

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 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。

本报告财务资料已经审计。

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	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
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.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	74
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.....	74
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.....	75

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.....	75
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 投资组合报告附注.....	75
§9 基金份额持有人信息.....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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的情况.....	77
§10 开放式基金份额变动.....	78
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	83
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§13 备查文件目录.....	89
13.1 备查文件目录.....	89
13.2 存放地点.....	89
13.3 查阅方式.....	90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金		
基金简称	银华中证 800 等权指数增强分级		
场内简称	800 分级		
基金主代码	161825		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 11 月 5 日		
基金管理人	银华基金管理股份有限公司		
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	49,579,881.12 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013 年 12 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	中证 800A	中证 800B	800 分级
下属分级基金的交易代码	150138	150139	161825
报告期末下属分级基金份额总额	2,932,616.00 份	2,932,616.00 份	43,714,649.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型基金。本基金在对中证 800 等权重指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。</p>
投资策略	<p>本基金以中证 800 等权重指数为目标指数，在有效复制目标指数的基础上，结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。</p> <p>当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 800 等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金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（如买入非成份股等）进行适当的替代。</p> <p>本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基</p>

	金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。		
业绩比较基准	95%×中证 800 等权重指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益。

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		银华基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010) 66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100738	100818
法定代表人		王珠林	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	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	-11,567,715.53	14,716,597.91	12,421,829.81
本期利润	-8,614,306.13	8,057,818.05	16,318,723.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1622	0.1040	0.2368
本期加权平均净值利润率	-16.26%	10.07%	23.17%
本期基金份额净值增长率	-14.49%	24.25%	39.65%
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	6,967,192.07	16,854,459.64	12,414,738.18
期末可供分配基金份额利润	0.1405	0.3566	0.3811
期末基金资产净值	49,235,812.08	56,182,924.26	44,119,884.73
期末基金份额净值	0.993	1.189	1.354
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	47.83%	72.87%	39.23%

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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

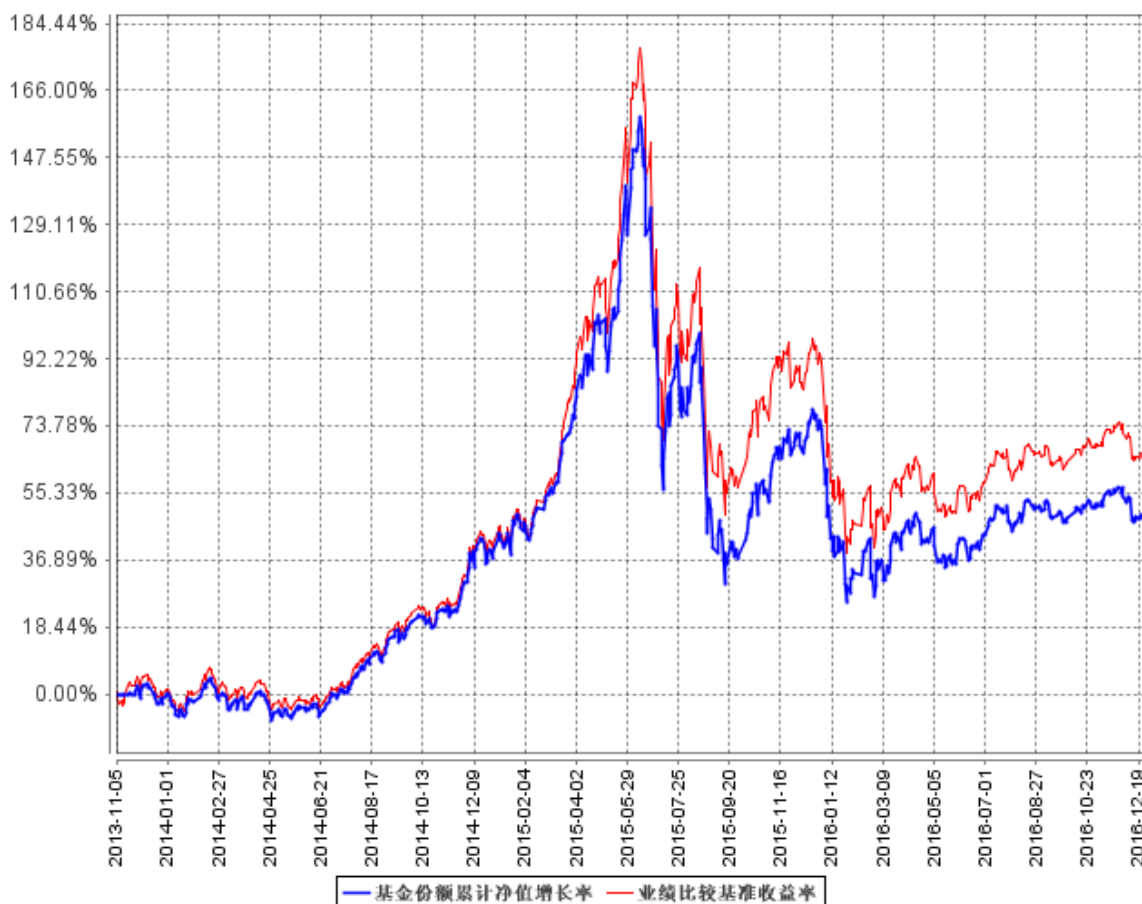
3.2 基金净值表现

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	-0.22%	0.76%	0.27%	0.77%	-0.49%	-0.01%
过去六个月	2.60%	0.82%	3.71%	0.85%	-1.11%	-0.03%
过去一年	-14.49%	1.69%	-14.19%	1.71%	-0.30%	-0.02%
过去三年	48.28%	1.85%	62.10%	1.90%	-13.82%	-0.05%
自基金合同生效起至今	47.83%	1.82%	64.20%	1.87%	-16.37%	-0.05%

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

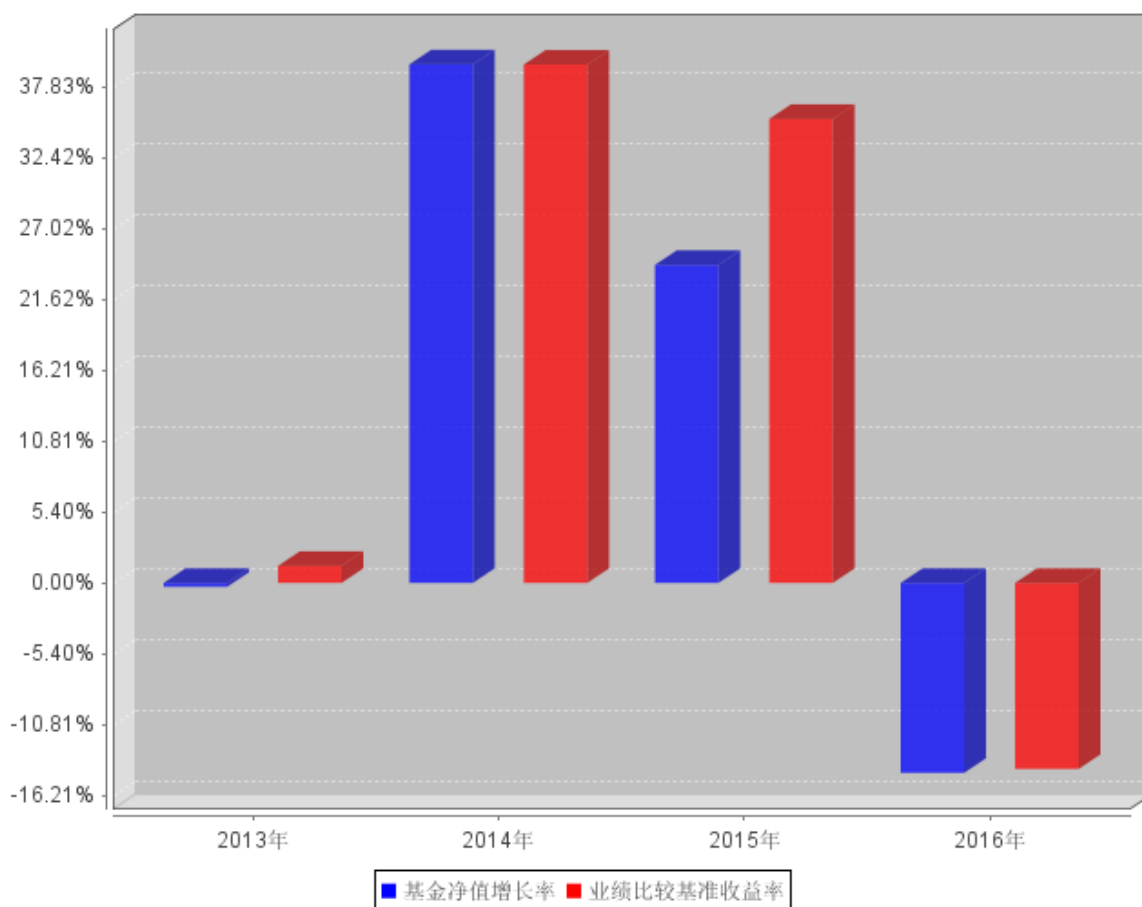
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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

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：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 过去三年基金的利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

§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

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有

限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2016 年 12 月 31 日,本基金管理人管理着 70 只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金(LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华

鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型证券投资基金。

同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周毅先生	本基金的基金经理、公司副总经理、境外投资部总监、量化投资部总监及量化投资总监	2013 年 11 月 5 日	-	17 年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，自 2010 年 5 月 7 日起担任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，2010 年 6 月 21 日至 2011 年 12 月 6 日期间兼任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2010 年 8 月 5 日至 2012 年 3 月 27 日期间兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，2010 年 12 月 6 日至 2012 年 11 月 7 日期间兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。具有从业资格。国籍：美国。
张凯先生	本基金的基金经理	2013 年 11 月 5 日	-	7 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自 2012 年 11 月 14 日起担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日起兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 800 等权重指数增强分级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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程,完善公平交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,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》及《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,制定了《银华基金管理股份有限公司公平交易执行制度》,规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制;明确了交易执行环节的集中交易制度,并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外,为了加强对异常交易行为的日常监控,本基金管理人还制定了《银华基金管理股份有限公司异常交易监控实施细则》,规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步修订了公平交易的范围,修订了对不同投资合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,不掺杂任何的人为判断,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2、一般情况下,场外交易指令以组合的名义下达,执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易,并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应,且各投资组合获得公平的交易机会;3、对于部分债券一级市场申

购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

综上所述，本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督，来确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。

