

华夏中证 500 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示及目录.....                            | 1  |
| §2 基金简介.....                               | 3  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....               | 4  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                       | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                            | 5  |
| 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....                | 6  |
| §4 管理人报告.....                              | 6  |
| §5 托管人报告.....                              | 12 |
| §6 审计报告.....                               | 12 |
| §7 年度财务报表.....                             | 13 |
| 7.1 资产负债表.....                             | 13 |
| 7.2 利润表.....                               | 15 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 16 |
| 7.4 报表附注.....                              | 17 |
| §8 投资组合报告.....                             | 39 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                        | 39 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 40 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 41 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 54 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 56 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....    | 56 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 57 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 57 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....    | 57 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 57 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 58 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                         | 58 |
| §9 基金份额持有人信息.....                          | 59 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 59 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人.....                      | 59 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 60 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....      | 60 |
| §10 开放式基金份额变动.....                         | 60 |
| §11 重大事件揭示.....                            | 60 |
| §12 备查文件目录.....                            | 63 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 华夏中证 500ETF             |
| 场内简称         | 中证 500                  |
| 基金主代码        | 512500                  |
| 交易代码         | 512500                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2015 年 5 月 5 日          |
| 基金管理人        | 华夏基金管理有限公司              |
| 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   | 312,408,794 份           |
| 基金合同存续期      | 不定期                     |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                 |
| 上市日期         | 2015 年 5 月 29 日         |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略   | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。                                   |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为“中证 500 指数”。   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。 |

### 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          |      | 华夏基金管理有限公司           | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张静                   | 田青                   |
|             | 联系电话 | 400-818-6666         | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 400-818-6666         | 010-67595096         |
| 传真          |      | 010-63136700         | 010-66275853         |
| 注册地址        |      | 北京市顺义区天竺空港工业区 A 区    | 北京市西城区金融大街 25 号      |
| 办公地址        |      | 北京市西城区金融大街 33 号通     | 北京市西城区闹市口大           |

|       |             |             |
|-------|-------------|-------------|
|       | 泰大厦 B 座 8 层 | 街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 100033      | 100033      |
| 法定代表人 | 杨明辉         | 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      | 《证券时报》           |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ChinaAMC.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                             |
|--------|----------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司       | 北京市西城区太平桥大街 17 号                 |
| 注册登记机构 | 华夏基金管理有限公司           | 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层      |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016 年          | 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|-----------------|---|
| 本期已实现收益       | -101,181,524.58 | -112,694,712.19                           |
| 本期利润          | -184,149,162.43 | -270,682,030.94                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.5688         | -0.5185                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -19.08%         | -18.23%                                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -16.45%         | -20.61%                                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末         | 2015 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | -480,546,314.30 | -297,584,459.60                           |
| 期末可供分配基金份额利润  | -1.5382         | -0.9417                                   |
| 期末基金资产净值      | 946,712,657.79  | 1,146,121,335.95                          |
| 期末基金份额净值      | 3.0304          | 3.6269                                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2016 年末         | 2015 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | -33.67%         | -20.61%                                   |

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -0.97%   | 0.81%       | -1.02%     | 0.83%         | 0.05%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 2.65%    | 0.91%       | 2.29%      | 0.92%         | 0.36%  | -0.01% |
| 过去一年       | -16.45%  | 1.84%       | -17.78%    | 1.90%         | 1.33%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -33.67%  | 2.43%       | -26.40%    | 2.53%         | -7.27% | -0.10% |

#### 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

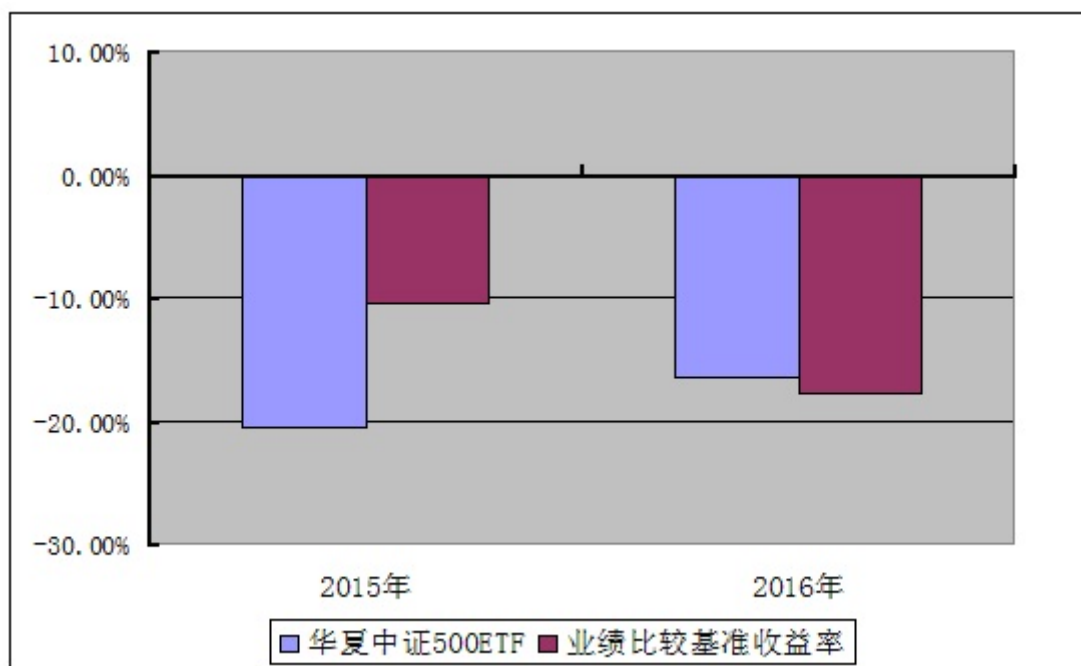
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015 年 5 月 5 日至 2016 年 12 月 31 日)



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

### 华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF

基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏上证 50AH 优选指数（LOF）和华夏快线 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数、海外市场指数等的产品线。

2016 年，在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖；在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面，2016 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）改进业务流程，客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务，还可自助办理资产证明和盖章对账单，业务处理更加高效便捷；（2）增加交易渠道，与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，并上线华夏财富网上交易系统，增加直销定投通等功能，为客户提供更多优惠便捷的理财渠道，提高交易便利性；（3）开展“你定，我投”、“客户个性化白皮书”、“2016 活期通年底晒账单”、2016 北京马拉松等系列宣传活动，为客户提供多样化的关怀服务。

#### 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期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---------------------|-------------|------|--------|--|
|    |                     | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 方军 | 本基金的基金经理、数量投资部总监    | 2015-05-05  | -    | 17 年   | 硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理、华夏回报证券投资基金基金经理助理、数量投资部副总经理等。 |
| 荣膺 | 本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁 | 2016-10-20  | -    | 6 年    | 北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品   |



|  |  |  |  |  |                           |
|--|--|--|--|--|---------------------------|
|  |  |  |  |  | 经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------|

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③根据本基金管理人发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告》，自 2017 年 3 月 24 日起，方军先生不再担任本基金基金经理。

#### 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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值选取排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2016 年，国际方面，美国经济稳定增长，美联储如期加息，美国总统大选结果提升了全球通货膨胀预期，美元走强；欧洲经济温和复苏，英国脱欧引发了市场动荡。国内方面，经济企稳迹象初显，工业结构持续优化，企业效益明显改善。在供给侧改革、基建与房地产投资拉动等因素影响下，工业品价格持续上涨，改善了市场情绪。报告期内，CPI 温和上涨，为引导经济去杠杆，央行下半年以来政策重点逐渐转为防止系统性风险，持续进行锁短放长，货币政策由相对宽松逐渐回归中性。

市场方面，年初在对经济前景的悲观预期、人民币短期快速贬值以及相关监管环境下，A 股出现了大幅急速调整行情；其后，随着监管政策不断调整，流动性缓解，市场情绪逐步企稳。纵观全年，在国企改革加快推进、基本面企稳、工业品价格持续上涨、银行理财新规出台、英国脱欧、债券市场去杠杆等多空因素综合影响下，A 股市场整体呈震荡走势。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 3.0304 元，本报告期份额净值增长率为-16.45%，同期中证 500 指数增长率为-17.78%。本基金本报告期跟踪偏

离度为+1.33%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 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 2017 年，国际方面，美元的加息节奏对国际金融、世界经济和市场的影 响仍需重点关注，而美国新一届政府的政策走向、英国脱欧流程的启动都将增加经济与金融市场的不确定性。国内方面，经济预计会维持平稳增长，政府会继续推进供给侧改革，混合所有制等改革领域也将扎实推进；财政政策料将继续积极有为，货币政策大概率维持中性。总体上，经济可能维持弱复苏但仍面临较大挑战，市场方面也依然存在较多不确定性，但因市场风险已经得到较大幅度释放，市场杠杆水平也更趋合理，市场整体或呈现平稳或窄幅震荡态势。如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，中证 500 指数作为小市值股票集合的代表在未来或将有相对较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司制定了合规风险管理制度、风险隔离制度、员工违规违纪处理制度，修订了保密管理制度和员工培训制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，加强了对微信等新媒体宣传材料的合规审核，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、基金交易、市场销售、后台运作等关键业务和岗位进行检查

监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权。当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 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累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20583 号

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华夏中证 500ETF 基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华夏中证 500ETF 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

## 6.2 注册会计师的责任

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

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

我们认为，上述华夏中证 500ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏中证 500ETF 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 许康玮 赵雪

上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 10 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产    | 附注号     | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：   |         |                         |                          |
| 银行存款  | 7.4.7.1 | 44,479,362.72           | 24,962,045.28            |
| 结算备付金 |         | 28,541,422.15           | 41,424,174.24            |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金           |            | 12,422,747.10                   | 15,126,165.65                    |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 861,940,945.30                  | 1,070,992,413.56                 |
| 其中：股票投资         |            | 861,543,712.18                  | 1,070,992,413.56                 |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 397,233.12                      | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 3,232,295.65                     |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 27,658.94                       | 35,951.33                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 947,412,136.21                  | 1,155,773,045.71                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | 6,623,411.53                     |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 408,185.46                      | 569,435.13                       |
| 应付托管费           |            | 81,637.08                       | 113,887.02                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 65,074.17                       | 155,862.12                       |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |
| 应付利润            |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                               | -                                |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 144,581.71                      | 2,189,113.96                     |
| 负债合计            |            | 699,478.42                      | 9,651,709.76                     |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 1,427,258,972.09                | 1,443,705,795.55                 |

|            |          |                 |                  |
|------------|----------|-----------------|------------------|
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | -480,546,314.30 | -297,584,459.60  |
| 所有者权益合计    |          | 946,712,657.79  | 1,146,121,335.95 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 947,412,136.21  | 1,155,773,045.71 |

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.0304 元，基金份额总额 312,408,794 份。

