

嘉实中证 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：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	13
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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§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.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	68
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	68
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.....	68
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.12 投资组合报告附注.....	69
§8 基金份额持有人信息.....	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	72
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	74
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	77

§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点.....	79
12.3 查阅方式.....	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,981,868.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010) 65215588	(010) 67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010) 67595096
传真		(010) 65182266	(010) 66275853
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		100005	100033
法定代表人		邓红国	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

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 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-17,585,226.56
本期利润	-11,731,438.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0741
本期加权平均净值利润率	-1.17%
本期基金份额净值增长率	-0.54%
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	438,231,065.55
期末可供分配基金份额利润	2.7054
期末基金资产净值	1,015,949,497.73
期末基金份额净值	6.2720
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	75.86%

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) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

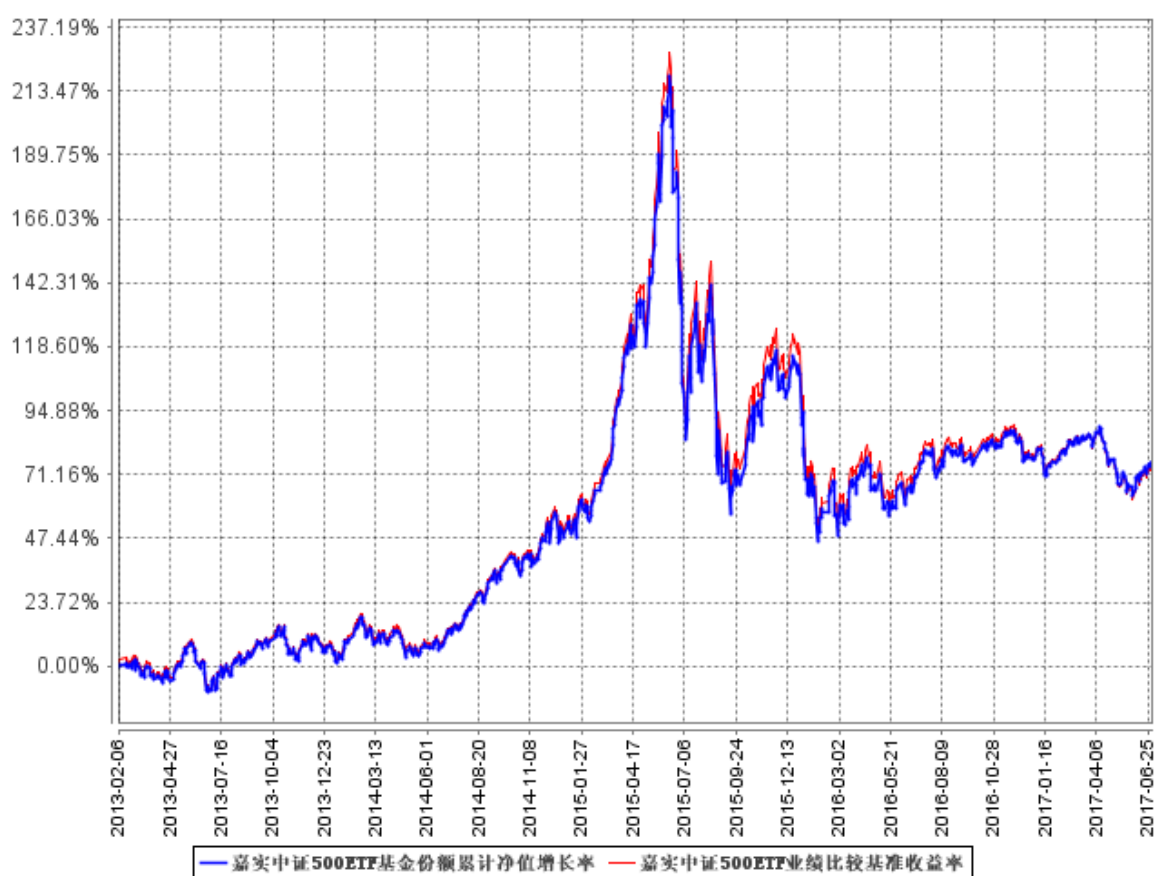
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.71%	0.93%	5.39%	0.93%	0.32%	0.00%
过去三个月	-3.43%	1.02%	-4.12%	1.02%	0.69%	0.00%
过去六个月	-0.54%	0.89%	-2.00%	0.90%	1.46%	-0.01%

过去一年	3.06%	0.90%	0.24%	0.91%	2.82%	-0.01%
过去三年	59.03%	2.04%	56.39%	2.06%	2.64%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	75.86%	1.85%	74.35%	1.87%	1.51%	-0.02%

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

嘉实中证500ETF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



图：嘉实中证 500ETF 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
(2013 年 2 月 6 日至 2017 年 6 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（二）投资范围和（七）投资限制”的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债

券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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		
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	12 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。

何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实创业板 ETF 基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	11 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司, 先后任职于产品管理部、指数投资部, 现任指数投资部副总监、基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 加拿大籍。
----	---	----------------	---	------	--

注: (1) 基金经理的任职日期, 离任日期是指公司作出决定后公告之日; (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

报告期内, 本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定, 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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度, 各投资组合按投资管理制度和流程独立决策, 并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会; 通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进, 确保公平交易原则的实现; 通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控, 公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 6 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年化跟踪误差为 0.35%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 6.2720 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.54%，业绩比较基准收益率为-2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与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专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 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	8,010,346.71	53,530,934.69
结算备付金		7,762,563.83	3,083,229.55
存出保证金		8,492,753.92	13,710,933.42
交易性金融资产	6.4.7.2	972,590,917.90	869,963,752.53
其中：股票投资		972,590,917.90	869,963,752.53
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,000,000.00	35,000,000.00
应收证券清算款		5,238,670.79	70,214.09
应收利息	6.4.7.5	-2,900.83	8,111.04
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		1,017,092,352.32	975,367,175.32
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		7.02	35,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		404,992.74	396,661.52
应付托管费		80,998.54	79,332.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	256,874.02	184,727.25
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	399,982.27	504,201.05
负债合计		1,142,854.59	36,164,922.13
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	577,718,432.18	531,174,793.41
未分配利润	6.4.7.10	438,231,065.55	408,027,459.78
所有者权益合计		1,015,949,497.73	939,202,253.19
负债和所有者权益总计		1,017,092,352.32	975,367,175.32

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.2720 元，基金份额总额 161,981,868.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 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	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至	2016 年 1 月 1 日至 2016

		2017 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		-7,741,111.47	-153,278,927.38
1.利息收入		428,370.35	135,829.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	115,932.79	135,738.73
债券利息收入		11.46	91.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		312,426.10	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,232,339.72	-18,358,687.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-19,836,179.32	-24,428,174.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,703.54	88,206.77
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	184,680.00	1,384,440.00
股利收益	6.4.7.15	5,410,456.06	4,596,840.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,853,787.60	-134,995,579.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	209,070.30	-60,490.21
减：二、费用		3,990,327.49	3,168,558.44
1. 管理人报酬		2,475,845.01	1,957,652.60
2. 托管费		495,168.97	391,530.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	640,221.65	474,774.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.19	379,091.86	344,600.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,731,438.96	-156,447,485.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,731,438.96	-156,447,485.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 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）	531,174,793.41	408,027,459.78	939,202,253.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,731,438.96	-11,731,438.96
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）	46,543,638.77	41,935,044.73	88,478,683.50
其中：1. 基金申购款	187,779,507.85	150,528,633.29	338,308,141.14
2. 基金赎回款	-141,235,869.08	-108,593,588.56	-249,829,457.64
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)	577,718,432.18	438,231,065.55	1,015,949,497.73
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)	415,618,173.12	451,662,867.47	867,281,040.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-156,447,485.82	-156,447,485.82
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)	109,136,808.02	75,454,410.32	184,591,218.34
其中：1.基金申购款	138,025,963.10	94,016,469.01	232,042,432.11
2.基金赎回款	-28,889,155.08	-18,562,058.69	-47,451,213.77
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)	524,754,981.14	370,669,791.97	895,424,773.11

