

华夏中证 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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	299,208,794 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 29 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	-41,685,598.79
本期利润	-11,504,098.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0377
本期加权平均净值利润率	-1.25%
本期基金份额净值增长率	-1.50%
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	-473,851,339.54
期末可供分配基金份额利润	-1.5837
期末基金资产净值	893,102,613.05
期末基金份额净值	2.9849
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	-34.66%

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.64%	0.92%	5.39%	0.93%	0.25%	-0.01%

过去三个月	-3.38%	1.00%	-4.12%	1.02%	0.74%	-0.02%
过去六个月	-1.50%	0.87%	-2.00%	0.90%	0.50%	-0.03%
过去一年	1.10%	0.89%	0.24%	0.91%	0.86%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-34.66%	2.18%	-27.88%	2.27%	-6.78%	-0.09%

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

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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批

RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF 和华夏快线 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数、海外市场指数等的产品线。今年 6 月，A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，作为境内率先推出的跟踪 MSCI 中国 A 股指数的 ETF 基金，华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 受到市场广泛关注。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面，2017 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2016-10-20	-	7 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。
方军	本基金的基金经理、数量投资部总监	2015-05-05	2017-03-24	18 年	硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理、华夏回报证券投资基金基金经理助理、数量投资部副总经理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年，国际方面，美国经济持续复苏，美联储加息 50bp；欧洲经济继续改善，但政治不确定性仍是重大风险隐患。国内方面，经济企稳态势延续，出口形势转暖，消费保持平稳，在供给侧改革、基建与房地产投资拉动等因素影响下，工业品价格脱离底部低位，企业利润增长加快，但 CPI 仍总体可控。报告期内，外汇市场较为稳定，货币政策保持中性，但监管部门重点防范潜在风险，房地产领域维持高压、金融领域严格推进“去杠杆”，市场资金利率中枢有一定的抬升。

市场方面，一季度在国内外基本面企稳确认、工业品价格持续上涨、企业盈利恢复、居民消费升级等因素带动下，市场走出了一波震荡上涨行情。二季度期初，工业品价格环比回落、金融领域加强监管等因素对风险偏好形成一定压制，市场有所调整，但在雄安新区、监管节奏调整、A 股纳

入 MSCI 等因素影响下，市场走出了一波以蓝筹龙头股板块为代表的震荡上涨行情。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.9849 元，本报告期份额净值增长率为-1.50%，同期中证 500 指数增长率为-2.00%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.50%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国际方面，在经济保持平稳增长的前提下，美国预期还会有一次加息，利率抬升一定程度后美联储或将启动缩表程序；英国脱欧对欧洲的负面影响继续消散，短期政治风险继续减弱，在依旧宽松的货币政策下预计欧洲经济走势仍持续缓慢回暖。国内方面，在供给侧结构性改革深入实施、创新驱动发展战略加快推进的背景下，我国实体经济运行当中的积极变化还会继续增加，稳中向好的发展态势将进一步巩固；货币政策仍会维持上半年的中性偏紧的态势，在长期性的金融严监管之下，股市的推动因素基本面重于资金面，但整体宏观环境仍然利好股市，在基本面继续向好的情况下，中证 500 指数有望有较好的投资机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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：华夏中证 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	18,034,457.09	44,479,362.72
结算备付金		13,145,496.52	28,541,422.15
存出保证金		9,039,548.15	12,422,747.10
交易性金融资产	6.4.7.2	846,005,870.22	861,940,945.30
其中：股票投资		845,567,100.02	861,543,712.18
基金投资		-	-
债券投资		438,770.20	397,233.12
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	11,500,000.00	-
应收证券清算款		260,153.14	-
应收利息	6.4.7.5	16,109.05	27,658.94
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		898,001,634.17	947,412,136.21
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		4,261,182.81	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		356,136.64	408,185.46
应付托管费		71,227.30	81,637.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,187.68	65,074.17
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	170,286.69	144,581.71
负债合计		4,899,021.12	699,478.42

所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,366,953,952.59	1,427,258,972.09
未分配利润	6.4.7.10	-473,851,339.54	-480,546,314.30
所有者权益合计		893,102,613.05	946,712,657.79
负债和所有者权益总计		898,001,634.17	947,412,136.21

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.9849 元，基金份额总额 299,208,794 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		-8,340,611.61	-208,613,051.85
1.利息收入		325,161.25	333,396.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	260,666.65	332,844.14
债券利息收入		679.46	552.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		63,815.14	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-38,853,978.81	-69,185,708.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-42,353,387.88	-69,207,342.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	132,798.55
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-1,259,160.00	-4,890,440.00
股利收益	6.4.7.17	4,758,569.07	4,779,275.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	30,181,500.20	-139,946,568.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	6,705.75	185,828.38
减：二、费用		3,163,486.98	3,293,753.01
1.管理人报酬		2,279,610.85	2,318,584.74
2.托管费		455,922.06	463,716.95
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	181,691.80	263,089.66
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.21	246,262.27	248,361.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号		-11,504,098.59	-211,906,804.86