②本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，上年度可比期间自 2015 年 5 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金<br>合同生效日) 至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|---|--|
| <b>一、收入</b>           |          | -177,349,113.24                           | -262,405,351.82  |
| 1.利息收入                |          | 752,167.79                                | 1,335,084.70   |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 751,040.97                                | 1,335,084.70   |
| 债券利息收入                |          | 1,126.82                                  | -  |
| 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）      |          | -95,397,386.67                            | -106,090,444.31  |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | -106,338,034.42                           | -117,530,209.47  |
| 基金投资收益                |          | -   | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | 132,798.55                                | -  |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.14 | -   | -  |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.15 | -   | -  |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.16 | 4,565,120.00                              | 5,451,280.00   |
| 股利收益                  | 7.4.7.17 | 6,242,729.20                              | 5,988,485.16   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | -82,967,637.85                            | -157,987,318.75  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -   | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19 | 263,743.49                                | 337,326.54   |
| <b>减：二、费用</b>         |          | 6,800,049.19                              | 8,276,679.12   |



|                            |          |                 |                 |
|----------------------------|----------|-----------------|-----------------|
| 1.管理人报酬                    |          | 4,825,739.82    | 4,801,501.19    |
| 2.托管费                      |          | 965,147.95      | 960,300.24      |
| 3.销售服务费                    |          | -               | -               |
| 4.交易费用                     | 7.4.7.20 | 503,042.78      | 2,023,634.38    |
| 5.利息支出                     |          | -               | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -               | -               |
| 6.其他费用                     | 7.4.7.21 | 506,118.64      | 491,243.31      |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |          | -184,149,162.43 | -270,682,030.94 |
| 减：所得税费用                    |          | -               | -               |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |          | -184,149,162.43 | -270,682,030.94 |

注：本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，上年度可比期间自 2015 年 5 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日               |                 |                  |
|--|--|-----------------|------------------|
|  | 实收基金   | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,443,705,795.55                                     | -297,584,459.60 | 1,146,121,335.95 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -184,149,162.43 | -184,149,162.43  |
| 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）      | -16,446,823.46                                       | 1,187,307.73    | -15,259,515.73   |
| 其中：1.基金申购款                             | 126,092,313.65                                       | -47,179,542.57  | 78,912,771.08    |
| 2.基金赎回款                                | -142,539,137.11                                      | 48,366,850.30   | -94,172,286.81   |
| 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）                        | 1,427,258,972.09                                     | -480,546,314.30 | 946,712,657.79   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日 |                 |                  |



金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2015 年 5 月 22 日中证 500 指数收盘值的两千万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 2,134,473,505 份，本次基金份额折算比例为 0.21889230，折算后基金份额总额为 467,208,794 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

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

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

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

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。赎回转出股票投资收益/（损失）于赎回当日按转出股票以当日市场交易收盘价计算的市值与其成本的差额确认。

当本基金申购或赎回对价中包含可以现金替代或退补现金替代时，在本基金补足或卖出被替代股票（或采取强制退款）之前，该股票估值日与申购日或赎回日估值的差额确认为“公允价值变动收益/（损失）”。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，于 2015 年 3 月 20 日起按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

7、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。

8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的



股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 44,479,362.72      | 24,962,045.28       |
| 定期存款 | -                  | -                   |
| 其他存款 | -                  | -                   |
| 合计   | 44,479,362.72      | 24,962,045.28       |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016年12月31日  |                  |                 |
|---------------|---------------------|------------------|-----------------|
|               | 成本                  | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            | 1,102,831,141.90    | 861,543,712.18   | -241,287,429.72 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -                | -               |
| 债券            | 交易所市场               | 351,200.00       | 397,233.12      |
|               | 银行间市场               | -                | -               |
|               | 合计                  | 351,200.00       | 397,233.12      |
| 资产支持证券        | -                   | -                | -               |
| 基金            | -                   | -                | -               |
| 其他            | -                   | -                | -               |
| 合计            | 1,103,182,341.90    | 861,940,945.30   | -241,241,396.60 |
| 项目            | 上年度末<br>2015年12月31日 |                  |                 |
|               | 成本                  | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            | 1,229,335,452.31    | 1,070,992,413.56 | -158,343,038.75 |
| 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 | 1,229,335,452.31 | 1,070,992,413.56 | -158,343,038.75 |

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日  |      |    |    |
|---------|--------------------------|------|----|----|
|         | 合同/名义<br>金额              | 公允价值 |    | 备注 |
|         |                          | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具  | -                        | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具  | -                        | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具  | 61,855,200.00            | -    | -  | -  |
| 其中：股指期货 | 61,855,200.00            | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具  | -                        | -    | -  | -  |
| 合计      | 61,855,200.00            | -    | -  | -  |
| 项目      | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |      |    |    |
|         | 合同/名义<br>金额              | 公允价值 |    | 备注 |
|         |                          | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具  | -                        | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具  | -                        | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具  | 73,990,000.00            | -    | -  | -  |
| 其中：股指期货 | 73,990,000.00            | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具  | -                        | -    | -  | -  |
| 合计      | 73,990,000.00            | -    | -  | -  |

注：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<br>(买/<br>卖)(单<br>位:手) | 合约市值          | 公允价值变动     | 风险说明                                   |
|--------|----------------------------------|----------------------------|---------------|------------|--|
| IC1701 | 中证 500 股<br>指期货<br>IC1701 合<br>约 | 30                         | 37,303,200.00 | 167,800.00 | 买入股指期货多头<br>合约的目的是进行<br>更有效的流动性管<br>理。 |

|                |                          |    |               |            |                            |
|----------------|--------------------------|----|---------------|------------|----------------------------|
| IC1702         | 中证 500 股指期货<br>IC1702 合约 | 20 | 24,552,000.00 | 118,640.00 | 买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理。 |
| 公允价值变动总额合计     |                          |    |               |            | 286,440.00                 |
| 股指期货投资本期收益     |                          |    |               |            | 4,565,120.00               |
| 股指期货投资本期公允价值变动 |                          |    |               |            | -69,280.00                 |

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 9,781.83                | 8,632.99                 |
| 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  | 17,240.71               | 27,155.87                |
| 应收债券利息     | 610.77                  | -                        |
| 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         | 25.63                   | 162.47                   |
| 合计         | 27,658.94               | 35,951.33                |

##### 7.4.7.6 其他资产

无。

##### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 65,074.17               | 155,862.12               |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 65,074.17               | 155,862.12               |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 应付指数使用费     | 74,581.71               | 98,098.47                |
| 预提费用        | 70,000.00               | 120,000.00               |
| 可退替代款       | -                       | 1,009,677.70             |
| 应退替代款       | -                       | 961,337.79               |
| 合计          | 144,581.71              | 2,189,113.96             |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|--|------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 上年度末          | 316,008,794.00                         | 1,443,705,795.55 |
| 本期申购          | 27,600,000.00                          | 126,092,313.65   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -31,200,000.00                         | -142,539,137.11  |
| 本期末           | 312,408,794.00                         | 1,427,258,972.09 |

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | -112,155,716.62 | -185,428,742.98 | -297,584,459.60 |
| 本期利润           | -101,181,524.58 | -82,967,637.85  | -184,149,162.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,676,468.97    | -3,489,161.24   | 1,187,307.73    |
| 其中：基金申购款       | -11,647,467.56  | -35,532,075.01  | -47,179,542.57  |
| 基金赎回款          | 16,323,936.53   | 32,042,913.77   | 48,366,850.30   |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | -208,660,772.23 | -271,885,542.07 | -480,546,314.30 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日（基金合同 |
|----|-----------------------|--------------------------------|
|----|-----------------------|--------------------------------|

|           | 2016 年 12 月 31 日 | 生效日) 至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 325,355.42       | 1,018,135.94               |
| 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 | 423,970.59       | 310,779.68                 |
| 其他        | 1,714.96         | 6,169.08                   |
| 合计        | 751,040.97       | 1,335,084.70               |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日 (基金合同<br>生效日) 至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------------------|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票<br>差价收入 | -90,712,642.60                            | -66,679,319.19  |
| 股票投资收益——赎回差价<br>收入   | -15,625,391.82                            | -50,850,890.28  |
| 股票投资收益——申购差价<br>收入   | -   | -   |
| 合计                   | -106,338,034.42                           | -117,530,209.47   |

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日 (基金<br>合同生效日) 至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---|---|
| 卖出股票成交总额   | 321,533,820.06                            | 1,128,555,369.39  |
| 减：卖出股票成本总额 | 412,246,462.66                            | 1,195,234,688.58  |
| 买卖股票差价收入   | -90,712,642.60                            | -66,679,319.19  |

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日 (基金合同<br>生效日) 至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---|---|
| 赎回基金份额对价总额 | 94,172,286.81                             | 1,363,334,367.76  |

|             |                |                |
|-------------|----------------|----------------|
| 减：现金支付赎回款总额 | 51,398,989.81  | 773,237,554.76 |
| 减：赎回股票成本总额  | 58,398,688.82  | 640,947,703.28 |
| 赎回差价收入      | -15,625,391.82 | -50,850,890.28 |

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                          | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日（基金合同<br>生效日）至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------------------|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券<br>到期兑付）成交总额   | 965,314.60                                | -   |
| 减：卖出债券（、债转股及<br>债券到期兑付）成本总额 | 832,000.00                                | -   |
| 减：应收利息总额                    | 516.05                                    | -   |
| 买卖债券差价收入                    | 132,798.55                                | -   |

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金合同生效日)<br>至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------|---|---|
| 股指期货投资收益 | 4,565,120.00                              | 5,451,280.00  |
| 合计       | 4,565,120.00                              | 5,451,280.00  |

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金合同<br>生效日)至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 6,242,729.20                              | 5,988,485.16  |
| 基金投资产生的股利收益 | -   | -   |
| 合计          | 6,242,729.20                              | 5,988,485.16  |

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金合同<br>生效日)至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---|---|
| 1.交易性金融资产  | -82,898,357.85                            | -158,343,038.75   |
| ——股票投资     | -82,944,390.97                            | -158,343,038.75   |
| ——债券投资     | 46,033.12                                 | -   |
| ——资产支持证券投资 | -   | -   |
| ——基金投资     | -   | -   |
| ——贵金属投资    | -   | -   |
| 2.衍生工具     | -69,280.00                                | 355,720.00  |
| ——权证投资     | -   | -   |
| ——股指期货投资   | -69,280.00                                | 355,720.00  |
| 3.其他       | -   | -   |
| 合计         | -82,967,637.85                            | -157,987,318.75   |

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金合同<br>生效日)至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----|---|---|
|----|---|---|

|         |            |             |
|---------|------------|-------------|
| 基金赎回费收入 | -          | 161,479.98  |
| 替代损益    | 263,743.49 | -452,472.28 |
| 其他      | -          | 628,318.84  |
| 合计      | 263,743.49 | 337,326.54  |

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日（基金合同<br>生效日）至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 503,042.78                                | 2,023,634.38  |
| 银行间市场交易费用 | -   | -   |
| 合计        | 503,042.78                                | 2,023,634.38  |

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日（基金合同<br>生效日）至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------|---|---|
| 审计费用  | 70,000.00                                 | 70,000.00   |
| 信息披露费 | 80,000.00                                 | 50,000.00   |
| 指数使用费 | 289,544.44                                | 288,090.05  |
| 上市费   | 60,000.00                                 | 65,000.00   |
| 银行费用  | 6,574.20                                  | 17,393.26   |
| 其他    | -   | 760.00  |
| 合计    | 506,118.64                                | 491,243.31  |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值



税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称  | 与本基金的关系      |
|--|--------------|
| 华夏基金管理有限公司                                     | 基金管理人        |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")                         | 基金托管人        |
| 中信证券股份有限公司 ("中信证券")                            | 基金管理人的股东     |
| 山东省农村经济开发投资公司                                  | 基金管理人的股东     |
| POWER CORPORATION OF CANADA                    | 基金管理人的股东     |
| 青岛海鹏科技投资有限公司                                   | 基金管理人的股东     |
| 南方工业资产管理有限责任公司                                 | 基金管理人的股东     |
| 华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 ("华夏中证 500ETF 联接") | 该基金是本基金的联接基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                  | 上年度可比期间                                   |
|----------------|-------------------------------------|---|
|                | 2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,825,739.82                        | 4,801,501.19                              |

