

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 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.....	52
7.8 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.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	53
8 基金份额持有人信息	54

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末上市基金前十名持有人	54
8.3	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	55
9	开放式基金份额变动	55
10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	56
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	58
11	影响投资者决策的其他重要信息	58
12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 500ETF
场内简称	广发 500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	995,038,319.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 5 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金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 95%。
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，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证 500 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		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-13,690,838.21
本期利润	-14,115,790.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0162
本期加权平均净值利润率	-0.94%
本期基金份额净值增长率	-1.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	699,498,900.95
期末可供分配基金份额利润	0.7030
期末基金资产净值	1,694,537,219.95
期末基金份额净值	1.7030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	70.29%

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

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

关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 期末可供分配利润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（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.38%	0.91%	5.39%	0.93%	-0.01%	-0.02%
过去三个月	-3.56%	0.99%	-4.12%	1.02%	0.56%	-0.03%
过去六个月	-1.32%	0.87%	-2.00%	0.90%	0.68%	-0.03%
过去一年	1.31%	0.89%	0.24%	0.91%	1.07%	-0.02%
过去三年	54.01%	2.01%	56.39%	2.06%	-2.38%	-0.05%
自基金合同生效起至今	70.29%	1.85%	78.58%	1.89%	-8.29%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为中证 500 指数。

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

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2013 年 4 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日)



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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 26 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百四十四只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发

起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新

机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF)、广发景祥纯债债券型证券投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
刘杰	本基金的基金经理；广发量化稳健基金的基金经理；广	2014-04-01	-	13 年	男，中国籍，工学学士，持有中国证券基金业从业证书，2004 年 7 月至 2010 年 11 月在广发基金管理有限公司信息技术部工作，

	<p>发沪深 300ETF 联接基金的基金经理；广发中证 500ETF 联接 (LOF) 基金的基金经理；广发沪深 300ETF 基金的基金经理；广发环保指数基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板 300ETF 基金的基金经理；广发中小板 300 联接基金的基金经理；广发军工 ETF 基金的基金经理；广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理；广发中证环保 ETF 基金的基金经理；广发创业板 ETF 基金的基金经理；广发创业板 ETF 联接基金的基金经理；数量投资部总经理助理</p>				<p>2010 年 11 月至 2014 年 3 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员, 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日任广发沪深 300 指数基金的基金经理, 2014 年 4 月 1 日起任广发中证 500ETF 以及广发中证 500ETF 联接 (LOF) 基金的基金经理, 2015 年 8 月 20 日起任广发沪深 300ETF 基金的基金经理, 2016 年 1 月 18 日起任广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理, 2016 年 1 月 25 日起任广发中小板 300ETF 及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理, 2016 年 1 月 28 日起任数量投资部总经理助理, 2016 年 8 月 30 日起任广发中证军工 ETF 基金的基金经理, 2016 年 9 月 26 日起任广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理, 2017 年 1 月 25 日起任广发中证环保 ETF 基金的基金经理, 2017 年 4 月 25 日起任广发创业板 ETF 基金的基金经理, 2017 年 5 月 25 日起任广发创业板 ETF 联接基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	--

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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》及其配套法规、《广发中证 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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关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 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

(1) 投资策略

作为 ETF 基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

(2) 运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，符合要求。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素，作为 ETF 基金，申赎影响相对较小且本基金成立以来规模稳步增长，目前的规模水平下，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为-1.32%，同期业绩比较基准收益率为-2.00%，较好地跟踪了指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在金融去杠杆、减持新政和加强监管等影响下，上半年市场呈现了明显“一九行情”，白酒、家电和金融等白马股表现最好。

展望下半年，随着 A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，未来 A 股市场或将进一步助推境外机构的价值投资理念。随着经济稳定且逐步好转，未来政策或转向监管和流动性之间的协调平衡，权益类资产的配置机会仍然值得关注。

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动高收益指数，中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势，而在短期表现，往往被誉为“反弹急先锋”，我们认为，对于未来的市场行情，投资者若进行中短期的反弹波段操作，可关注中证 500 指数基金。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上

所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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，本基金托管人在对广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	37,829,769.33	12,572,943.46
结算备付金		17,803,016.60	16,760,691.71
存出保证金		102,618.56	112,091.77
交易性金融资产	6.4.7.2	1,659,699,843.53	1,340,412,666.41
其中：股票投资		1,659,555,204.53	1,340,412,666.41
基金投资		-	-
债券投资		144,639.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,708,093.89
应收利息	6.4.7.5	11,275.89	5,366.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,715,446,523.91	1,371,571,853.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		18,355,853.83	3,410,181.48
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		627,073.53	661,795.05
应付托管费		125,414.71	132,359.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	933,730.96	1,386,102.21

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	867,230.93	851,950.94
负债合计		20,909,303.96	6,442,388.70
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	995,038,319.00	791,038,319.00
未分配利润	6.4.7.1 0	699,498,900.95	574,091,146.08
所有者权益合计		1,694,537,219.95	1,365,129,465.08
负债和所有者权益总计		1,715,446,523.91	1,371,571,853.78

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.7030 元，基金份额总额 995,038,319.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-8,281,159.96	-301,401,545.34
1. 利息收入		177,457.70	135,156.44
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	177,369.82	134,550.30
债券利息收入		87.88	606.14
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）		-8,698,248.48	-207,491,820.08
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-17,698,655.45	-216,418,009.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	214,025.15
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	688,920.00	-88,240.00

股利收益	6.4.7.1 5	8,311,486.97	8,800,404.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-424,952.14	-96,890,903.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	664,582.96	2,846,022.29
减：二、费用		5,834,630.39	7,551,788.27
1. 管理人报酬		3,695,487.73	3,683,488.25
2. 托管费		739,097.58	736,697.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	959,683.95	2,690,885.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	440,361.13	440,717.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,115,790.35	-308,953,333.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,115,790.35	-308,953,333.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	791,038,319.00	574,091,146.08	1,365,129,465.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,115,790.35	-14,115,790.35
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）	204,000,000.00	139,523,545.22	343,523,545.22
其中：1. 基金申购款	416,000,000.00	290,334,905.13	706,334,905.13
2. 基金赎回款	-212,000,000.00	-150,811,359.91	-362,811,359.91
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）	995,038,319.00	699,498,900.95	1,694,537,219.95
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	801,038,319.00	859,347,578.48	1,660,385,897.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-308,953,333.61	-308,953,333.61
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）	202,000,000.00	132,547,897.46	334,547,897.46
其中：1. 基金申购款	968,000,000.00	615,761,498.69	1,583,761,498.69
2. 基金赎回款	-766,000,000.00	-483,213,601.23	-1,249,213,601.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,003,038,319.00	682,942,142.33	1,685,980,461.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]165 号《关于核准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 4 月 11 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，并于 2013 年 4 月 11 日获确认。

本基金募集期为 2013 年 3 月 18 日至 2013 年 3 月 29 日，本基金为交易型开放式，存续期限不

定，募集期间净认购金额为人民币 425,036,920.00 元，有效认购户数为 3,122 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,399.00 元，折合基金份额 1,399.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。基金合同于 2013 年 4 月 11 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 425,038,319.00 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：标的指数成份股、备选成份股。可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券、权证、股指期货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。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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	37,829,769.33