在投资决策环节，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较

少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。尽管报告期内本基金多次发生大额申购赎回，我们仍将跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.993 元，本报告期份额净值增长率为-14.49%，同期业绩比较基准收益率为-14.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去的一年，A 股市场处于宽幅震荡中。尽管 PPP、金融地产、举牌概念等多种行业主题快速轮动，但仍缺乏能够持续引领市场的投资主线；上半年表现强势的食品饮料、有色金属等板块出现大幅度回调，而近年来强势的 TMT 板块今年以来持续低迷，整个季度市场整体表现偏弱势。地产火爆对股市的分流、定向增发及 IPO 对资金的吸引、以及二级市场缺乏持续的赚钱效应，都使得 A 股的吸引力不断下降，成交量也不断萎缩。

展望 2017 年，全球及国内的各方面不确定性因素将逐步落地，资产价格的波动将会加大。供给侧改革、混合所有制改革等受政策驱动的主题和有确定性业绩的公司或存在阶段性的投资机会。在没有明确的投资主线出现之前，我们保持相对谨慎的投资观点。

本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标，期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

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，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同基金的特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。首先，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并对其他业务环节进行不定期抽查。“季度监察稽核项目表”由各部门风险控制管理员组织关键岗位业务人员填报自查结果，部门总监签字确认后，将稽核结果报督察长及公司总经理。在持续关注对“季度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在投资研究交易环节，持续进行对研究报告合规性的检查、对股票库建立及完善的跟踪检查，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易

的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、不符合事项书面跟踪检查报告或警示报告的形式，及时将潜在风险通报部门总监、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人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，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

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

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2016 年 5 月 5 日至 2016 年 7 月 21 日。

§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”）在银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（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	安永华明（2017）审字第 60468687_A31 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	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和

	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基金管理人银华基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，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而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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基金管理人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。</p> <p>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。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	徐 艳	马剑英
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

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	4,249,719.03	3,769,428.43
结算备付金		1,680.59	166,459.53
存出保证金		5,921.39	34,054.50
交易性金融资产	7.4.7.2	45,869,041.49	52,756,377.52
其中：股票投资		45,869,041.49	52,756,377.52
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	847.62	986.86
应收股利		-	-
应收申购款		13,004.40	2,007.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		50,140,214.52	56,729,314.43
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		153,953.67	-
应付赎回款		451,968.29	55,961.57
应付管理人报酬		42,658.30	48,254.11
应付托管费		8,531.68	9,650.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	50,613.20	37,324.54
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	196,677.30	395,199.14
负债合计		904,402.44	546,390.17
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	33,305,188.79	32,512,781.88
未分配利润	7.4.7.10	15,930,623.29	23,670,142.38
所有者权益合计		49,235,812.08	56,182,924.26
负债和所有者权益总计		50,140,214.52	56,729,314.43

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，800 分级份额净值为人民币 0.993 元，中证 800A 份额净值为人民币 1.004 元，中证 800B 份额净值为人民币 0.982 元；基金份额总额为 49,579,881.12 份，其中 800 分级份额为 43,714,649.12 份，中证 800A 份额为 2,932,616.00 份，中证 800B 份额为 2,932,616.00 份。

7.2 利润表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

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		-7,062,197.38	11,126,944.31
1.利息收入		36,406.06	89,360.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	36,212.05	89,360.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		194.01	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,100,302.33	17,081,448.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,701,625.61	16,396,323.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	159,400.00	-
股利收益	7.4.7.16	441,923.28	685,124.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,953,409.40	-6,658,779.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	48,289.49	614,915.91
减：二、费用		1,552,108.75	3,069,126.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	531,102.84	784,297.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	106,220.55	156,859.42
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	287,205.49	1,493,934.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7.4.7.20	627,579.87	634,035.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,614,306.13	8,057,818.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,614,306.13	8,057,818.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

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）	32,512,781.88	23,670,142.38	56,182,924.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,614,306.13	-8,614,306.13
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）	792,406.91	874,787.04	1,667,193.95
其中：1. 基金申购款	30,671,760.04	13,536,832.53	44,208,592.57
2. 基金赎回款	-29,879,353.13	-12,662,045.49	-42,541,398.62
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）	33,305,188.79	15,930,623.29	49,235,812.08
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）	31,705,146.55	12,414,738.18	44,119,884.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,057,818.05	8,057,818.05
三、本期基金份额交易	807,635.33	3,197,586.15	4,005,221.48

进行基金的定期份额折算。每 2 份 800 分级份额将按 1 份中证 800A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，中证 800A 份额和中证 800B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于中证 800A 份额期末的约定应得收益，即中证 800A 份额每个定期折算期间期末即 11 月 30 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内 800 分级份额分配给中证 800A 份额持有人。800 分级份额持有人持有的每 2 份 800 分级份额将按 1 份中证 800A 份额获得新增 800 分级份额的分配。持有场外 800 分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外 800 分级份额的分配；持有场内 800 分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内 800 分级份额的分配。经过上述份额折算，中证 800A 份额和 800 分级份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当 800 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元及以上；当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元及以下。当 800 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额的基金份额净值均调整为 1 元。当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后银华 800 份额、中证 800A 份额和中证 800B 份额的基金份额净值均调整为 1 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，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，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提，且每季度不少于人民币 5 万元；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》和《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，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。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,249,719.03	3,769,428.43
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,249,719.03	3,769,428.43

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	48,280,694.02	45,869,041.49	-2,411,652.53
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	48,280,694.02	45,869,041.49	-2,411,652.53
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	58,121,439.45	52,756,377.52	-5,365,061.93
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	58,121,439.45	52,756,377.52	-5,365,061.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

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	844.38	836.54
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	0.50	74.96
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.04	60.06
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	2.70	15.30
合计	847.62	986.86

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

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	50,613.20	37,324.54
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	50,613.20	37,324.54

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	1,677.30	199.14
标的指数使用基点费	50,000.00	50,000.00

预提费用	145,000.00	345,000.00
合计	196,677.30	395,199.14

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	47,265,913.79	32,512,781.88
本期申购	44,026,582.45	30,276,559.25
本期赎回（以“-”号填列）	-42,716,925.13	-29,380,851.55
2016年12月1日 基金拆分 /份额折算前	48,575,571.11	33,408,489.58
基金拆分/份额折算变动份额	1,157,997.15	-
本期申购	588,470.54	395,200.79
本期赎回（以“-”号填列）	-742,157.68	-498,501.58
本期末	49,579,881.12	33,305,188.79

注：（1）根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2016 年 12 月 1 日为份额折算基准日，对 800 分级份额以及中证 800A 份额实施了定期份额折算，新增份额 1,157,997.15 份；

（2）根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回 800 分级份额，中证 800A 份额和中证 800B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露中证 800A 份额和中证 800B 份额的情况。

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	16,854,459.64	6,815,682.74	23,670,142.38
本期利润	-11,567,715.53	2,953,409.40	-8,614,306.13
本期基金份额交易 产生的变动数	1,680,447.96	-805,660.92	874,787.04
其中：基金申购款	14,397,531.10	-860,698.57	13,536,832.53
基金赎回款	-12,717,083.14	55,037.65	-12,662,045.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,967,192.07	8,963,431.22	15,930,623.29

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年	2015年1月1日至2015年12月

	12 月 31 日	31 日
活期存款利息收入	33,825.08	81,355.18
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	2,025.52	7,124.00
其他	361.45	881.05
合计	36,212.05	89,360.23

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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	95,067,023.49	489,856,517.07
减：卖出股票成本总额	105,768,649.10	473,460,193.65
买卖股票差价收入	-10,701,625.61	16,396,323.42

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金 额 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	159,400.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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	441,923.28	685,124.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	441,923.28	685,124.61

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至 2016年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	2,953,409.40	-6,658,779.86
——股票投资	2,953,409.40	-6,658,779.86
——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	2,953,409.40	-6,658,779.86

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年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	48,289.49	614,915.91
合计	48,289.49	614,915.91

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 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	287,205.49	1,493,934.00
银行间市场交易费用	-	-
合计	287,205.49	1,493,934.00

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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	45,000.00	45,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
标的指数使用基点费	200,000.00	200,000.00
银行汇划费用	4,379.87	10,835.52
账户服务费	18,200.00	18,200.00
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	627,579.87	634,035.52

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	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、基金代销机构
银华财富资本管理（北京）有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2016 年 8 月 9 日，银华基金管理有限公司变更名称为银华基金管理股份有限公司。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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 2016 年 12 月 31 日	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	531,102.84	784,297.32
其中：支付销售机构的客户维护费	98,102.20	145,259.44

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 2016 年 12 月 31 日	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	106,220.55	156,859.42

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

注：本基金于本报告期及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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日 (2013 年 11 月 5 日) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	16,837,524.19
期间申购/买入总份额	-	-	4,815,992.29
期间因拆分变动份额	-	-	516,200.45
减: 期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	22,169,716.93
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	50.71%

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日 (2013 年 11 月 5 日) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	16,721,571.91
期间因拆分变动份额	-	-	115,952.28
减: 期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	16,837,524.19
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	39.75%

注: 1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

注: 本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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	4,249,719.03	33,825.08	3,769,428.43

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 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：份）	总金额
中银国际证券	601099	太平洋	配股	2,160	9,158.40

注：本基金上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：根据《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》和《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	6,974	27,896.00	27,896.00	

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
600537	亿晶光电	2016年 12月27日	重大事项	7.43	2017年 1月13日	8.17	26,752	192,420.72	198,767.36	-
002727	一心堂	2016年 12月28日	重大事项	21.20	2017年 1月5日	21.66	8,920	195,442.48	189,104.00	-
000563	陕国投A	2016年 10月14日	重大事项	7.48	2017年 1月18日	6.73	10,532	67,689.43	78,779.36	-
000750	国海证券	2016年 12月15日	重大事项	6.97	2017年 1月20日	6.27	10,345	85,461.25	72,104.65	-
002025	航天电器	2016年 9月12日	重大事项	25.20	-	-	2,769	64,782.95	69,778.80	-
600161	天坛生物	2016年 12月6日	重大事项	39.40	-	-	1,733	63,334.90	68,280.20	-
600649	城投控股	2016年 12月6日	重大事项	20.34	-	-	3,285	46,196.40	66,816.90	-
000887	中鼎股份	2016年 11月18日	重大事项	25.94	2017年 2月15日	23.99	2,548	59,871.09	66,095.12	-
601727	上海电气	2016年 8月31日	重大事项	8.42	-	-	7,669	88,967.51	64,572.98	-
600673	东阳光科	2016年 11月15日	重大事项	7.29	-	-	8,684	57,439.53	63,306.36	-
300088	长信科技	2016年 9月12日	重大事项	15.80	-	-	3,969	54,250.67	62,710.20	-
000697	炼石有色	2016年 11月17日	重大事项	23.51	-	-	2,652	61,532.07	62,348.52	-
000748	长城信息	2016年 11月1日	重大事项	18.92	-	-	3,236	70,966.76	61,225.12	-
002396	星网锐捷	2016年 9月12日	重大事项	19.70	2017年 2月21日	18.35	3,104	72,666.48	61,148.80	-
002440	闰土股份	2016年 10月21日	重大事项	16.34	2017年 1月12日	15.22	3,728	63,327.23	60,915.52	-
600151	航天机电	2016年 11月11日	重大事项	10.97	-	-	5,420	61,661.04	59,457.40	-
000540	中天城投	2016年 11月28日	重大事项	6.93	2017年 1月3日	7.00	8,429	73,438.16	58,412.97	-
002745	木林森	2016年 7月15日	重大事项	36.49	-	-	1,600	58,408.32	58,384.00	-
603169	兰石重装	2016年 11月24日	重大事项	13.36	2017年 3月21日	14.32	4,303	62,709.73	57,488.08	-