注：①支付基金管理人的基金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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 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<br>2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 965,147.95                          | 960,300.24                                |

注：①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

份额单位：份

| 关联方名称      | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                              |
|------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------|
|            | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 |
| 中信证券股份有限公司 | 14,267.00               | 0.00%                    | 65.00                    | 0.00%                        |

|                |                |        |                |        |
|----------------|----------------|--------|----------------|--------|
| 华夏中证 500ETF 联接 | 236,097,342.00 | 75.57% | 227,997,423.00 | 72.15% |
|----------------|----------------|--------|----------------|--------|

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日 |              |
|------------|---|------------|--|--------------|
|            | 期末余额                                      | 当期利息收入     | 期末余额   | 当期利息收入       |
| 中国建设银行活期存款 | 44,479,362.72                             | 325,355.42 | 24,962,045.28  | 1,018,135.94 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日               |        |      |       |                |            |
|--|--------|------|-------|----------------|------------|
| 关联方名称  | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式  | 基金在承销期内买入      |            |
|  |        |      |       | 数量(单位:<br>股/张) | 总金额        |
| 中信证券股份有限公司   | 600743 | 华远地产 | 老股东配售 | 52,950         | 177,912.00 |
| 上年度可比期间<br>2015 年 5 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |        |      |       |                |            |
| 关联方名称  | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式  | 基金在承销期内买入      |            |
|  |        |      |       | 数量(单位:<br>股/张) | 总金额        |
| 中信证券股份有限公司   | -      | -    | -     | -              | -          |

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌 | 期末 | 复牌 | 复牌 | 数量(股) | 期末成本 | 期末估值 | 备 |
|------|------|------|----|----|----|----|-------|------|------|---|
|------|------|------|----|----|----|----|-------|------|------|---|

|        |       |            | 原因   | 估值<br>单价 | 日期         | 开盘<br>单价 |         | 总额           | 总额           | 注 |
|--------|-------|------------|------|----------|------------|----------|---------|--------------|--------------|---|
| 000887 | 中鼎股份  | 2016-11-18 | 重大事项 | 25.94    | 2017-02-15 | 23.99    | 143,100 | 3,940,971.50 | 3,712,014.00 | - |
| 601168 | 西部矿业  | 2016-12-19 | 重大事项 | 7.83     | -          | -        | 436,000 | 3,161,637.97 | 3,413,880.00 | - |
| 000748 | 长城信息  | 2016-11-01 | 重大事项 | 20.31    | -          | -        | 153,400 | 4,783,712.59 | 3,115,554.00 | - |
| 300088 | 长信科技  | 2016-09-12 | 重大事项 | 15.80    | -          | -        | 196,766 | 2,816,737.90 | 3,108,902.80 | - |
| 002400 | 省广股份  | 2016-11-28 | 重大事项 | 13.79    | -          | -        | 218,703 | 4,914,988.08 | 3,015,914.37 | - |
| 600673 | 东阳光科  | 2016-11-15 | 重大事项 | 7.29     | -          | -        | 394,343 | 3,322,539.02 | 2,874,760.47 | - |
| 002602 | 世纪华通  | 2016-12-15 | 重大事项 | 46.89    | 2017-01-09 | 50.00    | 57,300  | 1,491,701.69 | 2,686,797.00 | - |
| 000547 | 航天发展  | 2016-04-19 | 重大事项 | 15.36    | 2017-01-03 | 16.90    | 173,170 | 4,899,399.60 | 2,659,891.20 | - |
| 000050 | 深天马 A | 2016-09-12 | 重大事项 | 18.82    | 2017-03-23 | 20.70    | 136,800 | 2,915,742.63 | 2,574,576.00 | - |
| 600655 | 豫园商城  | 2016-12-20 | 重大事项 | 11.42    | -          | -        | 223,300 | 4,706,829.06 | 2,550,086.00 | - |
| 000697 | 炼石有色  | 2016-11-17 | 重大事项 | 23.51    | -          | -        | 106,198 | 2,822,530.83 | 2,496,714.98 | - |
| 600161 | 天坛生物  | 2016-12-06 | 重大事项 | 39.40    | 2017-03-24 | 43.34    | 60,201  | 2,447,854.96 | 2,371,919.40 | - |
| 600151 | 航天机电  | 2016-11-11 | 重大事项 | 10.97    | -          | -        | 201,820 | 3,279,224.77 | 2,213,965.40 | - |
| 000563 | 陕国投 A | 2016-10-14 | 重大事项 | 7.48     | 2017-01-18 | 6.73     | 295,700 | 1,970,361.75 | 2,211,836.00 | - |
| 002491 | 通鼎互联  | 2016-12-22 | 重大事项 | 15.54    | 2017-01-03 | 15.89    | 137,200 | 2,215,347.01 | 2,132,088.00 | - |
| 600687 | 刚泰控股  | 2016-07-25 | 重大事项 | 16.42    | 2017-01-18 | 16.38    | 122,500 | 2,007,102.78 | 2,011,450.00 | - |
| 002440 | 闰土股份  | 2016-10-24 | 重大事项 | 16.34    | 2017-01-12 | 15.22    | 109,200 | 2,635,912.68 | 1,784,328.00 | - |
| 600645 | 中源协和  | 2016-12-13 | 重大事项 | 26.80    | -          | -        | 66,400  | 2,940,823.03 | 1,779,520.00 | - |
| 000727 | 华东科技  | 2016-11-17 | 重大事项 | 3.37     | 2017-02-15 | 3.47     | 502,400 | 1,688,271.89 | 1,693,088.00 | - |
| 600171 | 上海贝岭  | 2016-12-14 | 重大事项 | 14.05    | 2017-02-16 | 14.90    | 119,700 | 2,674,317.28 | 1,681,785.00 | - |
| 002025 | 航天电器  | 2016-09-12 | 重大事项 | 25.20    | -          | -        | 62,850  | 1,658,494.44 | 1,583,820.00 | - |

|        |       |            |      |       |            |       |         |              |              |   |
|--------|-------|------------|------|-------|------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 000829 | 天音控股  | 2016-09-29 | 重大事项 | 11.28 | -          | -     | 138,400 | 2,719,396.28 | 1,561,152.00 | - |
| 002396 | 星网锐捷  | 2016-09-12 | 重大事项 | 19.70 | 2017-02-21 | 18.35 | 78,050  | 2,142,708.88 | 1,537,585.00 | - |
| 600859 | 王府井   | 2016-09-27 | 重大事项 | 16.28 | -          | -     | 84,150  | 1,896,008.20 | 1,369,962.00 | - |
| 600537 | 亿晶光电  | 2016-12-27 | 重大事项 | 7.43  | 2017-01-13 | 8.17  | 181,700 | 1,588,891.96 | 1,350,031.00 | - |
| 002635 | 安洁科技  | 2016-11-08 | 重大事项 | 36.40 | 2017-02-08 | 33.50 | 36,800  | 888,264.17   | 1,339,520.00 | - |
| 002727 | 一心堂   | 2016-12-28 | 重大事项 | 21.20 | 2017-01-05 | 21.66 | 56,377  | 1,309,381.02 | 1,195,192.40 | - |
| 002681 | 奋达科技  | 2016-12-19 | 重大事项 | 12.93 | -          | -     | 82,860  | 1,628,527.74 | 1,071,379.80 | - |
| 600551 | 时代出版  | 2016-11-28 | 重大事项 | 20.32 | -          | -     | 46,976  | 1,082,428.40 | 954,552.32   | - |
| 603169 | 兰石重装  | 2016-11-24 | 重大事项 | 13.36 | 2017-03-21 | 14.32 | 65,000  | 1,358,916.64 | 868,400.00   | - |
| 603555 | 贵人鸟   | 2016-12-12 | 重大事项 | 30.76 | -          | -     | 27,600  | 1,330,069.22 | 848,976.00   | - |
| 000693 | ST 华泽 | 2016-03-01 | 重大事项 | 12.50 | -          | -     | 66,000  | 1,723,678.74 | 825,000.00   | - |
| 601005 | 重庆钢铁  | 2016-06-02 | 重大事项 | 2.52  | -          | -     | 326,500 | 1,817,246.69 | 822,780.00   | - |
| 002745 | 木林森   | 2016-07-18 | 重大事项 | 36.49 | -          | -     | 18,000  | 641,350.61   | 656,820.00   | - |

注：根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票，以换股比例 1: 0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

##### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>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  | 861,543,712.18          | 91.00         | 1,070,992,413.56         | 93.44         |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                       | -             | -                        | -             |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                       | -             | -                        | -             |
| 合计            | 861,543,712.18          | 91.00         | 1,070,992,413.56         | 93.44         |

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |      |
|----|--|-----------------------------|------|
| 假设 | 1、估测组合市场价格风险的数据为中证 500 指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 |                             |      |
|    | 2、假定中证 500 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。                         |                             |      |
| 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                         | 上年度末 |

|  |     | (2016 年 12 月 31 日) | (2015 年 12 月 31 日) |
|--|-----|--------------------|--------------------|
|  | +5% | 49,674,013.15      | 55,953,643.62      |
|  | -5% | -49,674,013.15     | -55,953,643.62     |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### 7.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 861,940,945.30 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 1,070,992,413.56 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### 7.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

##### 7.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元



| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 861,543,712.18 | 90.94         |
|    | 其中：股票             | 861,543,712.18 | 90.94         |
| 2  | 固定收益投资            | 397,233.12     | 0.04          |
|    | 其中：债券             | 397,233.12     | 0.04          |
|    | 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      | 73,020,784.87  | 7.71          |
| 7  | 其他各项资产            | 12,450,406.04  | 1.31          |
| 8  | 合计                | 947,412,136.21 | 100.00        |

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 11,215,618.40  | 1.18          |
| B  | 采矿业              | 34,395,635.04  | 3.63          |
| C  | 制造业              | 531,393,989.75 | 56.13         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 26,444,680.21  | 2.79          |
| E  | 建筑业              | 24,764,787.13  | 2.62          |
| F  | 批发和零售业           | 51,751,325.42  | 5.47          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 24,289,359.86  | 2.57          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 51,264,270.46  | 5.41          |
| J  | 金融业              | 7,278,140.30   | 0.77          |
| K  | 房地产业             | 55,373,078.12  | 5.85          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 13,070,287.91  | 1.38          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 2,532,727.00   | 0.27          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,211,583.90   | 0.44          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -             |
| P  | 教育               | 391,589.00     | 0.04          |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,346,240.00   | 0.25          |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 12,994,429.60  | 1.37          |

|   |    |                |       |
|---|----|----------------|-------|
| S | 综合 | 7,825,970.08   | 0.83  |
|   | 合计 | 861,543,712.18 | 91.00 |