定期存款	-
其他存款	-
合计	37,829,769.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,701,802,547.29	1,659,555,204.53	-42,247,342.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	135,000.00	144,639.00
	银行间市场	-	-
	合计	135,000.00	144,639.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,701,937,547.29	1,659,699,843.53	-42,237,703.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	7,807.73
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	41.58
应收结算备付金利息	3,338.70
应收债券利息	87.88
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	-
合计	11,275.89

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	933,730.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	933,730.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	218,191.88
应付替代款	526,780.58
可退替代款	9,661.70
应付指数使用费	112,596.77
合计	867,230.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	791,038,319.00	791,038,319.00
本期申购	416,000,000.00	416,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-212,000,000.00	-212,000,000.00
本期末	995,038,319.00	995,038,319.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,029,340,565.19	-455,249,419.11	574,091,146.08
本期利润	-13,690,838.21	-424,952.14	-14,115,790.35
本期基金份额交易产生的变动数	263,249,809.10	-123,726,263.88	139,523,545.22
其中：基金申购款	538,770,833.15	-248,435,928.02	290,334,905.13
基金赎回款	-275,521,024.05	124,709,664.14	-150,811,359.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,278,899,536.08	-579,400,635.13	699,498,900.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	112,179.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	942.07
结算备付金利息收入	64,248.01
其他	-
合计	177,369.82

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,321,248.65
股票投资收益——赎回差价收入	-5,377,406.80
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-17,698,655.45

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	346,625,268.10
减：卖出股票成本总额	358,946,516.75
买卖股票差价收入	-12,321,248.65

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	362,811,359.91
减：现金支付赎回款总额	204,649,341.91
减：赎回股票成本总额	163,539,424.80
赎回差价收入	-5,377,406.80

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	688,920.00

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,311,486.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,311,486.97

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-424,952.14
——股票投资	-434,591.14
——债券投资	9,639.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-424,952.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
手续费返还	-
基金转换费收入	-
印花税返还	-
替代损益	664,582.96
其他	-
合计	664,582.96

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代股票的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）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（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	958,823.00
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	860.95
合计	959,683.95

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	440.00
上市费	29,752.78
指数使用费	221,729.25
合计	440,361.13

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人母公司的全资子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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
广发证券股份有限公司	154,747,313.61	17.84%	555,182,945.02	30.10%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	1,519,458.10	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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
广发证券股份有限公司	144,117.78	26.63%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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
广发证券股份有限公司	517,045.69	30.38%	122,502.10	7.01%

注：1. 股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)；

2. 本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3. 本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,695,487.73	3,683,488.25
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	739,097.58	736,697.57

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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

		例		
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	955,346,870.00	96.01%	760,841,142.00	96.18%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	37,829,769.33	112,179.74	12,653,202.81	82,624.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-

				受限						
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股流通受限	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股流通受限	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600468	百利电气	2017-05-16	重大事项停牌	6.50	-	-	117,851.00	1,115,336.08	766,031.50	-
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	109,768.00	2,234,069.65	1,372,100.00	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大事项停牌	5.76	2017-08-10	6.19	289,010.00	1,753,378.69	1,664,697.60	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大事项停牌	6.07	2017-08-15	6.68	287,704.00	1,922,447.11	1,746,363.28	-
601001	大同煤业	2017-06-22	重大事项停牌	5.25	2017-07-21	5.78	333,223.00	2,126,082.07	1,749,420.75	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大事项停牌	11.26	-	-	159,847.00	2,126,958.44	1,799,877.22	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项停牌	10.94	2017-08-18	12.03	166,668.00	2,417,068.73	1,823,347.92	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项停牌	12.59	2017-07-03	12.70	146,190.00	2,233,930.40	1,840,532.10	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项停牌	8.70	2017-08-14	9.57	240,024.00	2,048,739.95	2,088,208.80	-
002500	大康农	2017-0	重大事	3.50	-	-	615,418.00	2,251,726.77	2,153,963.	-

5	业	3-13	项停牌				0	2	00	
000061	农产品	2017-06-28	重大事项停牌	9.06	-	-	250,018.00	2,263,038.94	2,265,163.08	-
002122	天马股份	2017-04-24	重大事项停牌	10.30	2017-07-24	11.15	227,473.00	1,950,651.28	2,342,971.90	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项停牌	25.06	2017-07-07	22.54	94,950.00	2,489,738.10	2,379,447.00	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项停牌	17.02	2017-07-12	16.68	140,436.00	2,503,947.24	2,390,220.72	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大事项停牌	20.02	-	-	124,676.00	3,172,188.96	2,496,013.52	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项停牌	20.23	-	-	124,247.00	2,270,309.08	2,513,516.81	-
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大事项停牌	7.83	-	-	323,700.00	2,114,276.53	2,534,571.00	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项停牌	24.95	2017-07-04	22.46	102,049.00	2,439,704.17	2,546,122.55	-
600545	新疆城建	2017-06-22	重大事项停牌	11.96	2017-07-03	12.44	217,131.00	2,333,116.28	2,596,886.76	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大事项停牌	7.79	-	-	367,371.00	2,583,048.02	2,861,820.09	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大事项停牌	23.36	-	-	129,818.00	3,522,976.85	3,032,548.48	-
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项停牌	12.08	2017-07-06	12.61	284,900.00	3,569,372.27	3,441,592.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项停牌	10.33	2017-08-02	11.36	358,662.00	3,772,905.93	3,704,978.46	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项停牌	11.32	-	-	350,062.00	4,532,874.55	3,962,701.84	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项停牌	16.99	-	-	276,746.00	3,702,250.52	4,701,914.54	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大事项停牌	15.75	2017-08-09	14.50	316,800.00	4,011,599.99	4,989,600.00	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大事项停牌	7.29	-	-	760,285.00	5,458,729.94	5,542,477.65	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项停牌	14.98	2017-08-02	16.48	518,405.00	6,367,425.77	7,765,706.90	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大事项停牌	6.54	2017-07-05	5.92	1,340,427.00	6,624,978.89	8,766,392.58	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止, 本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止, 本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念, 在董事会下设立合规及风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 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监察稽核部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息, 或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降, 将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险, 本基金主要投资于信用等级较高的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。但是, 随着短期资金市场的发展, 本基金的投资范围扩大以后, 可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司, 违约风险较小; 银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	144,639.00	-
未评级	-	-
合计	144,639.00	-

注: 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券和同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	37,829,769.33	-	-	-	37,829,769.33
结算备付金	17,803,016.60	-	-	-	17,803,016.60
存出保证金	102,618.56	-	-	-	102,618.56
交易性金融资产	144,639.00	-	-	1,659,555,204.53	1,659,699,843.53
应收利息	-	-	-	11,275.89	11,275.89
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	55,880,043.49	-	-	1,659,566,480.42	1,715,446,523.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,355,853.83	18,355,853.83
应付管理人报酬	-	-	-	627,073.53	627,073.53

