

景顺长城中证 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：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

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，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20

6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	67
§9 基金份额持有人信息.....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	69
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	70
§10 开放式基金份额变动.....	71
§11 重大事件揭示.....	72
11.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 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	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风

	险收益特征。
--	--------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		杨光裕	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

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 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-6,529,267.29	17,219,963.37	34,587,635.19
本期利润	-21,838,065.84	17,353,462.51	38,959,833.92
加权平均基金份额本期利润	-0.4067	0.4133	0.5541
本期加权平均净值利润率	-25.14%	21.62%	52.05%
本期基金份额净值增长率	-17.82%	42.24%	39.97%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	31,851,311.81	59,547,912.55	14,416,160.32
期末可供分配基金份额利润	0.6298	0.9831	0.3942
期末基金资产净值	82,424,267.81	120,120,868.55	50,989,116.32
期末基金份额净值	1.6298	1.9831	1.3942
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	62.98%	98.31%	39.42%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

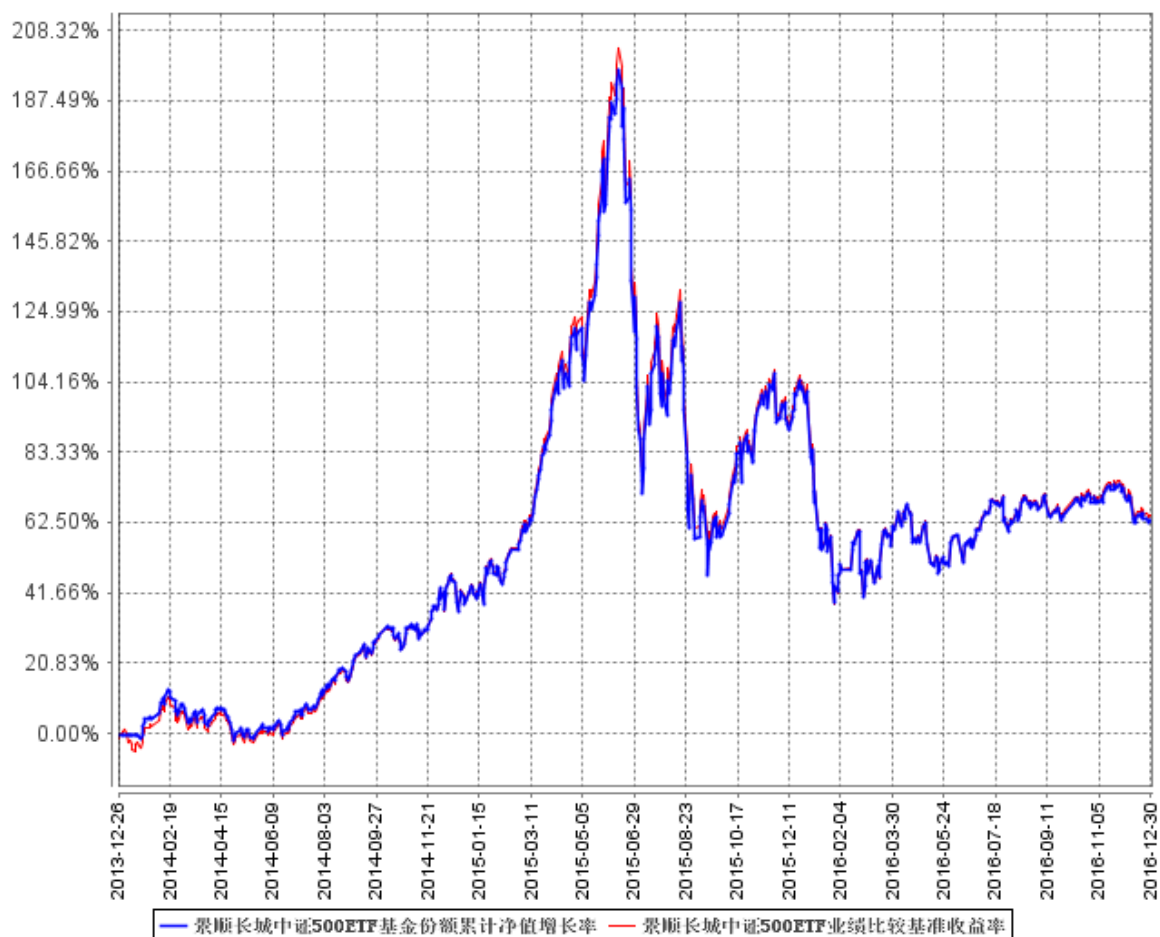
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

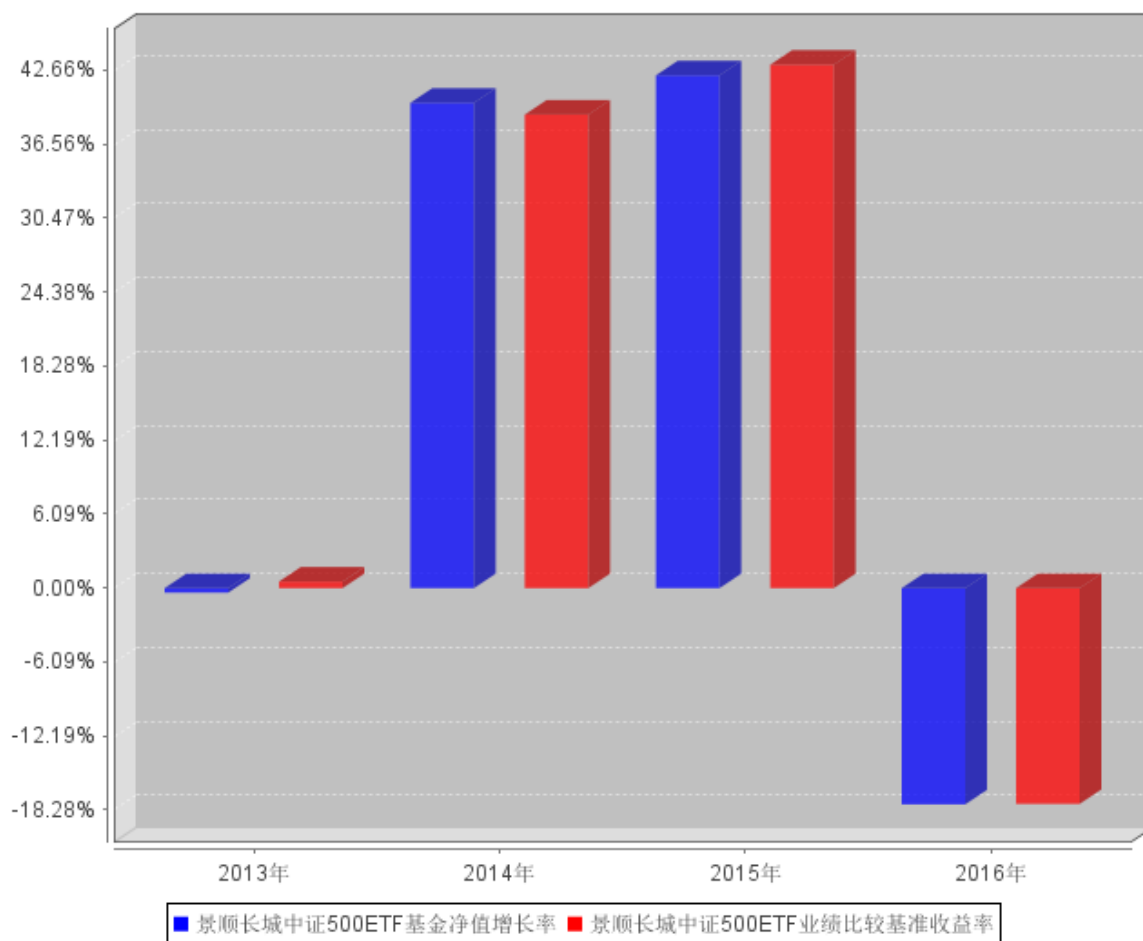
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.46%	0.81%	-1.02%	0.83%	-0.44%	-0.02%
过去六个月	1.49%	0.91%	2.29%	0.92%	-0.80%	-0.01%
过去一年	-17.82%	1.86%	-17.78%	1.90%	-0.04%	-0.04%
过去三年	63.62%	2.06%	63.58%	2.09%	0.04%	-0.03%
自基金合同生效起至今	62.98%	2.05%	64.47%	2.08%	-1.49%	-0.03%