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600201 | 生物股份 | 135,310   | 4,274,442.90 | 0.45         |
| 2  | 600522 | 中天科技 | 405,350   | 4,268,335.50 | 0.45         |
| 3  | 000656 | 金科股份 | 808,100   | 4,234,444.00 | 0.45         |
| 4  | 600682 | 南京新百 | 108,700   | 4,051,249.00 | 0.43         |
| 5  | 600584 | 长电科技 | 228,633   | 4,035,372.45 | 0.43         |
| 6  | 600079 | 人福医药 | 199,694   | 3,983,895.30 | 0.42         |
| 7  | 600643 | 爱建集团 | 311,030   | 3,859,882.30 | 0.41         |
| 8  | 000887 | 中鼎股份 | 143,100   | 3,712,014.00 | 0.39         |
| 9  | 300136 | 信维通信 | 129,000   | 3,676,500.00 | 0.39         |
| 10 | 600219 | 南山铝业 | 1,187,050 | 3,667,984.50 | 0.39         |
| 11 | 002405 | 四维图新 | 189,428   | 3,665,431.80 | 0.39         |
| 12 | 600487 | 亨通光电 | 192,900   | 3,599,514.00 | 0.38         |
| 13 | 600158 | 中体产业 | 149,800   | 3,530,786.00 | 0.37         |
| 14 | 601012 | 隆基股份 | 261,400   | 3,500,146.00 | 0.37         |
| 15 | 600525 | 长园集团 | 245,358   | 3,422,744.10 | 0.36         |
| 16 | 601168 | 西部矿业 | 436,000   | 3,413,880.00 | 0.36         |
| 17 | 002092 | 中泰化学 | 280,000   | 3,388,000.00 | 0.36         |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 30,220    | 3,380,107.00 | 0.36         |
| 19 | 002572 | 索菲亚  | 60,500    | 3,276,680.00 | 0.35         |
| 20 | 600166 | 福田汽车 | 1,018,200 | 3,146,238.00 | 0.33         |
| 21 | 000748 | 长城信息 | 153,400   | 3,115,554.00 | 0.33         |
| 22 | 300088 | 长信科技 | 196,766   | 3,108,902.80 | 0.33         |
| 23 | 600143 | 金发科技 | 396,733   | 3,086,582.74 | 0.33         |
| 24 | 600436 | 片仔癀  | 66,837    | 3,060,466.23 | 0.32         |
| 25 | 600521 | 华海药业 | 138,771   | 3,057,125.13 | 0.32         |
| 26 | 300115 | 长盈精密 | 117,060   | 3,050,583.60 | 0.32         |
| 27 | 002400 | 省广股份 | 218,703   | 3,015,914.37 | 0.32         |
| 28 | 000998 | 隆平高科 | 139,300   | 2,985,199.00 | 0.32         |
| 29 | 002508 | 老板电器 | 81,031    | 2,981,940.80 | 0.31         |
| 30 | 600699 | 均胜电子 | 89,800    | 2,971,482.00 | 0.31         |
| 31 | 002340 | 格林美  | 452,040   | 2,960,862.00 | 0.31         |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 32 | 600503 | 华丽家族  | 354,600 | 2,939,634.00 | 0.31 |
| 33 | 002366 | 台海核电  | 54,700  | 2,933,014.00 | 0.31 |
| 34 | 300156 | 神雾环保  | 116,300 | 2,908,663.00 | 0.31 |
| 35 | 600664 | 哈药股份  | 337,830 | 2,898,581.40 | 0.31 |
| 36 | 002168 | 深圳惠程  | 182,400 | 2,892,864.00 | 0.31 |
| 37 | 600879 | 航天电子  | 189,400 | 2,886,456.00 | 0.30 |
| 38 | 000930 | 中粮生化  | 214,100 | 2,877,504.00 | 0.30 |
| 39 | 600673 | 东阳光科  | 394,343 | 2,874,760.47 | 0.30 |
| 40 | 002004 | 华邦健康  | 315,400 | 2,860,678.00 | 0.30 |
| 41 | 000997 | 新大陆   | 145,800 | 2,832,894.00 | 0.30 |
| 42 | 000581 | 威孚高科  | 126,200 | 2,831,928.00 | 0.30 |
| 43 | 002439 | 启明星辰  | 135,033 | 2,807,336.07 | 0.30 |
| 44 | 600978 | 宜华生活  | 263,200 | 2,803,080.00 | 0.30 |
| 45 | 600315 | 上海家化  | 103,300 | 2,800,463.00 | 0.30 |
| 46 | 300026 | 红日药业  | 507,000 | 2,753,010.00 | 0.29 |
| 47 | 600266 | 北京城建  | 206,200 | 2,748,646.00 | 0.29 |
| 48 | 002701 | 奥瑞金   | 313,620 | 2,709,676.80 | 0.29 |
| 49 | 600500 | 中化国际  | 231,100 | 2,694,626.00 | 0.28 |
| 50 | 600138 | 中青旅   | 128,399 | 2,692,527.03 | 0.28 |
| 51 | 600497 | 驰宏锌锗  | 382,700 | 2,690,381.00 | 0.28 |
| 52 | 002602 | 世纪华通  | 57,300  | 2,686,797.00 | 0.28 |
| 53 | 000690 | 宝新能源  | 289,830 | 2,686,724.10 | 0.28 |
| 54 | 002460 | 赣锋锂业  | 101,100 | 2,680,161.00 | 0.28 |
| 55 | 300266 | 兴源环境  | 48,700  | 2,672,656.00 | 0.28 |
| 56 | 002422 | 科伦药业  | 165,700 | 2,671,084.00 | 0.28 |
| 57 | 000547 | 航天发展  | 173,170 | 2,659,891.20 | 0.28 |
| 58 | 300296 | 利亚德   | 78,100  | 2,633,532.00 | 0.28 |
| 59 | 002407 | 多氟多   | 96,300  | 2,628,027.00 | 0.28 |
| 60 | 600614 | 鼎立股份  | 224,500 | 2,626,650.00 | 0.28 |
| 61 | 002030 | 达安基因  | 112,666 | 2,613,851.20 | 0.28 |
| 62 | 002013 | 中航机电  | 142,375 | 2,604,038.75 | 0.28 |
| 63 | 600635 | 大众公用  | 430,400 | 2,586,704.00 | 0.27 |
| 64 | 000050 | 深天马 A | 136,800 | 2,574,576.00 | 0.27 |
| 65 | 000961 | 中南建设  | 247,075 | 2,569,580.00 | 0.27 |
| 66 | 600426 | 华鲁恒升  | 193,650 | 2,565,862.50 | 0.27 |
| 67 | 600655 | 豫园商城  | 223,300 | 2,550,086.00 | 0.27 |
| 68 | 002271 | 东方雨虹  | 116,900 | 2,535,561.00 | 0.27 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 69  | 000970 | 中科三环  | 189,104 | 2,524,538.40 | 0.27 |
| 70  | 002311 | 海大集团  | 166,800 | 2,510,340.00 | 0.27 |
| 71  | 000697 | 炼石有色  | 106,198 | 2,496,714.98 | 0.26 |
| 72  | 600122 | 宏图高科  | 204,176 | 2,495,030.72 | 0.26 |
| 73  | 002573 | 清新环境  | 141,900 | 2,478,993.00 | 0.26 |
| 74  | 300253 | 卫宁健康  | 126,223 | 2,472,708.57 | 0.26 |
| 75  | 600759 | 洲际油气  | 250,780 | 2,462,659.60 | 0.26 |
| 76  | 002179 | 中航光电  | 66,860  | 2,426,349.40 | 0.26 |
| 77  | 600418 | 江淮汽车  | 208,900 | 2,414,884.00 | 0.26 |
| 78  | 300113 | 顺网科技  | 89,700  | 2,412,033.00 | 0.25 |
| 79  | 000400 | 许继电气  | 132,700 | 2,408,505.00 | 0.25 |
| 80  | 002038 | 双鹭药业  | 90,100  | 2,406,571.00 | 0.25 |
| 81  | 600161 | 天坛生物  | 60,201  | 2,371,919.40 | 0.25 |
| 82  | 600240 | 华业资本  | 220,800 | 2,371,392.00 | 0.25 |
| 83  | 002001 | 新 和 成 | 120,900 | 2,369,640.00 | 0.25 |
| 84  | 002176 | 江特电机  | 197,300 | 2,353,789.00 | 0.25 |
| 85  | 600565 | 迪马股份  | 317,100 | 2,352,882.00 | 0.25 |
| 86  | 600312 | 平高电气  | 150,600 | 2,352,372.00 | 0.25 |
| 87  | 600388 | 龙净环保  | 189,800 | 2,347,826.00 | 0.25 |
| 88  | 300244 | 迪安诊断  | 73,320  | 2,346,240.00 | 0.25 |
| 89  | 600594 | 益佰制药  | 140,600 | 2,340,990.00 | 0.25 |
| 90  | 000012 | 南 玻 A | 203,800 | 2,311,092.00 | 0.24 |
| 91  | 002273 | 水晶光电  | 116,000 | 2,308,400.00 | 0.24 |
| 92  | 600633 | 浙报传媒  | 130,300 | 2,301,098.00 | 0.24 |
| 93  | 002665 | 首航节能  | 261,780 | 2,293,192.80 | 0.24 |
| 94  | 600811 | 东方集团  | 317,100 | 2,267,265.00 | 0.24 |
| 95  | 002223 | 鱼跃医疗  | 73,061  | 2,266,352.22 | 0.24 |
| 96  | 000598 | 兴蓉环境  | 392,900 | 2,263,104.00 | 0.24 |
| 97  | 000566 | 海南海药  | 177,900 | 2,261,109.00 | 0.24 |
| 98  | 002217 | 合力泰   | 126,300 | 2,260,770.00 | 0.24 |
| 99  | 600056 | 中国医药  | 118,300 | 2,251,249.00 | 0.24 |
| 100 | 600601 | 方正科技  | 487,200 | 2,241,120.00 | 0.24 |
| 101 | 600094 | 大名城   | 251,700 | 2,240,130.00 | 0.24 |
| 102 | 000939 | 凯迪生态  | 173,883 | 2,237,874.21 | 0.24 |
| 103 | 600528 | 中铁二局  | 161,800 | 2,226,368.00 | 0.24 |
| 104 | 002221 | 东华能源  | 179,584 | 2,225,045.76 | 0.24 |
| 105 | 600787 | 中储股份  | 244,100 | 2,213,987.00 | 0.23 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 106 | 600151 | 航天机电  | 201,820 | 2,213,965.40 | 0.23 |
| 107 | 000078 | 海王生物  | 351,355 | 2,213,536.50 | 0.23 |
| 108 | 000563 | 陕国投 A | 295,700 | 2,211,836.00 | 0.23 |
| 109 | 600881 | 亚泰集团  | 403,900 | 2,209,333.00 | 0.23 |
| 110 | 000975 | 银泰资源  | 140,765 | 2,201,564.60 | 0.23 |
| 111 | 300055 | 万邦达   | 134,400 | 2,201,472.00 | 0.23 |
| 112 | 000878 | 云南铜业  | 186,300 | 2,200,203.00 | 0.23 |
| 113 | 600200 | 江苏吴中  | 112,200 | 2,166,582.00 | 0.23 |
| 114 | 000988 | 华工科技  | 138,400 | 2,165,960.00 | 0.23 |
| 115 | 600478 | 科力远   | 216,170 | 2,161,700.00 | 0.23 |
| 116 | 600751 | 天海投资  | 257,900 | 2,156,044.00 | 0.23 |
| 117 | 600435 | 北方导航  | 165,200 | 2,154,208.00 | 0.23 |
| 118 | 002410 | 广联达   | 147,300 | 2,150,580.00 | 0.23 |
| 119 | 000031 | 中粮地产  | 240,900 | 2,148,828.00 | 0.23 |
| 120 | 600198 | 大唐电信  | 134,700 | 2,137,689.00 | 0.23 |
| 121 | 000612 | 焦作万方  | 184,900 | 2,135,595.00 | 0.23 |
| 122 | 300324 | 旋极信息  | 110,300 | 2,132,099.00 | 0.23 |
| 123 | 002491 | 通鼎互联  | 137,200 | 2,132,088.00 | 0.23 |
| 124 | 600410 | 华胜天成  | 196,122 | 2,131,846.14 | 0.23 |
| 125 | 002353 | 杰瑞股份  | 105,000 | 2,131,500.00 | 0.23 |
| 126 | 002191 | 劲嘉股份  | 204,300 | 2,126,763.00 | 0.22 |
| 127 | 600176 | 中国巨石  | 215,920 | 2,124,652.80 | 0.22 |
| 128 | 600755 | 厦门国贸  | 258,600 | 2,120,520.00 | 0.22 |
| 129 | 600516 | 方大炭素  | 228,900 | 2,119,614.00 | 0.22 |
| 130 | 600851 | 海欣股份  | 163,901 | 2,119,239.93 | 0.22 |
| 131 | 002408 | 齐翔腾达  | 192,219 | 2,114,409.00 | 0.22 |
| 132 | 601699 | 潞安环能  | 262,400 | 2,112,320.00 | 0.22 |
| 133 | 002250 | 联化科技  | 129,705 | 2,098,626.90 | 0.22 |
| 134 | 000758 | 中色股份  | 262,114 | 2,094,290.86 | 0.22 |
| 135 | 002048 | 宁波华翔  | 94,110  | 2,083,595.40 | 0.22 |
| 136 | 000979 | 中弘股份  | 787,680 | 2,079,475.20 | 0.22 |
| 137 | 300134 | 大富科技  | 81,700  | 2,071,912.00 | 0.22 |
| 138 | 600026 | 中远海能  | 303,500 | 2,066,835.00 | 0.22 |
| 139 | 000488 | 晨鸣纸业  | 197,700 | 2,048,172.00 | 0.22 |
| 140 | 000667 | 美好置业  | 554,400 | 2,045,736.00 | 0.22 |
| 141 | 600572 | 康恩贝   | 277,405 | 2,027,830.55 | 0.21 |
| 142 | 601929 | 吉视传媒  | 483,100 | 2,024,189.00 | 0.21 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 143 | 000786 | 北新建材  | 195,800 | 2,014,782.00 | 0.21 |
| 144 | 000959 | 首钢股份  | 304,300 | 2,014,466.00 | 0.21 |
| 145 | 600687 | 刚泰控股  | 122,500 | 2,011,450.00 | 0.21 |
| 146 | 600064 | 南京高科  | 120,000 | 2,010,000.00 | 0.21 |
| 147 | 000806 | 银河生物  | 126,500 | 2,003,760.00 | 0.21 |
| 148 | 600325 | 华发股份  | 155,700 | 1,992,960.00 | 0.21 |
| 149 | 600160 | 巨化股份  | 187,500 | 1,983,750.00 | 0.21 |
| 150 | 000006 | 深振业 A | 209,700 | 1,981,665.00 | 0.21 |
| 151 | 600108 | 亚盛集团  | 345,500 | 1,976,260.00 | 0.21 |
| 152 | 300273 | 和佳股份  | 115,400 | 1,968,724.00 | 0.21 |
| 153 | 600967 | 北方创业  | 144,900 | 1,966,293.00 | 0.21 |
| 154 | 600575 | 皖江物流  | 341,700 | 1,964,775.00 | 0.21 |
| 155 | 000860 | 顺鑫农业  | 88,700  | 1,951,400.00 | 0.21 |
| 156 | 603019 | 中科曙光  | 70,100  | 1,950,182.00 | 0.21 |
| 157 | 603766 | 隆鑫通用  | 93,600  | 1,945,008.00 | 0.21 |
| 158 | 300159 | 新研股份  | 142,900 | 1,940,582.00 | 0.20 |
| 159 | 600409 | 三友化工  | 205,400 | 1,928,706.00 | 0.20 |
| 160 | 601880 | 大连港   | 685,890 | 1,920,492.00 | 0.20 |
| 161 | 600511 | 国药股份  | 63,800  | 1,920,380.00 | 0.20 |
| 162 | 600120 | 浙江东方  | 65,900  | 1,905,828.00 | 0.20 |
| 163 | 603589 | 口子窖   | 59,300  | 1,905,309.00 | 0.20 |
| 164 | 600039 | 四川路桥  | 401,800 | 1,904,532.00 | 0.20 |
| 165 | 002657 | 中科金财  | 44,000  | 1,899,040.00 | 0.20 |
| 166 | 600499 | 科达洁能  | 250,600 | 1,894,536.00 | 0.20 |
| 167 | 002051 | 中工国际  | 82,380  | 1,888,149.60 | 0.20 |
| 168 | 002276 | 万马股份  | 125,100 | 1,880,253.00 | 0.20 |
| 169 | 600316 | 洪都航空  | 95,500  | 1,877,530.00 | 0.20 |
| 170 | 002078 | 太阳纸业  | 280,500 | 1,873,740.00 | 0.20 |
| 171 | 600808 | 马钢股份  | 661,700 | 1,872,611.00 | 0.20 |
| 172 | 601000 | 唐山港   | 466,680 | 1,871,386.80 | 0.20 |
| 173 | 002595 | 豪迈科技  | 88,799  | 1,869,218.95 | 0.20 |
| 174 | 000999 | 华润三九  | 75,100  | 1,857,223.00 | 0.20 |
| 175 | 000960 | 锡业股份  | 141,200 | 1,852,544.00 | 0.20 |
| 176 | 000513 | 丽珠集团  | 30,840  | 1,834,980.00 | 0.19 |
| 177 | 300287 | 飞利信   | 154,100 | 1,833,790.00 | 0.19 |
| 178 | 300199 | 翰宇药业  | 101,800 | 1,830,364.00 | 0.19 |
| 179 | 600549 | 厦门钨业  | 83,000  | 1,827,660.00 | 0.19 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 180 | 002489 | 浙江永强 | 241,358 | 1,827,080.06 | 0.19 |
| 181 | 000066 | 长城电脑 | 146,800 | 1,826,192.00 | 0.19 |
| 182 | 002375 | 亚厦股份 | 172,500 | 1,825,050.00 | 0.19 |
| 183 | 600611 | 大众交通 | 277,650 | 1,824,160.50 | 0.19 |
| 184 | 002155 | 湖南黄金 | 159,300 | 1,823,985.00 | 0.19 |
| 185 | 000028 | 国药一致 | 27,258  | 1,823,560.20 | 0.19 |
| 186 | 002390 | 信邦制药 | 184,300 | 1,822,727.00 | 0.19 |
| 187 | 002672 | 东江环保 | 103,550 | 1,822,480.00 | 0.19 |
| 188 | 002281 | 光迅科技 | 23,200  | 1,821,200.00 | 0.19 |
| 189 | 002022 | 科华生物 | 91,010  | 1,820,200.00 | 0.19 |
| 190 | 000685 | 中山公用 | 163,190 | 1,816,304.70 | 0.19 |
| 191 | 000543 | 皖能电力 | 238,420 | 1,814,376.20 | 0.19 |
| 192 | 002444 | 巨星科技 | 116,300 | 1,814,280.00 | 0.19 |
| 193 | 600717 | 天津港  | 179,200 | 1,806,336.00 | 0.19 |
| 194 | 002384 | 东山精密 | 91,900  | 1,802,159.00 | 0.19 |
| 195 | 600416 | 湘电股份 | 122,200 | 1,797,562.00 | 0.19 |
| 196 | 600348 | 阳泉煤业 | 266,900 | 1,796,237.00 | 0.19 |
| 197 | 600770 | 综艺股份 | 173,100 | 1,791,585.00 | 0.19 |
| 198 | 002268 | 卫士通  | 57,000  | 1,790,940.00 | 0.19 |
| 199 | 600062 | 华润双鹤 | 80,400  | 1,787,292.00 | 0.19 |
| 200 | 600587 | 新华医疗 | 71,100  | 1,785,321.00 | 0.19 |
| 201 | 002440 | 闰土股份 | 109,200 | 1,784,328.00 | 0.19 |
| 202 | 600597 | 光明乳业 | 136,500 | 1,782,690.00 | 0.19 |
| 203 | 600645 | 中源协和 | 66,400  | 1,779,520.00 | 0.19 |
| 204 | 002018 | 华信国际 | 174,700 | 1,776,699.00 | 0.19 |
| 205 | 002266 | 浙富控股 | 307,513 | 1,771,274.88 | 0.19 |
| 206 | 002050 | 三花智控 | 159,800 | 1,764,192.00 | 0.19 |
| 207 | 600098 | 广州发展 | 156,900 | 1,760,418.00 | 0.19 |
| 208 | 600183 | 生益科技 | 159,600 | 1,755,600.00 | 0.19 |
| 209 | 600884 | 杉杉股份 | 124,600 | 1,754,368.00 | 0.19 |
| 210 | 600380 | 健康元  | 175,900 | 1,746,687.00 | 0.18 |
| 211 | 002477 | 雏鹰农牧 | 347,930 | 1,746,608.60 | 0.18 |
| 212 | 000401 | 冀东水泥 | 146,600 | 1,744,540.00 | 0.18 |
| 213 | 600187 | 国中水务 | 323,100 | 1,741,509.00 | 0.18 |
| 214 | 600872 | 中炬高新 | 123,600 | 1,740,288.00 | 0.18 |
| 215 | 000592 | 平潭发展 | 257,320 | 1,739,483.20 | 0.18 |
| 216 | 002603 | 以岭药业 | 100,100 | 1,725,724.00 | 0.18 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 217 | 000825 | 太钢不锈 | 437,000 | 1,721,780.00 | 0.18 |
| 218 | 600863 | 内蒙华电 | 556,900 | 1,715,252.00 | 0.18 |
| 219 | 000519 | 江南红箭 | 114,595 | 1,707,465.50 | 0.18 |
| 220 | 600366 | 宁波韵升 | 86,400  | 1,701,216.00 | 0.18 |
| 221 | 600466 | 蓝光发展 | 175,600 | 1,698,052.00 | 0.18 |
| 222 | 000727 | 华东科技 | 502,400 | 1,693,088.00 | 0.18 |
| 223 | 002373 | 千方科技 | 122,536 | 1,690,996.80 | 0.18 |
| 224 | 600267 | 海正药业 | 128,556 | 1,690,511.40 | 0.18 |
| 225 | 600171 | 上海贝岭 | 119,700 | 1,681,785.00 | 0.18 |
| 226 | 600300 | 维维股份 | 250,400 | 1,672,672.00 | 0.18 |
| 227 | 002122 | 天马股份 | 131,800 | 1,672,542.00 | 0.18 |
| 228 | 002544 | 杰赛科技 | 59,400  | 1,671,516.00 | 0.18 |
| 229 | 600392 | 盛和资源 | 125,375 | 1,671,248.75 | 0.18 |
| 230 | 002261 | 拓维信息 | 140,100 | 1,669,992.00 | 0.18 |
| 231 | 002308 | 威创股份 | 112,810 | 1,662,819.40 | 0.18 |
| 232 | 600067 | 冠城大通 | 231,800 | 1,659,688.00 | 0.18 |
| 233 | 600073 | 上海梅林 | 144,852 | 1,658,555.40 | 0.18 |
| 234 | 600017 | 日照港  | 409,200 | 1,657,260.00 | 0.18 |
| 235 | 600422 | 昆药集团 | 122,600 | 1,656,326.00 | 0.17 |
| 236 | 002073 | 软控股份 | 145,800 | 1,654,830.00 | 0.17 |
| 237 | 600970 | 中材国际 | 233,300 | 1,654,097.00 | 0.17 |
| 238 | 300274 | 阳光电源 | 156,140 | 1,645,715.60 | 0.17 |
| 239 | 002431 | 棕榈股份 | 179,580 | 1,644,952.80 | 0.17 |
| 240 | 600307 | 酒钢宏兴 | 600,600 | 1,639,638.00 | 0.17 |
| 241 | 600125 | 铁龙物流 | 202,800 | 1,638,624.00 | 0.17 |
| 242 | 600086 | 东方金钰 | 149,800 | 1,629,824.00 | 0.17 |
| 243 | 600298 | 安琪酵母 | 91,450  | 1,629,639.00 | 0.17 |
| 244 | 600216 | 浙江医药 | 128,200 | 1,625,576.00 | 0.17 |
| 245 | 600284 | 浦东建设 | 123,120 | 1,623,952.80 | 0.17 |
| 246 | 600557 | 康缘药业 | 95,819  | 1,622,215.67 | 0.17 |
| 247 | 600651 | 飞乐音响 | 153,800 | 1,619,514.00 | 0.17 |
| 248 | 600022 | 山东钢铁 | 645,900 | 1,614,750.00 | 0.17 |
| 249 | 002437 | 誉衡药业 | 195,200 | 1,614,304.00 | 0.17 |
| 250 | 002019 | 亿帆医药 | 105,500 | 1,613,095.00 | 0.17 |
| 251 | 000926 | 福星股份 | 126,400 | 1,610,336.00 | 0.17 |
| 252 | 300291 | 华录百纳 | 72,100  | 1,606,388.00 | 0.17 |
| 253 | 600260 | 凯乐科技 | 103,600 | 1,603,728.00 | 0.17 |