应付托管费	-	-	-	125,414.71	125,414.71
应付交易费用	-	-	-	933,730.96	933,730.96
其他负债	-	-	-	867,230.93	867,230.93
负债总计	-	-	-	20,909,303.96	20,909,303.96
利率敏感度缺口	55,880,043.49	-	-	1,638,657,176.46	1,694,537,219.95
上年度末					
2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,572,943.46	-	-	-	12,572,943.46
结算备付金	16,760,691.71	-	-	-	16,760,691.71
存出保证金	112,091.77	-	-	-	112,091.77
交易性金融资产	-	-	-	1,340,412,666.41	1,340,412,666.41
应收证券清算款	-	-	-	1,708,093.89	1,708,093.89
应收利息	-	-	-	5,366.54	5,366.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	29,445,726.94	-	-	1,342,126,126.84	1,371,571,853.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,410,181.48	3,410,181.48
应付管理人报酬	-	-	-	661,795.05	661,795.05
应付托管费	-	-	-	132,359.02	132,359.02
应付交易费用	-	-	-	1,386,102.21	1,386,102.21
其他负债	-	-	-	851,950.94	851,950.94
负债总计	-	-	-	6,442,388.70	6,442,388.70
利率敏感度缺口	29,445,726.94	-	-	1,335,683,738.14	1,365,129,465.08

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	17,356.68	-
市场利率下降 25 个基点	-17,356.68	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	1,659,555,204.5 3	97.94	1,340,412,666.4 1	98.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	144,639.00	0.01	-	-
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	1,659,699,843.5 3	97.94	1,340,412,666.4 1	98.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
业绩比较基准上升 5%	96,085,673.36	66,905,888.65
业绩比较基准下降 5%	-96,085,673.36	-66,905,888.65

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,571,736,972.38 元，第二层级的余额为 87,839,188.05 元，属于第三层级的余额为 123,683.10 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票（2016 年 12 月 31 日：第一层级 1,222,331,871.67 元，第二层级 117,591,094.95 元，第三层级 489,699.79 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,659,555,204.53	96.74

	其中：股票	1,659,555,204.53	96.74
2	固定收益投资	144,639.00	0.01
	其中：债券	144,639.00	0.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	55,632,785.93	3.24
7	其他各项资产	113,894.45	0.01
8	合计	1,715,446,523.91	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	20,669,032.69	1.22
B	采矿业	48,566,274.70	2.87
C	制造业	1,035,301,697.25	61.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,216,590.78	3.32
E	建筑业	37,875,706.01	2.24
F	批发和零售业	89,276,339.87	5.27
G	交通运输、仓储和邮政业	49,475,411.91	2.92
H	住宿和餐饮业	1,684,590.20	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,497,246.09	6.64
J	金融业	23,513,237.75	1.39
K	房地产业	102,256,999.01	6.03
L	租赁和商务服务业	30,431,142.85	1.80
M	科学研究和技术服务业	4,099,365.33	0.24

N	水利、环境和公共设施管理业	14,381,962.76	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,890,777.00	0.11
Q	卫生和社会工作	4,337,075.60	0.26
R	文化、体育和娱乐业	19,052,864.33	1.12
S	综合	8,028,890.40	0.47
	合计	1,659,555,204.53	97.94

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300136	信维通信	323,066	12,929,101.32	0.76
2	600487	亨通光电	361,621	10,143,469.05	0.60
3	002460	赣锋锂业	218,200	10,091,750.00	0.60
4	002572	索菲亚	232,800	9,544,800.00	0.56
5	600201	生物股份	255,317	9,081,625.69	0.54
6	000656	金科股份	1,340,427	8,766,392.58	0.52
7	601012	隆基股份	497,611	8,509,148.10	0.50
8	002271	东方雨虹	223,524	8,292,740.40	0.49
9	300156	神雾环保	250,276	8,199,041.76	0.48
10	600176	中国巨石	715,108	7,851,885.84	0.46
11	600219	南山铝业	2,303,172	7,807,753.08	0.46
12	600643	爱建集团	518,405	7,765,706.90	0.46
13	600079	人福医药	377,715	7,410,768.30	0.44
14	600525	长园集团	544,916	7,405,408.44	0.44
15	002405	四维图新	372,747	7,365,480.72	0.43
16	000661	长春高新	56,476	7,291,616.36	0.43
17	600315	上海家化	223,400	7,249,330.00	0.43
18	603799	华友钴业	117,000	7,111,260.00	0.42
19	000050	深天马 A	342,900	7,053,453.00	0.42
20	600584	长电科技	430,374	6,907,502.70	0.41
21	000998	隆平高科	310,008	6,826,376.16	0.40

22	002092	中泰化学	533,141	6,770,890.70	0.40
23	002340	格林美	1,117,340	6,759,907.00	0.40
24	000066	中国长城	747,060	6,731,010.60	0.40
25	300115	长盈精密	224,681	6,556,191.58	0.39
26	600642	申能股份	1,028,535	6,479,770.50	0.38
27	300266	兴源环境	208,618	6,408,744.96	0.38
28	300296	利亚德	336,678	6,329,546.40	0.37
29	000997	新大陆	276,298	6,269,201.62	0.37
30	600516	方大炭素	432,000	6,143,040.00	0.36
31	601168	西部矿业	788,900	6,066,641.00	0.36
32	600879	航天电子	682,340	5,997,768.60	0.35
33	000786	北新建材	374,386	5,930,274.24	0.35
34	002422	科伦药业	356,455	5,888,636.60	0.35
35	600056	中国医药	225,276	5,845,912.20	0.34
36	600291	西水股份	265,120	5,832,640.00	0.34
37	002050	三花智控	355,202	5,796,896.64	0.34
38	600325	华发股份	693,182	5,788,069.70	0.34
39	600266	北京城建	392,811	5,711,471.94	0.34
40	600426	华鲁恒升	475,538	5,582,816.12	0.33
41	600673	东阳光科	760,285	5,542,477.65	0.33
42	600166	福田汽车	1,951,000	5,540,840.00	0.33
43	600388	龙净环保	356,089	5,530,062.17	0.33
44	600521	华海药业	260,316	5,477,048.64	0.32
45	600161	天坛生物	140,644	5,458,393.64	0.32
46	000581	威孚高科	208,761	5,406,909.90	0.32
47	002407	多氟多	245,300	5,394,147.00	0.32
48	600022	山东钢铁	2,598,946	5,353,828.76	0.32
49	000039	中集集团	295,800	5,333,274.00	0.31
50	002410	广联达	281,900	5,299,720.00	0.31
51	600435	北方导航	368,984	5,280,161.04	0.31
52	000970	中科三环	355,000	5,246,900.00	0.31
53	600528	中铁工业	366,889	5,242,843.81	0.31
54	000778	新兴铸管	779,650	5,223,655.00	0.31
55	000999	华润三九	161,358	5,123,116.50	0.30
56	002179	中航光电	164,252	5,123,019.88	0.30
57	002217	合力泰	518,300	5,120,804.00	0.30
58	600138	中青旅	242,310	5,103,048.60	0.30
59	600699	均胜电子	157,999	5,070,187.91	0.30
60	002038	双鹭药业	173,908	5,069,418.20	0.30
61	600839	四川长虹	1,397,662	5,059,536.44	0.30
62	002366	台海核电	107,409	5,038,556.19	0.30
63	002573	清新环境	265,848	5,003,259.36	0.30
64	600600	青岛啤酒	142,520	5,002,452.00	0.30
65	300088	长信科技	316,800	4,989,600.00	0.29