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：

 赵学军
基金管理人负责人

 王红
主管会计工作负责人

 张公允
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,108,591,728.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 047 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 137,674.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上 [2013] 83 号文审核同意,本基金 871,631,868.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在深交所挂牌交易。

根据《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》(以下简称“份额折算公告”)的有关规定,本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司确定 2013 年 3 月 5 日为本基金的基金折算处理日。当日基金资产净值为 3,136,108,366.93 元,折算前基金份额总额为 3,108,729,402.00 份,折算前基金份额净值为 1.0088 元。根据份额折算公告中的基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.28038605,折算后基金份额总额为 871,631,868.00 份,折算后基金份额净值为 3.5980 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算,并于 2013 年 3 月 6 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、

衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数。

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

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

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

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	8,010,346.71
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,010,346.71

注：定期存款的存款期限指票面存期。

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	1,016,896,997.62	972,590,917.90	-44,306,079.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,016,896,997.62	972,590,917.90	-44,306,079.72

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	40,030,720.00	-	-	
其中：股指期货投资	40,030,720.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	40,030,720.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1709	中证 500 股指期货 IC1709 合约	35	42,152,600.00	2,121,880.00
总额合计				2,121,880.00
减：可抵消期货暂收款				2,121,880.00
股指期货投资净额				

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产款	-	-
交易所市场买入返售金融资产款	15,000,000.00	-
合计	15,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,568.93
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	950.89
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-8,219.17
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2,798.52
合计	-2,900.83

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

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	256,874.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	256,874.02

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	323,149.47
应付指数使用费	76,832.80
其他	-

合计	399,982.27
----	------------

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	148,931,868.00	531,174,793.41
本期申购	52,650,000.00	187,779,507.85
本期赎回(以“-”号填列)	-39,600,000.00	-141,235,869.08
本期末	161,981,868.00	577,718,432.18

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	420,652,032.86	-12,624,573.08	408,027,459.78
本期利润	-17,585,226.56	5,853,787.60	-11,731,438.96
本期基金份额交易产生的变动数	36,712,233.85	5,222,810.88	41,935,044.73
其中：基金申购款	149,184,192.61	1,344,440.68	150,528,633.29
基金赎回款	-112,471,958.76	3,878,370.20	-108,593,588.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	439,779,040.15	-1,547,974.60	438,231,065.55

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	49,116.67
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	21,821.39
其他	44,994.73
合计	115,932.79

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	-7,368,219.30
股票投资收益——赎回差价收入	-12,467,960.02
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-19,836,179.32

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	236,475,316.75
减：卖出股票成本总额	243,843,536.05
买卖股票差价收入	-7,368,219.30

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	249,829,457.64
减：现金支付赎回款总额	16,051,429.64
减：赎回股票成本总额	246,245,988.02
赎回差价收入	-12,467,960.02

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	91,715.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	83,000.00
减：应收利息总额	11.46
买卖债券差价收入	8,703.54

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	184,680.00

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	5,410,456.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,410,456.06

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	2,323,787.60
——股票投资	2,323,787.60
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	3,530,000.00
——权证投资	-
——期货投资	3,530,000.00
3. 其他	-
合计	5,853,787.60

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	-

基金转出费收入	-
债券认购手续费返还	-
印花税手续费返还	-
替代损益	209,070.30
其他	-
合计	209,070.30

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	640,221.65
银行间市场交易费用	-
合计	640,221.65

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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	7,391.73
指数使用费	148,550.66
上市年费	29,752.78
红利手续费	-
其他	-
合计	379,091.86

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，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 500ETF 联接”）	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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	2,475,845.01	1,957,652.60
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

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	495,168.97	391,530.55

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

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

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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		上年度末	
	2017 年 6 月 30 日		2016 年 12 月 31 日	
	持有的	持有的基金	持有的	持有的基金

	基金份额	份额 占基金总份 额的比例	基金份额	份额 占基金总份 额的比例
嘉 实 中 证 500ETF 联接	101,914,880.00	62.92%	89,188,780.00	59.89%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,010,346.71	49,116.67	24,123,395.96	82,134.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017年1月1日至2017年6月30日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本期（2017年1月1日至2017年06月30日），本基金未实施利润分配。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
002879	长缆科技	2017年6	2017年7月	未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	网下

		月 5 日	7 日								申购
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20		网下 申购
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87		网下 申购
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62		网下 申购
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36		网下 申购
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26		网下 申购
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37		网下 申购
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76		网下 申购
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40		网下 申购

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.06	-	-	163,700	1,477,707.66	1,483,122.00	-

000099	中信海直	2017年5月4日	重大事件停牌	11.26		-	-	113,608	1,475,138.21	1,279,226.08	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事件停牌	6.54	2017年7月5日	5.92		972,960	5,121,989.36	6,363,158.40	-
000693	*ST华泽	2016年3月1日	重大事件停牌	12.50		-	-	55,900	1,171,355.43	698,750.00	-
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事件停牌	10.33	2017年8月2日	11.36		228,931	2,391,066.86	2,364,857.23	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事件停牌	24.95	2017年7月4日	22.46		67,376	1,484,110.16	1,681,031.20	-
002122	天马股份	2017年4月24日	重大事件停牌	10.30	2017年7月24日	11.15		163,182	1,435,089.63	1,680,774.60	-
002127	南极电商	2017年6月29日	重大事件停牌	12.08	2017年7月6日	12.61		185,700	2,258,124.51	2,243,256.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事件停牌	8.70	2017年8月14日	9.57		150,336	1,296,080.84	1,307,923.20	-
002168	深圳惠程	2017年1月23日	重大事件停牌	16.99		-	-	188,825	2,401,152.73	3,208,136.75	-
002358	森源电气	2017年5月12日	重大事件停牌	17.02	2017年7月12日	16.68		89,446	1,647,476.99	1,522,370.92	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事件停牌	20.23		-	-	101,400	1,922,160.66	2,051,322.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事件停牌	3.50		-	-	369,690	1,362,530.51	1,293,915.00	-
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事件停牌	25.06	2017年7月7日	22.54		70,650	2,127,850.88	1,770,489.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事件停牌	12.59	2017年7月3日	12.70		91,380	1,415,744.24	1,150,474.20	-
300088	长信	2016年9月	重大事件	15.75	2017年8月			210,200	2,597,631.09	3,310,650.00	-