|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 254 | 000816 | 智慧农业  | 251,845 | 1,601,734.20 | 0.17 |
| 255 | 002358 | 森源电气  | 82,600  | 1,584,268.00 | 0.17 |
| 256 | 002025 | 航天电器  | 62,850  | 1,583,820.00 | 0.17 |
| 257 | 000418 | 小天鹅 A | 49,000  | 1,583,680.00 | 0.17 |
| 258 | 600536 | 中国软件  | 65,817  | 1,583,557.02 | 0.17 |
| 259 | 000703 | 恒逸石化  | 105,300 | 1,582,659.00 | 0.17 |
| 260 | 300010 | 立思辰   | 95,200  | 1,582,224.00 | 0.17 |
| 261 | 000762 | 西藏矿业  | 92,500  | 1,575,275.00 | 0.17 |
| 262 | 000089 | 深圳机场  | 196,700 | 1,573,600.00 | 0.17 |
| 263 | 600600 | 青岛啤酒  | 53,400  | 1,572,096.00 | 0.17 |
| 264 | 600175 | 美都能源  | 317,229 | 1,570,283.55 | 0.17 |
| 265 | 002479 | 富春环保  | 105,900 | 1,569,438.00 | 0.17 |
| 266 | 000937 | 冀中能源  | 232,400 | 1,566,376.00 | 0.17 |
| 267 | 000829 | 天音控股  | 138,400 | 1,561,152.00 | 0.16 |
| 268 | 002002 | 鸿达兴业  | 212,357 | 1,558,700.38 | 0.16 |
| 269 | 600694 | 大商股份  | 39,006  | 1,557,509.58 | 0.16 |
| 270 | 601801 | 皖新传媒  | 88,278  | 1,551,044.46 | 0.16 |
| 271 | 000810 | 创维数字  | 109,800 | 1,544,886.00 | 0.16 |
| 272 | 002028 | 思源电气  | 116,876 | 1,540,425.68 | 0.16 |
| 273 | 000021 | 深科技   | 163,200 | 1,538,976.00 | 0.16 |
| 274 | 601311 | 骆驼股份  | 94,200  | 1,538,286.00 | 0.16 |
| 275 | 002396 | 星网锐捷  | 78,050  | 1,537,585.00 | 0.16 |
| 276 | 002512 | 达华智能  | 93,500  | 1,526,855.00 | 0.16 |
| 277 | 000777 | 中核科技  | 68,040  | 1,522,735.20 | 0.16 |
| 278 | 300001 | 特锐德   | 87,600  | 1,518,984.00 | 0.16 |
| 279 | 600169 | 太原重工  | 376,650 | 1,517,899.50 | 0.16 |
| 280 | 300122 | 智飞生物  | 92,000  | 1,515,240.00 | 0.16 |
| 281 | 601717 | 郑煤机   | 214,100 | 1,505,123.00 | 0.16 |
| 282 | 300202 | 聚龙股份  | 60,894  | 1,497,992.40 | 0.16 |
| 283 | 002325 | 洪涛股份  | 186,730 | 1,495,707.30 | 0.16 |
| 284 | 601010 | 文峰股份  | 284,300 | 1,495,418.00 | 0.16 |
| 285 | 600880 | 博瑞传播  | 169,700 | 1,486,572.00 | 0.16 |
| 286 | 600765 | 中航重机  | 103,555 | 1,483,943.15 | 0.16 |
| 287 | 002041 | 登海种业  | 78,150  | 1,475,472.00 | 0.16 |
| 288 | 600517 | 置信电气  | 150,500 | 1,464,365.00 | 0.15 |
| 289 | 002503 | 搜于特   | 101,430 | 1,459,577.70 | 0.15 |
| 290 | 600545 | 新疆城建  | 120,000 | 1,459,200.00 | 0.15 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 291 | 000848 | 承德露露 | 130,362 | 1,458,750.78 | 0.15 |
| 292 | 600058 | 五矿发展 | 95,100  | 1,448,373.00 | 0.15 |
| 293 | 002244 | 滨江集团 | 207,094 | 1,445,516.12 | 0.15 |
| 294 | 600809 | 山西汾酒 | 57,655  | 1,442,528.10 | 0.15 |
| 295 | 001696 | 宗申动力 | 152,400 | 1,432,560.00 | 0.15 |
| 296 | 600736 | 苏州高新 | 158,600 | 1,432,158.00 | 0.15 |
| 297 | 600259 | 广晟有色 | 33,500  | 1,423,415.00 | 0.15 |
| 298 | 002589 | 瑞康医药 | 43,600  | 1,414,820.00 | 0.15 |
| 299 | 000600 | 建投能源 | 159,000 | 1,411,920.00 | 0.15 |
| 300 | 002063 | 远光软件 | 107,405 | 1,411,301.70 | 0.15 |
| 301 | 002368 | 太极股份 | 46,086  | 1,410,692.46 | 0.15 |
| 302 | 002344 | 海宁皮城 | 124,300 | 1,407,076.00 | 0.15 |
| 303 | 002269 | 美邦服饰 | 280,400 | 1,404,804.00 | 0.15 |
| 304 | 000587 | 金洲慈航 | 94,300  | 1,403,184.00 | 0.15 |
| 305 | 600835 | 上海机电 | 71,600  | 1,397,632.00 | 0.15 |
| 306 | 002640 | 跨境通  | 75,800  | 1,387,140.00 | 0.15 |
| 307 | 000620 | 新华联  | 163,100 | 1,383,088.00 | 0.15 |
| 308 | 300166 | 东方国信 | 66,500  | 1,382,535.00 | 0.15 |
| 309 | 002285 | 世联行  | 181,512 | 1,379,491.20 | 0.15 |
| 310 | 600220 | 江苏阳光 | 316,600 | 1,374,044.00 | 0.15 |
| 311 | 002106 | 莱宝高科 | 121,900 | 1,370,156.00 | 0.14 |
| 312 | 600859 | 王府井  | 84,150  | 1,369,962.00 | 0.14 |
| 313 | 000572 | 海马汽车 | 255,500 | 1,369,480.00 | 0.14 |
| 314 | 603188 | 亚邦股份 | 76,500  | 1,366,290.00 | 0.14 |
| 315 | 600282 | 南钢股份 | 439,100 | 1,361,210.00 | 0.14 |
| 316 | 000062 | 深圳华强 | 47,911  | 1,361,151.51 | 0.14 |
| 317 | 600639 | 浦东金桥 | 73,200  | 1,358,592.00 | 0.14 |
| 318 | 600433 | 冠豪高新 | 169,300 | 1,357,786.00 | 0.14 |
| 319 | 600481 | 双良节能 | 179,880 | 1,352,697.60 | 0.14 |
| 320 | 002277 | 友阿股份 | 94,100  | 1,351,276.00 | 0.14 |
| 321 | 000158 | 常山股份 | 108,100 | 1,351,250.00 | 0.14 |
| 322 | 600537 | 亿晶光电 | 181,700 | 1,350,031.00 | 0.14 |
| 323 | 000636 | 风华高科 | 138,200 | 1,348,832.00 | 0.14 |
| 324 | 601678 | 滨化股份 | 184,640 | 1,346,025.60 | 0.14 |
| 325 | 601231 | 环旭电子 | 125,200 | 1,340,892.00 | 0.14 |
| 326 | 603077 | 和邦生物 | 261,700 | 1,339,904.00 | 0.14 |
| 327 | 002635 | 安洁科技 | 36,800  | 1,339,520.00 | 0.14 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 328 | 600993 | 马应龙   | 66,992  | 1,337,830.24 | 0.14 |
| 329 | 002354 | 天神娱乐  | 19,300  | 1,334,788.00 | 0.14 |
| 330 | 002317 | 众生药业  | 107,600 | 1,328,860.00 | 0.14 |
| 331 | 600270 | 外运发展  | 80,300  | 1,328,162.00 | 0.14 |
| 332 | 300147 | 香雪制药  | 102,790 | 1,325,991.00 | 0.14 |
| 333 | 000616 | 海航投资  | 254,018 | 1,325,973.96 | 0.14 |
| 334 | 002161 | 远望谷   | 114,801 | 1,323,655.53 | 0.14 |
| 335 | 601777 | 力帆股份  | 138,100 | 1,320,236.00 | 0.14 |
| 336 | 600277 | 亿利洁能  | 185,500 | 1,318,905.00 | 0.14 |
| 337 | 600053 | 九鼎投资  | 28,600  | 1,317,316.00 | 0.14 |
| 338 | 002399 | 海普瑞   | 71,800  | 1,308,196.00 | 0.14 |
| 339 | 300257 | 开山股份  | 76,100  | 1,305,876.00 | 0.14 |
| 340 | 600894 | 广日股份  | 95,300  | 1,302,751.00 | 0.14 |
| 341 | 600580 | 卧龙电气  | 142,600 | 1,297,660.00 | 0.14 |
| 342 | 002505 | 大康农业  | 365,140 | 1,292,595.60 | 0.14 |
| 343 | 000669 | 金鸿能源  | 75,100  | 1,287,965.00 | 0.14 |
| 344 | 000973 | 佛塑科技  | 171,700 | 1,287,750.00 | 0.14 |
| 345 | 002428 | 云南锗业  | 101,500 | 1,286,005.00 | 0.14 |
| 346 | 000090 | 天健集团  | 132,988 | 1,284,664.08 | 0.14 |
| 347 | 600805 | 悦达投资  | 151,097 | 1,282,813.53 | 0.14 |
| 348 | 000501 | 鄂武商 A | 65,700  | 1,282,464.00 | 0.14 |
| 349 | 000541 | 佛山照明  | 130,244 | 1,281,600.96 | 0.14 |
| 350 | 000726 | 鲁泰 A  | 99,800  | 1,278,438.00 | 0.14 |
| 351 | 000528 | 柳工    | 174,800 | 1,277,788.00 | 0.13 |
| 352 | 600826 | 兰生股份  | 46,700  | 1,275,844.00 | 0.13 |
| 353 | 002482 | 广田集团  | 137,650 | 1,273,262.50 | 0.13 |
| 354 | 000830 | 鲁西化工  | 227,600 | 1,272,284.00 | 0.13 |
| 355 | 600289 | 亿阳信通  | 98,100  | 1,270,395.00 | 0.13 |
| 356 | 002498 | 汉缆股份  | 295,400 | 1,270,220.00 | 0.13 |
| 357 | 002056 | 横店东磁  | 91,200  | 1,268,592.00 | 0.13 |
| 358 | 600729 | 重庆百货  | 54,133  | 1,268,336.19 | 0.13 |
| 359 | 000652 | 泰达股份  | 229,200 | 1,265,184.00 | 0.13 |
| 360 | 600458 | 时代新材  | 89,110  | 1,260,906.50 | 0.13 |
| 361 | 002707 | 众信旅游  | 81,000  | 1,259,550.00 | 0.13 |
| 362 | 600823 | 世茂股份  | 178,462 | 1,252,803.24 | 0.13 |
| 363 | 002005 | 德豪润达  | 217,000 | 1,247,750.00 | 0.13 |
| 364 | 002128 | 露天煤业  | 144,600 | 1,243,560.00 | 0.13 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 365 | 002123 | 梦网荣信 | 82,600  | 1,239,000.00 | 0.13 |
| 366 | 600112 | 天成控股 | 112,700 | 1,237,446.00 | 0.13 |
| 367 | 600596 | 新安股份 | 120,600 | 1,234,944.00 | 0.13 |
| 368 | 002581 | 未名医药 | 50,700  | 1,230,489.00 | 0.13 |
| 369 | 600750 | 江中药业 | 39,900  | 1,229,718.00 | 0.13 |
| 370 | 002242 | 九阳股份 | 68,200  | 1,229,646.00 | 0.13 |
| 371 | 000897 | 津滨发展 | 287,100 | 1,228,788.00 | 0.13 |
| 372 | 002064 | 华峰氨纶 | 223,300 | 1,225,917.00 | 0.13 |
| 373 | 002463 | 沪电股份 | 255,700 | 1,222,246.00 | 0.13 |
| 374 | 600006 | 东风汽车 | 177,600 | 1,221,888.00 | 0.13 |
| 375 | 002190 | 成飞集成 | 38,200  | 1,221,636.00 | 0.13 |
| 376 | 000680 | 山推股份 | 220,200 | 1,217,706.00 | 0.13 |
| 377 | 600628 | 新世界  | 86,141  | 1,217,172.33 | 0.13 |
| 378 | 000861 | 海印股份 | 249,740 | 1,211,239.00 | 0.13 |
| 379 | 600351 | 亚宝药业 | 122,252 | 1,207,849.76 | 0.13 |
| 380 | 600291 | 西水股份 | 62,900  | 1,206,422.00 | 0.13 |
| 381 | 000969 | 安泰科技 | 113,800 | 1,199,452.00 | 0.13 |
| 382 | 600141 | 兴发集团 | 78,600  | 1,195,506.00 | 0.13 |
| 383 | 002727 | 一心堂  | 56,377  | 1,195,192.40 | 0.13 |
| 384 | 600395 | 盘江股份 | 146,900 | 1,185,483.00 | 0.13 |
| 385 | 000681 | 视觉中国 | 62,125  | 1,184,102.50 | 0.13 |
| 386 | 601233 | 桐昆股份 | 82,000  | 1,177,520.00 | 0.12 |