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,504,098.59	-211,906,804.86

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	1,427,258,972.09	-480,546,314.30	946,712,657.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,504,098.59	-11,504,098.59
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）	-60,305,019.50	18,199,073.35	-42,105,946.15
其中：1.基金申购款	21,929,098.03	-7,901,960.71	14,027,137.32
2.基金赎回款	-82,234,117.53	26,101,034.06	-56,133,083.47
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）	1,366,953,952.59	-473,851,339.54	893,102,613.05
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）	1,443,705,795.55	-297,584,459.60	1,146,121,335.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-211,906,804.86	-211,906,804.86
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）	65,787,294.09	-24,542,573.48	41,244,720.61
其中：1.基金申购款	120,610,039.15	-45,310,311.29	75,299,727.86
2.基金赎回款	-54,822,745.06	20,767,737.81	-34,055,007.25
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)	1,509,493,089.64	-534,033,837.94	975,459,251.70

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：杨明辉，主管会计工作负责人：汪贵华，会计机构负责人：汪贵华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]113 号《关于准予华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 2,134,343,230 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

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 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证

监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。
- 4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1

个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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	18,034,457.09
定期存款	-
其他存款	-
合计	18,034,457.09

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	1,057,449,446.62	845,567,100.02	-211,882,346.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	428,200.00	438,770.20
	银行间市场	-	-
	合计	428,200.00	438,770.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,057,877,646.62	846,005,870.22	-211,871,776.40

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	45,064,760.00	-	-	-
其中：股指期货	45,064,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	45,064,760.00	-	-	-

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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1707	中证 500 股指期货 IC1707 合约	31	37,838,600.00	954,120.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理
IC1709	中证 500 股指期货 IC1709 合约	6	7,226,160.00	144,200.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理
公允价值变动总额合计(元)					1,098,320.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,259,160.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					811,880.00

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
合计	11,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	4,765.40
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	6,882.31
应收债券利息	711.03
应收买入返售证券利息	3,738.31

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.00
合计	16,109.05

6.4.7.6 其他资产

无。

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	40,187.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,187.68

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	104,136.54
应付指数使用费	66,150.15
合计	170,286.69

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	312,408,794.00	1,427,258,972.09
本期申购	4,800,000.00	21,929,098.03
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-82,234,117.53
本期末	299,208,794.00	1,366,953,952.59

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	-208,660,772.23	-271,885,542.07	-480,546,314.30
本期利润	-41,685,598.79	30,181,500.20	-11,504,098.59
本期基金份额交易产生的变动数	9,138,299.10	9,060,774.25	18,199,073.35

其中：基金申购款	-3,389,207.24	-4,512,753.47	-7,901,960.71
基金赎回款	12,527,506.34	13,573,527.72	26,101,034.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-241,208,071.92	-232,643,267.62	-473,851,339.54

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	134,122.32
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	126,332.50
其他	211.83
合计	260,666.65

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	-35,877,232.03
股票投资收益——赎回差价收入	-6,476,155.85
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-42,353,387.88

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	120,501,028.42
减：卖出股票成本总额	156,378,260.45
买卖股票差价收入	-35,877,232.03

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	56,133,083.47
减：现金支付赎回款总额	30,320,078.47
减：赎回股票成本总额	32,289,160.85
赎回差价收入	-6,476,155.85

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	-1,259,160.00
合计	-1,259,160.00

6.4.7.17 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	4,758,569.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,758,569.07

6.4.7.18 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	29,369,620.20
——股票投资	29,405,083.12
——债券投资	-35,462.92
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	811,880.00
——权证投资	-
——股指期货投资	811,880.00
4.其他	-
合计	30,181,500.20

6.4.7.19 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	-
替代损益	6,705.75
合计	6,705.75

6.4.7.20 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	181,691.80
银行间市场交易费用	-
合计	181,691.80

6.4.7.21 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	34,712.18
信息披露费	39,671.58
指数使用费	136,776.64
上市费	29,752.78
银行费用	4,989.09
其他费用	360.00
合计	246,262.27

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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("华夏中证 500ETF 联接")	该基金是本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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	2,279,610.85	2,318,584.74

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	455,922.06	463,716.95

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

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

无。

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

无。

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
中信证券	151,384.00	0.05%	14,267.00	0.00%
华夏中证 500ETF 联接	226,694,118.00	75.76%	236,097,342.00	75.57%