	科技	月 12 日	项停牌		月 9 日	14.50					
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大事 项停牌	23.36	-	-	89,260	2,485,774.01	2,085,113.60	-	
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事 项停牌	20.02	-	-	91,172	2,534,735.79	1,825,263.44	-	
600277	亿利洁能	2017 年 3 月 6 日	重大事 项停牌	7.83	-	-	184,100	1,198,538.06	1,441,503.00	-	
600289	亿阳信通	2017 年 5 月 10 日	重大事 项停牌	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	107,202	1,533,811.16	1,172,789.88	-	
600460	士兰微	2017 年 5 月 12 日	重大事 项停牌	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	178,129	1,183,240.89	1,081,243.03	-	
600468	百利电气	2017 年 5 月 16 日	重大事 项停牌	6.50	-	-	77,327	714,966.25	502,625.50	-	
600545	新疆城建	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	11.96	2017 年 7 月 3 日	12.44	131,583	1,521,895.37	1,573,732.68	-	
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大事 项停牌	14.98	2017 年 8 月 2 日	16.48	396,116	5,057,468.26	5,933,817.68	-	
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事 项停牌	11.32	-	-	213,700	3,235,194.53	2,419,084.00	-	
600657	信达地产	2017 年 2 月 20 日	重大事 项停牌	5.76	2017 年 8 月 10 日	6.19	177,654	1,080,252.88	1,023,287.04	-	
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事 项停牌	7.29	-	-	417,394	3,152,976.36	3,042,802.26	-	
601001	大同煤业	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	203,728	1,293,725.27	1,069,572.00	-	
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事 项停牌	7.79	-	-	238,271	1,805,074.25	1,856,131.09	-	

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

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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

6.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息

(该利息金额不重大)外, 本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示:

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	8,010,346.71	-	-	-	8,010,346.71
结算备付金	7,762,563.83	-	-	-	7,762,563.83
存出保证金	62,233.92	-	-	8,430,520.00	8,492,753.92
交易性金融资产	-	-	-	972,590,917.90	972,590,917.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	5,238,670.79	5,238,670.79
应收利息	-	-	-	-2,900.83	-2,900.83
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,835,144.46	-	-	986,257,207.86	1,017,092,352.32
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	7.02	7.02
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	404,992.74	404,992.74
应付托管费	-	-	-	80,998.54	80,998.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	256,874.02	256,874.02
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	399,982.27	399,982.27
负债总计	-	-	-	1,142,854.59	1,142,854.59
利率敏感度缺口	30,835,144.46	-	-	985,114,353.27	1,015,949,497.73
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	53,530,934.69	-	-	-	53,530,934.69
结算备付金	3,083,229.55	-	-	-	3,083,229.55
存出保证金	33,093.42	-	-	13,677,840.00	13,710,933.42
交易性金融资产	-	-	-	869,963,752.53	869,963,752.53

衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	35,000,000.00	-	-	35,000,000.00
应收证券清算款	-	-	70,214.09	70,214.09
应收利息	-	-	8,111.04	8,111.04
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	91,647,257.66	-	883,719,917.66	975,367,175.32
负债	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	35,000,000.00	35,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	396,661.52	396,661.52
应付托管费	-	-	79,332.31	79,332.31
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	184,727.25	184,727.25
应付税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	504,201.05	504,201.05
负债总计	-	-	36,164,922.13	36,164,922.13
利率敏感度缺口	91,647,257.66	-	847,554,995.53	939,202,253.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	972,590,917.90	95.73	869,963,752.53	92.63
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	972,590,917.90	95.73	869,963,752.53	92.63

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	50,568,844.78	45,659,866.39
	业绩比较基准下降 5%	-50,568,844.78	-45,659,866.39

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 921,721,355.41 元，属于第二层次的余额为 50,869,562.49 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 800,598,522.97 元，第二层次 69,365,229.56 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	972,590,917.90	95.62
	其中：股票	972,590,917.90	95.62
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	15,000,000.00	1.47
	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	15,772,910.54	1.55
7	其他各项资产	13,728,523.88	1.35
8	合计	1,017,092,352.32	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,124,895.53	1.19
B	采矿业	27,537,583.78	2.71
C	制造业	599,027,970.47	58.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,256,533.79	3.27

E	建筑业	21,894,759.57	2.16
F	批发和零售业	51,853,294.74	5.10
G	交通运输、仓储和邮政业	25,861,930.40	2.55
H	住宿和餐饮业	1,048,770.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,708,728.17	6.57
J	金融业	15,486,377.14	1.52
K	房地产业	60,807,410.34	5.99
L	租赁和商务服务业	18,170,353.41	1.79
M	科学研究和技术服务业	2,349,713.60	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	8,412,195.48	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,142,736.00	0.11
Q	卫生和社会工作	2,489,555.64	0.25
R	文化、体育和娱乐业	11,482,177.39	1.13
S	综合	4,463,173.80	0.44
	合计	964,118,159.25	94.90

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	698,750.00	0.07
C	制造业	7,766,369.03	0.76
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
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	8,472,758.65	0.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	189,900	7,599,798.00	0.75
2	000656	金科股份	972,960	6,363,158.40	0.63
3	600643	爱建集团	396,116	5,933,817.68	0.58
4	600487	亨通光电	209,860	5,886,573.00	0.58
5	002460	赣锋锂业	127,200	5,883,000.00	0.58
6	002572	索菲亚	133,800	5,485,800.00	0.54
7	600201	生物股份	148,076	5,267,063.32	0.52

8	601012	隆基股份	289,253	4,946,226.30	0.49
9	300156	神雾环保	146,300	4,792,788.00	0.47
10	002271	东方雨虹	127,892	4,744,793.20	0.47
11	600176	中国巨石	422,958	4,644,078.84	0.46
12	600219	南山铝业	1,340,800	4,545,312.00	0.45
13	603799	华友钴业	71,500	4,345,770.00	0.43
14	600525	长园集团	318,196	4,324,283.64	0.43
15	002405	四维图新	216,879	4,285,529.04	0.42
16	600079	人福医药	217,400	4,265,388.00	0.42
17	000661	长春高新	32,868	4,243,587.48	0.42
18	600315	上海家化	130,100	4,221,745.00	0.42
19	000050	深天马 A	203,000	4,175,710.00	0.41
20	600642	申能股份	659,700	4,156,110.00	0.41
21	000998	隆平高科	182,065	4,009,071.30	0.39
22	002092	中泰化学	311,072	3,950,614.40	0.39
23	002340	格林美	645,246	3,903,738.30	0.38
24	000066	中国长城	426,705	3,844,612.05	0.38
25	300115	长盈精密	130,820	3,817,327.60	0.38
26	300266	兴源环境	122,800	3,772,416.00	0.37
27	300296	利亚德	196,700	3,697,960.00	0.36
28	600584	长电科技	229,904	3,689,959.20	0.36
29	000997	新大陆	158,680	3,600,449.20	0.35
30	002050	三花智控	217,496	3,549,534.72	0.35
31	600516	方大炭素	249,100	3,542,202.00	0.35
32	601168	西部矿业	460,500	3,541,245.00	0.35
33	600291	西水股份	158,400	3,484,800.00	0.34
34	600879	航天电子	394,084	3,463,998.36	0.34
35	002422	科伦药业	208,700	3,447,724.00	0.34