| 387 | 002588 | 史丹利  | 103,400 | 1,173,590.00 | 0.12 |
| 388 | 002254 | 泰和新材 | 94,860  | 1,172,469.60 | 0.12 |
| 389 | 600790 | 轻纺城  | 162,470 | 1,169,784.00 | 0.12 |
| 390 | 600428 | 中远海特 | 190,488 | 1,165,786.56 | 0.12 |
| 391 | 002011 | 盾安环境 | 122,100 | 1,162,392.00 | 0.12 |
| 392 | 000596 | 古井贡酒 | 25,500  | 1,160,250.00 | 0.12 |
| 393 | 300032 | 金龙机电 | 71,400  | 1,148,826.00 | 0.12 |
| 394 | 000049 | 德赛电池 | 27,300  | 1,147,965.00 | 0.12 |
| 395 | 600496 | 精工钢构 | 267,460 | 1,144,728.80 | 0.12 |
| 396 | 600773 | 西藏城投 | 95,600  | 1,140,508.00 | 0.12 |
| 397 | 002699 | 美盛文化 | 33,700  | 1,139,060.00 | 0.12 |
| 398 | 002642 | 荣之联  | 56,500  | 1,135,650.00 | 0.12 |
| 399 | 601001 | 大同煤业 | 185,800 | 1,135,238.00 | 0.12 |
| 400 | 002345 | 潮宏基  | 93,800  | 1,133,104.00 | 0.12 |
| 401 | 000552 | 靖远煤电 | 298,800 | 1,132,452.00 | 0.12 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 402 | 002663 | 普邦股份 | 186,405 | 1,131,478.35 | 0.12 |
| 403 | 300039 | 上海凯宝 | 110,400 | 1,129,392.00 | 0.12 |
| 404 | 600869 | 智慧能源 | 145,900 | 1,129,266.00 | 0.12 |
| 405 | 600720 | 祁连山  | 137,900 | 1,126,643.00 | 0.12 |
| 406 | 300297 | 蓝盾股份 | 90,200  | 1,122,088.00 | 0.12 |
| 407 | 300043 | 星辉娱乐 | 110,500 | 1,120,470.00 | 0.12 |
| 408 | 600757 | 长江传媒 | 134,672 | 1,119,124.32 | 0.12 |
| 409 | 600850 | 华东电脑 | 46,195  | 1,116,995.10 | 0.12 |
| 410 | 600059 | 古越龙山 | 107,700 | 1,102,848.00 | 0.12 |
| 411 | 000099 | 中信海直 | 94,100  | 1,101,911.00 | 0.12 |
| 412 | 600563 | 法拉电子 | 30,000  | 1,100,100.00 | 0.12 |
| 413 | 002690 | 美亚光电 | 51,900  | 1,098,204.00 | 0.12 |
| 414 | 601689 | 拓普集团 | 37,300  | 1,097,366.00 | 0.12 |
| 415 | 600280 | 中央商场 | 127,200 | 1,095,192.00 | 0.12 |
| 416 | 601886 | 江河集团 | 102,506 | 1,091,688.90 | 0.12 |
| 417 | 000869 | 张裕 A | 30,200  | 1,087,200.00 | 0.11 |
| 418 | 002371 | 七星电子 | 40,450  | 1,075,970.00 | 0.11 |
| 419 | 600329 | 中新药业 | 61,600  | 1,074,304.00 | 0.11 |
| 420 | 002681 | 奋达科技 | 82,860  | 1,071,379.80 | 0.11 |
| 421 | 600292 | 远达环保 | 86,570  | 1,070,870.90 | 0.11 |
| 422 | 603883 | 老百姓  | 22,900  | 1,068,285.00 | 0.11 |
| 423 | 002093 | 国脉科技 | 96,000  | 1,062,720.00 | 0.11 |
| 424 | 600831 | 广电网络 | 80,600  | 1,052,636.00 | 0.11 |
| 425 | 600586 | 金晶科技 | 226,700 | 1,049,621.00 | 0.11 |
| 426 | 002332 | 仙琚制药 | 81,400  | 1,047,618.00 | 0.11 |
| 427 | 000417 | 合肥百货 | 121,200 | 1,045,956.00 | 0.11 |
| 428 | 603198 | 迎驾贡酒 | 48,200  | 1,038,710.00 | 0.11 |
| 429 | 600460 | 士兰微  | 166,100 | 1,033,142.00 | 0.11 |
| 430 | 600657 | 信达地产 | 169,100 | 1,031,510.00 | 0.11 |
| 431 | 002342 | 巨力索具 | 149,100 | 1,030,281.00 | 0.11 |
| 432 | 002029 | 七匹狼  | 100,600 | 1,027,126.00 | 0.11 |
| 433 | 000931 | 中关村  | 119,800 | 1,014,706.00 | 0.11 |
| 434 | 600195 | 中牧股份 | 47,700  | 1,013,625.00 | 0.11 |
| 435 | 600825 | 新华传媒 | 116,000 | 1,008,040.00 | 0.11 |
| 436 | 600748 | 上实发展 | 122,850 | 1,006,141.50 | 0.11 |
| 437 | 000426 | 兴业矿业 | 115,300 | 1,005,416.00 | 0.11 |
| 438 | 601002 | 晋亿实业 | 105,600 | 1,005,312.00 | 0.11 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 439 | 002309 | 中利科技  | 70,226  | 997,911.46 | 0.11 |
| 440 | 600862 | 中航高科  | 80,200  | 981,648.00 | 0.10 |
| 441 | 002551 | 尚荣医疗  | 49,292  | 981,403.72 | 0.10 |
| 442 | 000877 | 天山股份  | 136,800 | 964,440.00 | 0.10 |
| 443 | 600551 | 时代出版  | 46,976  | 954,552.32 | 0.10 |
| 444 | 600640 | 号百控股  | 47,700  | 953,046.00 | 0.10 |
| 445 | 002414 | 高德红外  | 41,600  | 947,648.00 | 0.10 |
| 446 | 603369 | 今世缘   | 72,200  | 947,264.00 | 0.10 |
| 447 | 601908 | 京运通   | 133,000 | 946,960.00 | 0.10 |
| 448 | 002251 | 步步高   | 57,510  | 946,039.50 | 0.10 |
| 449 | 600743 | 华远地产  | 208,150 | 926,267.50 | 0.10 |
| 450 | 600180 | 瑞茂通   | 67,700  | 916,658.00 | 0.10 |
| 451 | 002698 | 博实股份  | 58,610  | 912,557.70 | 0.10 |
| 452 | 000919 | 金陵药业  | 67,000  | 906,510.00 | 0.10 |
| 453 | 600776 | 东方通信  | 105,700 | 904,792.00 | 0.10 |
| 454 | 002416 | 爱施德   | 59,500  | 876,435.00 | 0.09 |
| 455 | 603169 | 兰石重装  | 65,000  | 868,400.00 | 0.09 |
| 456 | 600425 | 青松建化  | 183,200 | 851,880.00 | 0.09 |
| 457 | 603555 | 贵人鸟   | 27,600  | 848,976.00 | 0.09 |
| 458 | 600251 | 冠农股份  | 104,400 | 846,684.00 | 0.09 |
| 459 | 002327 | 富安娜   | 94,300  | 829,840.00 | 0.09 |
| 460 | 600335 | 国机汽车  | 68,000  | 826,200.00 | 0.09 |
| 461 | 000693 | ST 华泽 | 66,000  | 825,000.00 | 0.09 |
| 462 | 600801 | 华新水泥  | 106,200 | 823,050.00 | 0.09 |
| 463 | 601005 | 重庆钢铁  | 326,500 | 822,780.00 | 0.09 |
| 464 | 603806 | 福斯特   | 17,700  | 818,979.00 | 0.09 |
| 465 | 002118 | 紫鑫药业  | 113,700 | 818,640.00 | 0.09 |
| 466 | 603001 | 奥康国际  | 35,500  | 812,950.00 | 0.09 |
| 467 | 600864 | 哈投股份  | 70,200  | 801,684.00 | 0.08 |
| 468 | 000631 | 顺发恒业  | 161,796 | 792,800.40 | 0.08 |
| 469 | 600397 | 安源煤业  | 153,400 | 791,544.00 | 0.08 |
| 470 | 600874 | 创业环保  | 96,500  | 784,545.00 | 0.08 |
| 471 | 603355 | 莱克电气  | 16,900  | 780,273.00 | 0.08 |
| 472 | 603528 | 多伦科技  | 11,900  | 777,665.00 | 0.08 |
| 473 | 002315 | 焦点科技  | 12,800  | 771,712.00 | 0.08 |
| 474 | 002646 | 青青稞酒  | 39,900  | 768,075.00 | 0.08 |
| 475 | 002392 | 北京利尔  | 133,000 | 766,080.00 | 0.08 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 476 | 600483 | 福能股份 | 68,800  | 761,616.00 | 0.08 |
| 477 | 603698 | 航天工程 | 27,300  | 753,207.00 | 0.08 |
| 478 | 603567 | 珍宝岛  | 37,700  | 744,952.00 | 0.08 |
| 479 | 002233 | 塔牌集团 | 79,400  | 742,390.00 | 0.08 |
| 480 | 603005 | 晶方科技 | 24,500  | 735,980.00 | 0.08 |
| 481 | 600184 | 光电股份 | 33,900  | 731,562.00 | 0.08 |
| 482 | 600618 | 氯碱化工 | 49,900  | 728,041.00 | 0.08 |
| 483 | 600338 | 西藏珠峰 | 25,000  | 724,500.00 | 0.08 |
| 484 | 000517 | 荣安地产 | 134,500 | 707,470.00 | 0.07 |
| 485 | 603328 | 依顿电子 | 22,100  | 706,758.00 | 0.07 |
| 486 | 601016 | 节能风电 | 79,700  | 705,345.00 | 0.07 |
| 487 | 600971 | 恒源煤电 | 110,900 | 695,343.00 | 0.07 |
| 488 | 002249 | 大洋电机 | 76,700  | 661,921.00 | 0.07 |
| 489 | 603568 | 伟明环保 | 28,400  | 661,720.00 | 0.07 |
| 490 | 002745 | 木林森  | 18,000  | 656,820.00 | 0.07 |
| 491 | 600088 | 中视传媒 | 29,400  | 644,448.00 | 0.07 |
| 492 | 002194 | 武汉凡谷 | 50,100  | 644,286.00 | 0.07 |
| 493 | 600468 | 百利电气 | 47,900  | 623,658.00 | 0.07 |
| 494 | 002238 | 天威视讯 | 41,132  | 602,583.80 | 0.06 |
| 495 | 000723 | 美锦能源 | 39,400  | 595,728.00 | 0.06 |
| 496 | 000025 | 特力A  | 10,400  | 574,808.00 | 0.06 |
| 497 | 600917 | 重庆燃气 | 37,900  | 499,901.00 | 0.05 |
| 498 | 603868 | 飞科电器 | 9,200   | 431,112.00 | 0.05 |
| 499 | 603025 | 大豪科技 | 10,900  | 425,427.00 | 0.04 |
| 500 | 600981 | 汇鸿集团 | 47,300  | 401,577.00 | 0.04 |
| 501 | 603377 | 东方时尚 | 9,700   | 391,589.00 | 0.04 |
| 502 | 603866 | 桃李面包 | 8,700   | 381,930.00 | 0.04 |
| 503 | 000761 | 本钢板材 | 57,700  | 310,426.00 | 0.03 |
| 504 | 300072 | 三聚环保 | 25      | 1,157.25   | 0.00 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额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  | 002426 | 胜利精密 | 4,011,835.00 | 0.35            |
| 2  | 300113 | 顺网科技 | 3,785,521.03 | 0.33            |
| 3  | 300136 | 信维通信 | 3,608,252.23 | 0.31            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 4  | 002572 | 索菲亚  | 3,459,104.95 | 0.30 |
| 5  | 600682 | 南京新百 | 3,111,486.00 | 0.27 |
| 6  | 002460 | 赣锋锂业 | 3,018,828.62 | 0.26 |
| 7  | 600166 | 福田汽车 | 3,007,432.00 | 0.26 |
| 8  | 002366 | 台海核电 | 2,945,528.11 | 0.26 |
| 9  | 300156 | 神雾环保 | 2,893,752.66 | 0.25 |
| 10 | 002407 | 多氟多  | 2,876,423.29 | 0.25 |
| 11 | 600315 | 上海家化 | 2,806,796.00 | 0.24 |
| 12 | 002038 | 双鹭药业 | 2,797,467.85 | 0.24 |
| 13 | 002422 | 科伦药业 | 2,781,234.04 | 0.24 |
| 14 | 300296 | 利亚德  | 2,708,331.16 | 0.24 |
| 15 | 000581 | 威孚高科 | 2,660,553.41 | 0.23 |
| 16 | 002131 | 利欧股份 | 2,637,085.00 | 0.23 |
| 17 | 300266 | 兴源环境 | 2,618,975.03 | 0.23 |
| 18 | 600266 | 北京城建 | 2,603,377.00 | 0.23 |
| 19 | 000983 | 西山煤电 | 2,554,447.20 | 0.22 |
| 20 | 002176 | 江特电机 | 2,529,443.00 | 0.22 |