66	600978	宜华生活	495,299	4,977,754.95	0.29
67	600260	凯乐科技	195,189	4,946,089.26	0.29
68	002223	鱼跃医疗	208,581	4,939,198.08	0.29
69	000028	国药一致	61,023	4,936,760.70	0.29
70	601000	唐山港	941,367	4,913,935.74	0.29
71	000488	晨鸣纸业	378,314	4,880,250.60	0.29
72	603589	口子窖	124,700	4,837,113.00	0.29
73	600614	鹏起科技	438,822	4,827,042.00	0.28
74	002311	海大集团	263,171	4,808,134.17	0.28
75	600158	中体产业	280,183	4,791,129.30	0.28
76	002168	深圳惠程	276,746	4,701,914.54	0.28
77	300113	顺网科技	174,000	4,680,600.00	0.28
78	002004	华邦健康	597,100	4,675,293.00	0.28
79	000878	云南铜业	352,500	4,649,475.00	0.27
80	300055	万邦达	252,400	4,644,160.00	0.27
81	600503	华丽家族	671,100	4,637,301.00	0.27
82	600511	国药股份	127,734	4,629,080.16	0.27
83	002078	太阳纸业	627,444	4,611,713.40	0.27
84	002273	水晶光电	222,914	4,598,715.82	0.27
85	002030	达安基因	211,047	4,598,714.13	0.27
86	300383	光环新网	336,800	4,567,008.00	0.27
87	000400	许继电气	252,137	4,528,380.52	0.27
88	002019	亿帆医药	271,400	4,526,952.00	0.27
89	600298	安琪酵母	174,358	4,510,641.46	0.27
90	300002	神州泰岳	535,996	4,470,206.64	0.26
91	002001	新和成	229,564	4,455,837.24	0.26
92	000566	海南海药	335,766	4,452,257.16	0.26
93	603019	中科曙光	158,200	4,451,748.00	0.26
94	600755	厦门国贸	487,251	4,443,729.12	0.26
95	600635	大众公用	813,796	4,435,188.20	0.26
96	002384	东山精密	178,591	4,411,197.70	0.26
97	600808	马钢股份	1,246,067	4,411,077.18	0.26
98	002583	海能达	273,707	4,403,945.63	0.26
99	002244	滨江集团	632,536	4,377,149.12	0.26
100	600392	盛和资源	331,502	4,372,511.38	0.26
101	600717	天津港	349,400	4,364,006.00	0.26
102	000547	航天发展	417,089	4,358,580.05	0.26
103	000418	小天鹅A	92,810	4,342,579.90	0.26
104	300324	旋极信息	237,824	4,337,909.76	0.26
105	300244	迪安诊断	137,860	4,337,075.60	0.26
106	000930	中粮生化	402,053	4,334,131.34	0.26
107	000401	冀东水泥	280,100	4,310,739.00	0.25
108	600872	中炬高新	234,121	4,284,414.30	0.25
109	600122	宏图高科	385,861	4,283,057.10	0.25

110	600240	华业资本	471,297	4,269,950.82	0.25
111	601231	环旭电子	270,808	4,254,393.68	0.25
112	600160	巨化股份	352,196	4,236,917.88	0.25
113	002439	启明星辰	226,675	4,216,155.00	0.25
114	002176	江特电机	482,560	4,207,923.20	0.25
115	000598	兴蓉环境	746,000	4,192,520.00	0.25
116	600633	浙数文化	216,400	4,180,848.00	0.25
117	002491	通鼎互联	310,900	4,178,496.00	0.25
118	600418	江淮汽车	395,360	4,171,048.00	0.25
119	600500	XD 中化国	435,800	4,166,248.00	0.25
120	600409	三友化工	413,249	4,161,417.43	0.25
121	600062	华润双鹤	150,996	4,141,820.28	0.24
122	000960	锡业股份	303,800	4,134,718.00	0.24
123	600143	金发科技	681,700	4,110,651.00	0.24
124	002408	齐翔腾达	369,737	4,096,685.96	0.24
125	000825	太钢不锈	939,400	4,086,390.00	0.24
126	002400	省广股份	508,285	4,081,528.55	0.24
127	300159	新研股份	307,405	4,070,042.20	0.24
128	600594	益佰制药	263,506	4,021,101.56	0.24
129	000078	海王生物	666,085	4,016,492.55	0.24
130	000685	中山公用	365,612	4,003,451.40	0.24
131	000089	深圳机场	424,400	3,968,140.00	0.23
132	600655	豫园商城	350,062	3,962,701.84	0.23
133	000513	丽珠集团	58,092	3,956,065.20	0.23
134	000979	中弘股份	1,508,869	3,953,236.78	0.23
135	300146	汤臣倍健	287,654	3,952,365.96	0.23
136	300058	蓝色光标	503,678	3,938,761.96	0.23
137	600312	平高电气	285,520	3,923,044.80	0.23
138	002354	天神娱乐	182,420	3,922,030.00	0.23
139	002601	龙鳞佰利	238,600	3,908,268.00	0.23
140	601699	潞安环能	499,200	3,903,744.00	0.23
141	600811	东方集团	598,624	3,903,028.48	0.23
142	600881	亚泰集团	766,000	3,891,280.00	0.23
143	600884	杉杉股份	235,544	3,879,409.68	0.23
144	002051	中工国际	186,949	3,875,452.77	0.23
145	600967	内蒙一机	283,558	3,864,895.54	0.23
146	000697	炼石有色	187,952	3,847,377.44	0.23
147	600970	中材国际	440,055	3,824,077.95	0.23
148	601880	大连港	1,291,856	3,823,893.76	0.23
149	600026	中远海能	573,266	3,800,753.58	0.22
150	000926	福星股份	310,746	3,791,101.20	0.22
151	300122	智飞生物	198,300	3,789,513.00	0.22
152	002431	棕榈股份	343,848	3,789,204.96	0.22
153	000988	华工科技	259,625	3,787,928.75	0.22