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



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

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



注：2013 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2013 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止2016年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理62只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证800食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城

安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐喻军	本基金的 基金经理	2014 年 12 月 27 日	-	6 年	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和

其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年中国经济处于产业结构调整阶段，虽然全年 GDP 增速跌至 6.7%，但经济整体呈现企稳迹象，PMI 在 2 季度出现短暂回落后，3、4 季度逐步回升。12 月份的工业增加值累计同比增长 6%，较 3 季度保持稳定。5 月权威人士定调经济“L”型走势，全年通胀较低但 PPI 在全球大宗商品以及供给侧改革下明显回升，年末出现再通胀预期。强美元背景下，汇率层面持续面临贬值压力；货币政策受制于汇率、资产价格等因素态度偏紧。2016 年市场出现分化行情，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板指数下跌 27.71%。在经历年初熔断后，受益于商品价格上涨的周期股、业绩稳定的蓝筹股和部分具备竞争优势的白马成长股，2016 年股价创出熔断前的新高；而估值较高、业绩未能兑现，2015 年涨幅巨大的大部分创业板股票 2016 年整体表现疲弱。

本基金采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，本基金上市以后基金的收益和标的

指数收益基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年,本基金份额净值增长率为-17.82%,业绩比较基准收益率为-17.78%。2016 年,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内,跟踪误差(年化)控制在 2%以内。

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 年宏观经济,基本面仍可能延续企稳态势。但房地产限购限贷政策对投资的影响将有所体现,经济增长驱动主要看基建投资是否持续维持高位和制造业投资能否有所反弹。受 2016 年 1 季度低基数影响,CPI 仍将维持在 2%以上,将继续强化市场的通胀预期;PPI 同比仍将回升,环比预计小幅回落。中央经济工作会议定调货币政策稳健中性。防范地产泡沫、控制金融风险、应对人民币贬值压力仍是央行货币政策的重点。

本基金作为被动指数基金,将继续采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理,控制跟踪误差和跟踪偏离度。

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,本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度,健全管理制度和业务规章,依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核,对监察稽核中发现的问题及时提示,督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告,及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力,确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整,保障基金份额持有人利益,本基金管理人采取的主要措施包括:

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上,根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况,对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新,从管理制度和业务流程上进行风险控制,进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度,形成不同

岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及其适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供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)的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

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

从 2016 年 8 月 8 日至 2016 年 11 月 3 日，及从 2016 年 11 月 18 日至 2016 年 12 月 26 日，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20980 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人；
引言段	我们审计了后附的景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“景顺长城中证 500ETF”)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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是景顺长城中证 500ETF 的基金管理人景顺长城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。
注册会计师的责任段	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。

审计意见段	我们认为，上述景顺长城中证 500ETF 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，公允反映了景顺长城中证 500ETF2016 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。	
注册会计师的姓名	单峰	朱宏宇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,205,918.59	3,943,378.32
结算备付金		4,154.88	43,723.28
存出保证金		2,600.65	18,448.70
交易性金融资产	7.4.7.2	81,475,537.41	116,776,373.40
其中：股票投资		81,475,537.41	116,776,373.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	260.31	810.54
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		82,688,471.84	120,782,734.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	359,282.88
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,601.36	52,045.99
应付托管费		7,120.28	10,409.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	21,482.39	40,127.63

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	200,000.00	200,000.00
负债合计		264,204.03	661,865.69
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	50,572,956.00	60,572,956.00
未分配利润	7.4.7.10	31,851,311.81	59,547,912.55
所有者权益合计		82,424,267.81	120,120,868.55
负债和所有者权益总计		82,688,471.84	120,782,734.24

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6298 元，基金份额总额 50,572,956.00 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-20,690,332.85	18,553,163.58
1.利息收入		14,771.13	35,067.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	14,748.38	35,067.99
债券利息收入		22.75	-
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）		-5,396,305.43	18,294,718.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,998,562.29	18,001,372.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,836.25	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	586,420.61	293,346.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-15,308,798.55	133,499.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	89,878.01

减：二、费用		1,147,732.99	1,199,701.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	434,535.31	397,319.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	86,907.14	79,463.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	75,715.54	111,750.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	550,575.00	611,167.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,838,065.84	17,353,462.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,838,065.84	17,353,462.51

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 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 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）	60,572,956.00	59,547,912.55	120,120,868.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-21,838,065.84	-21,838,065.84
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）	-10,000,000.00	-5,858,534.90	-15,858,534.90
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-10,000,000.00	-5,858,534.90	-15,858,534.90
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）	50,572,956.00	31,851,311.81	82,424,267.81
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	36,572,956.00	14,416,160.32	50,989,116.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,353,462.51	17,353,462.51
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)	24,000,000.00	27,778,289.72	51,778,289.72
其中：1. 基金申购款	82,000,000.00	80,172,153.32	162,172,153.32
2. 基金赎回款	-58,000,000.00	-52,393,863.60	-110,393,863.60
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)	60,572,956.00	59,547,912.55	120,120,868.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
许义明	吴建军	邵媛媛
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,538,347.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效,基金合同

生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]第 17 号文审核同意,本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2017 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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则按直线法计算。

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据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：

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收

入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,205,918.59	3,943,378.32
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,205,918.59	3,943,378.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,278,638.09	81,475,537.41	-10,803,100.68
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	92,278,638.09	81,475,537.41	-10,803,100.68
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	112,270,675.53	116,776,373.40	4,505,697.87
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	112,270,675.53	116,776,373.40	4,505,697.87

注：于 2016 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元 (2015 年 12 月 31 日：0.00 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末和上年度末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末和上年度末的买入返售金融资产项目余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末和上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	257.21	782.62
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	1.90	19.62
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-

应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.20	8.30
合计	260.31	810.54

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末和上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	21,482.39	40,127.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	21,482.39	40,127.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	150,000.00	150,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	200,000.00	200,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	60,572,956.00	60,572,956.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-10,000,000.00	-10,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	50,572,956.00	50,572,956.00

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	79,088,392.64	-19,540,480.09	59,547,912.55
本期利润	-6,529,267.29	-15,308,798.55	-21,838,065.84
本期基金份额交易产生的变动数	-12,682,095.46	6,823,560.56	-5,858,534.90
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-12,682,095.46	6,823,560.56	-5,858,534.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,877,029.89	-28,025,718.08	31,851,311.81