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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  | 300072 | 三聚环保 | 7,323,287.45 | 0.64           |
| 2  | 002466 | 天齐锂业 | 6,221,366.89 | 0.54           |
| 3  | 002085 | 万丰奥威 | 5,393,370.59 | 0.47           |
| 4  | 600074 | 保千里  | 4,102,808.00 | 0.36           |
| 5  | 002310 | 东方园林 | 3,948,567.17 | 0.34           |
| 6  | 002426 | 胜利精密 | 3,831,300.94 | 0.33           |
| 7  | 600482 | 中国动力 | 3,724,501.69 | 0.32           |
| 8  | 002219 | 恒康医疗 | 3,587,184.42 | 0.31           |
| 9  | 002714 | 牧原股份 | 3,579,667.99 | 0.31           |
| 10 | 002018 | 华信国际 | 3,360,356.40 | 0.29           |
| 11 | 600498 | 烽火通信 | 3,359,356.72 | 0.29           |
| 12 | 000983 | 西山煤电 | 3,342,867.37 | 0.29           |
| 13 | 600654 | 中安消  | 3,210,237.40 | 0.28           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 600376 | 首开股份 | 3,150,060.00 | 0.27 |
| 15 | 300182 | 捷成股份 | 3,144,917.44 | 0.27 |
| 16 | 600816 | 安信信托 | 3,113,727.00 | 0.27 |
| 17 | 300122 | 智飞生物 | 2,971,283.14 | 0.26 |
| 18 | 002174 | 游族网络 | 2,843,253.68 | 0.25 |
| 19 | 002049 | 紫光国芯 | 2,780,413.91 | 0.24 |
| 20 | 300085 | 银之杰  | 2,780,334.79 | 0.24 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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 | 312,062,169.70 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 321,533,820.06 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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） | 397,233.12 | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 397,233.12 | 0.04         |

