15
314	000541	佛山照明	25,200	259,308.00	0.15
315	600125	铁龙物流	40,501	257,991.37	0.15
316	000519	江南红箭	20,110	255,598.10	0.15
317	002681	奋达科技	15,140	255,563.20	0.15
318	600351	亚宝药业	25,200	252,756.00	0.15
319	000861	海印股份	50,810	251,001.40	0.15
320	002093	国脉科技	20,225	250,992.25	0.15
321	000090	天健集团	28,480	250,624.00	0.15
322	002727	一心堂	10,000	250,000.00	0.15
323	600639	浦东金桥	10,000	249,800.00	0.15
324	603883	老百姓	5,000	248,700.00	0.14
325	300257	开山股份	15,032	248,328.64	0.14
326	000669	金鸿能源	14,868	248,295.60	0.14
327	600729	重庆百货	10,000	248,000.00	0.14
328	002588	史丹利	20,080	247,988.00	0.14
329	002025	航天电器	10,040	247,887.60	0.14
330	600395	盘江股份	30,000	247,800.00	0.14
331	600004	白云机场	20,200	247,652.00	0.14
332	002344	海宁皮城	25,400	247,650.00	0.14
333	002503	搜于特	19,820	246,164.40	0.14
334	000550	江铃汽车	10,060	245,061.60	0.14
335	300202	聚龙股份	10,100	244,521.00	0.14
336	002463	沪电股份	45,760	241,612.80	0.14
337	000937	冀中能源	45,400	241,528.00	0.14
338	600823	世茂股份	35,560	241,452.40	0.14
339	002498	汉缆股份	55,600	241,304.00	0.14
340	600614	鼎立股份	29,500	240,130.00	0.14
341	600460	士兰微	30,250	239,882.50	0.14
342	002317	众生药业	20,000	239,800.00	0.14
343	000596	古井贡酒	5,000	239,750.00	0.14
344	002269	美邦服饰	54,400	239,360.00	0.14
345	000681	视觉中国	10,100	238,865.00	0.14
346	002005	德豪润达	40,400	238,764.00	0.14
347	002106	莱宝高科	20,000	237,600.00	0.14
348	600628	新世界	20,100	237,180.00	0.14
349	600458	时代新材	15,200	236,816.00	0.14
350	601005	重庆钢铁	93,900	236,628.00	0.14
351	002551	尚荣医疗	10,060	235,202.80	0.14

352	002358	森源电气	15,212	234,721.16	0.14
353	600587	新华医疗	10,100	233,209.00	0.14
354	002041	登海种业	15,000	233,100.00	0.14
355	600859	王府井	15,270	232,714.80	0.14
356	000620	新华联	25,400	232,410.00	0.14
357	000513	丽珠集团	5,020	231,472.20	0.13
358	601717	郑煤机	40,600	231,420.00	0.13
359	000501	鄂武商 A	14,700	230,643.00	0.13
360	600563	法拉电子	5,000	227,600.00	0.13
361	000528	柳 工	35,100	227,448.00	0.13
362	002663	普邦园林	30,896	227,394.56	0.13
363	000088	盐 田 港	35,300	227,332.00	0.13
364	000636	风华高科	25,700	227,188.00	0.13
365	002479	富春环保	20,200	226,846.00	0.13
366	600180	瑞茂通	15,000	226,650.00	0.13
367	603077	和邦生物	45,800	225,336.00	0.13
368	000680	山推股份	45,700	225,301.00	0.13
369	603567	珍宝岛	10,300	225,055.00	0.13
370	000726	鲁 泰 A	20,201	224,433.11	0.13
371	600112	天成控股	20,088	224,182.08	0.13
372	600809	山西汾酒	10,100	224,018.00	0.13
373	002128	露天煤业	29,400	220,794.00	0.13
374	002064	华峰氨纶	45,800	219,840.00	0.13
375	600812	华北制药	35,280	219,088.80	0.13
376	000897	津滨发展	56,000	216,720.00	0.13
377	002118	紫鑫药业	14,700	216,090.00	0.13
378	600496	精工钢构	50,320	214,363.20	0.12
379	000049	德赛电池	5,050	211,797.00	0.12
380	600757	长江传媒	25,200	211,428.00	0.12
381	601126	四方股份	20,000	210,600.00	0.12
382	600300	维维股份	35,400	210,276.00	0.12
383	000158	常山股份	15,100	209,739.00	0.12
384	600059	古越龙山	20,358	209,483.82	0.12
385	000652	泰达股份	45,500	209,300.00	0.12
386	601886	江河集团	20,300	208,481.00	0.12
387	000552	靖远煤电	59,200	208,384.00	0.12
388	002646	青青稞酒	10,046	207,048.06	0.12
389	601666	平煤股份	50,600	206,954.00	0.12
390	002267	陕天然气	19,700	206,850.00	0.12