154	002701	奥瑞金	590,437	3,772,892.43	0.22
155	600499	科达洁能	473,600	3,760,384.00	0.22
156	600809	山西汾酒	108,000	3,746,520.00	0.22
157	000690	宝新能源	625,469	3,740,304.62	0.22
158	002048	宁波华翔	178,959	3,733,084.74	0.22
159	600183	生益科技	302,338	3,730,850.92	0.22
160	002373	千方科技	273,506	3,730,621.84	0.22
161	600120	浙江东方	138,109	3,712,369.92	0.22
162	600664	哈药股份	638,701	3,710,852.81	0.22
163	002013	中航机电	358,662	3,704,978.46	0.22
164	000806	银河生物	273,800	3,696,300.00	0.22
165	002221	东华能源	338,750	3,695,762.50	0.22
166	000729	燕京啤酒	548,066	3,683,003.52	0.22
167	002390	信邦制药	421,675	3,672,789.25	0.22
168	000600	建投能源	299,068	3,669,564.36	0.22
169	600094	大名城	478,206	3,667,840.02	0.22
170	600307	酒钢宏兴	1,285,876	3,664,746.60	0.22
171	600572	康恩贝	529,253	3,662,430.76	0.22
172	002640	跨境通	172,112	3,657,380.00	0.22
173	300253	卫宁健康	466,913	3,646,590.53	0.22
174	002512	达华智能	225,100	3,635,365.00	0.21
175	600787	中储股份	458,077	3,623,389.07	0.21
176	300026	红日药业	766,743	3,611,359.53	0.21
177	002191	劲嘉股份	384,548	3,599,369.28	0.21
178	000012	南玻A	384,820	3,590,370.60	0.21
179	600874	创业环保	183,416	3,589,451.12	0.21
180	600566	济川药业	94,300	3,586,229.00	0.21
181	002028	思源电气	224,485	3,578,290.90	0.21
182	600863	内蒙华电	1,185,610	3,568,686.10	0.21
183	002665	首航节能	495,129	3,564,928.80	0.21
184	000816	智慧农业	477,508	3,552,659.52	0.21
185	002635	安洁科技	98,045	3,551,189.90	0.21
186	000667	美好置业	1,062,165	3,515,766.15	0.21
187	002444	巨星科技	224,710	3,500,981.80	0.21
188	000592	平潭发展	633,844	3,498,818.88	0.21
189	600478	科力远	405,645	3,492,603.45	0.21
190	600017	日照港	775,627	3,490,321.50	0.21
191	002603	以岭药业	199,597	3,484,963.62	0.21
192	000006	深振业A	394,707	3,477,368.67	0.21
193	000758	中色股份	493,558	3,459,841.58	0.20
194	300166	东方国信	256,433	3,443,895.19	0.20
195	002127	南极电商	284,900	3,441,592.00	0.20
196	600064	南京高科	227,752	3,439,055.20	0.20
197	000975	银泰资源	271,935	3,434,539.05	0.20

198	002477	雏鹰农牧	774,838	3,432,532.34	0.20
199	300001	特锐德	204,740	3,431,442.40	0.20
200	600125	铁龙物流	382,890	3,430,694.40	0.20
201	000031	中粮地产	453,618	3,415,743.54	0.20
202	002672	东江环保	200,410	3,384,924.90	0.20
203	000939	凯迪生态	655,644	3,343,784.40	0.20
204	002250	联化科技	233,422	3,337,934.60	0.20
205	603077	和邦生物	655,420	3,336,087.80	0.20
206	600565	迪马股份	604,800	3,332,448.00	0.20
207	600348	阳泉煤业	490,500	3,325,590.00	0.20
208	000158	常山股份	210,400	3,324,320.00	0.20
209	000727	华东科技	1,173,300	3,320,439.00	0.20
210	000860	顺鑫农业	165,903	3,319,719.03	0.20
211	600410	华胜天成	371,337	3,290,045.82	0.19
212	300274	阳光电源	295,437	3,276,396.33	0.19
213	600198	大唐电信	256,289	3,272,810.53	0.19
214	000877	天山股份	258,148	3,270,735.16	0.19
215	600597	光明乳业	256,246	3,267,136.50	0.19
216	300287	飞利信	353,400	3,244,212.00	0.19
217	002261	拓维信息	276,887	3,242,346.77	0.19
218	000732	泰禾集团	194,380	3,242,258.40	0.19
219	600416	湘电股份	236,153	3,235,296.10	0.19
220	603766	隆鑫通用	441,513	3,214,214.64	0.19
221	600687	刚泰控股	248,540	3,201,195.20	0.19
222	002308	威创股份	245,098	3,198,528.90	0.19
223	002266	浙富控股	654,319	3,193,076.72	0.19
224	002353	杰瑞股份	199,800	3,160,836.00	0.19
225	002002	鸿达兴业	403,612	3,160,281.96	0.19
226	601929	吉视传媒	912,000	3,155,520.00	0.19
227	600200	江苏吴中	238,992	3,154,694.40	0.19
228	000563	陕国投 A	609,605	3,151,657.85	0.19
229	600039	四川路桥	756,462	3,146,881.92	0.19
230	600086	东方金钰	284,755	3,078,201.55	0.18
231	600282	南钢股份	828,400	3,073,364.00	0.18
232	002468	申通快递	120,607	3,064,623.87	0.18
233	600751	天海投资	537,900	3,060,651.00	0.18
234	000027	深圳能源	453,460	3,051,785.80	0.18
235	300134	大富科技	129,818	3,032,548.48	0.18
236	300257	开山股份	143,800	3,031,304.00	0.18
237	600466	蓝光发展	350,800	3,027,404.00	0.18
238	002022	科华生物	173,836	3,019,531.32	0.18
239	600557	康缘药业	181,771	3,019,216.31	0.18
240	600380	健康元	332,485	3,018,963.80	0.18
241	601689	拓普集团	89,937	3,011,990.13	0.18

242	002396	星网锐捷	155,606	3,010,976.10	0.18
243	002375	亚厦股份	334,000	2,975,940.00	0.18
244	002268	卫士通	176,680	2,971,757.60	0.18
245	002517	恺英网络	84,369	2,968,945.11	0.18
246	000830	鲁西化工	429,679	2,964,785.10	0.17
247	600694	大商股份	75,862	2,956,342.14	0.17
248	600582	天地科技	643,931	2,955,643.29	0.17
249	000501	鄂武商 A	159,933	2,952,363.18	0.17
250	002281	光迅科技	132,824	2,951,349.28	0.17
251	300199	翰宇药业	192,339	2,950,480.26	0.17
252	600151	航天机电	358,345	2,949,179.35	0.17
253	002440	闰土股份	192,717	2,940,861.42	0.17
254	000519	中兵红箭	232,982	2,935,573.20	0.17
255	002589	瑞康医药	189,333	2,915,728.20	0.17
256	600316	洪都航空	181,300	2,913,491.00	0.17
257	002489	浙江永强	454,877	2,902,115.26	0.17
258	600611	大众交通	525,697	2,901,847.44	0.17
259	002544	杰赛科技	126,687	2,888,463.60	0.17
260	600835	上海机电	136,414	2,883,791.96	0.17
261	000712	锦龙股份	175,900	2,879,483.00	0.17
262	002155	湖南黄金	300,772	2,878,388.04	0.17
263	600169	太原重工	744,991	2,875,665.26	0.17
264	000703	恒逸石化	201,700	2,872,208.00	0.17
265	600759	洲际油气	472,389	2,862,677.34	0.17
266	601717	郑煤机	367,371	2,861,820.09	0.17
267	600366	宁波韵升	162,150	2,860,326.00	0.17
268	600270	外运发展	151,059	2,859,546.87	0.17
269	000528	柳工	330,454	2,855,122.56	0.17
270	603000	人民网	216,407	2,850,080.19	0.17
271	601928	凤凰传媒	291,834	2,848,299.84	0.17
272	002342	巨力索具	282,062	2,840,364.34	0.17
273	002670	国盛金控	178,380	2,836,242.00	0.17
274	600267	海正药业	242,450	2,831,816.00	0.17
275	002657	中科金财	97,244	2,819,103.56	0.17
276	000612	焦作万方	348,265	2,803,533.25	0.17
277	600645	中源协和	130,731	2,801,565.33	0.17
278	300273	和佳股份	230,314	2,800,618.24	0.17
279	600108	亚盛集团	649,701	2,800,211.31	0.17
280	600993	马应龙	128,013	2,788,123.14	0.16
281	600187	国中水务	551,808	2,786,630.40	0.16
282	000090	天健集团	249,882	2,773,690.20	0.16
283	600563	法拉电子	56,035	2,768,689.35	0.16
284	002368	太极股份	99,922	2,766,840.18	0.16
285	002285	世联行	342,046	2,743,208.92	0.16