600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大事项	20.32	-	-	2,803	57,636.24	56,956.96	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	重大事项	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	1,544	40,883.42	56,201.60	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	16,600	56,491.05	55,942.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项	13.79	-	-	4,027	61,877.01	55,532.33	-
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	重大事项	2.52	-	-	21,367	84,842.03	53,844.84	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项	9.16	-	-	5,758	81,537.83	52,743.28	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大事项	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	3,200	50,254.00	52,544.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	3,397	83,790.16	52,177.92	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	4,123	84,995.70	51,537.50	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	2,600	52,212.28	48,932.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项	11.28	-	-	4,317	55,361.16	48,695.76	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	1,000	18,942.07	46,890.00	-
603555	贵人鸟	2016 年 12 月 12 日	重大事项	30.76	-	-	1,505	44,141.13	46,293.80	-
600875	东方电气	2016 年 12 月 9 日	重大事项	10.79	-	-	4,032	56,499.40	43,505.28	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 29 日	重大事项	16.63	-	-	2,440	41,212.17	40,577.20	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项	11.42	-	-	3,471	41,709.59	39,638.82	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大事项	16.28	-	-	2,413	46,921.11	39,283.64	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项	7.83	-	-	4,896	35,449.18	38,335.68	-
000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事项	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	6,043	43,076.94	37,768.75	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	2,400	36,902.00	37,296.00	-
600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	重大事项	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	2,647	43,047.30	37,190.35	-
002681	奋达科技	2016 年	重大事项	12.93	-	-	2,740	39,215.84	35,428.20	-

		12 月 19 日								
600654	中安消	2016 年 12 月 14 日	重大事项	17.43	-	-	2,000	34,950.00	34,860.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.60	-	-	2,347	55,759.18	34,266.20	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大事项	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	937	43,301.35	33,544.60	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	重大事项	26.80	-	-	1,192	42,693.04	31,945.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 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，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金及结算备付金等。

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	4,249,719.03	-	-	-	-	-	4,249,719.03
结算备付金	1,680.59	-	-	-	-	-	1,680.59
存出保证金	5,921.39	-	-	-	-	-	5,921.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	45,869,041.49	45,869,041.49
应收利息	-	-	-	-	-	847.62	847.62
应收申购款	-	-	-	-	-	13,004.40	13,004.40
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,257,321.01	-	-	-	-	45,882,893.51	50,140,214.52
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	153,953.67	153,953.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	451,968.29	451,968.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,658.30	42,658.30
应付托管费	-	-	-	-	-	8,531.68	8,531.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,613.20	50,613.20
其他负债	-	-	-	-	-	196,677.30	196,677.30
负债总计	-	-	-	-	-	904,402.44	904,402.44
利率敏感度缺口	4,257,321.01	-	-	-	-	44,978,491.07	49,235,812.08
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	3,769,428.43	-	-	-	-	-	3,769,428.43
结算备付金	166,459.53	-	-	-	-	-	166,459.53
存出保证金	34,054.50	-	-	-	-	-	34,054.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	52,756,377.52	52,756,377.52
应收利息	-	-	-	-	-	986.86	986.86
应收申购款	-	-	-	-	-	2,007.59	2,007.59
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,969,942.46	-	-	-	-	52,759,371.97	56,729,314.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	55,961.57	55,961.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,254.11	48,254.11
应付托管费	-	-	-	-	-	9,650.81	9,650.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	37,324.54	37,324.54
其他负债	-	-	-	-	-	395,199.14	395,199.14
负债总计	-	-	-	-	-	546,390.17	546,390.17
利率敏感度缺口	3,969,942.46	-	-	-	-	52,212,981.80	56,182,924.26

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产

的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.2.1 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	45,869,041.49	93.16	52,756,377.52	93.90
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	45,869,041.49	93.16	52,756,377.52	93.90

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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）
	+5%	2,411,877.46	6,122,169.08
-5%	-2,411,877.46	-6,122,169.08	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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 公允价值**

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 43,199,516.84 元，属于第二层次的余额为人民币 2,669,524.65 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 48,270,244.65 元，第二层次人民币 4,486,132.87 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 2,083,609.15 元（2015 年度：人民币 1,950,322.78 元），由第二层次转入第一层次的金额为人民币 2,766,940.81 元（2015 年度：人民币 1,596,708.77 元）。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2015 年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2016 年 5 月 5 日至 2016 年 7 月 21 日。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§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	45,869,041.49	91.48
	其中：股票	45,869,041.49	91.48

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	4,251,399.62	8.48
7	其他各项资产	19,773.41	0.04
8	合计	50,140,214.52	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	332,154.33	0.67
B	采矿业	1,887,145.70	3.83
C	制造业	23,399,429.27	47.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,720,592.38	3.49
E	建筑业	1,769,836.20	3.59
F	批发和零售业	3,235,915.49	6.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,341,769.71	2.73
H	住宿和餐饮业	36,471.48	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,140,962.22	8.41
J	金融业	1,988,993.96	4.04
K	房地产业	2,877,108.49	5.84
L	租赁和商务服务业	750,615.26	1.52
M	科学研究和技术服务业	68,971.38	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	378,159.72	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	39,441.49	0.08
Q	卫生和社会工作	73,290.60	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,002,059.33	2.04

S	综合	624,958.02	1.27
	合计	45,667,875.03	92.75

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	51,537.50	0.10
C	制造业	121,732.96	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	27,896.00	0.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	201,166.46	0.41

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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	600537	亿晶光电	26,752	198,767.36	0.40
2	601231	环旭电子	18,300	195,993.00	0.40
3	000620	新华联	22,860	193,852.80	0.39
4	600586	金晶科技	41,860	193,811.80	0.39
5	601908	京运通	27,076	192,781.12	0.39
6	600801	华新水泥	24,828	192,417.00	0.39
7	002001	新和成	9,807	192,217.20	0.39
8	000631	顺发恒业	39,208	192,119.20	0.39
9	002238	天威视讯	13,046	191,123.90	0.39
10	600351	亚宝药业	19,327	190,950.76	0.39
11	600037	歌华有线	12,400	189,968.00	0.39
12	600993	马应龙	9,506	189,834.82	0.39
13	300274	阳光电源	17,960	189,298.40	0.38
14	600335	国机汽车	15,570	189,175.50	0.38
15	002727	一心堂	8,920	189,104.00	0.38
16	002309	中利科技	13,295	188,921.95	0.38
17	002646	青青稞酒	9,791	188,476.75	0.38
18	600981	汇鸿集团	22,100	187,629.00	0.38
19	000919	金陵药业	13,864	187,579.92	0.38
20	600216	浙江医药	14,781	187,423.08	0.38
21	600563	法拉电子	5,111	187,420.37	0.38
22	600894	广日股份	13,710	187,415.70	0.38
23	600862	中航高科	15,300	187,272.00	0.38
24	002551	尚荣医疗	9,395	187,054.45	0.38
25	002221	东华能源	15,092	186,989.88	0.38
26	600805	悦达投资	22,012	186,881.88	0.38
27	600635	大众公用	31,078	186,778.78	0.38
28	002223	鱼跃医疗	6,021	186,771.42	0.38
29	300055	万邦达	11,400	186,732.00	0.38
30	600180	瑞茂通	13,750	186,175.00	0.38
31	600597	光明乳业	14,246	186,052.76	0.38
32	600776	东方通信	21,727	185,983.12	0.38
33	002463	沪电股份	38,893	185,908.54	0.38

34	600292	远达环保	15,027	185,883.99	0.38
35	600067	冠城大通	25,959	185,866.44	0.38
36	300199	翰宇药业	10,335	185,823.30	0.38
37	002498	汉缆股份	43,200	185,760.00	0.38
38	000598	兴蓉环境	32,249	185,754.24	0.38
39	600755	厦门国贸	22,648	185,713.60	0.38
40	002315	焦点科技	3,080	185,693.20	0.38
41	000917	电广传媒	12,894	185,544.66	0.38
42	002029	七匹狼	18,162	185,434.02	0.38
43	600648	外高桥	9,388	185,319.12	0.38
44	601929	吉视传媒	44,222	185,290.18	0.38
45	600289	亿阳信通	14,304	185,236.80	0.38
46	001696	宗申动力	19,699	185,170.60	0.38
47	300166	东方国信	8,900	185,031.00	0.38
48	002327	富安娜	21,023	185,002.40	0.38
49	600783	鲁信创投	8,178	184,986.36	0.38
50	000861	海印股份	38,131	184,935.35	0.38
51	600220	江苏阳光	42,588	184,831.92	0.38
52	600874	创业环保	22,725	184,754.25	0.38
53	002375	亚厦股份	17,462	184,747.96	0.38
54	002332	仙琚制药	14,349	184,671.63	0.38
55	600418	江淮汽车	15,974	184,659.44	0.38
56	000099	中信海直	15,767	184,631.57	0.37
57	002123	梦网荣信	12,300	184,500.00	0.37
58	002317	众生药业	14,937	184,471.95	0.37
59	300147	香雪制药	14,300	184,470.00	0.37
60	600743	华远地产	41,440	184,408.00	0.37
61	002663	普邦园林	30,363	184,303.41	0.37
62	600373	中文传媒	9,122	184,264.40	0.37
63	600557	康缘药业	10,875	184,113.75	0.37
64	300297	蓝盾股份	14,800	184,112.00	0.37
65	000616	海航投资	35,269	184,104.18	0.37
66	600729	重庆百货	7,857	184,089.51	0.37
67	000552	靖远煤电	48,548	183,996.92	0.37
68	600869	智慧能源	23,764	183,933.36	0.37
69	600879	航天电子	12,063	183,840.12	0.37
70	603567	珍宝岛	9,300	183,768.00	0.37
71	600483	福能股份	16,600	183,762.00	0.37
72	600458	时代新材	12,973	183,567.95	0.37