391	002029	七匹狼	20,200	205,030.00	0.12
392	000417	合肥百货	25,300	204,677.00	0.12
393	000900	现代投资	30,340	204,491.60	0.12
394	300039	上海凯宝	20,080	204,213.60	0.12
395	000830	鲁西化工	45,100	203,852.00	0.12
396	600456	宝钛股份	10,099	203,191.88	0.12
397	600481	双良节能	35,400	202,842.00	0.12
398	600761	安徽合力	20,100	202,809.00	0.12
399	600282	南钢股份	86,200	202,570.00	0.12
400	000931	中关村	25,300	201,894.00	0.12
401	600236	桂冠电力	30,000	201,600.00	0.12
402	600825	新华传媒	25,300	201,135.00	0.12
403	000869	张裕A	5,000	200,900.00	0.12
404	600428	中远航运	35,600	199,716.00	0.12
405	600551	时代出版	10,000	199,600.00	0.12
406	002251	步步高	15,220	197,403.40	0.11
407	002642	荣之联	7,500	197,325.00	0.11
408	600831	广电网络	15,200	196,992.00	0.11
409	000919	金陵药业	15,000	196,350.00	0.11
410	002345	潮宏基	20,020	195,795.60	0.11
411	600586	金晶科技	45,500	195,650.00	0.11
412	002698	博实股份	10,121	194,930.46	0.11
413	600748	上实发展	20,100	193,764.00	0.11
414	601369	陕鼓动力	30,100	192,038.00	0.11
415	002635	安洁科技	5,000	191,900.00	0.11
416	600292	远达环保	15,140	191,823.80	0.11
417	601908	京运通	25,000	191,750.00	0.11
418	002482	广田集团	25,277	191,599.66	0.11
419	000426	兴业矿业	25,400	191,008.00	0.11
420	603355	莱克电气	5,000	190,500.00	0.11
421	000877	天山股份	30,760	190,096.80	0.11
422	603005	晶方科技	5,000	189,350.00	0.11
423	601001	大同煤业	35,200	189,024.00	0.11
424	600850	华东电脑	6,565	188,349.85	0.11
425	002602	世纪华通	10,100	187,153.00	0.11
426	600509	天富能源	25,400	186,690.00	0.11
427	603169	兰石重装	14,800	184,408.00	0.11
428	600195	中牧股份	10,000	183,000.00	0.11
429	600545	新疆城建	26,400	182,424.00	0.11