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	14,254.25	31,621.86
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	396.29	3,367.38
其他	97.84	78.75
合计	14,748.38	35,067.99

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,796,942.34	5,538,286.95
股票投资收益——赎回差价收入	-3,201,619.95	12,463,085.26
股票投资收益——申购差价收入	-	-

合计	-5,998,562.29	18,001,372.21
----	---------------	---------------

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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	24,395,944.43	29,620,909.86
减：卖出股票成本总额	27,192,886.77	24,082,622.91
买卖股票差价收入	-2,796,942.34	5,538,286.95

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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
赎回基金份额对价总额	15,858,534.90	110,393,863.60
减：现金支付赎回款总额	294,060.90	8,823,311.60
减：赎回股票成本总额	18,766,093.95	89,107,466.74
赎回差价收入	-3,201,619.95	12,463,085.26

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	124,359.00	-
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	108,500.00	-
减：应收利息总额	22.75	-
买卖债券差价收入	15,836.25	-

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期和上年度可比期间的衍生工具收益项目发生额为零。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	586,420.61	293,346.23
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	586,420.61	293,346.23

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-15,308,798.55	133,499.14
——股票投资	-15,308,798.55	133,499.14
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-15,308,798.55	133,499.14

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元(上年度可比期间：-1,896.60元)。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	-	89,878.01
合计	-	89,878.01

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	75,715.54	111,750.61
银行间市场交易费用	-	-
合计	75,715.54	111,750.61

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	240,000.00	300,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	575.00	1,167.18
合计	550,575.00	611,167.18

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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），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。

根据财政部、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），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。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截至 2016 年 12 月 31 日止年度的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	18,491,715.95	36.75%	37,885,846.65	47.07%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	17,221.54	36.76%	7,403.65	34.46%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	34,970.35	47.05%	18,735.90	46.69%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	434,535.31
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
	当期发生的基金应支付的托管费	86,907.14

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
景顺长城中证 500ETF 联接基 金	46,000,000.00	90.96%	48,000,000.00	79.24%

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至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
中国银行	1,205,918.59	14,254.25	3,943,378.32	31,621.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期和上年度可比期间在承销期内均未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大事项停牌	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	13,208	293,882.33	342,615.52	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项停牌	7.83	-	-	39,100	271,208.82	306,153.00	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项停牌	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	6,300	174,912.11	295,407.00	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大事项停牌	20.31	-	-	14,200	321,182.78	288,402.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项停牌	13.79	-	-	20,360	367,644.44	280,764.40	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	15.80	-	-	17,600	201,978.26	278,080.00	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项停牌	7.29	-	-	37,500	298,554.69	273,375.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项停牌	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	15,900	396,262.59	244,224.00	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项停牌	11.42	-	-	20,672	392,043.94	236,074.24	-

000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	12,200	253,548.70	229,604.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大事项停牌	23.51	-	-	9,722	206,940.82	228,564.22	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项停牌	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	14,700	242,252.00	228,438.00	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	重大事项停牌	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	5,590	176,032.06	220,246.00	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大事项停牌	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	12,600	208,977.25	206,892.00	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项停牌	10.97	-	-	18,555	230,384.80	203,548.35	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大事项停牌	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	26,900	151,682.03	201,212.00	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项停牌	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	59,300	203,146.78	199,841.00	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	重大事项停牌	26.80	-	-	6,330	327,156.61	169,644.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大事项停牌	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	10,000	202,841.58	163,400.00	-
600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	重大事项停牌	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	11,102	192,649.52	155,983.10	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	25.20	-	-	5,490	144,336.67	138,348.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项停牌	11.28	-	-	12,168	151,581.27	137,255.04	-

002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项停牌	19.70	2017年2月21日	18.35	6,871	158,508.59	135,358.70	-
600859	王府井	2016年9月27日	重大事项停牌	16.28	-	-	7,864	142,168.97	128,025.92	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项停牌	7.43	2017年1月13日	8.17	16,884	124,050.52	125,448.12	-
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项停牌	36.40	2017年2月8日	33.50	3,300	70,098.76	120,120.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项停牌	21.20	2017年1月5日	21.66	5,308	138,034.79	112,529.60	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大事项停牌	2.52	-	-	44,100	181,912.37	111,132.00	-
002681	奋达科技	2016年12月19日	重大事项停牌	12.93	-	-	7,720	140,595.43	99,819.60	-
600551	时代出版	2016年11月28日	重大事项停牌	20.32	-	-	4,285	82,395.18	87,071.20	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大事项停牌	13.36	2017年3月21日	14.32	6,500	119,221.32	86,840.00	-
603555	贵人鸟	2016年12月12日	重大事项停牌	30.76	-	-	2,557	88,667.85	78,653.32	-
000693	ST华泽	2016年3月1日	重大事项停牌	12.50	-	-	6,242	130,240.24	78,025.00	-
002745	木林森	2016年7月15日	重大事项停牌	36.49	-	-	1,700	61,653.00	62,033.00	-

注：1. 本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2. 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

截至本期末,本基金未从事银行间市场债券正回购交易,无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末,本基金未从事证券交易所债券正回购交易,无质押债券。

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

本基金是指数型基金,紧密跟踪中证 500 指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法,跟踪中证 500 指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会,负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制,并对公司内部稽核审计工作进行审核监督;在管理层层面设立风险管理委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责,投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理岗设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理的价格适时变现。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,205,918.59	-	-	-	-	-	1,205,918.59
结算备付金	4,154.88	-	-	-	-	-	4,154.88
存出保证金	2,600.65	-	-	-	-	-	2,600.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,475,537.41	81,475,537.41
应收利息	-	-	-	-	-	260.31	260.31
资产总计	1,212,674.12	-	-	-	-	81,475,797.72	82,688,471.84
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,601.36	35,601.36
应付托管费	-	-	-	-	-	7,120.28	7,120.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,482.39	21,482.39
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	264,204.03	264,204.03
利率敏感度缺口	1,212,674.12	-	-	-	-	-	-
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,943,378.32	-	-	-	-	-	3,943,378.32
结算备付金	43,723.28	-	-	-	-	-	43,723.28
存出保证金	18,448.70	-	-	-	-	-	18,448.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	116,776,373.40	116,776,373.40
应收利息	-	-	-	-	-	810.54	810.54
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,005,550.30	-	-	-	-	116,777,183.94	120,782,734.24

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	359,282.88	359,282.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	52,045.99	52,045.99
应付托管费	-	-	-	-	-	10,409.19	10,409.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	40,127.63	40,127.63
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	661,865.69	661,865.69
利率敏感度缺口	4,005,550.30	-	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%；本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方

法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	81,475,537.41	98.85	116,776,373.40	97.22
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	81,475,537.41	98.85	116,776,373.40	97.22

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. “沪深 300 指数”上升 5	5,087,388.90	5,885,922.56
2. “沪深 300 指数”下降 5	-5,087,388.90	-5,885,922.56	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 75,222,410.08 元, 属于第二层次的余额为 6,253,127.33 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 106,297,750.63 元, 第二层次 10,478,622.77 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 基金申购款

于 2016 年度, 本基金申购基金份额的对价总额为 0.00 元(2015 年度: 本基金申购基金份额的对价总额为 162,172,153.32 元, 其中包括以股票支付的申购款 129,685,640.30 元和以现金支付的申购款 32,486,513.02 元)。