73	000652	泰达股份	33,217	183,357.84	0.37
74	600496	精工钢构	42,829	183,308.12	0.37
75	603198	迎驾贡酒	8,500	183,175.00	0.37
76	002004	华邦健康	20,180	183,032.60	0.37
77	002276	万马股份	12,170	182,915.10	0.37
78	600580	卧龙电气	20,073	182,664.30	0.37
79	600823	世茂股份	26,012	182,604.24	0.37
80	002118	紫鑫药业	25,352	182,534.40	0.37
81	600366	宁波韵升	9,270	182,526.30	0.37
82	600188	兖州煤业	16,804	182,491.44	0.37
83	000667	美好集团	49,373	182,186.37	0.37
84	000600	建投能源	20,489	181,942.32	0.37
85	002152	广电运通	13,700	181,936.00	0.37
86	600831	广电网络	13,928	181,899.68	0.37
87	002233	塔牌集团	19,448	181,838.80	0.37
88	600157	永泰能源	45,276	181,556.76	0.37
89	000973	佛塑科技	24,203	181,522.50	0.37
90	300026	红日药业	33,400	181,362.00	0.37
91	300010	立思辰	10,900	181,158.00	0.37
92	002325	洪涛股份	22,608	181,090.08	0.37
93	002373	千方科技	13,086	180,586.80	0.37
94	603806	福斯特	3,900	180,453.00	0.37
95	002128	露天煤业	20,978	180,410.80	0.37
96	000021	深科技	19,117	180,273.31	0.37
97	600006	东风汽车	26,191	180,194.08	0.37
98	002642	荣之联	8,948	179,854.80	0.37
99	300133	华策影视	15,834	179,715.90	0.37
100	600270	外运发展	10,825	179,045.50	0.36
101	000970	中科三环	13,396	178,836.60	0.36
102	600016	民生银行	8,677	78,787.16	0.16
103	000563	陕国投 A	10,532	78,779.36	0.16
104	601377	兴业证券	9,651	73,830.15	0.15
105	002640	跨境通	4,000	73,200.00	0.15
106	000750	国海证券	10,345	72,104.65	0.15
107	002025	航天电器	2,769	69,778.80	0.14
108	000538	云南白药	904	68,839.60	0.14
109	600519	贵州茅台	206	68,834.90	0.14
110	600161	天坛生物	1,733	68,280.20	0.14
111	600649	城投控股	3,285	66,816.90	0.14

112	600175	美都能源	13,153	65,107.35	0.13
113	601727	上海电气	7,669	64,572.98	0.13
114	600673	东阳光科	8,684	63,306.36	0.13
115	300273	和佳股份	3,694	63,019.64	0.13
116	300088	长信科技	3,969	62,710.20	0.13
117	000697	炼石有色	2,652	62,348.52	0.13
118	000415	渤海金控	8,708	62,262.20	0.13
119	000748	长城信息	3,236	61,225.12	0.12
120	002396	星网锐捷	3,104	61,148.80	0.12
121	002440	闰土股份	3,728	60,915.52	0.12
122	600151	航天机电	5,420	59,457.40	0.12
123	600525	长园集团	4,217	58,827.15	0.12
124	000540	中天城投	8,429	58,412.97	0.12
125	002745	木林森	1,600	58,384.00	0.12
126	603169	兰石重装	4,303	57,488.08	0.12
127	600551	时代出版	2,803	56,956.96	0.12
128	002635	安洁科技	1,544	56,201.60	0.11
129	000727	华东科技	16,600	55,942.00	0.11
130	002400	省广股份	4,027	55,532.33	0.11
131	002129	中环股份	5,758	52,743.28	0.11
132	600687	刚泰控股	3,200	52,544.00	0.11
133	000547	航天发展	3,397	52,177.92	0.11
134	000050	深天马 A	2,600	48,932.00	0.10
135	000829	天音控股	4,317	48,695.76	0.10
136	600717	天津港	4,686	47,234.88	0.10
137	002602	世纪华通	1,000	46,890.00	0.10
138	603555	贵人鸟	1,505	46,293.80	0.09
139	000612	焦作万方	3,900	45,045.00	0.09
140	000963	华东医药	622	44,827.54	0.09
141	600718	东软集团	2,252	44,274.32	0.09
142	600416	湘电股份	2,966	43,629.86	0.09
143	600875	东方电气	4,032	43,505.28	0.09
144	002572	索菲亚	800	43,328.00	0.09
145	601800	中国交建	2,846	43,230.74	0.09
146	601336	新华保险	981	42,948.18	0.09
147	603025	大豪科技	1,100	42,933.00	0.09
148	300257	开山股份	2,500	42,900.00	0.09
149	600284	浦东建设	3,252	42,893.88	0.09
150	600158	中体产业	1,806	42,567.42	0.09

151	002310	东方园林	3,000	42,450.00	0.09
152	000975	银泰资源	2,706	42,321.84	0.09
153	600547	山东黄金	1,157	42,242.07	0.09
154	000826	启迪桑德	1,280	42,214.40	0.09
155	000703	恒逸石化	2,804	42,144.12	0.09
156	000519	江南红箭	2,827	42,122.30	0.09
157	002252	上海莱士	1,824	42,116.16	0.09
158	600827	百联股份	2,932	42,103.52	0.09
159	600640	号百控股	2,106	42,077.88	0.09
160	600050	中国联通	5,755	42,069.05	0.09
161	002503	搜于特	2,921	42,033.19	0.09
162	002304	洋河股份	595	42,007.00	0.09
163	601318	中国平安	1,185	41,984.55	0.09
164	000860	顺鑫农业	1,908	41,976.00	0.09
165	601628	中国人寿	1,736	41,820.24	0.08
166	600276	恒瑞医药	915	41,632.50	0.08
167	600481	双良节能	5,528	41,570.56	0.08
168	603355	莱克电气	900	41,553.00	0.08
169	000513	丽珠集团	698	41,531.00	0.08
170	600098	广州发展	3,700	41,514.00	0.08
171	600053	九鼎投资	900	41,454.00	0.08
172	002508	老板电器	1,125	41,400.00	0.08
173	600426	华鲁恒升	3,123	41,379.75	0.08
174	600086	东方金钰	3,797	41,311.36	0.08
175	600282	南钢股份	13,300	41,230.00	0.08
176	002345	潮宏基	3,395	41,011.60	0.08
177	600219	南山铝业	13,272	41,010.48	0.08
178	600682	南京新百	1,100	40,997.00	0.08
179	600703	三安光电	3,059	40,960.01	0.08
180	600068	葛洲坝	4,446	40,858.74	0.08
181	002450	康得新	2,138	40,857.18	0.08
182	600409	三友化工	4,351	40,855.89	0.08
183	603001	奥康国际	1,782	40,807.80	0.08
184	002168	深圳惠程	2,573	40,807.78	0.08
185	600820	隧道股份	3,700	40,737.00	0.08
186	600535	天士力	981	40,701.69	0.08
187	600660	福耀玻璃	2,183	40,669.29	0.08
188	600466	蓝光发展	4,200	40,614.00	0.08
189	600019	宝钢股份	6,393	40,595.55	0.08

190	002281	光迅科技	517	40,584.50	0.08
191	600406	国电南瑞	2,440	40,577.20	0.08
192	600500	中化国际	3,480	40,576.80	0.08
193	002475	立讯精密	1,955	40,566.25	0.08
194	601328	交通银行	7,027	40,545.79	0.08
195	600196	复星医药	1,751	40,518.14	0.08
196	002384	东山精密	2,066	40,514.26	0.08
197	002085	万丰奥威	2,048	40,468.48	0.08
198	600005	武钢股份	11,863	40,452.83	0.08
199	600309	万华化学	1,877	40,411.81	0.08
200	600415	小商品城	4,669	40,386.85	0.08
201	600195	中牧股份	1,898	40,332.50	0.08
202	000690	宝新能源	4,349	40,315.23	0.08
203	600809	山西汾酒	1,611	40,307.22	0.08
204	600115	东方航空	5,699	40,291.93	0.08
205	300115	长盈精密	1,546	40,288.76	0.08
206	002074	国轩高科	1,300	40,287.00	0.08
207	002049	紫光国芯	1,223	40,285.62	0.08
208	002050	三花股份	3,649	40,284.96	0.08
209	600518	康美药业	2,256	40,269.60	0.08
210	600643	爱建集团	3,244	40,258.04	0.08
211	000709	河钢股份	12,042	40,220.28	0.08
212	601668	中国建筑	4,538	40,206.68	0.08
213	000400	许继电气	2,213	40,165.95	0.08
214	600021	上海电力	3,306	40,134.84	0.08
215	601678	滨化股份	5,505	40,131.45	0.08
216	000930	中粮生化	2,985	40,118.40	0.08
217	002277	友阿股份	2,793	40,107.48	0.08
218	002028	思源电气	3,042	40,093.56	0.08
219	000049	德赛电池	953	40,073.65	0.08
220	601633	长城汽车	3,619	40,026.14	0.08
221	300156	神雾环保	1,600	40,016.00	0.08
222	600150	中国船舶	1,449	40,006.89	0.08
223	601718	际华集团	4,340	39,971.40	0.08
224	002595	豪迈科技	1,897	39,931.85	0.08
225	601998	中信银行	6,229	39,927.89	0.08
226	601166	兴业银行	2,472	39,898.08	0.08
227	000926	福星股份	3,131	39,888.94	0.08
228	600122	宏图高科	3,262	39,861.64	0.08

229	601777	力帆股份	4,166	39,826.96	0.08
230	002342	巨力索具	5,759	39,794.69	0.08
231	601390	中国中铁	4,487	39,754.82	0.08
232	300202	聚龙股份	1,616	39,753.60	0.08
233	600575	皖江物流	6,909	39,726.75	0.08
234	002603	以岭药业	2,300	39,652.00	0.08
235	600267	海正药业	3,015	39,647.25	0.08
236	600528	中铁二局	2,881	39,642.56	0.08
237	600655	豫园商城	3,471	39,638.82	0.08
238	601857	中国石油	4,986	39,638.70	0.08
239	000661	长春高新	354	39,594.90	0.08
240	600750	江中药业	1,284	39,572.88	0.08
241	000333	美的集团	1,404	39,550.68	0.08
242	601006	大秦铁路	5,583	39,527.64	0.08
243	002408	齐翔腾达	3,593	39,523.00	0.08
244	603866	桃李面包	900	39,510.00	0.08
245	600383	金地集团	3,048	39,502.08	0.08
246	601818	光大银行	10,102	39,498.82	0.08
247	601888	中国国旅	910	39,494.00	0.08
248	600587	新华医疗	1,572	39,472.92	0.08
249	600594	益佰制药	2,370	39,460.50	0.08
250	603377	东方时尚	977	39,441.49	0.08
251	002073	软控股份	3,473	39,418.55	0.08
252	000997	新大陆	2,028	39,404.04	0.08
253	000939	凯迪生态	3,061	39,395.07	0.08
254	000401	冀东水泥	3,310	39,389.00	0.08
255	002217	合力泰	2,200	39,380.00	0.08
256	002244	滨江集团	5,641	39,374.18	0.08
257	601088	中国神华	2,433	39,365.94	0.08
258	600565	迪马股份	5,300	39,326.00	0.08
259	002311	海大集团	2,613	39,325.65	0.08
260	601186	中国铁建	3,285	39,288.60	0.08
261	600859	王府井	2,413	39,283.64	0.08
262	000572	海马汽车	7,328	39,278.08	0.08
263	600177	雅戈尔	2,809	39,269.82	0.08
264	601939	建设银行	7,215	39,249.60	0.08
265	000858	五粮液	1,138	39,238.24	0.08
266	002153	石基信息	1,610	39,235.70	0.08
267	600867	通化东宝	1,789	39,232.77	0.08