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

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
中国建设银行活期存款	18,034,457.09	134,122.32	33,802,117.35	176,481.31

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满	2017-06-27	2017-07-05	新发	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

	电子			流通受限						
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
000656	金科股份	2017-05-05	重大事项	6.54	2017-07-05	5.92	800,900	4,636,614.58	5,237,886.00	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	14.98	2017-08-02	16.48	307,130	4,907,441.31	4,600,807.40	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项	16.99	-	-	183,200	2,607,793.97	3,112,568.00	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大事项	15.75	2017-08-09	14.50	196,766	2,816,737.90	3,099,064.50	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大事项	7.29	-	-	376,743	3,167,108.37	2,746,456.47	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项	11.32	-	-	212,500	4,453,573.36	2,405,500.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	206,812	2,446,592.82	2,136,367.96	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大事项	23.36	-	-	85,600	2,996,439.68	1,999,616.00	-
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-07-06	12.61	150,800	1,852,998.00	1,821,664.00	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23	-	-	80,200	1,439,790.72	1,622,446.00	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大事项	7.79	-	-	202,200	1,996,906.32	1,575,138.00	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04	22.46	62,850	1,658,494.44	1,568,107.50	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大事项	20.02	-	-	69,400	3,004,727.20	1,389,388.00	-
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大事项	7.83	-	-	176,200	1,115,219.03	1,379,646.00	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	54,500	2,522,886.47	1,365,770.00	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项	17.02	2017-07-12	16.68	80,000	1,708,242.69	1,361,600.00	-
600545	新疆	2017-06-22	重大事	11.96	2017-07-03	12.44	113,500	1,848,241.23	1,357,460.00	-

	城建		项							
002122	天马股份	2017-04-24	重大事项	10.30	2017-07-24	11.15	127,000	1,272,884.13	1,308,100.00	-
002505	大康农业	2017-03-13	重大事项	3.50	-	-	364,040	1,395,907.59	1,274,140.00	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项	8.70	2017-08-14	9.57	143,400	1,493,221.31	1,247,580.00	-
000061	农产品	2017-06-28	重大事项	9.06	-	-	133,100	1,199,599.60	1,205,886.00	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项	10.94	2017-08-18	12.03	94,100	2,113,732.01	1,029,454.00	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大事项	11.26	-	-	90,500	1,772,817.74	1,019,030.00	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	78,260	1,532,296.34	985,293.40	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大事项	6.07	2017-08-15	6.68	160,300	1,393,443.87	973,021.00	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大事项	5.76	2017-08-10	6.19	161,400	1,291,437.36	929,664.00	-
601001	大同煤业	2017-06-22	重大事项	5.25	2017-07-21	5.78	175,600	1,430,965.96	921,900.00	-
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	-	-	66,000	1,723,678.74	825,000.00	-
600468	百利电气	2017-05-16	重大事项	6.50	-	-	69,600	922,657.37	452,400.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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	845,567,100.02	94.68	861,543,712.18	91.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	845,567,100.02	94.68	861,543,712.18	91.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为中证 500 指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定中证 500 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	+5%	45,512,509.16	49,674,013.15
	-5%	-45,512,509.16	-49,674,013.15

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

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

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 846,005,870.22 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止：

第一层次的余额为 861,940,945.30 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。)

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.5 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。

§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	845,567,100.02	94.16
	其中：股票	845,567,100.02	94.16
2	固定收益投资	438,770.20	0.05
	其中：债券	438,770.20	0.05
	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	11,500,000.00	1.28
	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	31,179,953.61	3.47
7	其他各项资产	9,315,810.34	1.04
8	合计	898,001,634.17	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 报告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

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	10,631,482.80	1.19
B	采矿业	27,439,427.95	3.07
C	制造业	527,584,162.86	59.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,743,260.10	3.22
E	建筑业	19,054,797.63	2.13
F	批发和零售业	43,961,028.54	4.92
G	交通运输、仓储和邮政业	22,420,779.36	2.51
H	住宿和餐饮业	886,170.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,615,953.64	6.45
J	金融业	12,715,688.40	1.42
K	房地产业	52,586,543.72	5.89
L	租赁和商务服务业	15,608,645.89	1.75
M	科学研究和技术服务业	2,042,098.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	7,352,550.60	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	977,340.00	0.11
Q	卫生和社会工作	2,168,223.20	0.24
R	文化、体育和娱乐业	9,908,654.38	1.11
S	综合	3,870,292.95	0.43
	合计	845,567,100.02	94.68