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

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 | 128013 | 洪涛转债 | 2,064 | 232,943.04 | 0.02 |
| 2 | 127003 | 海印转债 | 1,448 | 164,290.08 | 0.02 |
| 3 | -      | -    | -     | -          | -    |
| 4 | -      | -    | -     | -          | -    |
| 5 | -      | -    | -     | -          | -    |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

| 代码             | 名称                       | 持仓量<br>(买/卖)(单位:手) | 合约市值          | 公允价值变动     | 风险说明                       |
|----------------|--------------------------|--------------------|---------------|------------|----------------------------|
| IC1701         | 中证 500 股指期货<br>IC1701 合约 | 30                 | 37,303,200.00 | 167,800.00 | 买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理。 |
| IC1702         | 中证 500 股指期货<br>IC1702 合约 | 20                 | 24,552,000.00 | 118,640.00 | 买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理。 |
| 公允价值变动总额合计     |                          |                    |               |            | 286,440.00                 |
| 股指期货投资本期收益     |                          |                    |               |            | 4,565,120.00               |
| 股指期货投资本期公允价值变动 |                          |                    |               |            | -69,280.00                 |

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，

实现投资目标。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 12,422,747.10 |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 27,658.94     |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 12,450,406.04 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|---------------|
| 1  | 127003 | 海印转债 | 164,290.08 | 0.02          |

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 000887 | 中鼎股份 | 3,712,014.00 | 0.39          | 重大事项     |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构         |        |               |        |                |        |
|-----------|-----------|---------------|--------|---------------|--------|----------------|--------|
|           |           | 机构投资者         |        | 个人投资者         |        | 华夏中证 500ETF 联接 |        |
|           |           | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 4,965     | 62,922.21 | 12,255,073.00 | 3.92%  | 64,056,379.00 | 20.50% | 236,097,342.00 | 75.57% |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                                    | 持有份额 (份)    | 占上市总份额比例 |
|----|--|-------------|----------|
| 1  | 百年人寿保险股份有限公司—分红保险产品                      | 7,391,500   | 2.37%    |
| 2  | 北京安瑞祥和资产管理有限公司                           | 2,218,035   | 0.71%    |
| 3  | 姚文波                                      | 970,568     | 0.31%    |
| 4  | 吕爱平                                      | 700,000     | 0.22%    |
| 5  | 倪光新                                      | 582,546     | 0.19%    |
| 6  | 国信证券股份有限公司                               | 541,788     | 0.17%    |
| 7  | 袁园                                       | 525,341     | 0.17%    |
| 8  | 梁鹏飞                                      | 493,868     | 0.16%    |
| 9  | 贺承祥                                      | 440,113     | 0.14%    |
| 10 | 陈洁玲                                      | 437,784     | 0.14%    |
| 10 | 马松奇                                      | 437,784     | 0.14%    |
| 10 | 王虎俊                                      | 437,784     | 0.14%    |
| 10 | 张光辉                                      | 437,784     | 0.14%    |
| 11 | 中国建设银行股份有限公司—华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 236,097,342 | 75.57%   |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2015年5月5日）基金份额总额 | 2,134,473,505 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 316,008,794   |
| 本报告期基金总申购份额              | 27,600,000    |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 31,200,000    |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -             |
| 本报告期末基金份额总额              | 312,408,794   |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 70,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计

服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------|--------|----------------|--------------|-----------|------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 申万宏源证券 | 2      | 353,073,736.33 | 55.77%       | 46,360.69 | 55.78%     | -  |
| 国泰君安证券 | 2      | 198,764,135.37 | 31.40%       | 26,097.34 | 31.40%     | -  |
| 中信建投证券 | 3      | 81,204,716.46  | 12.83%       | 10,661.95 | 12.83%     | -  |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 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。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了光大证券、海通证券、中国银河证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易       |              | 回购交易 |              |
|--------|------------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 |
| 国泰君安证券 | 965,314.60 | 100.00%      | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式       | 法定披露日期     |
|----|---|--------------|------------|
| 1  | 华夏基金管理有限公司公告                                  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-01-04 |
| 2  | 华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-01-04 |
| 3  | 华夏基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下基金场内申赎业务安排的提示性公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-01-05 |
| 4  | 华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-01-07 |
| 5  | 华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-01-13 |
| 6  | 华夏基金管理有限公司关于设立上海华夏财富投资管理有限公司的公告               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-01-30 |
| 7  | 华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-03-04 |
| 8  | 华夏基金管理有限公司公告                                  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-07-02 |
| 9  | 华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-07-02 |
| 10 | 华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告                  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-07-23 |
| 11 | 华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-09-20 |
| 12 | 华夏基金管理有限公司关于增聘华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-10-22 |
| 13 | 华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2016-11-18 |

|  |           |  |  |
|--|-----------|--|--|
|  | 司兼职等情况的公告 |  |  |
|--|-----------|--|--|

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；
- 12.1.2 《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 法律意见书；
- 12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司  
二〇一七年三月二十九日