268	601669	中国电建	5,403	39,225.78	0.08
269	601933	永辉超市	7,988	39,221.08	0.08
270	002482	广田集团	4,240	39,220.00	0.08
271	000423	东阿阿胶	728	39,217.36	0.08
272	002202	金风科技	2,292	39,216.12	0.08
273	000725	京东方 A	13,705	39,196.30	0.08
274	000063	中兴通讯	2,457	39,189.15	0.08
275	600741	华域汽车	2,456	39,173.20	0.08
276	002041	登海种业	2,073	39,138.24	0.08
277	002269	美邦服饰	7,809	39,123.09	0.08
278	601009	南京银行	3,609	39,121.56	0.08
279	600332	白云山	1,631	39,111.38	0.08
280	000501	鄂武商 A	2,003	39,098.56	0.08
281	600864	哈投股份	3,422	39,079.24	0.08
282	600498	烽火通信	1,550	39,075.50	0.08
283	000959	首钢股份	5,900	39,058.00	0.08
284	000961	中南建设	3,755	39,052.00	0.08
285	600104	上汽集团	1,665	39,044.25	0.08
286	601211	国泰君安	2,100	39,039.00	0.08
287	600736	苏州高新	4,322	39,027.66	0.08
288	002142	宁波银行	2,345	39,020.80	0.08
289	000656	金科股份	7,446	39,017.04	0.08
290	600183	生益科技	3,546	39,006.00	0.08
291	601398	工商银行	8,844	39,002.04	0.08
292	600015	华夏银行	3,593	38,984.05	0.08
293	600143	金发科技	5,010	38,977.80	0.08
294	600031	三一重工	6,388	38,966.80	0.08
295	300058	蓝色光标	3,830	38,951.10	0.08
296	002589	瑞康医药	1,200	38,940.00	0.08
297	600028	中国石化	7,186	38,876.26	0.08
298	000001	平安银行	4,269	38,847.90	0.08
299	600298	安琪酵母	2,180	38,847.60	0.08
300	002581	未名医药	1,600	38,832.00	0.08
301	002179	中航光电	1,070	38,830.30	0.08
302	601985	中国核电	5,500	38,830.00	0.08
303	600079	人福医药	1,946	38,822.70	0.08
304	600160	巨化股份	3,668	38,807.44	0.08
305	000568	泸州老窖	1,174	38,742.00	0.08
306	000998	隆平高科	1,807	38,724.01	0.08

307	600085	同仁堂	1,234	38,722.92	0.08
308	600059	古越龙山	3,779	38,696.96	0.08
309	600618	氯碱化工	2,651	38,678.09	0.08
310	300070	碧水源	2,207	38,666.64	0.08
311	600837	海通证券	2,455	38,666.25	0.08
312	600436	片仔癀	844	38,646.76	0.08
313	300291	华录百纳	1,734	38,633.52	0.08
314	002489	浙江永强	5,103	38,629.71	0.08
315	600633	浙报传媒	2,187	38,622.42	0.08
316	600572	康恩贝	5,283	38,618.73	0.08
317	600685	中船防务	1,300	38,610.00	0.08
318	600887	伊利股份	2,193	38,596.80	0.08
319	600036	招商银行	2,191	38,561.60	0.08
320	603589	口子窖	1,200	38,556.00	0.08
321	600816	安信信托	1,632	38,547.84	0.08
322	600030	中信证券	2,400	38,544.00	0.08
323	600482	中国动力	1,262	38,541.48	0.08
324	600959	江苏有限	3,410	38,533.00	0.08
325	600704	物产中大	3,729	38,520.57	0.08
326	600297	广汇汽车	4,500	38,520.00	0.08
327	600312	平高电气	2,466	38,518.92	0.08
328	600073	上海梅林	3,363	38,506.35	0.08
329	000425	徐工机械	11,392	38,504.96	0.08
330	002191	劲嘉股份	3,698	38,496.18	0.08
331	601601	中国太保	1,386	38,489.22	0.08
332	600200	江苏吴中	1,992	38,465.52	0.08
333	000685	中山公用	3,456	38,465.28	0.08
334	600958	东方证券	2,476	38,452.28	0.08
335	300266	兴源环境	700	38,416.00	0.08
336	600688	上海石化	5,964	38,408.16	0.08
337	601169	北京银行	3,935	38,405.60	0.08
338	600039	四川路桥	8,102	38,403.48	0.08
339	600277	亿利洁能	5,400	38,394.00	0.08
340	600759	洲际油气	3,908	38,376.56	0.08
341	601788	光大证券	2,400	38,376.00	0.08
342	002064	华峰氨纶	6,989	38,369.61	0.08
343	600184	光电股份	1,778	38,369.24	0.08
344	000157	中联重科	8,446	38,344.84	0.08
345	601168	西部矿业	4,896	38,335.68	0.08

346	000651	格力电器	1,557	38,333.34	0.08
347	002479	富春环保	2,585	38,309.70	0.08
348	600886	国投电力	5,741	38,292.47	0.08
349	601288	农业银行	12,345	38,269.50	0.08
350	600851	海欣股份	2,958	38,246.94	0.08
351	601689	拓普集团	1,300	38,246.00	0.08
352	600585	海螺水泥	2,255	38,244.80	0.08
353	600009	上海机场	1,442	38,241.84	0.08
354	600316	洪都航空	1,945	38,238.70	0.08
355	600422	昆药集团	2,830	38,233.30	0.08
356	601018	宁波港	7,551	38,208.06	0.08
357	002093	国脉科技	3,449	38,180.43	0.08
358	000977	浪潮信息	1,800	38,160.00	0.08
359	002665	首航节能	4,356	38,158.56	0.08
360	002013	中航机电	2,086	38,152.94	0.08
361	002399	海普瑞	2,094	38,152.68	0.08
362	603328	依顿电子	1,193	38,152.14	0.08
363	002008	大族激光	1,688	38,148.80	0.08
364	600871	石化油服	9,300	38,130.00	0.08
365	600428	中远海特	6,230	38,127.60	0.08
366	601198	东兴证券	1,900	38,114.00	0.08
367	600109	国金证券	2,924	38,099.72	0.08
368	601608	中信重工	6,791	38,097.51	0.08
369	002690	美亚光电	1,800	38,088.00	0.08
370	600066	宇通客车	1,944	38,082.96	0.08
371	600674	川投能源	4,377	38,079.90	0.08
372	002308	威创股份	2,583	38,073.42	0.08
373	600584	长电科技	2,157	38,071.05	0.08
374	600521	华海药业	1,728	38,067.84	0.08
375	600690	青岛海尔	3,851	38,047.88	0.08
376	002344	海宁皮城	3,360	38,035.20	0.08
377	601555	东吴证券	2,865	38,018.55	0.08
378	601012	隆基股份	2,839	38,014.21	0.08
379	600221	海南航空	11,659	38,008.34	0.08
380	600056	中国医药	1,996	37,983.88	0.08
381	000630	铜陵有色	12,328	37,970.24	0.08
382	600023	浙能电力	6,990	37,955.70	0.08
383	600900	长江电力	2,998	37,954.68	0.08
384	600315	上海家化	1,400	37,954.00	0.08

385	000895	双汇发展	1,813	37,946.09	0.08
386	600170	上海建工	8,022	37,944.06	0.08
387	600872	中炬高新	2,694	37,931.52	0.08
388	000726	鲁泰 A	2,961	37,930.41	0.08
389	000636	风华高科	3,886	37,927.36	0.08
390	002241	歌尔股份	1,430	37,923.60	0.08
391	603000	人民网	2,147	37,916.02	0.08
392	600000	浦发银行	2,339	37,915.19	0.08
393	600038	中直股份	783	37,912.86	0.08
394	603766	隆鑫通用	1,824	37,902.72	0.08
395	002065	东华软件	1,626	37,885.80	0.08
396	002465	海格通信	3,251	37,874.15	0.08
397	600895	张江高科	2,137	37,867.64	0.08
398	002392	北京利尔	6,573	37,860.48	0.08
399	601002	晋亿实业	3,976	37,851.52	0.08
400	601688	华泰证券	2,119	37,845.34	0.08
401	000768	中航飞机	1,780	37,842.80	0.08
402	600873	梅花生物	5,804	37,842.08	0.08
403	002056	横店东磁	2,720	37,835.20	0.08
404	600017	日照港	9,340	37,827.00	0.08
405	000528	柳工	5,174	37,821.94	0.08
406	002437	誉衡药业	4,573	37,818.71	0.08
407	601258	庞大集团	13,650	37,810.50	0.08
408	600795	国电电力	11,927	37,808.59	0.08
409	002005	德豪润达	6,574	37,800.50	0.08
410	000009	中国宝安	3,647	37,782.92	0.08
411	000669	金鸿能源	2,203	37,781.45	0.08
412	000166	申万宏源	6,043	37,768.75	0.08
413	601607	上海医药	1,930	37,750.80	0.08
414	600478	科力远	3,775	37,750.00	0.08
415	300124	汇川技术	1,856	37,732.48	0.08
416	000625	长安汽车	2,525	37,723.50	0.08
417	002155	湖南黄金	3,294	37,716.30	0.08
418	002368	太极股份	1,232	37,711.52	0.08
419	002285	世联行	4,962	37,711.20	0.08
420	002268	卫士通	1,200	37,704.00	0.08
421	600100	同方股份	2,722	37,699.70	0.08
422	002024	苏宁云商	3,292	37,693.40	0.08
423	002573	清新环境	2,157	37,682.79	0.08