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	163,800	6,555,276.00	0.73
2	000656	金科股份	800,900	5,237,886.00	0.59
3	002460	赣锋锂业	110,800	5,124,500.00	0.57
4	600487	亨通光电	182,600	5,121,930.00	0.57

5	002572	索菲亚	116,500	4,776,500.00	0.53
6	600643	爱建集团	307,130	4,600,807.40	0.52
7	600201	生物股份	128,910	4,585,328.70	0.51
8	601012	隆基股份	251,500	4,300,650.00	0.48
9	300156	神雾环保	127,000	4,160,520.00	0.47
10	002271	东方雨虹	111,300	4,129,230.00	0.46
11	600176	中国巨石	363,024	3,986,003.52	0.45
12	600219	南山铝业	1,166,950	3,955,960.50	0.44
13	600525	长园集团	276,858	3,762,500.22	0.42
14	002405	四维图新	188,728	3,729,265.28	0.42
15	600079	人福医药	189,294	3,713,948.28	0.42
16	000661	长春高新	28,620	3,695,128.20	0.41
17	600315	上海家化	113,300	3,676,585.00	0.41
18	603799	华友钴业	59,200	3,598,176.00	0.40
19	000050	深天马 A	174,500	3,589,465.00	0.40
20	600642	申能股份	555,600	3,500,280.00	0.39
21	000066	中国长城	385,302	3,471,571.02	0.39
22	000998	隆平高科	157,000	3,457,140.00	0.39
23	002092	中泰化学	270,700	3,437,890.00	0.38
24	600584	长电科技	212,433	3,409,549.65	0.38
25	002340	格林美	560,742	3,392,489.10	0.38
26	300115	长盈精密	113,760	3,319,516.80	0.37
27	300266	兴源环境	107,900	3,314,688.00	0.37
28	300296	利亚德	171,200	3,218,560.00	0.36
29	000997	新大陆	138,100	3,133,489.00	0.35
30	002168	深圳惠程	183,200	3,112,568.00	0.35
31	300088	长信科技	196,766	3,099,064.50	0.35
32	601168	西部矿业	402,100	3,092,149.00	0.35
33	600516	方大炭素	216,900	3,084,318.00	0.35
34	600879	航天电子	346,100	3,042,219.00	0.34
35	002050	三花智控	186,200	3,038,784.00	0.34
36	600325	华发股份	363,360	3,034,056.00	0.34
37	002422	科伦药业	181,700	3,001,684.00	0.34
38	000786	北新建材	188,000	2,977,920.00	0.33
39	600291	西水股份	135,300	2,976,600.00	0.33
40	600056	中国医药	112,300	2,914,185.00	0.33
41	000581	威孚高科	111,200	2,880,080.00	0.32
42	600266	北京城建	197,700	2,874,558.00	0.32
43	600426	华鲁恒升	243,205	2,855,226.70	0.32
44	002407	多氟多	129,800	2,854,302.00	0.32
45	600022	山东钢铁	1,367,060	2,816,143.60	0.32
46	600388	龙净环保	179,900	2,793,847.00	0.31
47	600166	福田汽车	981,800	2,788,312.00	0.31

48	600161	天坛生物	71,431	2,772,237.11	0.31
49	600521	华海药业	131,571	2,768,253.84	0.31
50	000039	中集集团	153,000	2,758,590.00	0.31
51	600673	东阳光科	376,743	2,746,456.47	0.31
52	000778	新兴铸管	405,900	2,719,530.00	0.30
53	600839	四川长虹	751,200	2,719,344.00	0.30
54	600435	北方导航	186,100	2,663,091.00	0.30
55	002410	广联达	141,200	2,654,560.00	0.30
56	000970	中科三环	179,104	2,647,157.12	0.30
57	600528	中铁工业	185,000	2,643,650.00	0.30
58	000999	华润三九	82,300	2,613,025.00	0.29
59	002311	海大集团	142,400	2,601,648.00	0.29
60	002179	中航光电	83,088	2,591,514.72	0.29
61	002217	合力泰	260,000	2,568,800.00	0.29
62	002366	台海核电	54,700	2,565,977.00	0.29
63	600138	中青旅	121,799	2,565,086.94	0.29
64	600699	均胜电子	79,800	2,560,782.00	0.29
65	000028	国药一致	31,458	2,544,952.20	0.28
66	600600	青岛啤酒	72,400	2,541,240.00	0.28
67	002573	清新环境	134,400	2,529,408.00	0.28
68	002038	双鹭药业	86,300	2,515,645.00	0.28
69	600978	宜华生活	249,300	2,505,465.00	0.28
70	601000	唐山港	479,180	2,501,319.60	0.28
71	002223	鱼跃医疗	105,391	2,495,658.88	0.28
72	600260	凯乐科技	97,000	2,457,980.00	0.28
73	600614	鹏起科技	222,400	2,446,400.00	0.27
74	603589	口子窖	63,000	2,443,770.00	0.27
75	600158	中体产业	141,800	2,424,780.00	0.27
76	000488	晨鸣纸业	187,300	2,416,170.00	0.27
77	600655	豫园商城	212,500	2,405,500.00	0.27
78	300383	光环新网	176,500	2,393,340.00	0.27
79	000878	云南铜业	178,600	2,355,734.00	0.26
80	300113	顺网科技	87,200	2,345,680.00	0.26
81	002004	华邦健康	299,300	2,343,519.00	0.26
82	300055	万邦达	127,300	2,342,320.00	0.26
83	300002	神州泰岳	279,300	2,329,362.00	0.26
84	002078	太阳纸业	316,800	2,328,480.00	0.26
85	600503	华丽家族	336,800	2,327,288.00	0.26
86	002030	达安基因	106,666	2,324,252.14	0.26
87	600511	国药股份	64,100	2,322,984.00	0.26
88	002273	水晶光电	111,500	2,300,245.00	0.26
89	002019	亿帆医药	137,600	2,295,168.00	0.26
90	002583	海能达	142,100	2,286,389.00	0.26