36	000786	北新建材	215,996	3,421,376.64	0.34
37	600325	华发股份	409,277	3,417,462.95	0.34
38	600056	中国医药	129,019	3,348,043.05	0.33
39	002407	多氟多	151,700	3,335,883.00	0.33
40	300088	长信科技	210,200	3,310,650.00	0.33
41	600266	北京城建	227,100	3,302,034.00	0.33
42	000039	中集集团	182,800	3,295,884.00	0.32
43	600022	山东钢铁	1,586,530	3,268,251.80	0.32
44	600839	四川长虹	892,100	3,229,402.00	0.32
45	000778	新兴铸管	482,000	3,229,400.00	0.32
46	600426	华鲁恒升	273,934	3,215,985.16	0.32
47	600388	龙净环保	206,500	3,206,945.00	0.32
48	600166	福田汽车	1,127,900	3,203,236.00	0.32
49	600521	华海药业	151,108	3,179,312.32	0.31
50	600161	天坛生物	80,928	3,140,815.68	0.31
51	000581	威孚高科	121,200	3,139,080.00	0.31
52	600435	北方导航	215,810	3,088,241.10	0.30
53	600528	中铁工业	214,653	3,067,391.37	0.30
54	002410	广联达	162,200	3,049,360.00	0.30
55	600673	东阳光科	417,394	3,042,802.26	0.30
56	000970	中科三环	205,800	3,041,724.00	0.30
57	000999	华润三九	94,500	3,000,375.00	0.30
58	002217	合力泰	302,200	2,985,736.00	0.29
59	002179	中航光电	95,514	2,979,081.66	0.29
60	600600	青岛啤酒	84,000	2,948,400.00	0.29
61	002366	台海核电	62,800	2,945,948.00	0.29
62	600138	中青旅	139,840	2,945,030.40	0.29
63	600699	均胜电子	91,687	2,942,235.83	0.29

64	000028	国药一致	36,042	2,915,797.80	0.29
65	002573	清新环境	154,400	2,905,808.00	0.29
66	002038	双鹭药业	99,200	2,891,680.00	0.28
67	600978	宜华生活	286,549	2,879,817.45	0.28
68	601000	唐山港	550,489	2,873,552.58	0.28
69	002223	鱼跃医疗	121,029	2,865,966.72	0.28
70	300383	光环新网	209,600	2,842,176.00	0.28
71	600614	鹏起科技	255,502	2,810,522.00	0.28
72	603589	口子窖	72,400	2,808,396.00	0.28
73	002311	海大集团	152,784	2,791,363.68	0.27
74	600158	中体产业	162,983	2,787,009.30	0.27
75	000488	晨鸣纸业	215,075	2,774,467.50	0.27
76	300002	神州泰岳	331,600	2,765,544.00	0.27
77	002583	海能达	168,600	2,712,774.00	0.27
78	000878	云南铜业	205,200	2,706,588.00	0.27
79	002078	太阳纸业	367,607	2,701,911.45	0.27
80	300113	顺网科技	100,376	2,700,114.40	0.27
81	002004	华邦健康	344,048	2,693,895.84	0.27
82	300055	万邦达	146,300	2,691,920.00	0.26
83	600511	国药股份	74,009	2,682,086.16	0.26
84	600503	华丽家族	387,000	2,674,170.00	0.26
85	002030	达安基因	122,488	2,669,013.52	0.26
86	002019	亿帆医药	159,500	2,660,460.00	0.26
87	002273	水晶光电	128,050	2,641,671.50	0.26
88	000400	许继电气	146,100	2,623,956.00	0.26
89	603019	中科曙光	93,200	2,622,648.00	0.26
90	600260	凯乐科技	102,769	2,604,166.46	0.26
91	002244	滨江集团	375,770	2,600,328.40	0.26

92	600392	盛和资源	195,600	2,579,964.00	0.25
93	600298	安琪酵母	99,443	2,572,590.41	0.25
94	000566	海南海药	193,620	2,567,401.20	0.25
95	600755	厦门国贸	281,453	2,566,851.36	0.25
96	002384	东山精密	103,417	2,554,399.90	0.25
97	002001	新和成	131,500	2,552,415.00	0.25
98	600808	马钢股份	720,800	2,551,632.00	0.25
99	600635	大众公用	467,378	2,547,210.10	0.25
100	300324	旋极信息	138,800	2,531,712.00	0.25
101	000547	航天发展	241,700	2,525,765.00	0.25
102	600717	天津港	202,200	2,525,478.00	0.25
103	000930	中粮生化	232,927	2,510,953.06	0.25
104	600409	三友化工	249,256	2,510,007.92	0.25
105	000401	冀东水泥	162,700	2,503,953.00	0.25
106	600240	华业资本	275,181	2,493,139.86	0.25
107	000418	小天鹅 A	53,249	2,491,520.71	0.25
108	300244	迪安诊断	79,134	2,489,555.64	0.25
109	002176	江特电机	284,000	2,476,480.00	0.24
110	601231	环旭电子	157,600	2,475,896.00	0.24
111	600122	宏图高科	222,985	2,475,133.50	0.24
112	600872	中炬高新	134,616	2,463,472.80	0.24
113	002491	通鼎互联	182,800	2,456,832.00	0.24
114	600160	巨化股份	204,036	2,454,553.08	0.24
115	300146	汤臣倍健	177,500	2,438,850.00	0.24
116	000598	兴蓉环境	432,800	2,432,336.00	0.24
117	600633	浙数文化	125,800	2,430,456.00	0.24
118	300058	蓝色光标	310,400	2,427,328.00	0.24
119	000960	锡业股份	177,800	2,419,858.00	0.24

120	600655	豫园商城	213,700	2,419,084.00	0.24
121	002439	启明星辰	129,900	2,416,140.00	0.24
122	600418	江淮汽车	228,686	2,412,637.30	0.24
123	002601	龙蟠佰利	147,200	2,411,136.00	0.24
124	600500	中化国际	251,500	2,404,340.00	0.24
125	600062	华润双鹤	87,419	2,397,903.17	0.24
126	000825	太钢不锈	550,500	2,394,675.00	0.24
127	300159	新研股份	180,000	2,383,200.00	0.23
128	002408	齐翔腾达	214,331	2,374,787.48	0.23
129	600143	金发科技	393,700	2,374,011.00	0.23
130	002400	省广股份	294,777	2,367,059.31	0.23
131	002013	中航机电	228,931	2,364,857.23	0.23
132	000685	中山公用	213,759	2,340,661.05	0.23
133	002354	天神娱乐	108,740	2,337,910.00	0.23
134	600594	益佰制药	153,000	2,334,780.00	0.23
135	000089	深圳机场	247,700	2,315,995.00	0.23
136	000078	海王生物	383,753	2,314,030.59	0.23
137	000513	丽珠集团	33,817	2,302,937.70	0.23
138	000729	燕京啤酒	340,400	2,287,488.00	0.23
139	000979	中弘股份	868,652	2,275,868.24	0.22
140	601699	潞安环能	289,000	2,259,980.00	0.22
141	600312	平高电气	163,806	2,250,694.44	0.22
142	600811	东方集团	345,071	2,249,862.92	0.22
143	002127	南极电商	185,700	2,243,256.00	0.22
144	000926	福星股份	183,398	2,237,455.60	0.22
145	600884	杉杉股份	135,544	2,232,409.68	0.22
146	600566	济川药业	58,600	2,228,558.00	0.22
147	002051	中工国际	107,480	2,228,060.40	0.22