430	600596	新安股份	25,000	182,250.00	0.11
431	603589	口子窖	5,000	181,050.00	0.11
432	002309	中利科技	10,100	180,891.00	0.11
433	603699	纽威股份	10,100	179,174.00	0.10
434	600790	轻纺城	30,500	179,035.00	0.10
435	601678	滨化股份	35,100	178,659.00	0.10
436	600657	信达地产	35,594	177,258.12	0.10
437	601002	晋亿实业	20,300	176,610.00	0.10
438	002342	巨力索具	30,200	175,160.00	0.10
439	600329	中新药业	10,141	175,135.07	0.10
440	603568	伟明环保	7,550	174,405.00	0.10
441	600466	蓝光发展	20,300	173,768.00	0.10
442	600053	九鼎投资	5,000	173,150.00	0.10
443	600617	国新能源	15,100	173,046.00	0.10
444	600640	号百控股	10,300	172,937.00	0.10
445	600141	兴发集团	15,000	172,800.00	0.10
446	002277	友阿股份	15,000	172,800.00	0.10
447	601515	东风股份	15,200	171,760.00	0.10
448	600720	祁连山	25,400	170,434.00	0.10
449	002327	富安娜	20,000	170,200.00	0.10
450	002745	木林森	5,000	169,950.00	0.10
451	600776	东方通信	20,200	169,478.00	0.10
452	002332	仙琚制药	15,100	169,120.00	0.10
453	600280	中央商场	25,000	169,000.00	0.10
454	600864	哈投股份	15,000	168,450.00	0.10
455	600483	福能股份	14,800	167,980.00	0.10
456	002408	齐翔腾达	30,578	167,873.22	0.10
457	603025	大豪科技	5,000	167,850.00	0.10
458	002181	粤传媒	20,220	166,006.20	0.10
459	601233	桐昆股份	15,000	162,900.00	0.09
460	600251	XD冠农股	20,098	160,784.00	0.09
461	002122	天马股份	25,300	157,366.00	0.09
462	600874	创业环保	20,000	155,400.00	0.09
463	600132	XD重庆啤	10,100	153,419.00	0.09
464	600425	青松建化	35,400	150,450.00	0.09
465	000703	恒逸石化	15,100	149,037.00	0.09
466	000631	顺发恒业	30,554	148,797.98	0.09
467	000517	荣安地产	30,700	148,588.00	0.09
468	603328	依顿电子	5,000	147,700.00	0.09

469	601965	中国汽研	15,000	144,150.00	0.08
470	000030	富奥股份	20,000	143,400.00	0.08
471	600743	华远地产	30,200	142,846.00	0.08
472	600468	百利电气	10,000	141,500.00	0.08
473	603698	航天工程	5,000	137,200.00	0.08
474	002293	罗莱生活	10,000	137,000.00	0.08
475	601226	华电重工	14,800	135,716.00	0.08
476	600397	安源煤业	30,500	134,810.00	0.08
477	600618	氯碱化工	10,100	132,613.00	0.08
478	002216	三全食品	15,268	131,304.80	0.08
479	600510	黑牡丹	15,000	130,800.00	0.08
480	002194	武汉凡谷	10,100	129,078.00	0.08
481	002249	大洋电机	10,500	125,685.00	0.07
482	002392	北京利尔	25,300	124,982.00	0.07
483	600801	华新水泥	19,800	124,938.00	0.07
484	603555	贵人鸟	5,000	124,650.00	0.07
485	002678	珠江钢琴	10,000	122,700.00	0.07
486	002233	塔牌集团	15,200	122,056.00	0.07
487	600507	方大特钢	25,400	121,920.00	0.07
488	600088	中视传媒	5,070	120,260.40	0.07
489	603198	迎驾贡酒	5,000	119,550.00	0.07
490	002461	珠江啤酒	10,000	116,200.00	0.07
491	600184	光电股份	5,046	114,241.44	0.07
492	600335	国机汽车	10,000	112,100.00	0.07
493	600971	恒源煤电	20,100	110,952.00	0.06
494	603001	奥康国际	5,000	106,300.00	0.06
495	600623	华谊集团	5,000	99,050.00	0.06
496	600751	天海投资	15,500	94,705.00	0.06
497	002238	天威视讯	5,944	86,009.68	0.05
498	600917	重庆燃气	5,000	49,750.00	0.03

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	000718	苏宁环球	51,460	673,611.40	0.39
2	600654	中安消	35,500	658,170.00	0.38
3	000511	*ST 烯碳	56,400	503,088.00	0.29
4	000982	中银绒业	44,100	265,923.00	0.15

5	000693	ST 华泽	15,000	187,500.00	0.11
6	000582	北部湾港	5,100	83,232.00	0.05
7	002018	华信国际	4,180	39,710.00	0.02
8	002219	恒康医疗	3,202	35,382.10	0.02