91	000400	许继电气	127,300	2,286,308.00	0.26
92	603019	中科曙光	80,300	2,259,642.00	0.25
93	600298	安琪酵母	86,650	2,241,635.50	0.25
94	000566	海南海药	168,700	2,236,962.00	0.25
95	600755	厦门国贸	244,900	2,233,488.00	0.25
96	002244	滨江集团	321,894	2,227,506.48	0.25
97	002001	新 和 成	114,500	2,222,445.00	0.25
98	600392	盛和资源	168,475	2,222,185.25	0.25
99	002384	东山精密	89,900	2,220,530.00	0.25
100	600808	马钢股份	627,200	2,220,288.00	0.25
101	600635	大众公用	407,000	2,218,150.00	0.25
102	600633	浙数文化	114,600	2,214,072.00	0.25
103	300324	旋极信息	120,800	2,203,392.00	0.25
104	600717	天津港	176,100	2,199,489.00	0.25
105	000547	航天发展	210,370	2,198,366.50	0.25
106	002439	启明星辰	117,933	2,193,553.80	0.25
107	000930	中粮生化	202,700	2,185,106.00	0.24
108	000401	冀东水泥	141,700	2,180,763.00	0.24
109	000418	小天鹅 A	46,400	2,171,056.00	0.24
110	300244	迪安诊断	68,920	2,168,223.20	0.24
111	601231	环旭电子	137,200	2,155,412.00	0.24
112	600122	宏图高科	193,976	2,153,133.60	0.24
113	600240	华业资本	237,600	2,152,656.00	0.24
114	600872	中炬高新	117,300	2,146,590.00	0.24
115	002400	省广股份	267,014	2,144,122.42	0.24
116	600160	巨化股份	177,600	2,136,528.00	0.24
117	002176	江特电机	245,000	2,136,400.00	0.24
118	002013	中航机电	206,812	2,136,367.96	0.24
119	600409	三友化工	211,300	2,127,791.00	0.24
120	002491	通鼎互联	158,300	2,127,552.00	0.24
121	600143	金发科技	351,333	2,118,537.99	0.24
122	000598	兴蓉环境	376,700	2,117,054.00	0.24
123	000960	锡业股份	154,700	2,105,467.00	0.24
124	600418	江淮汽车	199,100	2,100,505.00	0.24
125	600500	XD 中化国	219,000	2,093,640.00	0.23
126	600062	华润双鹤	76,200	2,090,166.00	0.23
127	000825	太钢不锈	479,100	2,084,085.00	0.23
128	300159	新研股份	156,600	2,073,384.00	0.23
129	002408	齐翔腾达	186,619	2,067,738.52	0.23
130	300146	汤臣倍健	149,600	2,055,504.00	0.23
131	300058	蓝色光标	261,500	2,044,930.00	0.23
132	600594	益佰制药	133,200	2,032,632.00	0.23
133	002601	龙蟠佰利	124,000	2,031,120.00	0.23