286	002503	搜于特	389,586	2,738,789.58	0.16
287	600729	重庆百货	101,980	2,737,143.20	0.16
288	601678	滨化股份	392,027	2,724,587.65	0.16
289	000937	冀中能源	442,700	2,709,324.00	0.16
290	002437	誉衡药业	369,927	2,693,068.56	0.16
291	600765	中航重机	194,957	2,686,507.46	0.16
292	600750	江中药业	77,296	2,686,036.00	0.16
293	000587	金洲慈航	180,054	2,682,804.60	0.16
294	600098	广州发展	338,016	2,673,706.56	0.16
295	300116	坚瑞沃能	247,600	2,661,700.00	0.16
296	000049	德赛电池	51,246	2,655,055.26	0.16
297	002325	洪涛股份	362,505	2,646,286.50	0.16
298	600073	上海梅林	276,133	2,637,070.15	0.16
299	600422	昆药集团	232,064	2,631,605.76	0.16
300	000021	深科技	306,298	2,628,036.84	0.16
301	002011	盾安环境	231,343	2,625,743.05	0.15
302	000543	皖能电力	448,310	2,613,647.30	0.15
303	000829	天音控股	241,196	2,604,916.80	0.15
304	600848	上海临港	120,655	2,601,321.80	0.15
305	600545	新疆城建	217,131	2,596,886.76	0.15
306	000777	中核科技	129,948	2,593,762.08	0.15
307	002709	天赐材料	62,989	2,593,257.13	0.15
308	600300	维维股份	485,464	2,592,377.76	0.15
309	000810	创维数字	213,700	2,592,181.00	0.15
310	000669	金鸿能源	142,614	2,585,591.82	0.15
311	002018	华信国际	376,800	2,581,080.00	0.15
312	002056	横店东磁	343,456	2,575,920.00	0.15
313	600639	浦东金桥	141,364	2,561,515.68	0.15
314	002242	九阳股份	130,016	2,557,414.72	0.15
315	002025	航天电器	102,049	2,546,122.55	0.15
316	000897	津滨发展	540,633	2,540,975.10	0.15
317	601311	XD 骆驼股	179,015	2,534,852.40	0.15
318	600277	亿利洁能	323,700	2,534,571.00	0.15
319	002317	众生药业	203,630	2,529,084.60	0.15
320	603188	亚邦股份	144,700	2,523,568.00	0.15
321	000636	风华高科	295,399	2,513,845.49	0.15
322	002399	海普瑞	124,247	2,513,516.81	0.15
323	600284	浦东建设	232,928	2,496,988.16	0.15
324	002249	大洋电机	379,420	2,496,583.60	0.15
325	300291	华录百纳	124,676	2,496,013.52	0.15
326	000762	西藏矿业	176,106	2,495,422.02	0.15
327	000572	海马汽车	481,938	2,491,619.46	0.15
328	600651	飞乐音响	290,548	2,460,941.56	0.15
329	000596	古井贡酒	48,242	2,457,929.90	0.15

330	000848	承德露露	246,173	2,456,806.54	0.14
331	600770	综艺股份	327,517	2,456,377.50	0.14
332	601016	节能风电	666,500	2,452,720.00	0.14
333	600259	广晟有色	62,404	2,436,252.16	0.14
334	600587	新华医疗	136,483	2,426,667.74	0.14
335	300376	易事特	266,800	2,419,876.00	0.14
336	000062	深圳华强	91,201	2,419,562.53	0.14
337	600536	中国软件	126,075	2,415,597.00	0.14
338	000766	通化金马	151,057	2,413,890.86	0.14
339	002254	泰和新材	180,247	2,397,285.10	0.14
340	600216	浙江医药	241,754	2,395,782.14	0.14
341	002358	森源电气	140,436	2,390,220.72	0.14
342	002106	莱宝高科	235,619	2,386,820.47	0.14
343	002276	万马股份	236,421	2,385,487.89	0.14
344	600496	精工钢构	492,789	2,380,170.87	0.14
345	002642	荣之联	94,950	2,379,447.00	0.14
346	002479	富春环保	198,658	2,364,030.20	0.14
347	300010	立思辰	182,457	2,362,818.15	0.14
348	002123	梦网荣信	211,200	2,346,432.00	0.14
349	002073	软控股份	276,407	2,343,931.36	0.14
350	002122	天马股份	227,473	2,342,971.90	0.14
351	002064	华峰氨纶	484,044	2,333,092.08	0.14
352	002482	广田集团	258,155	2,320,813.45	0.14
353	600171	上海贝岭	227,091	2,309,515.47	0.14
354	002707	众信旅游	175,100	2,299,063.00	0.14
355	002428	云南锗业	214,960	2,295,772.80	0.14
356	603444	吉比特	8,100	2,294,973.00	0.14
357	000652	泰达股份	432,534	2,292,430.20	0.14
358	600458	时代新材	198,206	2,269,458.70	0.13
359	000061	农产品	250,018	2,265,163.08	0.13
360	002332	仙琚制药	263,223	2,263,717.80	0.13
361	000680	山推股份	413,175	2,251,803.75	0.13
362	600058	五矿发展	180,700	2,242,487.00	0.13
363	000726	鲁泰A	188,694	2,237,910.84	0.13
364	000541	佛山照明	245,543	2,236,896.73	0.13
365	000620	新华联	313,933	2,232,063.63	0.13
366	600428	中远海特	357,593	2,224,228.46	0.13
367	002463	沪电股份	488,136	2,221,018.80	0.13
368	000969	安泰科技	253,662	2,214,469.26	0.13
369	001696	宗申动力	287,789	2,178,562.73	0.13
370	603883	老百姓	44,500	2,164,925.00	0.13
371	002505	大康农业	615,418	2,153,963.00	0.13
372	600517	置信电气	284,409	2,152,976.13	0.13
373	600894	广日股份	181,269	2,146,224.96	0.13