(3) 于 2016 年度, 本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。本基金的基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定, 在相应定期报告中予以披露。

(4) 除上述(1)、(2)和(3)所述事项外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,475,537.41	98.53
	其中：股票	81,475,537.41	98.53
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,210,073.47	1.46
7	其他各项资产	2,860.96	0.00
8	合计	82,688,471.84	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,037,761.41	1.26
B	采矿业	3,116,999.52	3.78
C	制造业	50,559,729.19	61.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,509,889.17	3.05
E	建筑业	2,317,095.34	2.81
F	批发和零售业	4,846,297.14	5.88
G	交通运输、仓储和邮政业	2,292,966.06	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,870,942.32	5.91
J	金融业	695,539.98	0.84
K	房地产业	5,175,016.30	6.28
L	租赁和商务服务业	1,230,210.51	1.49

M	科学研究和技术服务业	238,619.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	392,485.76	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	40,370.00	0.05
Q	卫生和社会工作	217,600.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	1,202,483.07	1.46
S	综合	731,532.64	0.89
	合计	81,475,537.41	98.85

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	76,800	402,432.00	0.49
2	600201	生物股份	12,542	396,201.78	0.48
3	600522	中天科技	37,500	394,875.00	0.48
4	300136	信维通信	13,800	393,300.00	0.48
5	600682	南京新百	10,200	380,154.00	0.46
6	600525	长园集团	27,239	379,984.05	0.46
7	600584	长电科技	21,246	374,991.90	0.46
8	600079	人福医药	18,500	369,075.00	0.45
9	600643	爱建集团	29,478	365,821.98	0.44
10	600219	南山铝业	113,822	351,709.98	0.43
11	000887	中鼎股份	13,208	342,615.52	0.42
12	002405	四维图新	17,479	338,218.65	0.41
13	600487	亨通光电	17,799	332,129.34	0.40
14	601012	隆基股份	24,400	326,716.00	0.40
15	600158	中体产业	13,801	325,289.57	0.39

16	002092	中泰化学	26,400	319,440.00	0.39
17	000661	长春高新	2,815	314,857.75	0.38
18	300156	神雾环保	12,400	310,124.00	0.38
19	002572	索菲亚	5,700	308,712.00	0.37
20	601168	西部矿业	39,100	306,153.00	0.37
21	600315	上海家化	11,100	300,921.00	0.37
22	600166	福田汽车	95,800	296,022.00	0.36
23	002602	世纪华通	6,300	295,407.00	0.36
24	300115	长盈精密	11,080	288,744.80	0.35
25	000748	长城信息	14,200	288,402.00	0.35
26	002460	赣锋锂业	10,800	286,308.00	0.35
27	600143	金发科技	36,800	286,304.00	0.35
28	300266	兴源环境	5,200	285,376.00	0.35
29	002422	科伦药业	17,700	285,324.00	0.35
30	002366	台海核电	5,300	284,186.00	0.34
31	300296	利亚德	8,400	283,248.00	0.34
32	600521	华海药业	12,788	281,719.64	0.34
33	600436	片仔癀	6,150	281,608.50	0.34
34	600699	均胜电子	8,498	281,198.82	0.34
35	002407	多氟多	10,300	281,087.00	0.34
36	002400	省广股份	20,360	280,764.40	0.34
37	300088	长信科技	17,600	278,080.00	0.34
38	000998	隆平高科	12,909	276,639.87	0.34
39	002508	老板电器	7,469	274,859.20	0.33
40	002340	格林美	41,786	273,698.30	0.33
41	600673	东阳光科	37,500	273,375.00	0.33
42	600503	华丽家族	32,900	272,741.00	0.33
43	000581	威孚高科	12,000	269,280.00	0.33
44	002168	深圳惠程	16,920	268,351.20	0.33
45	600664	哈药股份	31,270	268,296.60	0.33
46	300026	红日药业	49,402	268,252.86	0.33
47	600879	航天电子	17,596	268,163.04	0.33
48	000930	中粮生化	19,788	265,950.72	0.32
49	002004	华邦健康	29,210	264,934.70	0.32
50	000997	新大陆	13,452	261,372.36	0.32
51	002439	启明星辰	12,500	259,875.00	0.32
52	600978	宜华生活	24,300	258,795.00	0.31
53	600266	北京城建	19,300	257,269.00	0.31
54	600614	鼎立股份	21,732	254,264.40	0.31

55	002176	江特电机	21,100	251,723.00	0.31
56	000961	中南建设	24,200	251,680.00	0.31
57	002701	奥瑞金	29,020	250,732.80	0.30
58	600138	中青旅	11,926	250,088.22	0.30
59	600500	中化国际	21,400	249,524.00	0.30
60	600497	驰宏锌锗	35,400	248,862.00	0.30
61	000690	宝新能源	26,751	247,981.77	0.30
62	000547	航天发展	15,900	244,224.00	0.30
63	002030	达安基因	10,398	241,233.60	0.29
64	002013	中航机电	13,136	240,257.44	0.29
65	600635	大众公用	39,800	239,198.00	0.29
66	002311	海大集团	15,760	237,188.00	0.29
67	600426	华鲁恒升	17,874	236,830.50	0.29
68	600655	豫园商城	20,672	236,074.24	0.29
69	002271	东方雨虹	10,832	234,946.08	0.29
70	000970	中科三环	17,500	233,625.00	0.28
71	600122	宏图高科	18,911	231,092.42	0.28
72	000050	深天马 A	12,200	229,604.00	0.28
73	300253	卫宁健康	11,700	229,203.00	0.28
74	002573	清新环境	13,100	228,857.00	0.28
75	000697	炼石有色	9,722	228,564.22	0.28
76	002491	通鼎互联	14,700	228,438.00	0.28
77	300324	旋极信息	11,800	228,094.00	0.28
78	600759	洲际油气	23,213	227,951.66	0.28
79	300113	顺网科技	8,400	225,876.00	0.27
80	000400	许继电气	12,400	225,060.00	0.27
81	600418	江淮汽车	19,462	224,980.72	0.27
82	002038	双鹭药业	8,400	224,364.00	0.27
83	002179	中航光电	6,167	223,800.43	0.27
84	600565	迪马股份	29,800	221,116.00	0.27
85	600751	天海投资	26,400	220,704.00	0.27
86	600161	天坛生物	5,590	220,246.00	0.27
87	600240	华业资本	20,481	219,965.94	0.27
88	002001	新 和 成	11,200	219,520.00	0.27
89	300244	迪安诊断	6,800	217,600.00	0.26
90	600312	平高电气	13,900	217,118.00	0.26
91	002273	水晶光电	10,888	216,671.20	0.26
92	600388	龙净环保	17,500	216,475.00	0.26
93	600594	益佰制药	13,000	216,450.00	0.26