134	000685	中山公用	184,290	2,017,975.50	0.23
135	000089	深圳机场	215,500	2,014,925.00	0.23
136	000078	海王生物	333,955	2,013,748.65	0.23
137	000513	丽珠集团	29,440	2,004,864.00	0.22
138	000979	中弘股份	765,080	2,004,509.60	0.22
139	002354	天神娱乐	93,040	2,000,360.00	0.22
140	300134	大富科技	85,600	1,999,616.00	0.22
141	300026	红日药业	421,400	1,984,794.00	0.22
142	000697	炼石有色	96,898	1,983,502.06	0.22
143	601699	潞安环能	251,500	1,966,730.00	0.22
144	600312	平高电气	142,600	1,959,324.00	0.22
145	600811	东方集团	300,200	1,957,304.00	0.22
146	002051	中工国际	94,356	1,955,999.88	0.22
147	600884	杉杉股份	118,100	1,945,107.00	0.22
148	600967	内蒙一机	142,100	1,936,823.00	0.22
149	300122	智飞生物	101,000	1,930,110.00	0.22
150	601880	大连港	651,390	1,928,114.40	0.22
151	000729	燕京啤酒	286,700	1,926,624.00	0.22
152	000926	福星股份	157,800	1,925,160.00	0.22
153	002635	安洁科技	53,150	1,925,093.00	0.22
154	600970	中材国际	221,300	1,923,097.00	0.22
155	002640	跨境通	90,100	1,914,625.00	0.21
156	000988	华工科技	131,200	1,914,208.00	0.21
157	002431	棕榈股份	173,580	1,912,851.60	0.21
158	600026	中远海能	287,700	1,907,451.00	0.21
159	002701	奥瑞金	297,120	1,898,596.80	0.21
160	000690	宝新能源	317,330	1,897,633.40	0.21
161	600809	山西汾酒	54,655	1,895,981.95	0.21
162	600499	科达洁能	237,400	1,884,956.00	0.21
163	002373	千方科技	138,036	1,882,811.04	0.21
164	600566	济川药业	49,500	1,882,485.00	0.21
165	600881	亚泰集团	370,400	1,881,632.00	0.21
166	600183	生益科技	152,300	1,879,382.00	0.21
167	600307	酒钢宏兴	658,400	1,876,440.00	0.21
168	600120	浙江东方	69,800	1,876,224.00	0.21
169	000806	银河生物	138,800	1,873,800.00	0.21
170	600664	哈药股份	320,630	1,862,860.30	0.21
171	002048	宁波华翔	89,210	1,860,920.60	0.21
172	002221	东华能源	170,284	1,857,798.44	0.21
173	002390	信邦制药	213,000	1,855,230.00	0.21
174	000600	建投能源	150,700	1,849,089.00	0.21
175	002512	达华智能	114,000	1,841,100.00	0.21
176	600863	内蒙华电	610,600	1,837,906.00	0.21

177	600094	大名城	239,200	1,834,664.00	0.21
178	300253	卫宁健康	234,264	1,829,601.84	0.20
179	600787	中储股份	231,200	1,828,792.00	0.20
180	600572	康恩贝	264,005	1,826,914.60	0.20
181	002127	南极电商	150,800	1,821,664.00	0.20
182	000012	南 玻 A	193,200	1,802,556.00	0.20
183	002191	劲嘉股份	192,500	1,801,800.00	0.20
184	600874	创业环保	91,500	1,790,655.00	0.20
185	002665	首航节能	248,580	1,789,776.00	0.20
186	000667	美好置业	538,200	1,781,442.00	0.20
187	002028	思源电气	111,676	1,780,115.44	0.20
188	000816	智慧农业	238,645	1,775,518.80	0.20
189	000592	平潭发展	321,120	1,772,582.40	0.20
190	002603	以岭药业	101,300	1,768,698.00	0.20
191	600478	科力远	204,670	1,762,208.70	0.20
192	300166	东方国信	131,176	1,761,693.68	0.20
193	002444	巨星科技	113,000	1,760,540.00	0.20
194	000006	深振业 A	198,900	1,752,309.00	0.20
195	600017	日照港	388,000	1,746,000.00	0.20
196	000758	中色股份	248,414	1,741,382.14	0.19
197	300001	特锐德	103,800	1,739,688.00	0.19
198	002477	雏鹰农牧	391,730	1,735,363.90	0.19
199	000975	银泰资源	136,465	1,723,552.95	0.19
200	000031	中粮地产	228,700	1,722,111.00	0.19
201	600125	铁龙物流	192,100	1,721,216.00	0.19
202	600064	南京高科	113,600	1,715,360.00	0.19
203	600348	阳泉煤业	252,800	1,713,984.00	0.19
204	002672	东江环保	101,150	1,708,423.50	0.19
205	603077	和邦生物	333,600	1,698,024.00	0.19
206	000732	泰禾集团	101,300	1,689,684.00	0.19
207	000158	常山股份	106,900	1,689,020.00	0.19
208	600565	迪马股份	305,900	1,685,509.00	0.19
209	000939	凯迪生态	330,466	1,685,376.60	0.19
210	000860	顺鑫农业	83,900	1,678,839.00	0.19
211	002250	联化科技	116,405	1,664,591.50	0.19
212	600198	大唐电信	129,900	1,658,823.00	0.19
213	000563	陕国投 A	319,300	1,650,781.00	0.18
214	600597	光明乳业	129,400	1,649,850.00	0.18
215	300274	阳光电源	148,540	1,647,308.60	0.18
216	300287	飞利信	179,400	1,646,892.00	0.18
217	600410	华胜天成	185,722	1,645,496.92	0.18
218	000877	天山股份	129,600	1,642,032.00	0.18
219	002261	拓维信息	140,200	1,641,742.00	0.18