424	002230	科大讯飞	1,391	37,682.19	0.08
425	000006	深振业 A	3,987	37,677.15	0.08
426	600338	西藏珠峰	1,300	37,674.00	0.08
427	002456	欧菲光	1,099	37,673.72	0.08
428	600489	中金黄金	3,116	37,672.44	0.08
429	000039	中集集团	2,576	37,661.12	0.08
430	000541	佛山照明	3,827	37,657.68	0.08
431	601618	中国中冶	8,081	37,657.46	0.08
432	600720	祁连山	4,609	37,655.53	0.08
433	002390	信邦制药	3,807	37,651.23	0.08
434	000786	北新建材	3,658	37,640.82	0.08
435	002250	联化科技	2,326	37,634.68	0.08
436	002018	华信国际	3,700	37,629.00	0.08
437	002426	胜利精密	4,550	37,628.50	0.08
438	600664	哈药股份	4,385	37,623.30	0.08
439	600008	首创股份	9,154	37,622.94	0.08
440	600917	重庆燃气	2,852	37,617.88	0.08
441	000792	盐湖股份	1,972	37,606.04	0.08
442	600600	青岛啤酒	1,276	37,565.44	0.08
443	600018	上港集团	7,337	37,565.44	0.08
444	002512	达华智能	2,300	37,559.00	0.08
445	600460	士兰微	6,038	37,556.36	0.08
446	300072	三聚环保	811	37,541.19	0.08
447	000596	古井贡酒	825	37,537.50	0.08
448	600611	大众交通	5,713	37,534.41	0.08
449	002366	台海核电	700	37,534.00	0.08
450	600010	包钢股份	13,445	37,511.55	0.08
451	000158	常山股份	3,000	37,500.00	0.08
452	600022	山东钢铁	15,000	37,500.00	0.08
453	600329	中新药业	2,150	37,496.00	0.08
454	600770	综艺股份	3,622	37,487.70	0.08
455	600376	首开股份	3,174	37,484.94	0.08
456	000816	智慧农业	5,892	37,473.12	0.08
457	600061	国投安信	2,400	37,464.00	0.08
458	000848	承德露露	3,347	37,452.93	0.08
459	600138	中青旅	1,786	37,452.42	0.08
460	600120	浙江东方	1,295	37,451.40	0.08
461	601127	小康股份	1,400	37,436.00	0.08
462	601928	凤凰传媒	3,575	37,430.25	0.08

463	600811	东方集团	5,235	37,430.25	0.08
464	000566	海南海药	2,944	37,418.24	0.08
465	600029	南方航空	5,328	37,402.56	0.08
466	000876	新希望	4,644	37,384.20	0.08
467	600094	大名城	4,200	37,380.00	0.08
468	600737	中粮屯河	3,000	37,380.00	0.08
469	600252	中恒集团	8,157	37,359.06	0.08
470	600266	北京城建	2,800	37,324.00	0.08
471	603883	老百姓	800	37,320.00	0.08
472	000712	锦龙股份	1,592	37,316.48	0.08
473	600881	亚泰集团	6,822	37,316.34	0.08
474	600280	中央商场	4,334	37,315.74	0.08
475	000825	太钢不锈	9,470	37,311.80	0.08
476	002491	通鼎互联	2,400	37,296.00	0.08
477	600260	凯乐科技	2,409	37,291.32	0.08
478	603885	吉祥航空	1,600	37,280.00	0.08
479	603568	伟明环保	1,600	37,280.00	0.08
480	002236	大华股份	2,725	37,278.00	0.08
481	600325	华发股份	2,911	37,260.80	0.08
482	600657	信达地产	6,107	37,252.70	0.08
483	600111	北方稀土	3,036	37,251.72	0.08
484	603005	晶方科技	1,240	37,249.60	0.08
485	002714	牧原股份	1,600	37,248.00	0.08
486	601989	中国重工	5,253	37,243.77	0.08
487	000776	广发证券	2,209	37,243.74	0.08
488	601000	唐山港	9,286	37,236.86	0.08
489	601311	骆驼股份	2,280	37,232.40	0.08
490	600397	安源煤业	7,212	37,213.92	0.08
491	002594	比亚迪	749	37,210.32	0.08
492	600118	中国卫星	1,191	37,206.84	0.08
493	000793	华闻传媒	3,295	37,200.55	0.08
494	600089	特变电工	4,074	37,195.62	0.08
495	600392	盛和资源	2,790	37,190.70	0.08
496	600171	上海贝岭	2,647	37,190.35	0.08
497	600967	北方创业	2,740	37,181.80	0.08
498	002699	美盛文化	1,100	37,180.00	0.08
499	600978	宜华生活	3,489	37,157.85	0.08
500	002672	东江环保	2,111	37,153.60	0.08
501	601901	方正证券	4,888	37,148.80	0.08

502	300144	宋城演艺	1,774	37,147.56	0.08
503	600808	马钢股份	13,126	37,146.58	0.08
504	600637	东方明珠	1,594	37,140.20	0.08
505	002477	雏鹰农牧	7,397	37,132.94	0.08
506	600307	酒钢宏兴	13,600	37,128.00	0.08
507	600064	南京高科	2,216	37,118.00	0.08
508	002460	赣锋锂业	1,400	37,114.00	0.08
509	002410	广联达	2,542	37,113.20	0.08
510	600388	龙净环保	3,000	37,110.00	0.08
511	002505	大康农业	10,480	37,099.20	0.08
512	300296	利亚德	1,100	37,092.00	0.08
513	002470	金正大	4,694	37,082.60	0.08
514	002422	科伦药业	2,300	37,076.00	0.08
515	000830	鲁西化工	6,631	37,067.29	0.08
516	000027	深圳能源	5,394	37,056.78	0.08
517	600468	百利电气	2,846	37,054.92	0.08
518	600026	中远海能	5,441	37,053.21	0.08
519	601880	大连港	13,233	37,052.40	0.08
520	300136	信维通信	1,300	37,050.00	0.08
521	000778	新兴铸管	7,165	37,043.05	0.08
522	600251	冠农股份	4,567	37,038.37	0.08
523	600880	博瑞传播	4,228	37,037.28	0.08
524	002174	游族网络	1,400	37,030.00	0.08
525	603698	航天工程	1,342	37,025.78	0.08
526	300032	金龙机电	2,300	37,007.00	0.08
527	002271	东方雨虹	1,706	37,003.14	0.08
528	000156	华数传媒	2,066	37,002.06	0.08
529	300244	迪安诊断	1,156	36,992.00	0.08
530	600352	浙江龙盛	4,014	36,968.94	0.08
531	002736	国信证券	2,377	36,962.35	0.08
532	002261	拓维信息	3,100	36,952.00	0.08
533	600340	华夏幸福	1,546	36,949.40	0.08
534	002371	七星电子	1,389	36,947.40	0.08
535	002701	奥瑞金	4,276	36,944.64	0.08
536	000728	国元证券	1,856	36,934.40	0.08
537	600511	国药股份	1,227	36,932.70	0.08
538	600088	中视传媒	1,684	36,913.28	0.07
539	601886	江河集团	3,466	36,912.90	0.07
540	002299	圣农发展	1,739	36,901.58	0.07

541	300287	飞利信	3,100	36,890.00	0.07
542	600125	铁龙物流	4,565	36,885.20	0.07
543	600256	广汇能源	7,897	36,878.99	0.07
544	000999	华润三九	1,491	36,872.43	0.07
545	600112	天成控股	3,358	36,870.84	0.07
546	600435	北方导航	2,826	36,851.04	0.07
547	000979	中弘股份	13,958	36,849.12	0.07
548	600048	保利地产	4,036	36,848.68	0.07
549	600583	海油工程	4,992	36,840.96	0.07
550	601233	桐昆股份	2,565	36,833.40	0.07
551	601333	广深铁路	7,264	36,828.48	0.07
552	002251	步步高	2,238	36,815.10	0.07
553	600060	海信电器	2,150	36,808.00	0.07
554	600380	健康元	3,706	36,800.58	0.07
555	000089	深圳机场	4,600	36,800.00	0.07
556	001979	招商蛇口	2,245	36,795.55	0.07
557	000969	安泰科技	3,491	36,795.14	0.07
558	600787	中储股份	4,056	36,787.92	0.07
559	600601	方正科技	7,997	36,786.20	0.07
560	601111	中国国航	5,109	36,784.80	0.07
561	600240	华业资本	3,425	36,784.50	0.07
562	002266	浙富控股	6,383	36,766.08	0.07
563	000623	吉林敖东	1,186	36,754.14	0.07
564	600614	鼎立股份	3,140	36,738.00	0.07
565	603369	今世缘	2,800	36,736.00	0.07
566	600804	鹏博士	1,675	36,732.75	0.07
567	000028	国药一致	549	36,728.10	0.07
568	601801	皖新传媒	2,090	36,721.30	0.07
569	603188	亚邦股份	2,056	36,720.16	0.07
570	000627	天茂集团	4,800	36,720.00	0.07
571	600433	冠豪高新	4,578	36,715.56	0.07
572	603077	和邦生物	7,171	36,715.52	0.07
573	601010	文峰股份	6,980	36,714.80	0.07
574	000783	长江证券	3,588	36,705.24	0.07
575	002019	亿帆医药	2,400	36,696.00	0.07
576	601866	中远海发	8,994	36,695.52	0.07
577	600839	四川长虹	8,778	36,692.04	0.07
578	002131	利欧股份	2,300	36,685.00	0.07
579	002007	华兰生物	1,026	36,679.50	0.07

580	002254	泰和新材	2,967	36,672.12	0.07
581	603019	中科曙光	1,318	36,666.76	0.07
582	300146	汤臣倍健	3,070	36,655.80	0.07
583	000543	皖能电力	4,815	36,642.15	0.07
584	600628	新世界	2,593	36,639.09	0.07
585	002195	二三四五	3,236	36,631.52	0.07
586	603993	洛阳钼业	9,847	36,630.84	0.07
587	000878	云南铜业	3,100	36,611.00	0.07
588	000559	万向钱潮	2,760	36,597.60	0.07
589	000810	创维数字	2,600	36,582.00	0.07
590	002544	杰赛科技	1,300	36,582.00	0.07
591	600748	上实发展	4,465	36,568.35	0.07
592	601717	郑煤机	5,200	36,556.00	0.07
593	601872	招商轮船	7,400	36,556.00	0.07
594	002078	太阳纸业	5,472	36,552.96	0.07
595	000062	深圳华强	1,286	36,535.26	0.07
596	600169	太原重工	9,064	36,527.92	0.07
597	000012	南玻 A	3,221	36,526.14	0.07
598	002415	海康威视	1,534	36,524.54	0.07
599	600825	新华传媒	4,203	36,524.07	0.07
600	002190	成飞集成	1,142	36,521.16	0.07
601	002038	双鹭药业	1,367	36,512.57	0.07
602	600705	中航资本	5,964	36,499.68	0.07
603	600754	锦江股份	1,238	36,471.48	0.07
604	000587	金洲慈航	2,451	36,470.88	0.07
605	300039	上海凯宝	3,565	36,469.95	0.07
606	002698	博实股份	2,342	36,464.94	0.07
607	000897	津滨发展	8,519	36,461.32	0.07
608	600757	长江传媒	4,386	36,447.66	0.07
609	600291	西水股份	1,900	36,442.00	0.07
610	002568	百润股份	1,800	36,432.00	0.07
611	000069	华侨城 A	5,242	36,431.90	0.07
612	600863	内蒙华电	11,828	36,430.24	0.07
613	000066	长城电脑	2,928	36,424.32	0.07
614	601899	紫金矿业	10,902	36,412.68	0.07
615	603868	飞科电器	777	36,410.22	0.07
616	000100	TCL 集团	11,033	36,408.90	0.07
617	300168	万达信息	1,800	36,396.00	0.07
618	600166	福田汽车	11,776	36,387.84	0.07