94	600633	浙报传媒	12,200	215,452.00	0.26
95	000959	首钢股份	32,500	215,150.00	0.26
96	000806	银河生物	13,500	213,840.00	0.26
97	002223	鱼跃医疗	6,884	213,541.68	0.26
98	000012	南玻A	18,800	213,192.00	0.26
99	002665	首航节能	24,235	212,298.60	0.26
100	000598	兴蓉环境	36,800	211,968.00	0.26
101	600811	东方集团	29,300	209,495.00	0.25
102	002217	合力泰	11,700	209,430.00	0.25
103	600056	中国医药	10,998	209,291.94	0.25
104	000975	银泰资源	13,360	208,950.40	0.25
105	000566	海南海药	16,418	208,672.78	0.25
106	300159	新研股份	15,300	207,774.00	0.25
107	600094	大名城	23,300	207,370.00	0.25
108	000939	凯迪生态	16,104	207,258.48	0.25
109	600601	方正科技	45,012	207,055.20	0.25
110	600687	刚泰控股	12,600	206,892.00	0.25
111	600528	中铁二局	14,999	206,386.24	0.25
112	002221	东华能源	16,604	205,723.56	0.25
113	000878	云南铜业	17,400	205,494.00	0.25
114	000078	海王生物	32,550	205,065.00	0.25
115	600787	中储股份	22,524	204,292.68	0.25
116	600881	亚泰集团	37,310	204,085.70	0.25
117	002048	宁波华翔	9,211	203,931.54	0.25
118	600151	航天机电	18,555	203,548.35	0.25
119	300055	万邦达	12,400	203,112.00	0.25
120	002410	广联达	13,800	201,480.00	0.24
121	000563	陕国投A	26,900	201,212.00	0.24
122	600198	大唐电信	12,635	200,517.45	0.24
123	300134	大富科技	7,900	200,344.00	0.24
124	600200	江苏吴中	10,366	200,167.46	0.24
125	600478	科力远	20,000	200,000.00	0.24
126	000727	华东科技	59,300	199,841.00	0.24
127	002408	齐翔腾达	18,163	199,793.00	0.24
128	600435	北方导航	15,320	199,772.80	0.24
129	000988	华工科技	12,759	199,678.35	0.24
130	000031	中粮地产	22,357	199,424.44	0.24
131	603589	口子窖	6,200	199,206.00	0.24
132	002353	杰瑞股份	9,800	198,940.00	0.24

133	000960	锡业股份	15,100	198,112.00	0.24
134	000999	华润三九	8,000	197,840.00	0.24
135	000612	焦作万方	17,081	197,285.55	0.24
136	601699	潞安环能	24,500	197,225.00	0.24
137	600410	华胜天成	18,123	196,997.01	0.24
138	002191	劲嘉股份	18,874	196,478.34	0.24
139	600176	中国巨石	19,962	196,426.08	0.24
140	600516	方大炭素	21,200	196,312.00	0.24
141	600755	厦门国贸	23,902	195,996.40	0.24
142	600549	厦门钨业	8,900	195,978.00	0.24
143	600851	海欣股份	15,100	195,243.00	0.24
144	000979	中弘股份	73,790	194,805.60	0.24
145	002250	联化科技	11,974	193,739.32	0.24
146	000667	美好置业	52,500	193,725.00	0.24
147	000758	中色股份	24,200	193,358.00	0.23
148	600026	中远海能	28,070	191,156.70	0.23
149	002018	华信国际	18,700	190,179.00	0.23
150	000488	晨鸣纸业	18,297	189,556.92	0.23
151	000786	北新建材	18,338	188,698.02	0.23
152	600572	康恩贝	25,799	188,590.69	0.23
153	600098	广州发展	16,800	188,496.00	0.23
154	601929	吉视传媒	44,700	187,293.00	0.23
155	600064	南京高科	11,061	185,271.75	0.22
156	600575	皖江物流	32,046	184,264.50	0.22
157	000825	太钢不锈	46,700	183,998.00	0.22
158	600325	华发股份	14,362	183,833.60	0.22
159	603019	中科曙光	6,600	183,612.00	0.22
160	600863	内蒙华电	59,600	183,568.00	0.22
161	000006	深振业 A	19,419	183,509.55	0.22
162	600967	北方创业	13,501	183,208.57	0.22
163	600160	巨化股份	17,300	183,034.00	0.22
164	600108	亚盛集团	31,900	182,468.00	0.22
165	002657	中科金财	4,200	181,272.00	0.22
166	000860	顺鑫农业	8,226	180,972.00	0.22
167	600120	浙江东方	6,234	180,287.28	0.22
168	603766	隆鑫通用	8,619	179,102.82	0.22
169	600409	三友化工	18,994	178,353.66	0.22
170	601880	大连港	63,499	177,797.20	0.22
171	002544	杰赛科技	6,300	177,282.00	0.22

172	600511	国药股份	5,886	177,168.60	0.21
173	600039	四川路桥	37,139	176,038.86	0.21
174	300273	和佳股份	10,290	175,547.40	0.21
175	600499	科达洁能	23,200	175,392.00	0.21
176	600307	酒钢宏兴	64,200	175,266.00	0.21
177	300287	飞利信	14,700	174,930.00	0.21
178	002375	亚厦股份	16,500	174,570.00	0.21
179	002051	中工国际	7,600	174,192.00	0.21
180	002078	太阳纸业	26,026	173,853.68	0.21
181	002276	万马股份	11,552	173,626.56	0.21
182	600717	天津港	17,200	173,376.00	0.21
183	002672	东江环保	9,845	173,272.00	0.21
184	600808	马钢股份	61,200	173,196.00	0.21
185	002390	信邦制药	17,500	173,075.00	0.21
186	600316	洪都航空	8,800	173,008.00	0.21
187	002019	亿帆医药	11,300	172,777.00	0.21
188	600022	山东钢铁	69,100	172,750.00	0.21
189	002595	豪迈科技	8,200	172,610.00	0.21
190	000513	丽珠集团	2,898	172,431.00	0.21
191	002444	巨星科技	11,011	171,771.60	0.21
192	600416	湘电股份	11,632	171,106.72	0.21
193	002384	东山精密	8,713	170,861.93	0.21
194	000028	国药一致	2,538	169,792.20	0.21
195	600645	中源协和	6,330	169,644.00	0.21
196	002155	湖南黄金	14,800	169,460.00	0.21
197	300199	翰宇药业	9,400	169,012.00	0.21
198	002489	浙江永强	22,294	168,765.58	0.20
199	000685	中山公用	15,144	168,552.72	0.20
200	000066	长城电脑	13,542	168,462.48	0.20
201	600611	大众交通	25,637	168,435.09	0.20
202	600466	蓝光发展	17,400	168,258.00	0.20
203	600587	新华医疗	6,696	168,136.56	0.20
204	000089	深圳机场	21,000	168,000.00	0.20
205	002022	科华生物	8,400	168,000.00	0.20
206	600600	青岛啤酒	5,700	167,808.00	0.20
207	000543	皖能电力	22,041	167,732.01	0.20
208	002281	光迅科技	2,123	166,655.50	0.20
209	601000	唐山港	41,547	166,603.47	0.20
210	002268	卫士通	5,300	166,526.00	0.20