220	600416	湘电股份	119,300	1,634,410.00	0.18
221	002399	海普瑞	80,200	1,622,446.00	0.18
222	000027	深圳能源	240,300	1,617,219.00	0.18
223	000727	华东科技	571,100	1,616,213.00	0.18
224	603766	隆鑫通用	221,950	1,615,796.00	0.18
225	002308	威创股份	123,610	1,613,110.50	0.18
226	600687	刚泰控股	125,200	1,612,576.00	0.18
227	002266	浙富控股	330,013	1,610,463.44	0.18
228	002002	鸿达兴业	203,557	1,593,851.31	0.18
229	002353	杰瑞股份	100,700	1,593,074.00	0.18
230	600200	江苏吴中	120,400	1,589,280.00	0.18
231	600039	四川路桥	381,000	1,584,960.00	0.18
232	601929	吉视传媒	457,700	1,583,642.00	0.18
233	002468	申通快递	62,300	1,583,043.00	0.18
234	601717	郑煤机	202,200	1,575,138.00	0.18
235	002025	航天电器	62,850	1,568,107.50	0.18
236	300116	坚瑞沃能	144,100	1,549,075.00	0.17
237	600582	天地科技	336,800	1,545,912.00	0.17
238	600466	蓝光发展	179,100	1,545,633.00	0.17
239	600282	南钢股份	416,400	1,544,844.00	0.17
240	002517	恺英网络	43,800	1,541,322.00	0.17
241	600751	天海投资	270,400	1,538,576.00	0.17
242	600086	东方金钰	141,900	1,533,939.00	0.17
243	601689	拓普集团	45,600	1,527,144.00	0.17
244	002396	星网锐捷	78,850	1,525,747.50	0.17
245	002268	卫士通	90,540	1,522,882.80	0.17
246	300257	开山股份	72,100	1,519,868.00	0.17
247	601928	凤凰传媒	155,300	1,515,728.00	0.17
248	600380	健康元	166,600	1,512,728.00	0.17
249	600557	康缘药业	90,919	1,510,164.59	0.17
250	600151	航天机电	183,220	1,507,900.60	0.17
251	002375	亚厦股份	169,100	1,506,681.00	0.17
252	002022	科华生物	86,210	1,497,467.70	0.17
253	002544	杰赛科技	65,500	1,493,400.00	0.17
254	000712	锦龙股份	91,200	1,492,944.00	0.17
255	000501	鄂武商 A	80,860	1,492,675.60	0.17
256	000519	中兵红箭	117,995	1,486,737.00	0.17
257	000830	鲁西化工	215,400	1,486,260.00	0.17
258	300199	翰宇药业	96,600	1,481,844.00	0.17
259	603000	人民网	112,500	1,481,625.00	0.17
260	002440	闰土股份	96,700	1,475,642.00	0.17
261	002281	光迅科技	66,100	1,468,742.00	0.16
262	002589	瑞康医药	94,960	1,462,384.00	0.16