619	600596	新安股份	3,553	36,382.72	0.07
620	000931	中关村	4,295	36,378.65	0.07
621	000762	西藏矿业	2,136	36,376.08	0.07
622	002051	中工国际	1,587	36,374.04	0.07
623	600517	置信电气	3,737	36,361.01	0.07
624	000869	张裕A	1,010	36,360.00	0.07
625	002161	远望谷	3,153	36,354.09	0.07
626	600198	大唐电信	2,290	36,342.30	0.07
627	002385	大北农	5,118	36,337.80	0.07
628	600835	上海机电	1,861	36,326.72	0.07
629	002048	宁波华翔	1,640	36,309.60	0.07
630	000078	海王生物	5,763	36,306.90	0.07
631	000090	天健集团	3,758	36,302.28	0.07
632	002340	格林美	5,542	36,300.10	0.07
633	300015	爱尔眼科	1,214	36,298.60	0.07
634	000758	中色股份	4,542	36,290.58	0.07
635	000723	美锦能源	2,400	36,288.00	0.07
636	000402	金融街	3,521	36,266.30	0.07
637	000061	农产品	2,931	36,256.47	0.07
638	601766	中国中车	3,711	36,256.47	0.07
639	600694	大商股份	908	36,256.44	0.07
640	300122	智飞生物	2,200	36,234.00	0.07
641	601600	中国铝业	8,586	36,232.92	0.07
642	002405	四维图新	1,872	36,223.20	0.07
643	300134	大富科技	1,428	36,214.08	0.07
644	600893	中航动力	1,106	36,210.44	0.07
645	000060	中金岭南	3,247	36,204.05	0.07
646	600570	恒生电子	768	36,203.52	0.07
647	000418	小天鹅A	1,120	36,198.40	0.07
648	600062	华润双鹤	1,628	36,190.44	0.07
649	000988	华工科技	2,312	36,182.80	0.07
650	600176	中国巨石	3,674	36,152.16	0.07
651	600588	用友网络	1,735	36,122.70	0.07
652	600271	航天信息	1,810	36,109.50	0.07
653	601611	中国核电	2,100	36,099.00	0.07
654	300182	捷成股份	3,499	36,074.69	0.07
655	000777	中核科技	1,611	36,054.18	0.07
656	002002	鸿达兴业	4,910	36,039.40	0.07
657	601216	君正集团	7,744	36,009.60	0.07

658	601021	春秋航空	980	36,005.20	0.07
659	600362	江西铜业	2,152	36,002.96	0.07
660	601877	正泰电器	1,800	36,000.00	0.07
661	600522	中天科技	3,418	35,991.54	0.07
662	002424	贵州百灵	1,900	35,986.00	0.07
663	000877	天山股份	5,101	35,962.05	0.07
664	600739	辽宁成大	2,002	35,955.92	0.07
665	601958	金铂股份	4,694	35,909.10	0.07
666	000581	威孚高科	1,600	35,904.00	0.07
667	002249	大洋电机	4,160	35,900.80	0.07
668	000417	合肥百货	4,154	35,849.02	0.07
669	002431	棕榈股份	3,913	35,843.08	0.07
670	002183	怡亚通	3,300	35,838.00	0.07
671	600790	轻纺城	4,976	35,827.20	0.07
672	000839	中信国安	3,900	35,802.00	0.07
673	600826	兰生股份	1,310	35,789.20	0.07
674	002106	莱宝高科	3,184	35,788.16	0.07
675	002673	西部证券	1,721	35,745.17	0.07
676	600606	绿地控股	4,100	35,711.00	0.07
677	600372	中航电子	1,922	35,672.32	0.07
678	600208	新湖中宝	8,572	35,659.52	0.07
679	600516	方大炭素	3,850	35,651.00	0.07
680	600850	华东电脑	1,473	35,617.14	0.07
681	000800	一汽轿车	3,276	35,610.12	0.07
682	300017	网宿科技	664	35,597.04	0.07
683	600348	阳泉煤业	5,286	35,574.78	0.07
684	600999	招商证券	2,178	35,566.74	0.07
685	600487	亨通光电	1,906	35,565.96	0.07
686	000592	平潭发展	5,260	35,557.60	0.07
687	002500	山西证券	2,958	35,555.16	0.07
688	000680	山推股份	6,429	35,552.37	0.07
689	600765	中航重机	2,480	35,538.40	0.07
690	600884	杉杉股份	2,524	35,537.92	0.07
691	000761	本钢板材	6,600	35,508.00	0.07
692	600108	亚盛集团	6,207	35,504.04	0.07
693	002407	多氟多	1,300	35,477.00	0.07
694	300253	卫宁健康	1,810	35,457.90	0.07
695	600201	生物股份	1,122	35,443.98	0.07
696	002092	中泰化学	2,929	35,440.90	0.07

697	002681	奋达科技	2,740	35,428.20	0.07
698	000008	神州高铁	3,800	35,416.00	0.07
699	600058	五矿发展	2,325	35,409.75	0.07
700	000718	苏宁环球	4,100	35,383.00	0.07
701	002416	爱施德	2,400	35,352.00	0.07
702	002439	启明星辰	1,700	35,343.00	0.07
703	002146	荣盛发展	4,500	35,325.00	0.07
704	600536	中国软件	1,468	35,320.08	0.07
705	002353	杰瑞股份	1,739	35,301.70	0.07
706	600582	天地科技	7,100	35,287.00	0.07
707	002466	天齐锂业	1,087	35,273.15	0.07
708	000488	晨鸣纸业	3,404	35,265.44	0.07
709	601155	新城控股	3,000	35,250.00	0.07
710	601001	大同煤业	5,769	35,248.59	0.07
711	000517	荣安地产	6,700	35,242.00	0.07
712	600549	厦门钨业	1,600	35,232.00	0.07
713	300024	机器人	1,645	35,170.10	0.07
714	300315	掌趣科技	3,800	35,112.00	0.07
715	000671	阳光城	6,302	35,102.14	0.07
716	000338	潍柴动力	3,522	35,079.12	0.07
717	600639	浦东金桥	1,889	35,059.84	0.07
718	000031	中粮地产	3,929	35,046.68	0.07
719	600666	奥瑞德	1,300	35,035.00	0.07
720	600699	均胜电子	1,058	35,009.22	0.07
721	601099	太平洋	6,790	34,968.50	0.07
722	600141	兴发集团	2,298	34,952.58	0.07
723	600425	青松建化	7,515	34,944.75	0.07
724	002414	高德红外	1,533	34,921.74	0.07
725	600971	恒源煤电	5,568	34,911.36	0.07
726	002428	云南锗业	2,754	34,893.18	0.07
727	600654	中安消	2,000	34,860.00	0.07
728	601118	海南橡胶	5,007	34,848.72	0.07
729	000806	银河生物	2,200	34,848.00	0.07
730	002030	达安基因	1,502	34,846.40	0.07
731	600153	建发股份	3,255	34,828.50	0.07
732	600503	华丽家族	4,200	34,818.00	0.07
733	600651	飞乐音响	3,305	34,801.65	0.07
734	002022	科华生物	1,740	34,800.00	0.07
735	300324	旋极信息	1,800	34,794.00	0.07

736	002273	水晶光电	1,748	34,785.20	0.07
737	600410	华胜天成	3,199	34,773.13	0.07
738	002588	史丹利	3,062	34,753.70	0.07
739	600970	中材国际	4,901	34,748.09	0.07
740	600300	维维股份	5,194	34,695.92	0.07
741	600187	国中水务	6,435	34,684.65	0.07
742	300001	特锐德	2,000	34,680.00	0.07
743	601919	中远海控	6,615	34,662.60	0.07
744	000738	中航动控	1,400	34,636.00	0.07
745	002354	天神娱乐	500	34,580.00	0.07
746	000681	视觉中国	1,814	34,574.84	0.07
747	600497	驰宏锌锗	4,918	34,573.54	0.07
748	002657	中科金财	800	34,528.00	0.07
749	000938	紫光股份	600	34,434.00	0.07
750	600074	保千里	2,600	34,424.00	0.07
751	600663	陆家嘴	1,555	34,412.15	0.07
752	300033	同花顺	500	34,390.00	0.07
753	002063	远光软件	2,617	34,387.38	0.07
754	002358	森源电气	1,789	34,313.02	0.07
755	300027	华谊兄弟	3,116	34,276.00	0.07
756	600395	盘江股份	4,247	34,273.29	0.07
757	002011	盾安环境	3,600	34,272.00	0.07
758	600485	信威集团	2,347	34,266.20	0.07
759	002122	天马股份	2,698	34,237.62	0.07
760	600499	科达洁能	4,526	34,216.56	0.07
761	002707	众信旅游	2,200	34,210.00	0.07
762	300002	神州泰岳	3,700	34,188.00	0.07
763	000960	锡业股份	2,600	34,112.00	0.07
764	601225	陕西煤业	7,027	34,080.95	0.07
765	002081	金螳螂	3,475	34,020.25	0.07
766	000555	神州信息	1,600	33,968.00	0.07
767	300043	星辉娱乐	3,348	33,948.72	0.07
768	002242	九阳股份	1,882	33,932.46	0.07
769	000002	万科A	1,646	33,825.30	0.07
770	002292	奥飞娱乐	1,490	33,823.00	0.07
771	600259	广晟有色	796	33,822.04	0.07
772	002444	巨星科技	2,167	33,805.20	0.07
773	601699	潞安环能	4,195	33,769.75	0.07
774	000503	海虹控股	801	33,682.05	0.07