211	600348	阳泉煤业	24,700	166,231.00	0.20
212	600770	综艺股份	16,000	165,600.00	0.20
213	600597	光明乳业	12,600	164,556.00	0.20
214	600062	华润双鹤	7,400	164,502.00	0.20
215	600392	盛和资源	12,327	164,318.91	0.20
216	000401	冀东水泥	13,800	164,220.00	0.20
217	002266	浙富控股	28,445	163,843.20	0.20
218	002440	闰土股份	10,000	163,400.00	0.20
219	002261	拓维信息	13,697	163,268.24	0.20
220	002050	三花智控	14,750	162,840.00	0.20
221	600183	生益科技	14,710	161,810.00	0.20
222	600380	健康元	16,268	161,541.24	0.20
223	002477	雏鹰农牧	32,177	161,528.54	0.20
224	600884	杉杉股份	11,472	161,525.76	0.20
225	300122	智飞生物	9,800	161,406.00	0.20
226	600872	中炬高新	11,450	161,216.00	0.20
227	600187	国中水务	29,900	161,161.00	0.20
228	000592	平潭发展	23,800	160,888.00	0.20
229	002603	以岭药业	9,300	160,332.00	0.19
230	600300	维维股份	23,980	160,186.40	0.19
231	600366	宁波韵升	8,045	158,406.05	0.19
232	000519	江南红箭	10,627	158,342.30	0.19
233	600267	海正药业	11,900	156,485.00	0.19
234	600171	上海贝岭	11,102	155,983.10	0.19
235	002373	千方科技	11,300	155,940.00	0.19
236	002431	棕榈股份	16,950	155,262.00	0.19
237	002122	天马股份	12,218	155,046.42	0.19
238	600073	上海梅林	13,500	154,575.00	0.19
239	600422	昆药集团	11,364	153,527.64	0.19
240	600175	美都能源	31,015	153,524.25	0.19
241	600017	日照港	37,880	153,414.00	0.19
242	002073	软控股份	13,500	153,225.00	0.19
243	600067	冠城大通	21,397	153,202.52	0.19
244	002308	威创股份	10,393	153,192.82	0.19
245	600970	中材国际	21,550	152,789.50	0.19
246	300274	阳光电源	14,420	151,986.80	0.18
247	002640	跨境通	8,300	151,890.00	0.18
248	600125	铁龙物流	18,787	151,798.96	0.18
249	600298	安琪酵母	8,500	151,470.00	0.18

250	600216	浙江医药	11,900	150,892.00	0.18
251	600086	东方金钰	13,849	150,677.12	0.18
252	000703	恒逸石化	10,000	150,300.00	0.18
253	600284	浦东建设	11,353	149,746.07	0.18
254	600557	康缘药业	8,834	149,559.62	0.18
255	600651	飞乐音响	14,200	149,526.00	0.18
256	002437	誉衡药业	18,075	149,480.25	0.18
257	300291	华录百纳	6,700	149,276.00	0.18
258	000810	创维数字	10,600	149,142.00	0.18
259	000926	福星股份	11,690	148,930.60	0.18
260	600260	凯乐科技	9,608	148,731.84	0.18
261	300010	立思辰	8,900	147,918.00	0.18
262	000816	智慧农业	23,250	147,870.00	0.18
263	002512	达华智能	9,000	146,970.00	0.18
264	000418	小天鹅 A	4,534	146,538.88	0.18
265	000762	西藏矿业	8,596	146,389.88	0.18
266	000937	冀中能源	21,700	146,258.00	0.18
267	600536	中国软件	6,067	145,972.02	0.18
268	002002	鸿达兴业	19,877	145,897.18	0.18
269	002358	森源电气	7,600	145,768.00	0.18
270	002479	富春环保	9,800	145,236.00	0.18
271	600694	大商股份	3,600	143,748.00	0.17
272	601231	环旭电子	13,400	143,514.00	0.17
273	601801	皖新传媒	8,158	143,336.06	0.17
274	000021	深科技	15,130	142,675.90	0.17
275	002028	思源电气	10,820	142,607.60	0.17
276	300001	特锐德	8,200	142,188.00	0.17
277	601311	骆驼股份	8,676	141,679.08	0.17
278	002399	海普瑞	7,700	140,294.00	0.17
279	600169	太原重工	34,800	140,244.00	0.17
280	000777	中核科技	6,245	139,763.10	0.17
281	601010	文峰股份	26,493	139,353.18	0.17
282	300166	东方国信	6,700	139,293.00	0.17
283	601717	郑煤机	19,810	139,264.30	0.17
284	002025	航天电器	5,490	138,348.00	0.17
285	002325	洪涛股份	17,250	138,172.50	0.17
286	300202	聚龙股份	5,600	137,760.00	0.17
287	600880	博瑞传播	15,716	137,672.16	0.17
288	600765	中航重机	9,589	137,410.37	0.17

289	000829	天音控股	12,168	137,255.04	0.17
290	002041	登海种业	7,240	136,691.20	0.17
291	002503	搜于特	9,499	136,690.61	0.17
292	002396	星网锐捷	6,871	135,358.70	0.16
293	002707	众信旅游	8,700	135,285.00	0.16
294	600517	置信电气	13,903	135,276.19	0.16
295	000848	承德露露	12,059	134,940.21	0.16
296	600545	新疆城建	11,095	134,915.20	0.16
297	600058	五矿发展	8,800	134,024.00	0.16
298	002244	滨江集团	19,124	133,485.52	0.16
299	600736	苏州高新	14,712	132,849.36	0.16
300	600809	山西汾酒	5,300	132,606.00	0.16
301	001696	宗申动力	14,100	132,540.00	0.16
302	000620	新华联	15,600	132,288.00	0.16
303	002123	梦网荣信	8,800	132,000.00	0.16
304	600259	广晟有色	3,100	131,719.00	0.16
305	002581	未名医药	5,400	131,058.00	0.16
306	002368	太极股份	4,280	131,010.80	0.16
307	000600	建投能源	14,700	130,536.00	0.16
308	002106	莱宝高科	11,600	130,384.00	0.16
309	002063	远光软件	9,922	130,375.08	0.16
310	002344	海宁皮城	11,500	130,180.00	0.16
311	600639	浦东金桥	7,012	130,142.72	0.16
312	000158	常山股份	10,400	130,000.00	0.16
313	002589	瑞康医药	4,000	129,800.00	0.16
314	002269	美邦服饰	25,900	129,759.00	0.16
315	000587	金洲慈航	8,717	129,708.96	0.16
316	600835	上海机电	6,594	128,714.88	0.16
317	600291	西水股份	6,700	128,506.00	0.16
318	600859	王府井	7,864	128,025.92	0.16
319	002285	世联行	16,803	127,702.80	0.15
320	600220	江苏阳光	29,281	127,079.54	0.15
321	603188	亚邦股份	7,100	126,806.00	0.15
322	000572	海马汽车	23,600	126,496.00	0.15
323	603077	和邦生物	24,674	126,330.88	0.15
324	600282	南钢股份	40,600	125,860.00	0.15
325	600433	冠豪高新	15,646	125,480.92	0.15
326	600537	亿晶光电	16,884	125,448.12	0.15
327	002277	友阿股份	8,733	125,405.88	0.15