148	600967	内蒙一机	163,236	2,224,906.68	0.22
149	300122	智飞生物	115,900	2,214,849.00	0.22
150	000697	炼石有色	108,135	2,213,523.45	0.22
151	601880	大连港	747,449	2,212,449.04	0.22
152	600970	中材国际	254,177	2,208,798.13	0.22
153	002640	跨境通	103,700	2,203,625.00	0.22
154	000690	宝新能源	367,861	2,199,808.78	0.22
155	002431	棕榈股份	199,500	2,198,490.00	0.22
156	000988	华工科技	150,624	2,197,604.16	0.22
157	600026	中远海能	330,396	2,190,525.48	0.22
158	002373	千方科技	160,068	2,183,327.52	0.21
159	600120	浙江东方	81,207	2,182,844.16	0.21
160	002701	奥瑞金	341,341	2,181,168.99	0.21
161	600809	山西汾酒	62,700	2,175,063.00	0.21
162	600499	科达洁能	272,700	2,165,238.00	0.21
163	600183	生益科技	175,185	2,161,782.90	0.21
164	600307	酒钢宏兴	756,500	2,156,025.00	0.21
165	000806	银河生物	159,400	2,151,900.00	0.21
166	002390	信邦制药	247,050	2,151,805.50	0.21
167	600664	哈药股份	368,310	2,139,881.10	0.21
168	002512	达华智能	132,300	2,136,645.00	0.21
169	002048	宁波华翔	102,403	2,136,126.58	0.21
170	002221	东华能源	195,572	2,133,690.52	0.21
171	000600	建投能源	173,100	2,123,937.00	0.21
172	300253	卫宁健康	270,363	2,111,535.03	0.21
173	600863	内蒙华电	701,400	2,111,214.00	0.21
174	600094	大名城	274,900	2,108,483.00	0.21
175	600787	中储股份	265,670	2,101,449.70	0.21

176	600572	康恩贝	303,249	2,098,483.08	0.21
177	300134	大富科技	89,260	2,085,113.60	0.21
178	000012	南玻A	221,900	2,070,327.00	0.20
179	002191	劲嘉股份	220,752	2,066,238.72	0.20
180	000592	平潭发展	373,300	2,060,616.00	0.20
181	002665	首航节能	285,615	2,056,428.00	0.20
182	600874	创业环保	105,042	2,055,671.94	0.20
183	300026	红日药业	436,400	2,055,444.00	0.20
184	002028	思源电气	128,485	2,048,050.90	0.20
185	002635	安洁科技	56,544	2,048,023.68	0.20
186	000667	美好置业	618,238	2,046,367.78	0.20
187	300166	东方国信	152,096	2,042,649.28	0.20
188	000816	智慧农业	274,164	2,039,780.16	0.20
189	002603	以岭药业	116,300	2,030,598.00	0.20
190	600478	科力远	235,209	2,025,149.49	0.20
191	002444	巨星科技	129,820	2,022,595.60	0.20
192	300001	特锐德	120,400	2,017,904.00	0.20
193	002477	雏鹰农牧	454,361	2,012,819.23	0.20
194	000006	深振业A	228,257	2,010,944.17	0.20
195	600017	日照港	445,710	2,005,695.00	0.20
196	000732	泰禾集团	120,200	2,004,936.00	0.20
197	000758	中色股份	285,500	2,001,355.00	0.20
198	600881	亚泰集团	392,459	1,993,691.72	0.20
199	000975	银泰资源	156,724	1,979,424.12	0.19
200	000031	中粮地产	262,863	1,979,358.39	0.19
201	600125	铁龙物流	220,690	1,977,382.40	0.19
202	603077	和邦生物	387,831	1,974,059.79	0.19
203	600064	南京高科	130,540	1,971,154.00	0.19

204	600348	阳泉煤业	290,400	1,968,912.00	0.19
205	002672	东江环保	116,100	1,960,929.00	0.19
206	000158	常山股份	122,800	1,940,240.00	0.19
207	600565	迪马股份	351,800	1,938,418.00	0.19
208	000939	凯迪生态	379,688	1,936,408.80	0.19
209	000027	深圳能源	287,300	1,933,529.00	0.19
210	000563	陕国投 A	373,338	1,930,157.46	0.19
211	000860	顺鑫农业	96,447	1,929,904.47	0.19
212	002250	联化科技	134,185	1,918,845.50	0.19
213	300287	飞利信	208,000	1,909,440.00	0.19
214	600198	大唐电信	149,112	1,904,160.24	0.19
215	600597	光明乳业	148,600	1,894,650.00	0.19
216	300274	阳光电源	170,820	1,894,393.80	0.19
217	300116	坚瑞沃能	176,200	1,894,150.00	0.19
218	600410	华胜天成	213,438	1,891,060.68	0.19
219	002261	拓维信息	161,000	1,885,310.00	0.19
220	000877	天山股份	148,774	1,884,966.58	0.19
221	600416	湘电股份	137,083	1,878,037.10	0.18
222	002468	申通快递	73,900	1,877,799.00	0.18
223	002308	威创股份	143,240	1,869,282.00	0.18
224	002266	浙富控股	382,357	1,865,902.16	0.18
225	000727	华东科技	656,500	1,857,895.00	0.18
226	603766	隆鑫通用	255,200	1,857,856.00	0.18
227	601717	郑煤机	238,271	1,856,131.09	0.18
228	600687	刚泰控股	143,800	1,852,144.00	0.18
229	600200	江苏吴中	139,502	1,841,426.40	0.18
230	600582	天地科技	399,800	1,835,082.00	0.18
231	002002	鸿达兴业	233,835	1,830,928.05	0.18

232	002353	杰瑞股份	115,600	1,828,792.00	0.18
233	002517	恺英网络	51,900	1,826,361.00	0.18
234	300291	华录百纳	91,172	1,825,263.44	0.18
235	600039	四川路桥	437,584	1,820,349.44	0.18
236	601929	吉视传媒	526,000	1,819,960.00	0.18
237	601928	凤凰传媒	184,400	1,799,744.00	0.18
238	600466	蓝光发展	206,300	1,780,369.00	0.18
239	600282	南钢股份	478,500	1,775,235.00	0.17
240	000712	锦龙股份	108,200	1,771,234.00	0.17
241	002642	荣之联	70,650	1,770,489.00	0.17
242	600751	天海投资	310,700	1,767,883.00	0.17
243	601689	拓普集团	52,700	1,764,923.00	0.17
244	002396	星网锐捷	91,150	1,763,752.50	0.17
245	600086	东方金钰	162,960	1,761,597.60	0.17
246	603000	人民网	133,500	1,758,195.00	0.17
247	300257	开山股份	82,900	1,747,532.00	0.17
248	600380	健康元	191,551	1,739,283.08	0.17
249	002375	亚厦股份	194,200	1,730,322.00	0.17
250	600557	康缘药业	104,143	1,729,815.23	0.17
251	002670	国盛金控	108,480	1,724,832.00	0.17
252	002022	科华生物	98,987	1,719,404.19	0.17
253	000501	鄂武商 A	92,919	1,715,284.74	0.17
254	600151	航天机电	207,873	1,710,794.79	0.17
255	000830	鲁西化工	247,683	1,709,012.70	0.17
256	000519	中兵红箭	135,610	1,708,686.00	0.17
257	002544	杰赛科技	74,700	1,703,160.00	0.17
258	002268	卫士通	101,160	1,701,511.20	0.17
259	300199	翰宇药业	110,900	1,701,206.00	0.17