374	002690	美亚光电	111,300	2,134,734.00	0.13
375	601233	桐昆股份	153,838	2,132,194.68	0.13
376	600329	中新药业	117,647	2,130,587.17	0.13
377	300297	蓝盾股份	194,300	2,127,585.00	0.13
378	600859	王府井	131,368	2,121,593.20	0.13
379	600805	XD 悦达投	286,361	2,104,753.35	0.12
380	000426	兴业矿业	233,182	2,103,301.64	0.12
381	600880	博瑞传播	321,940	2,102,268.20	0.12
382	601777	力帆股份	261,330	2,101,093.20	0.12
383	600586	金晶科技	429,554	2,100,519.06	0.12
384	300043	星辉娱乐	255,609	2,098,549.89	0.12
385	600736	苏州高新	296,315	2,094,947.05	0.12
386	002063	远光软件	200,626	2,090,522.92	0.12
387	002128	露天煤业	240,024	2,088,208.80	0.12
388	600790	轻纺城	305,213	2,078,500.53	0.12
389	000616	海航投资	481,813	2,071,795.90	0.12
390	000552	靖远煤电	574,812	2,052,078.84	0.12
391	603369	今世缘	155,248	2,049,273.60	0.12
392	600220	江苏阳光	595,524	2,042,647.32	0.12
393	600338	西藏珠峰	53,700	2,040,063.00	0.12
394	600395	盘江股份	278,300	2,039,939.00	0.12
395	002663	普邦股份	374,044	2,031,058.92	0.12
396	600720	祁连山	258,461	2,023,749.63	0.12
397	603355	莱克电气	34,261	2,013,518.97	0.12
398	600773	西藏城投	180,086	1,993,552.02	0.12
399	300147	香雪制药	193,776	1,990,079.52	0.12
400	603888	新华网	61,350	1,987,126.50	0.12
401	002727	一心堂	107,900	1,985,360.00	0.12
402	601886	江河集团	193,226	1,980,566.50	0.12
403	002269	美邦服饰	528,395	1,970,913.35	0.12
404	603556	海兴电力	44,800	1,966,272.00	0.12
405	600006	东风汽车	335,135	1,960,539.75	0.12
406	002041	登海种业	147,708	1,957,131.00	0.12
407	300039	上海凯宝	267,252	1,942,922.04	0.11
408	002005	德豪润达	407,056	1,941,657.12	0.11
409	002345	潮宏基	178,382	1,939,012.34	0.11
410	600596	新安股份	229,189	1,936,647.05	0.11
411	603816	顾家家居	32,900	1,933,862.00	0.11
412	600801	华新水泥	202,708	1,931,807.24	0.11
413	300032	金龙机电	137,100	1,912,545.00	0.11
414	002277	友阿股份	295,864	1,908,322.80	0.11
415	600280	中央商场	240,494	1,907,117.42	0.11
416	002190	成飞集成	71,100	1,905,480.00	0.11
417	600648	外高桥	102,583	1,899,837.16	0.11

418	000417	合肥百货	229,688	1,894,926.00	0.11
419	600757	长江传媒	253,589	1,894,309.83	0.11
420	603377	东方时尚	50,300	1,890,777.00	0.11
421	600053	九鼎投资	54,063	1,890,042.48	0.11
422	603198	迎驾贡酒	99,100	1,885,873.00	0.11
423	300202	聚龙股份	113,997	1,883,230.44	0.11
424	600869	智慧能源	279,670	1,882,179.10	0.11
425	002371	北方华创	78,535	1,878,557.20	0.11
426	600059	古越龙山	202,215	1,870,488.75	0.11
427	002120	韵达股份	36,104	1,862,966.40	0.11
428	600628	新世界	161,278	1,862,760.90	0.11
429	600580	卧龙电气	271,629	1,852,509.78	0.11
430	600141	兴发集团	149,265	1,846,408.05	0.11
431	002681	奋达科技	146,190	1,840,532.10	0.11
432	002588	史丹利	237,385	1,825,490.65	0.11
433	600289	亿阳信通	166,668	1,823,347.92	0.11
434	000681	视觉中国	116,131	1,818,611.46	0.11
435	002233	塔牌集团	149,331	1,817,358.27	0.11
436	600481	双良节能	340,290	1,806,939.90	0.11
437	000099	中信海直	159,847	1,799,877.22	0.11
438	002344	海宁皮城	213,300	1,774,656.00	0.10
439	600195	中牧股份	90,549	1,755,745.11	0.10
440	601001	大同煤业	333,223	1,749,420.75	0.10
441	600292	远达环保	162,236	1,748,904.08	0.10
442	600460	士兰微	287,704	1,746,363.28	0.10
443	601002	晋亿实业	198,609	1,717,967.85	0.10
444	600537	亿晶光电	344,048	1,713,359.04	0.10
445	002147	新光圆成	109,000	1,693,860.00	0.10
446	600971	恒源煤电	208,126	1,692,064.38	0.10
447	002309	中利集团	134,932	1,687,999.32	0.10
448	600754	锦江股份	62,162	1,684,590.20	0.10
449	600862	中航高科	173,500	1,681,215.00	0.10
450	600748	上实发展	232,569	1,674,496.80	0.10
451	600640	号百控股	98,783	1,669,432.70	0.10
452	600657	信达地产	289,010	1,664,697.60	0.10
453	600743	华远地产	392,228	1,655,202.16	0.10
454	600826	兰生股份	88,893	1,608,963.30	0.09
455	603169	兰石重装	130,300	1,583,145.00	0.09
456	600184	光电股份	84,110	1,577,903.60	0.09
457	600251	冠农股份	196,732	1,567,954.04	0.09
458	002699	美盛文化	113,220	1,562,436.00	0.09
459	600335	国机汽车	129,924	1,553,891.04	0.09
460	600831	广电网络	151,276	1,505,196.20	0.09
461	002551	尚荣医疗	93,307	1,505,041.91	0.09

462	002392	北京利尔	250,040	1,482,737.20	0.09
463	600996	贵广网络	123,100	1,473,507.00	0.09
464	002093	国脉科技	167,302	1,472,257.60	0.09
465	002414	高德红外	80,109	1,465,994.70	0.09
466	603868	飞科电器	23,550	1,456,332.00	0.09
467	002118	紫鑫药业	212,978	1,454,639.74	0.09
468	002416	爱施德	128,635	1,387,971.65	0.08
469	000693	*ST 华泽	109,768	1,372,100.00	0.08
470	600551	时代出版	85,789	1,354,608.31	0.08
471	600776	东方通信	199,475	1,352,440.50	0.08
472	002646	青青稞酒	77,290	1,349,483.40	0.08
473	002251	步步高	107,699	1,334,390.61	0.08
474	603005	晶方科技	47,391	1,326,474.09	0.08
475	603698	航天工程	51,500	1,297,800.00	0.08
476	000536	华映科技	216,597	1,258,428.57	0.07
477	603001	奥康国际	66,230	1,244,461.70	0.07
478	000517	荣安地产	263,200	1,223,880.00	0.07
479	603568	伟明环保	56,478	1,221,054.36	0.07
480	000025	特力 A	23,300	1,205,542.00	0.07
481	603328	依顿电子	84,724	1,198,844.60	0.07
482	603567	珍宝岛	70,100	1,179,783.00	0.07
483	603528	多伦科技	79,600	1,143,852.00	0.07
484	603806	福斯特	35,050	1,121,950.50	0.07
485	600936	广西广电	131,200	1,058,784.00	0.06
486	002807	江阴银行	83,600	1,047,508.00	0.06
487	600126	杭钢股份	150,432	1,031,963.52	0.06
488	600618	氯碱化工	94,061	1,004,571.48	0.06
489	002315	焦点科技	40,219	1,003,061.86	0.06
490	603866	桃李面包	27,195	967,598.10	0.06
491	603228	景旺电子	19,800	955,350.00	0.06
492	603515	欧普照明	25,700	928,284.00	0.05
493	601020	华钰矿业	41,400	912,042.00	0.05
494	002194	武汉凡谷	94,805	839,024.25	0.05
495	600468	百利电气	117,851	766,031.50	0.05
496	002815	崇达技术	21,700	716,968.00	0.04
497	603658	安图生物	15,700	676,670.00	0.04
498	603025	大豪科技	25,400	670,560.00	0.04
499	600917	重庆燃气	70,600	665,758.00	0.04
500	000761	本钢板材	124,900	653,227.00	0.04
501	603877	太平鸟	23,216	649,815.84	0.04
502	002818	富森美	16,400	647,308.00	0.04
503	601811	新华文轩	40,500	630,180.00	0.04
504	603569	长久物流	17,700	591,711.00	0.03
505	600682	南京新百	14,614	539,256.60	0.03