328	000636	风华高科	12,843	125,347.68	0.15
329	000062	深圳华强	4,400	125,004.00	0.15
330	600481	双良节能	16,622	124,997.44	0.15
331	002354	天神娱乐	1,800	124,488.00	0.15
332	002317	众生药业	10,073	124,401.55	0.15
333	600053	九鼎投资	2,700	124,362.00	0.15
334	601678	滨化股份	17,039	124,214.31	0.15
335	601777	力帆股份	12,929	123,601.24	0.15
336	600270	外运发展	7,460	123,388.40	0.15
337	002161	远望谷	10,658	122,886.74	0.15
338	600993	马应龙	6,147	122,755.59	0.15
339	000616	海航投资	23,435	122,330.70	0.15
340	300147	香雪制药	9,460	122,034.00	0.15
341	002482	广田集团	13,165	121,776.25	0.15
342	600277	亿利洁能	17,100	121,581.00	0.15
343	300257	开山股份	7,073	121,372.68	0.15
344	600894	广日股份	8,843	120,883.81	0.15
345	002635	安洁科技	3,300	120,120.00	0.15
346	600580	卧龙电气	13,177	119,910.70	0.15
347	002505	大康农业	33,770	119,545.80	0.15
348	000669	金鸿能源	6,970	119,535.50	0.15
349	300297	蓝盾股份	9,600	119,424.00	0.14
350	000973	佛塑科技	15,893	119,197.50	0.14
351	002428	云南锗业	9,396	119,047.32	0.14
352	000541	佛山照明	12,072	118,788.48	0.14
353	600805	悦达投资	13,959	118,511.91	0.14
354	000528	柳工	16,200	118,422.00	0.14
355	000501	鄂武商A	6,061	118,310.72	0.14
356	000090	天健集团	12,243	118,267.38	0.14
357	601689	拓普集团	4,000	117,680.00	0.14
358	000726	鲁泰A	9,180	117,595.80	0.14
359	000830	鲁西化工	21,007	117,429.13	0.14
360	002498	汉缆股份	27,300	117,390.00	0.14
361	600729	重庆百货	5,000	117,150.00	0.14
362	600289	亿阳信通	9,046	117,145.70	0.14
363	600826	兰生股份	4,282	116,984.24	0.14
364	000652	泰达股份	21,165	116,830.80	0.14
365	600458	时代新材	8,253	116,779.95	0.14
366	002056	横店东磁	8,382	116,593.62	0.14

367	002690	美亚光电	5,500	116,380.00	0.14
368	002005	德豪润达	20,100	115,575.00	0.14
369	002128	露天煤业	13,431	115,506.60	0.14
370	600823	世茂股份	16,440	115,408.80	0.14
371	600112	天成控股	10,472	114,982.56	0.14
372	002463	沪电股份	23,999	114,715.22	0.14
373	600750	江中药业	3,716	114,527.12	0.14
374	600596	新安股份	11,114	113,807.36	0.14
375	000897	津滨发展	26,499	113,415.72	0.14
376	002064	华峰氨纶	20,600	113,094.00	0.14
377	000680	山推股份	20,404	112,834.12	0.14
378	600006	东风汽车	16,400	112,832.00	0.14
379	002242	九阳股份	6,249	112,669.47	0.14
380	600628	新世界	7,967	112,573.71	0.14
381	600141	兴发集团	7,400	112,554.00	0.14
382	002727	一心堂	5,308	112,529.60	0.14
383	600351	亚宝药业	11,342	112,058.96	0.14
384	002190	成飞集成	3,500	111,930.00	0.14
385	000861	海印股份	23,069	111,884.65	0.14
386	601005	重庆钢铁	44,100	111,132.00	0.13
387	000969	安泰科技	10,484	110,501.36	0.13
388	600773	西藏城投	9,204	109,803.72	0.13
389	600395	盘江股份	13,600	109,752.00	0.13
390	601233	桐昆股份	7,600	109,136.00	0.13
391	000681	视觉中国	5,700	108,642.00	0.13
392	600790	轻纺城	15,074	108,532.80	0.13
393	002588	史丹利	9,552	108,415.20	0.13
394	002254	泰和新材	8,759	108,261.24	0.13
395	600428	中远航运	17,643	107,975.16	0.13
396	300032	金龙机电	6,700	107,803.00	0.13
397	002011	盾安环境	11,292	107,499.84	0.13
398	000596	古井贡酒	2,354	107,107.00	0.13
399	000049	德赛电池	2,537	106,680.85	0.13
400	000552	靖远煤电	28,120	106,574.80	0.13
401	002663	普邦股份	17,515	106,316.05	0.13
402	600496	精工钢构	24,798	106,135.44	0.13
403	600869	智慧能源	13,672	105,821.28	0.13
404	603198	迎驾贡酒	4,900	105,595.00	0.13
405	002642	荣之联	5,250	105,525.00	0.13

406	600862	中航高科	8,600	105,264.00	0.13
407	601001	大同煤业	17,200	105,092.00	0.13
408	002345	潮宏基	8,680	104,854.40	0.13
409	600850	华东电脑	4,335	104,820.30	0.13
410	002699	美盛文化	3,100	104,780.00	0.13
411	300039	上海凯宝	10,210	104,448.30	0.13
412	600720	祁连山	12,778	104,396.26	0.13
413	600757	长江传媒	12,469	103,617.39	0.13
414	300043	星辉娱乐	10,200	103,428.00	0.13
415	600563	法拉电子	2,819	103,372.73	0.13
416	603883	老百姓	2,200	102,630.00	0.12
417	600059	古越龙山	10,000	102,400.00	0.12
418	600329	中新药业	5,855	102,111.20	0.12
419	000099	中信海直	8,690	101,759.90	0.12
420	600280	中央商场	11,741	101,090.01	0.12
421	603369	今世缘	7,700	101,024.00	0.12
422	000869	张裕A	2,800	100,800.00	0.12
423	601886	江河集团	9,439	100,525.35	0.12
424	002681	奋达科技	7,720	99,819.60	0.12
425	002371	七星电子	3,752	99,803.20	0.12
426	600292	远达环保	8,048	99,553.76	0.12
427	600460	士兰微	15,842	98,537.24	0.12
428	002093	国脉科技	8,891	98,423.37	0.12
429	600831	广电网络	7,445	97,231.70	0.12
430	002332	仙琚制药	7,530	96,911.10	0.12
431	600586	金晶科技	20,900	96,767.00	0.12
432	000417	合肥百货	11,152	96,241.76	0.12
433	600657	信达地产	15,610	95,221.00	0.12
434	002342	巨力索具	13,771	95,157.61	0.12
435	002029	七匹狼	9,279	94,738.59	0.11
436	002416	爱施德	6,400	94,272.00	0.11
437	002309	中利科技	6,600	93,786.00	0.11
438	000931	中关村	11,066	93,729.02	0.11
439	600825	新华传媒	10,754	93,452.26	0.11
440	000426	兴业矿业	10,688	93,199.36	0.11
441	601002	晋亿实业	9,777	93,077.04	0.11
442	600195	中牧股份	4,376	92,990.00	0.11
443	600748	上实发展	11,346	92,923.74	0.11
444	002551	尚荣医疗	4,594	91,466.54	0.11