260	002440	闰土股份	111,077	1,695,035.02	0.17
261	002281	光迅科技	75,923	1,687,009.06	0.17
262	002122	天马股份	163,182	1,680,774.60	0.17
263	002589	瑞康医药	108,950	1,677,830.00	0.17
264	002489	浙江永强	262,739	1,676,274.82	0.16
265	600169	太原重工	433,524	1,673,402.64	0.16
266	600648	外高桥	90,300	1,672,356.00	0.16
267	000703	恒逸石化	117,300	1,670,352.00	0.16
268	600316	洪都航空	103,900	1,669,673.00	0.16
269	600611	大众交通	302,038	1,667,249.76	0.16
270	002155	湖南黄金	174,125	1,666,376.25	0.16
271	002368	太极股份	60,150	1,665,553.50	0.16
272	600366	宁波韵升	94,267	1,662,869.88	0.16
273	600694	大商股份	42,538	1,657,705.86	0.16
274	600759	洲际油气	273,325	1,656,349.50	0.16
275	600270	外运发展	87,444	1,655,314.92	0.16
276	002657	中科金财	57,000	1,652,430.00	0.16
277	600835	上海机电	77,875	1,646,277.50	0.16
278	000528	柳工	190,271	1,643,941.44	0.16
279	002342	巨力索具	162,322	1,634,582.54	0.16
280	600267	海正药业	139,900	1,634,032.00	0.16
281	000612	焦作万方	201,564	1,622,590.20	0.16
282	600108	亚盛集团	376,300	1,621,853.00	0.16
283	300273	和佳股份	133,120	1,618,739.20	0.16
284	002709	天赐材料	39,200	1,613,864.00	0.16
285	600187	国中水务	319,554	1,613,747.70	0.16
286	600563	法拉电子	32,570	1,609,283.70	0.16
287	000090	天健集团	144,640	1,605,504.00	0.16

288	600645	中源协和	74,600	1,598,678.00	0.16
289	601678	滨化股份	229,487	1,594,934.65	0.16
290	002503	搜于特	226,372	1,591,395.16	0.16
291	600993	马应龙	72,807	1,585,736.46	0.16
292	002285	世联行	197,559	1,584,423.18	0.16
293	600848	上海临港	73,300	1,580,348.00	0.16
294	600729	重庆百货	58,846	1,579,426.64	0.16
295	600545	新疆城建	131,583	1,573,732.68	0.15
296	000937	冀中能源	256,000	1,566,720.00	0.15
297	600098	广州发展	197,600	1,563,016.00	0.15
298	600765	中航重机	112,807	1,554,480.46	0.15
299	002437	誉衡药业	212,409	1,546,337.52	0.15
300	000049	德赛电池	29,702	1,538,860.62	0.15
301	002325	洪涛股份	210,347	1,535,533.10	0.15
302	000587	金洲慈航	102,541	1,527,860.90	0.15
303	000021	深科技	177,656	1,524,288.48	0.15
304	002358	森源电气	89,446	1,522,370.92	0.15
305	000810	创维数字	124,900	1,515,037.00	0.15
306	600073	上海梅林	158,529	1,513,951.95	0.15
307	300376	易事特	166,900	1,513,783.00	0.15
308	000543	皖能电力	259,547	1,513,159.01	0.15
309	600422	昆药集团	133,356	1,512,257.04	0.15
310	600750	江中药业	43,503	1,511,729.25	0.15
311	600300	维维股份	282,700	1,509,618.00	0.15
312	002011	盾安环境	132,907	1,508,494.45	0.15
313	002018	华信国际	220,100	1,507,685.00	0.15
314	002249	大洋电机	228,884	1,506,056.72	0.15
315	000829	天音控股	139,162	1,502,949.60	0.15

316	000766	通化金马	93,300	1,490,934.00	0.15
317	000669	金鸿能源	82,167	1,489,687.71	0.15
318	002056	横店东磁	198,500	1,488,750.00	0.15
319	600639	浦东金桥	82,152	1,488,594.24	0.15
320	000061	农产品	163,700	1,483,122.00	0.15
321	000777	中核科技	74,033	1,477,698.68	0.15
322	601016	节能风电	401,500	1,477,520.00	0.15
323	000636	风华高科	172,961	1,471,898.11	0.14
324	000897	津滨发展	312,463	1,468,576.10	0.14
325	002317	众生药业	118,060	1,466,305.20	0.14
326	002242	九阳股份	74,117	1,457,881.39	0.14
327	603188	亚邦股份	83,500	1,456,240.00	0.14
328	601311	骆驼股份	102,419	1,450,253.04	0.14
329	603444	吉比特	5,100	1,444,983.00	0.14
330	600277	亿利洁能	184,100	1,441,503.00	0.14
331	000572	海马汽车	278,011	1,437,316.87	0.14
332	600284	浦东建设	133,850	1,434,872.00	0.14
333	000762	西藏矿业	100,639	1,426,054.63	0.14
334	600259	广晟有色	36,411	1,421,485.44	0.14
335	600651	飞乐音响	167,686	1,420,300.42	0.14
336	000596	古井贡酒	27,800	1,416,410.00	0.14
337	000848	承德露露	141,799	1,415,154.02	0.14
338	600770	综艺股份	188,421	1,413,157.50	0.14
339	600496	精工钢构	291,859	1,409,678.97	0.14
340	600587	新华医疗	78,538	1,396,405.64	0.14
341	002123	梦网荣信	124,800	1,386,528.00	0.14
342	000062	深圳华强	52,230	1,385,661.90	0.14
343	600216	浙江医药	139,500	1,382,445.00	0.14

344	002106	莱宝高科	136,360	1,381,326.80	0.14
345	002276	万马股份	136,111	1,373,359.99	0.14
346	002254	泰和新材	103,248	1,373,198.40	0.14
347	002479	富春环保	115,383	1,373,057.70	0.14
348	600536	中国软件	71,618	1,372,200.88	0.14
349	002064	华峰氨纶	283,470	1,366,325.40	0.13
350	300010	立思辰	105,300	1,363,635.00	0.13
351	002428	云南锗业	126,135	1,347,121.80	0.13
352	002482	广田集团	149,783	1,346,549.17	0.13
353	002073	软控股份	158,660	1,345,436.80	0.13
354	002707	众信旅游	101,800	1,336,634.00	0.13
355	600458	时代新材	116,312	1,331,772.40	0.13
356	002332	仙琚制药	154,831	1,331,546.60	0.13
357	600171	上海贝岭	130,175	1,323,879.75	0.13
358	000652	泰达股份	249,464	1,322,159.20	0.13
359	002128	露天煤业	150,336	1,307,923.20	0.13
360	000680	山推股份	239,703	1,306,381.35	0.13
361	000620	新华联	183,187	1,302,459.57	0.13
362	000969	安泰科技	148,635	1,297,583.55	0.13
363	002505	大康农业	369,690	1,293,915.00	0.13
364	000541	佛山照明	141,943	1,293,100.73	0.13
365	600428	中远海特	207,352	1,289,729.44	0.13
366	002463	沪电股份	283,055	1,287,900.25	0.13
367	000726	鲁泰 A	108,519	1,287,035.34	0.13
368	600058	五矿发展	103,500	1,284,435.00	0.13
369	000099	中信海直	113,608	1,279,226.08	0.13
370	001696	宗申动力	165,871	1,255,643.47	0.12
371	002690	美亚光电	65,300	1,252,454.00	0.12