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	600654	中安消	817,734.00	0.40
2	300113	顺网科技	812,456.08	0.39
3	000748	长城信息	649,898.00	0.31
4	002426	胜利精密	622,417.45	0.30
5	002038	双鹭药业	607,526.00	0.29
6	600978	宜华生活	586,732.00	0.28
7	002131	利欧股份	585,395.00	0.28
8	600166	福田汽车	552,749.00	0.27
9	002572	索菲亚	548,022.00	0.27
10	600682	南京新百	533,201.00	0.26
11	002366	台海核电	522,255.57	0.25
12	300244	迪安诊断	518,512.00	0.25
13	000983	西山煤电	511,357.00	0.25
14	600266	北京城建	491,649.00	0.24
15	000511	*ST 烯碳	467,996.00	0.23
16	002310	东方园林	455,290.00	0.22
17	600026	中海发展	452,535.00	0.22
18	002353	杰瑞股份	429,182.00	0.21
19	000598	兴蓉环境	425,447.00	0.21
20	002368	太极股份	423,969.00	0.21

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，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	600816	安信信托	743,635.10	0.36

2	600074	保千里	690,695.50	0.33
3	600376	首开股份	623,914.90	0.30
4	300267	尔康制药	561,161.38	0.27
5	600797	浙大网新	481,741.50	0.23
6	300122	智飞生物	480,018.56	0.23
7	002180	艾派克	472,981.60	0.23
8	002143	印纪传媒	442,551.54	0.21
9	300085	银之杰	436,822.60	0.21
10	002174	游族网络	427,620.50	0.21
11	002568	百润股份	391,641.20	0.19
12	000829	天音控股	391,412.08	0.19
13	600704	物产中大	390,238.40	0.19
14	000732	泰禾集团	384,993.00	0.19
15	000028	国药一致	382,615.50	0.19
16	002657	中科金财	363,141.00	0.18
17	600885	宏发股份	361,892.68	0.18
18	603369	今世缘	360,797.50	0.17
19	000650	仁和药业	332,035.84	0.16
20	002237	恒邦股份	323,189.60	0.16

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，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	42,963,945.22
卖出股票收入（成交）总额	38,915,576.58

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定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	24,451.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,344.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	25,796.02
---	----	-----------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000718	苏宁环球	673,611.40	0.39	重大事项
2	600654	中安消	658,170.00	0.38	重大资产重组
3	000511	*ST 烯碳	503,088.00	0.29	重大事项
4	000693	ST 华泽	187,500.00	0.11	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
265	404,116.85	100,011,023.00	93.39%	7,079,941.00	6.61%

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	李光英	1,680,000.00	1.57%
2	徐军	450,102.00	0.42%
3	张容丽	444,900.00	0.28%
4	张容丽	300,600.00	0.19%
5	许良	205,018.00	0.18%

6	林宏	193,543.00	0.18%
7	何凤珍	190,799.00	0.15%
8	肖小兰	155,400.00	0.15%
9	沈恺	150,000.00	0.14%
10	凌军	135,901.00	0.13%
	中国银行股份有限公司—诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资	100,000,000.00	93.38%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本开放式基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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（2014年2月7日）基金份额总额	879,090,964.00
本报告期期初基金份额总额	105,090,964.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	107,090,964.00

§ 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，未召开本基金的基金份额持有人大会，没有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

本报告期内，基金管理人、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

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，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

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

2016 年 6 月，针对深圳证监局向公司出具的《关于对诺安基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，以及对相关人员的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
中信证券	2	81,809,631.40	100.00%	76,188.40	100.00%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1)、实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2)、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3)、经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4)、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5)、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6)、研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

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

本基金租用证券公司交易单元无其他证券投资。

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	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	基金管理人网站	2016年1月4日
2	诺安基金管理有限公司旗下基金2015年最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告	基金管理人网站	2016年1月5日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016年1月6日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	基金管理人网站	2016年1月7日
5	诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金2015年第4季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2016年1月21日
6	诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要2016年第1期	《证券时报》、 《中国证券报》	2016年3月23日
7	诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2016年第1期	基金管理人网站	2016年3月23日
8	诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金2015年年度报告摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2016年3月30日
9	诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金2015年年度报告	基金管理人网站	2016年3月30日
10	诺安中证500交易型开放指数证券投资基金2016年第1季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2016年4月20日
11	诺安基金管理有限公司关于直销账户变更的公告	《中国证券报》	2016年6月14日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公开募集的文件。

②《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

③《诺安中证 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、营业执照。

⑤诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告正文。

⑥报告期内诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日