445	000877	天山股份	12,595	88,794.75	0.11
446	600640	号百控股	4,428	88,471.44	0.11
447	002251	步步高	5,362	88,204.90	0.11
448	601908	京运通	12,317	87,697.04	0.11
449	002698	博实股份	5,630	87,659.10	0.11
450	600551	时代出版	4,285	87,071.20	0.11
451	603169	兰石重装	6,500	86,840.00	0.11
452	002414	高德红外	3,792	86,381.76	0.10
453	600743	华远地产	19,225	85,551.25	0.10
454	600180	瑞茂通	6,286	85,112.44	0.10
455	603528	多伦科技	1,300	84,955.00	0.10
456	000919	金陵药业	6,215	84,088.95	0.10
457	600776	东方通信	9,781	83,725.36	0.10
458	600425	青松建化	16,965	78,887.25	0.10
459	603555	贵人鸟	2,557	78,653.32	0.10
460	600338	西藏珠峰	2,700	78,246.00	0.09
461	600251	冠农股份	9,622	78,034.42	0.09
462	000693	ST 华泽	6,242	78,025.00	0.09
463	600801	华新水泥	9,965	77,228.75	0.09
464	600335	国机汽车	6,351	77,164.65	0.09
465	002327	富安娜	8,760	77,088.00	0.09
466	002118	紫鑫药业	10,520	75,744.00	0.09
467	603001	奥康国际	3,296	75,478.40	0.09
468	601016	节能风电	8,500	75,225.00	0.09
469	600864	哈投股份	6,501	74,241.42	0.09
470	603806	福斯特	1,600	74,032.00	0.09
471	002315	焦点科技	1,226	73,915.54	0.09
472	603355	莱克电气	1,600	73,872.00	0.09
473	000631	顺发恒业	14,996	73,480.40	0.09
474	600397	安源煤业	14,200	73,272.00	0.09
475	600874	创业环保	8,879	72,186.27	0.09
476	002392	北京利尔	12,302	70,859.52	0.09
477	600483	福能股份	6,400	70,848.00	0.09
478	002646	青青稞酒	3,669	70,628.25	0.09
479	603567	珍宝岛	3,500	69,160.00	0.08
480	603005	晶方科技	2,300	69,092.00	0.08
481	002233	塔牌集团	7,381	69,012.35	0.08
482	603698	航天工程	2,500	68,975.00	0.08
483	000517	荣安地产	13,100	68,906.00	0.08

484	600184	光电股份	3,180	68,624.40	0.08
485	600618	氯碱化工	4,617	67,362.03	0.08
486	600971	恒源煤电	10,280	64,455.60	0.08
487	603568	伟明环保	2,750	64,075.00	0.08
488	603328	依顿电子	2,000	63,960.00	0.08
489	000723	美锦能源	4,200	63,504.00	0.08
490	002249	大洋电机	7,257	62,627.91	0.08
491	002745	木林森	1,700	62,033.00	0.08
492	000025	特力A	1,100	60,797.00	0.07
493	600088	中视传媒	2,700	59,184.00	0.07
494	002194	武汉凡谷	4,593	59,065.98	0.07
495	600468	百利电气	4,434	57,730.68	0.07
496	002238	天威视讯	3,807	55,772.55	0.07
497	603868	飞科电器	1,000	46,860.00	0.06
498	600917	重庆燃气	3,500	46,165.00	0.06
499	600981	汇鸿集团	5,100	43,299.00	0.05
500	603025	大豪科技	1,100	42,933.00	0.05
501	603377	东方时尚	1,000	40,370.00	0.05
502	603866	桃李面包	900	39,510.00	0.05
503	000761	本钢板材	6,200	33,356.00	0.04

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	300113	顺网科技	389,284.02	0.32
2	300136	信维通信	387,081.00	0.32
3	002439	启明星辰	334,420.00	0.28
4	002460	赣锋锂业	330,084.00	0.27
5	002572	索菲亚	327,065.00	0.27
6	002426	胜利精密	324,541.00	0.27

7	002407	多氟多	316,240.00	0.26
8	300156	神雾环保	315,063.00	0.26
9	600315	上海家化	305,281.00	0.25
10	002422	科伦药业	301,775.00	0.25
11	002131	利欧股份	301,529.73	0.25
12	600682	南京新百	301,496.77	0.25
13	300296	利亚德	296,452.00	0.25
14	600166	福田汽车	291,642.00	0.24
15	002366	台海核电	280,111.00	0.23
16	002038	双鹭药业	277,513.62	0.23
17	300266	兴源环境	275,855.00	0.23
18	002176	江特电机	273,419.00	0.23
19	000983	西山煤电	266,844.00	0.22
20	002310	东方园林	266,210.00	0.22

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	635,732.22	0.53
2	002466	天齐锂业	586,517.48	0.49
3	002085	万丰奥威	432,598.72	0.36
4	600654	中安消	405,492.00	0.34
5	002310	东方园林	397,787.92	0.33
6	600816	安信信托	353,145.40	0.29
7	002439	启明星辰	341,603.00	0.28
8	000983	西山煤电	337,399.00	0.28
9	600498	烽火通信	329,144.00	0.27
10	600074	保千里	325,153.00	0.27
11	002426	胜利精密	307,951.00	0.26
12	002131	利欧股份	294,769.00	0.25
13	600376	首开股份	293,735.42	0.24
14	600482	中国动力	292,181.50	0.24
15	002049	紫光国芯	268,438.84	0.22
16	002714	牧原股份	267,747.20	0.22

17	000718	苏宁环球	244,555.20	0.20
18	002174	游族网络	241,503.00	0.20
19	002299	圣农发展	240,323.00	0.20
20	601155	新城控股	233,488.00	0.19

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	25,966,943.28
卖出股票收入（成交）总额	24,395,944.43

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本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	2,600.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	260.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,860.96

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
217	233,055.10	2,062,682.00	4.08%	2,510,274.00	4.96%

9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
景顺长城中证 500 交易型开放式指 数证券投资基金联接基金	46,000,000.00	90.96%

9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国银行股份有限公司—景顺长城 中证 500 交易型开放式指数证券投 资基金联接基金	46,000,000.00	90.96%
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000.00	3.95%
3	何凤珍	1,006,097.00	1.99%
4	杜月仙	100,000.00	0.20%
5	沈健美	78,000.00	0.15%
6	田凯平	74,202.00	0.15%
7	邱雨	71,800.00	0.14%
8	郭志峰	60,000.00	0.12%
9	马宝茹	51,800.00	0.10%
10	孙伟	49,800.00	0.10%
11	高伟煊	49,000.00	0.10%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 26 日）基金份额总额	512, 572, 956. 00
本报告期期初基金份额总额	60, 572, 956. 00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	10, 000, 000. 00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	50, 572, 956. 00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，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

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2016 年 1 月 22 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意黄卫明先生辞去本公司督察长一职。

2、本基金管理人于 2016 年 2 月 4 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任杨皦阳先生担任本公司督察长。

3、本基金管理人于 2016 年 2 月 20 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任毛从容女士担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2016 年 7 月 4 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意赵如冰先生辞去本公司董事长一职，聘任杨光裕先生担任本公司董事长。根据公司章程相关规定，“公司的董事长为公司的法定代表人”。经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人已于 2016 年 7 月 13 日变更为杨光裕先生，本基金管理人已于 2016 年 7 月 15 日发布了公告。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 3 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

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	
中国银河证券股份有限公司	1	31,819,161.36	63.25%	29,633.32	63.24%	未变更
长城证券股份有限公司	3	18,491,715.95	36.75%	17,221.54	36.76%	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准：

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
中国银河证 券股份有限 公司	22,862.30	18.38%	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	101,496.70	81.62%	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源西 部证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于指数熔断后本公司各基金申购赎回、转换业务开放时间调整的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2016年1月4日

2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断后本公司各基金申购赎回、转换业务开放时间调整的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 22 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于聘任督察长的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 2 月 4 日
7	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 2 月 5 日
8	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 2 月 5 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 2 月 20 日
10	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
11	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
12	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 7 月 4 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 7 月 15 日
15	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 7 月 21 日
16	景顺长城中证 500 交易型开放式指	中国证券报, 上海证	2016 年 8 月 10 日

	数证券投资基金 2016 年第 2 号更新招募说明书摘要	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
17	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 8 月 10 日
18	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 8 月 27 日
19	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 8 月 27 日
20	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 10 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 3 月 29 日