372	603883	老百姓	25,700	1,250,305.00	0.12
373	600329	中新药业	68,664	1,243,505.04	0.12
374	300297	蓝盾股份	113,500	1,242,825.00	0.12
375	600517	置信电气	163,782	1,239,829.74	0.12
376	601233	桐昆股份	89,208	1,236,422.88	0.12
377	300043	星辉娱乐	150,200	1,233,142.00	0.12
378	600894	广日股份	103,849	1,229,572.16	0.12
379	600736	苏州高新	173,088	1,223,732.16	0.12
380	000426	兴业矿业	135,340	1,220,766.80	0.12
381	601777	力帆股份	151,676	1,219,475.04	0.12
382	603888	新华网	37,550	1,216,244.50	0.12
383	600859	王府井	75,000	1,211,250.00	0.12
384	002063	远光软件	116,110	1,209,866.20	0.12
385	600805	悦达投资	164,434	1,208,589.90	0.12
386	603556	海兴电力	27,500	1,206,975.00	0.12
387	600880	博瑞传播	184,800	1,206,744.00	0.12
388	600586	金晶科技	246,685	1,206,289.65	0.12
389	600790	轻纺城	176,980	1,205,233.80	0.12
390	603369	今世缘	90,900	1,199,880.00	0.12
391	600338	西藏珠峰	31,500	1,196,685.00	0.12
392	000616	海航投资	276,370	1,188,391.00	0.12
393	000552	靖远煤电	331,400	1,183,098.00	0.12
394	600220	江苏阳光	344,550	1,181,806.50	0.12
395	002663	普邦股份	216,892	1,177,723.56	0.12
396	600720	祁连山	150,003	1,174,523.49	0.12
397	600289	亿阳信通	107,202	1,172,789.88	0.12
398	600395	盘江股份	159,900	1,172,067.00	0.12
399	600773	西藏城投	105,684	1,169,921.88	0.12

400	603816	顾家家居	19,900	1,169,722.00	0.12
401	002727	一心堂	62,800	1,155,520.00	0.11
402	002681	奋达科技	91,380	1,150,474.20	0.11
403	300147	香雪制药	111,850	1,148,699.50	0.11
404	603377	东方时尚	30,400	1,142,736.00	0.11
405	601886	江河集团	111,417	1,142,024.25	0.11
406	002120	韵达股份	22,000	1,135,200.00	0.11
407	603355	莱克电气	19,300	1,134,261.00	0.11
408	002269	美邦服饰	303,400	1,131,682.00	0.11
409	600006	东风汽车	193,232	1,130,407.20	0.11
410	300039	上海凯宝	155,251	1,128,674.77	0.11
411	002041	登海种业	85,028	1,126,621.00	0.11
412	002005	德豪润达	236,055	1,125,982.35	0.11
413	600801	华新水泥	117,456	1,119,355.68	0.11
414	002190	成飞集成	41,700	1,117,560.00	0.11
415	002345	潮宏基	102,057	1,109,359.59	0.11
416	600596	新安股份	131,218	1,108,792.10	0.11
417	002277	友阿股份	171,034	1,103,169.30	0.11
418	603198	迎驾贡酒	57,900	1,101,837.00	0.11
419	600280	中央商场	138,634	1,099,367.62	0.11
420	600053	九鼎投资	31,400	1,097,744.00	0.11
421	300032	金龙机电	78,600	1,096,470.00	0.11
422	300202	聚龙股份	66,300	1,095,276.00	0.11
423	600757	长江传媒	146,516	1,094,474.52	0.11
424	000417	合肥百货	131,876	1,087,977.00	0.11
425	600059	古越龙山	117,134	1,083,489.50	0.11
426	600628	新世界	93,686	1,082,073.30	0.11
427	600869	智慧能源	160,776	1,082,022.48	0.11

428	600460	士兰微	178,129	1,081,243.03	0.11
429	002588	史丹利	139,680	1,074,139.20	0.11
430	600141	兴发集团	86,600	1,071,242.00	0.11
431	601001	大同煤业	203,728	1,069,572.00	0.11
432	600580	卧龙电气	155,619	1,061,321.58	0.10
433	002371	北方华创	44,300	1,059,656.00	0.10
434	000681	视觉中国	67,600	1,058,616.00	0.10
435	002147	新光圆成	67,900	1,055,166.00	0.10
436	002233	塔牌集团	86,351	1,050,891.67	0.10
437	600754	锦江股份	38,700	1,048,770.00	0.10
438	600481	双良节能	195,640	1,038,848.40	0.10
439	002344	海宁皮城	123,900	1,030,848.00	0.10
440	600657	信达地产	177,654	1,023,287.04	0.10
441	600292	远达环保	94,266	1,016,187.48	0.10
442	600195	中牧股份	51,898	1,006,302.22	0.10
443	601002	晋亿实业	114,893	993,824.45	0.10
444	600537	亿晶光电	198,840	990,223.20	0.10
445	600971	恒源煤电	120,753	981,721.89	0.10
446	600862	中航高科	100,900	977,721.00	0.10
447	600640	号百控股	57,600	973,440.00	0.10
448	002309	中利集团	77,372	967,923.72	0.10
449	600748	上实发展	133,587	961,826.40	0.09
450	600743	华远地产	226,694	956,648.68	0.09
451	600184	光电股份	49,150	922,054.00	0.09
452	600826	兰生股份	50,799	919,461.90	0.09
453	002699	美盛文化	65,840	908,592.00	0.09
454	600251	冠农股份	113,844	907,336.68	0.09
455	600996	贵广网络	75,600	904,932.00	0.09

456	603169	兰石重装	74,400	903,960.00	0.09
457	600335	国机汽车	74,550	891,618.00	0.09
458	600831	广电网络	87,646	872,077.70	0.09
459	002551	尚荣医疗	53,584	864,309.92	0.09
460	002392	北京利尔	144,700	858,071.00	0.08
461	002093	国脉科技	97,300	856,240.00	0.08
462	002118	紫鑫药业	123,700	844,871.00	0.08
463	002414	高德红外	45,278	828,587.40	0.08
464	002416	爱施德	74,800	807,092.00	0.08
465	600776	东方通信	115,434	782,642.52	0.08
466	000536	华映科技	133,600	776,216.00	0.08
467	002251	步步高	62,599	775,601.61	0.08
468	600551	时代出版	48,917	772,399.43	0.08
469	603005	晶方科技	27,300	764,127.00	0.08
470	002646	青青稞酒	43,517	759,806.82	0.07
471	603698	航天工程	29,803	751,035.60	0.07
472	603001	奥康国际	38,745	728,018.55	0.07
473	603568	伟明环保	33,200	717,784.00	0.07
474	000517	荣安地产	153,900	715,635.00	0.07
475	603868	飞科电器	11,500	711,160.00	0.07
476	603567	珍宝岛	41,000	690,030.00	0.07
477	603328	依顿电子	48,200	682,030.00	0.07
478	000025	特力A	13,000	672,620.00	0.07
479	600936	广西广电	80,700	651,249.00	0.06
480	600126	杭钢股份	94,100	645,526.00	0.06
481	603528	多伦科技	44,900	645,213.00	0.06
482	002807	江阴银行	51,200	641,536.00	0.06
483	603806	福斯特	19,400	620,994.00	0.06