506	002602	世纪华通	13,300	482,258.00	0.03
507	600067	冠城大通	59,935	411,753.45	0.02
508	600522	中天科技	31,880	384,154.00	0.02
509	600175	美都能源	71,969	313,065.15	0.02
510	002595	豪迈科技	14,016	311,575.68	0.02
511	600575	皖江物流	68,223	286,536.60	0.02
512	000959	首钢股份	39,696	277,475.04	0.02
513	000961	中南建设	33,375	217,605.00	0.01
514	601010	文峰股份	48,870	205,742.70	0.01
515	600601	方正科技	54,534	202,866.48	0.01
516	002327	富安娜	20,092	166,964.52	0.01
517	600825	新华传媒	23,313	165,289.17	0.01
518	002498	汉缆股份	38,200	139,812.00	0.01
519	601005	*ST 重钢	60,500	128,865.00	0.01
520	600351	XD 亚宝药	15,782	123,415.24	0.01
521	000861	海印股份	32,534	119,399.78	0.01
522	600180	瑞茂通	7,348	103,165.92	0.01
523	000919	金陵药业	8,665	93,755.30	0.01
524	600851	海欣股份	9,963	89,467.74	0.01
525	002698	博实股份	7,437	87,533.49	0.01
526	000723	美锦能源	8,720	70,108.80	0.00
527	600425	*ST 青松	22,017	70,014.06	0.00
528	603801	N 志邦	1,406	47,522.80	0.00
529	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
530	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
531	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
532	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
533	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
534	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
535	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
536	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
537	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
538	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
539	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
540	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
541	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
542	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
543	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
544	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
545	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
546	300663	科蓝软件	93	2,216.19	0.00
547	300662	科锐国际	56	1,415.12	0.00
548	603536	惠发股份	8	191.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额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	300136	信维通信	6,594,743.91	0.48
2	000778	新兴铸管	5,664,001.50	0.41
3	600642	申能股份	5,646,433.50	0.41
4	000039	中集集团	5,116,501.69	0.37
5	603799	华友钴业	5,087,538.00	0.37
6	300002	神州泰岳	4,536,898.19	0.33
7	300383	光环新网	4,372,650.00	0.32
8	002460	赣锋锂业	4,358,754.45	0.32
9	600839	四川长虹	4,283,086.27	0.31
10	002583	海能达	4,193,958.72	0.31
11	300058	蓝色光标	4,053,233.35	0.30
12	002601	龙鳞佰利	3,736,473.00	0.27
13	000729	燕京啤酒	3,719,129.52	0.27
14	300156	神雾环保	3,689,604.27	0.27
15	002127	南极电商	3,621,992.00	0.27
16	300146	汤臣倍健	3,465,686.61	0.25
17	000998	隆平高科	3,347,408.17	0.25
18	300296	利亚德	3,286,569.11	0.24
19	000732	泰禾集团	3,248,508.18	0.24
20	002572	索菲亚	3,228,126.33	0.24

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002508	老板电器	9,591,025.84	0.70
2	600522	中天科技	7,571,722.27	0.55
3	000887	中鼎股份	6,701,763.52	0.49
4	600436	片仔癀	6,408,703.31	0.47
5	600682	南京新百	6,247,568.00	0.46
6	002602	世纪华通	5,320,329.00	0.39

7	000959	首钢股份	4,236,613.27	0.31
8	002595	豪迈科技	3,982,726.59	0.29
9	600497	驰宏锌锗	3,853,632.69	0.28
10	000961	中南建设	3,500,830.50	0.26
11	000066	中国长城	3,442,263.41	0.25
12	600549	厦门钨业	3,419,445.20	0.25
13	000973	佛塑科技	2,681,060.31	0.20
14	600601	方正科技	2,485,134.00	0.18
15	600175	美都能源	2,373,818.57	0.17
16	002581	未名医药	2,326,361.83	0.17
17	600851	海欣股份	2,279,881.19	0.17
18	000869	张裕 A	2,240,777.37	0.16
19	600067	冠城大通	2,191,885.00	0.16
20	002498	汉缆股份	2,167,075.06	0.16

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	536,829,543.02
卖出股票的收入（成交）总额	346,625,268.10

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	144,639.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	144,639.00	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113012	骆驼转债	1,350	144,639.00	0.01

7.7 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。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					688,920.00
股指期货投资本期公允价值变动					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情况。

7.12.2 报告期内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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	102,618.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,275.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,894.45

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000656	金科股份	8,766,392.58	0.52	重大事项停牌

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
1,628	611,202.90	972,888,078.00	97.77%	22,150,241.00	2.23%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	955,346,870.00	96.01%
2	光大证券—光大银行—光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划	8,000,000.00	0.80%
3	华夏人寿保险股份有限公司—自有资金	3,558,800.00	0.36%
4	方正证券股份有限公司	2,483,920.00	0.25%
5	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	1,457,900.00	0.15%
6	广发基金—中国银行—中银国际证券有限责任公司	765,756.00	0.08%
7	吕庆柱	757,700.00	0.08%
8	沈杰	716,000.00	0.07%
9	吴钢鸿	600,000.00	0.06%
10	杨定宇	593,800.00	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 4 月 11 日）基金份额总额	425,038,319.00
本报告期期初基金份额总额	791,038,319.00
本报告期基金总申购份额	416,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	212,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	995,038,319.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	4	380,584,686.32	43.88%	88,031.36	16.26%	-
光大证券	3	331,929,051.48	38.27%	309,127.22	57.11%	-
广发证券	8	154,747,313.61	17.84%	144,117.78	26.63%	新增 2 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-

第一创业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	新增 1 个
方正证券	7	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	减少 1 个
信达证券	3	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中银国际	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-

兴业证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：1 交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2 交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于增加国泰君安为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-02-15
2	广发基金管理有限公司关于增加招商证券为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-01-13
3	广发基金管理有限公司关于增加财通证券为旗下部分基金申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-01-12

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证 500 交易型	1	20170101-20170630	760,841,142.00	308,767,500.00	114,261,772.00	955,346,870.00	96.01%

开放式 指数证 券投资 基金联 接基金 (LOF)							
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
2. 《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3. 《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；
 2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。
- 投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日