775	601016	节能风电	3,800	33,630.00	0.07
776	300104	乐视网	937	33,544.60	0.07
777	600545	新疆城建	2,758	33,537.28	0.07
778	300085	银之杰	1,600	33,440.00	0.07
779	002176	江特电机	2,800	33,404.00	0.07
780	000983	西山煤电	3,934	33,281.64	0.07
781	000413	东旭光电	2,955	33,273.30	0.07
782	000937	冀中能源	4,927	33,207.98	0.07
783	000025	特力A	600	33,162.00	0.07
784	600773	西藏城投	2,777	33,129.61	0.07
785	300251	光线传媒	3,378	32,969.28	0.07
786	002027	分众传媒	2,300	32,821.00	0.07
787	300059	东方财富	1,931	32,691.83	0.07
788	603528	多伦科技	500	32,675.00	0.07
789	600446	金证股份	1,300	32,669.00	0.07
790	300159	新研股份	2,400	32,592.00	0.07
791	002739	万达院线	600	32,442.00	0.07
792	300113	顺网科技	1,200	32,268.00	0.07
793	600645	中源协和	1,192	31,945.60	0.06
794	600751	天海投资	3,800	31,768.00	0.06
795	002194	武汉凡谷	2,421	31,134.06	0.06
796	000426	兴业矿业	3,520	30,694.40	0.06

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

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	000887	中鼎股份	2,548	66,095.12	0.13
2	601005	重庆钢铁	21,367	53,844.84	0.11
3	000693	ST 华泽	4,123	51,537.50	0.10
4	601375	中原证券	6,974	27,896.00	0.06
5	300003	乐普医疗	100	1,793.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述基金投资股票。

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	601318	中国平安	1,280,809.80	2.28
2	600016	民生银行	799,965.00	1.42
3	601166	兴业银行	747,710.00	1.33
4	601398	工商银行	651,891.00	1.16
5	600036	招商银行	649,771.00	1.16
6	000002	万科 A	641,628.00	1.14
7	601328	交通银行	534,868.00	0.95
8	600000	浦发银行	504,734.00	0.90
9	600030	中信证券	483,023.00	0.86
10	600837	海通证券	480,277.00	0.85
11	600519	贵州茅台	476,807.00	0.85
12	601288	农业银行	429,171.00	0.76
13	601169	北京银行	395,031.00	0.70
14	600823	世茂股份	371,512.00	0.66
15	601668	中国建筑	327,920.00	0.58
16	601601	中国太保	324,998.00	0.58
17	600373	中文传媒	323,726.00	0.58
18	601766	中国中车	298,106.00	0.53
19	600335	国机汽车	289,226.00	0.51
20	000333	美的集团	286,027.00	0.51

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	601318	中国平安	1,303,601.00	2.32
2	600016	民生银行	786,081.00	1.40
3	601166	兴业银行	775,216.00	1.38
4	000002	万科 A	690,676.00	1.23
5	600036	招商银行	677,869.17	1.21
6	601398	工商银行	677,647.00	1.21
7	600837	海通证券	579,083.00	1.03
8	600030	中信证券	566,988.79	1.01
9	601328	交通银行	551,124.00	0.98

10	600000	浦发银行	529,120.00	0.94
11	600519	贵州茅台	512,913.00	0.91
12	601288	农业银行	452,181.00	0.80
13	601169	北京银行	432,515.80	0.77
14	601668	中国建筑	380,039.00	0.68
15	601601	中国太保	357,404.00	0.64
16	000333	美的集团	341,920.00	0.61
17	000001	平安银行	317,823.00	0.57
18	601766	中国中车	308,266.00	0.55
19	600900	长江电力	293,899.00	0.52
20	601678	滨化股份	291,919.00	0.52

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	95,927,903.67
卖出股票收入（成交）总额	95,067,023.49

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

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	5,921.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	847.62
5	应收申购款	13,004.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,773.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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**

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	600537	亿晶光电	198,767.36	0.40	重大事项

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

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	66,095.12	0.13	重大事项

2	601005	重庆钢铁	53,844.84	0.11	重大事项
3	000693	ST 华泽	51,537.50	0.10	重大事项
4	601375	中原证券	27,896.00	0.06	新股锁定

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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§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

份额级别	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
中证 800A	133	22,049.74	882,576.00	30.10%	2,050,040.00	69.90%
中证 800B	679	4,319.02	0.00	0.00%	2,932,616.00	100.00%
800 分级	1,734	25,210.29	22,170,123.93	50.72%	21,544,525.19	49.28%
合计	2,546	19,473.64	23,052,699.93	46.50%	26,527,181.19	53.50%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

中证 800A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	太平资管—建设银行—太平资产乾坤 10 号资管产品	922,700.00	31.45%
2	李怡名	564,841.00	19.25%
3	王平	253,700.00	8.65%
4	郑志坤	240,744.00	8.20%
5	陶玲	120,555.00	4.11%
6	梁小红	103,788.00	3.54%
7	上海明法投资管理有限公司—明法 CTA 一号基金	100,000.00	3.41%
8	李小平	85,835.00	2.93%
9	张维琴	78,700.00	2.68%

10	胡葛芳	71,718.00	2.44%
----	-----	-----------	-------

中证 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	田蕴	161,100.00	5.49%
2	杨成英	144,600.00	4.93%
3	赵红军	106,555.00	3.63%
4	李明华	102,017.00	3.48%
5	王玉印	94,940.00	3.24%
6	满学瑞	78,087.00	2.66%
7	罗志军	71,958.00	2.45%
8	屈晓东	67,700.00	2.31%
9	顾耀国	62,000.00	2.11%
10	查刚	60,500.00	2.06%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中证 800A	0.00	0.00%
	中证 800B	0.00	0.00%
	800 分级	228,834.86	0.52%
	合计	228,834.86	0.46%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

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的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日（2013 年 11 月 5 日）基金份额总额	-	-	458,328,703.92
本报告期期初基金份额总额	2,454,261.00	2,454,261.00	42,357,391.79

本报告期基金总申购份额	-	-	44,615,052.99
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	43,459,082.81
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	478,355.00	478,355.00	201,287.15
本报告期期末基金份额总额	2,932,616.00	2,932,616.00	43,714,649.12

注:拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中的调整份额。

§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,无基金份额持有人大会决议。

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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2016 年 9 月 3 日发布公告,经银华基金管理有限公司 2016 年第 1 次临时股东大会审议通过,选举李福春先生、常忠先生担任银华基金管理有限公司第六届董事会董事。经银华基金管理有限公司董事会、股东会审议通过,深圳市市场监督管理局核准,银华基金管理有限公司变更为“银华基金管理股份有限公司”。经银华基金管理股份有限公司创立大会暨 2016 年第一次股东大会审议通过,选举王珠林先生、钱龙海先生、李福春先生、吴坚先生、郑秉文先生、刘星先生、邢冬梅女士、封和平先生、王立新先生为本公司第一届董事会董事。其中,吴坚先生为新任董事,邢冬梅女士、封和平先生为新任独立董事。常忠先生不再继续担任本公司董事。

11.2.2 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

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,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

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。该审计机构已为本基金连续提供了 3 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

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
方正证券股份有限公司	4	190,877,477.57	100.00%	174,897.40	100.00%	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券股份 有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个交 易单元
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，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、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后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 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
方正证券股份 有限公司	-	-	2,700,000.00	100.00%	-	-
财达证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

第一创业证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国开证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

首创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易及权证交易。

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	《银华基金管理有限公司 2015 年 12 月 31 日基金净值 公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	《银华基金管理有限公司关 于因 2016 年 1 月 4 日发生指 数熔断调整旗下基金申购、 赎回等业务办理时间的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	《银华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》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
4	《银华基金管理有限公司关 于旗下部分基金持有的东华 软件、万科 A、苏宁环球估 值方法调整的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
5	《银华基金管理有限公司关	三大证券报及本基	2016 年 1 月 7 日

	于旗下部分基金持有的德尔未来、文化长城、格林美、万里扬、宏图高科估值方法调整的公告》	金管理人网站	
6	《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 7 日发生指数熔断调整旗下基金申购、赎回等业务办理时间的公告》	本基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
7	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的海格通信、鼎龙股份、创意信息估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 8 日
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日
9	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的千方科技、初灵信息、万方发展估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
10	《关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
11	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 22 日
12	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的宝通科技、凯撒旅游、航天科技、梅花生物估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 28 日
13	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的建发股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
14	《银华基金管理有限公司关于旗下非货币基金参加通联支付网络服务股份有限公司使用中国银行借记卡认、申购费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
15	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的温氏股份、青岛海尔、乐普医疗	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 30 日

	估值方法调整的公告》		
16	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的视觉中国、胜利精密估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 4 日
17	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的浦发银行估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 19 日
18	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在平安证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 26 日
19	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的格力电器估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 27 日
20	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中源协和、天银机电估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 2 日
21	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的西部矿业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 9 日
22	《银华基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 11 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳新兰德证券投资咨询有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 15 日
24	《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 24 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的四维图新估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 25 日
26	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2015 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 25 日
27	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2015 年年度报告》	本基金管理人网站	2016 年 3 月 25 日

28	《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销定期定额申购业务费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 1 日
29	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的大同煤业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 15 日
30	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的杰瑞股份、光线传媒、富春通信估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
31	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在上海证券开通定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 19 日
32	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
33	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的银之杰估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
34	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的泸州老窖估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 5 日
35	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的启明星辰估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 14 日
36	《银华基金管理有限公司关于淘宝店业务及网上直销支付宝渠道下线的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 18 日
37	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在大同证券开通定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 19 日
38	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 16 日
39	《关于开通通联支付渠道网上直销定期定额申购业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
40	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日

	》		
41	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
42	《银华基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 21 日
43	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的驰宏锌锗估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 7 日
44	《银华基金管理有限公司关于网上直销系统开展通联支付招商银行卡费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 11 日
45	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的唐人神、宝钢股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 14 日
46	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在中山证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 14 日
47	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中环股份估值方法变更的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 18 日
48	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 19 日
49	《银华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金每笔赎回申请的最低份额、转换转出最低份额及赎回后的最低保有份额的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 21 日
50	《银华基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 26 日
51	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 8 月 24 日

	2016 年半年度报告摘要》		
52	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2016 年半年度报告》	本基金管理人网站	2016 年 8 月 24 日
53	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
54	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 26 日
55	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2016 年第 3 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 26 日
56	《关于增加民生证券为旗下部分基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 22 日
57	《关于银华中证 800 指数增强分级证券投资基金折算公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 25 日
58	《关于银华中证 800 指数增强分级基金办理定期折算期间暂停及恢复申赎的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 25 日
59	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 29 日
60	《关于中证 800A 份额定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 5 日
61	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 5 日
62	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的徐工机械、长城信息、佳讯飞鸿估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 14 日
63	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 2 号）》	本基金管理人网站	2016 年 12 月 20 日

64	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 2 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 20 日
65	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 22 日
66	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 22 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

- 13.1.1 中国证监会核准银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的住所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司
2017 年 3 月 31 日