484	600618	氯碱化工	54,246	579,347.28	0.06
485	603228	景旺电子	11,800	569,350.00	0.06
486	002315	焦点科技	22,664	565,240.16	0.06
487	601020	华钰矿业	25,300	557,359.00	0.05
488	603515	欧普照明	15,300	552,636.00	0.05
489	603866	桃李面包	15,200	540,816.00	0.05
490	002194	武汉凡谷	54,494	482,271.90	0.05
491	603658	安图生物	10,100	435,310.00	0.04
492	002815	崇达技术	12,800	422,912.00	0.04
493	002818	富森美	10,600	418,382.00	0.04
494	600917	重庆燃气	41,300	389,459.00	0.04
495	601811	新华文轩	24,800	385,888.00	0.04
496	603877	太平鸟	13,700	383,463.00	0.04
497	000761	本钢板材	72,700	380,221.00	0.04
498	603569	长久物流	10,600	354,358.00	0.03
499	603025	大豪科技	11,800	311,520.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002168	深圳惠程	188,825	3,208,136.75	0.32
2	002399	海普瑞	101,400	2,051,322.00	0.20
3	002025	航天电器	67,376	1,681,031.20	0.17
4	000693	*ST 华泽	55,900	698,750.00	0.07
5	600468	百利电气	77,327	502,625.50	0.05
6	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
7	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00

8	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
9	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
10	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
11	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
12	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
13	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
14	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
15	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
16	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
17	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
18	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
19	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
20	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
21	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
22	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	000066	长城电脑	4,408,542.76	0.47
2	600642	申能股份	4,080,116.51	0.43
3	000778	新兴铸管	3,395,221.90	0.36
4	603799	华友钴业	3,138,342.56	0.33
5	000039	中集集团	3,105,915.80	0.33
6	600839	四川长虹	3,104,270.00	0.33

7	300002	神州泰岳	2,815,138.13	0.30
8	300383	光环新网	2,582,513.00	0.27
9	300058	蓝色光标	2,523,203.48	0.27
10	002583	海能达	2,512,238.82	0.27
11	002127	南极电商	2,267,226.68	0.24
12	002601	龙蟠佰利	2,250,580.00	0.24
13	000729	燕京啤酒	2,244,493.00	0.24
14	600566	济川药业	2,195,095.73	0.23
15	300146	汤臣倍健	2,084,931.09	0.22
16	000732	泰禾集团	1,995,233.52	0.21
17	000027	深圳能源	1,946,405.11	0.21
18	002670	国盛金控	1,849,692.40	0.20
19	002468	申通快递	1,823,821.03	0.19
20	600176	中国巨石	1,802,861.80	0.19

7.4.2 累计卖出金额前 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	600522	中天科技	5,869,329.46	0.62
2	002508	老板电器	5,863,974.94	0.62
3	600682	南京新百	5,028,834.62	0.54
4	000066	长城电脑	5,015,959.14	0.53
5	600436	片仔癀	4,640,193.20	0.49
6	000887	中鼎股份	3,557,606.84	0.38
7	000959	首钢股份	2,985,649.17	0.32
8	002602	世纪华通	2,972,712.76	0.32
9	600497	驰宏锌锗	2,817,288.94	0.30

10	002595	豪迈科技	2,444,535.53	0.26
11	600549	厦门钨业	2,295,639.00	0.24
12	600601	方正科技	2,277,792.66	0.24
13	000961	中南建设	2,105,954.70	0.22
14	600067	冠城大通	1,921,478.52	0.20
15	600575	皖江物流	1,888,621.76	0.20
16	600851	海欣股份	1,730,306.08	0.18
17	600175	美都能源	1,647,449.01	0.18
18	002581	未名医药	1,617,826.95	0.17
19	000973	佛塑科技	1,593,718.29	0.17
20	600823	世茂股份	1,541,602.04	0.16

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	277,077,837.64
卖出股票收入（成交）总额	236,475,316.75

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

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 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1709	中证 500 股指期货 IC1709 合约	35	42,152,600.00	2,121,880.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					2,121,880.00
股指期货投资本期收益 (元)					184,680.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					3,530,000.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,492,753.92
2	应收证券清算款	5,238,670.79

3	应收股利	-
4	应收利息	-2,900.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,728,523.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	6,363,158.40	0.63	重大事项停牌
2	600643	爱建集团	5,933,817.68	0.58	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002168	深圳惠程	3,208,136.75	0.32	重大事项停牌
2	002399	海普瑞	2,051,322.00	0.20	重大事项停牌
3	002025	航天电器	1,681,031.20	0.17	重大事项停牌
4	000693	*ST 华泽	698,750.00	0.07	重大事项停牌
5	600468	百利电气	502,625.50	0.05	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

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,895	85,478.56	148,190,945.00	91.49%	13,790,923.00	8.51%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
嘉实中证 500ETF 联接	101,914,880.00	62.92%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中国证券金融股份有限公司	40,950,000.00	25.28%
2	天津珍熙美容实业有限公司	2,536,005.00	1.57%
3	百年人寿保险股份有限公司—传统 保险产品	1,500,000.00	0.93%
4	张鹤林	685,400.00	0.42%
5	方正证券股份有限公司	553,246.00	0.34%
6	杨碧茹	409,124.00	0.25%
7	朱婕	397,203.00	0.25%
8	马玉敏	309,999.00	0.19%

9	杨锦华	307,970.00	0.19%
10	汇丰人寿保险有限公司－平衡增长 投资账户	300,000.00	0.19%
11	中国建设银行股份有限公司－嘉实 中证 500 交易型开放式指数证券投 资基金联接基金	101,914,880.00	62.92%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 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 2 月 6 日）基金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	148,931,868.00
本报告期基金总申购份额	52,650,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	39,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	161,981,868.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
中信建投证 券股份有限 公司	2	194,158,213.46	38.69%	135,915.46	38.69%	-
华泰证券股 份有限公司	1	132,873,620.19	26.48%	93,011.94	26.48%	-
招商证券股 份有限公司	1	90,144,284.84	17.97%	63,103.19	17.97%	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	44,617,972.56	8.89%	31,233.11	8.89%	-
海通证券股 份有限公司	1	34,390,010.29	6.85%	24,073.19	6.85%	-
广发证券股 份有限公司	1	5,589,255.13	1.11%	3,912.73	1.11%	-
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部证券有限	1	-	-	-	-	-

公司						
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：中投证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证

		例		成交总额 的比例		成交总额 的比例
中信建投证 券股份有限 公司	91,715.00	100.00%	88,000,000.00	3.83%	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	531,000,000.00	23.13%	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	15,000,000.00	0.65%	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	1,178,200,000.00	51.31%	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	230,000,000.00	10.02%	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	254,000,000.00	11.06%	-	-

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	关于可对嘉实沪深 300ETF 和嘉实 中证 500ETF 设置申购上限、赎回 上限的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、管 理人网站	2017 年 3 月 31 日

§ 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	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	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额占 比

别		20%的时间 区间					
机 构	1	2017/01/01 至 2017/06/30	40,950,000.00	-	-	40,950,000.00	25.28%
个 人	-	-	-	-	-	-	-
联 接 基 金	1	2017/01/01 至 2017/06/30	89,188,780.00	142,175,200.00	129,449,100.00	101,914,880.00	62.92%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨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，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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

- (1) 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司
- (2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- (2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日