263	002489	浙江永强	228,658	1,458,838.04	0.16
264	600169	太原重工	377,150	1,455,799.00	0.16
265	000703	恒逸石化	102,200	1,455,328.00	0.16
266	600316	洪都航空	90,500	1,454,335.00	0.16
267	002670	国盛金控	91,400	1,453,260.00	0.16
268	600611	大众交通	263,050	1,452,036.00	0.16
269	002155	湖南黄金	151,600	1,450,812.00	0.16
270	600366	宁波韵升	82,100	1,448,244.00	0.16
271	600187	国中水务	285,600	1,442,280.00	0.16
272	600759	洲际油气	237,980	1,442,158.80	0.16
273	600694	大商股份	37,006	1,442,123.82	0.16
274	600270	外运发展	76,100	1,440,573.00	0.16
275	600835	上海机电	67,800	1,433,292.00	0.16
276	002368	太极股份	51,686	1,431,185.34	0.16
277	000528	柳工	165,500	1,429,920.00	0.16
278	002657	中科金财	49,300	1,429,207.00	0.16
279	600267	海正药业	121,756	1,422,110.08	0.16
280	002342	巨力索具	141,200	1,421,884.00	0.16
281	000612	焦作万方	175,400	1,411,970.00	0.16
282	600108	亚盛集团	327,400	1,411,094.00	0.16
283	300273	和佳股份	115,900	1,409,344.00	0.16
284	600563	法拉电子	28,400	1,403,244.00	0.16
285	000090	天健集团	125,888	1,397,356.80	0.16
286	300291	华录百纳	69,400	1,389,388.00	0.16
287	600645	中源协和	64,600	1,384,378.00	0.16
288	002503	搜于特	196,660	1,382,519.80	0.15
289	600993	马应龙	63,392	1,380,677.76	0.15
290	002285	世联行	172,112	1,380,338.24	0.15
291	600277	亿利洁能	176,200	1,379,646.00	0.15
292	600729	重庆百货	51,333	1,377,777.72	0.15
293	601678	滨化股份	198,140	1,377,073.00	0.15
294	600848	上海临港	63,800	1,375,528.00	0.15
295	002642	荣之联	54,500	1,365,770.00	0.15
296	000937	冀中能源	222,900	1,364,148.00	0.15
297	002709	天赐材料	33,100	1,362,727.00	0.15
298	002358	森源电气	80,000	1,361,600.00	0.15
299	600098	广州发展	171,900	1,359,729.00	0.15
300	600545	新疆城建	113,500	1,357,460.00	0.15
301	600765	中航重机	98,155	1,352,575.90	0.15
302	002437	誉衡药业	184,700	1,344,616.00	0.15
303	000049	德赛电池	25,900	1,341,879.00	0.15
304	000829	天音控股	123,700	1,335,960.00	0.15
305	002325	洪涛股份	182,430	1,331,739.00	0.15

306	000587	金洲慈航	89,300	1,330,570.00	0.15
307	000021	深科技	154,600	1,326,468.00	0.15
308	000810	创维数字	108,700	1,318,531.00	0.15
309	600073	上海梅林	138,052	1,318,396.60	0.15
310	600422	昆药集团	116,100	1,316,574.00	0.15
311	000543	皖能电力	225,720	1,315,947.60	0.15
312	002011	盾安环境	115,800	1,314,330.00	0.15
313	600300	维维股份	246,100	1,314,174.00	0.15
314	600750	江中药业	37,800	1,313,550.00	0.15
315	002018	华信国际	191,500	1,311,775.00	0.15
316	002122	天马股份	127,000	1,308,100.00	0.15
317	002056	横店东磁	173,200	1,299,000.00	0.15
318	000669	金鸿能源	71,500	1,296,295.00	0.15
319	600639	浦东金桥	71,500	1,295,580.00	0.15
320	000777	中核科技	64,440	1,286,222.40	0.14
321	002249	大洋电机	194,900	1,282,442.00	0.14
322	000897	津滨发展	272,100	1,278,870.00	0.14
323	002317	众生药业	102,800	1,276,776.00	0.14
324	300376	易事特	140,600	1,275,242.00	0.14
325	002505	大康农业	364,040	1,274,140.00	0.14
326	000636	风华高科	149,400	1,271,394.00	0.14
327	600648	外高桥	68,600	1,270,472.00	0.14
328	002242	九阳股份	64,500	1,268,715.00	0.14
329	603188	亚邦股份	72,700	1,267,888.00	0.14
330	601311	XD 骆驼股	89,200	1,263,072.00	0.14
331	601016	节能风电	343,000	1,262,240.00	0.14
332	000766	通化金马	78,700	1,257,626.00	0.14
333	000572	海马汽车	242,000	1,251,140.00	0.14
334	600284	浦东建设	116,620	1,250,166.40	0.14
335	002128	露天煤业	143,400	1,247,580.00	0.14
336	603444	吉比特	4,400	1,246,652.00	0.14
337	600259	广晟有色	31,800	1,241,472.00	0.14
338	000762	西藏矿业	87,500	1,239,875.00	0.14
339	600651	飞乐音响	146,100	1,237,467.00	0.14
340	000596	古井贡酒	24,200	1,232,990.00	0.14
341	000848	承德露露	123,462	1,232,150.76	0.14
342	600770	综艺股份	163,900	1,229,250.00	0.14
343	600496	精工钢构	253,960	1,226,626.80	0.14
344	600587	新华医疗	68,300	1,214,374.00	0.14
345	000062	深圳华强	45,511	1,207,406.83	0.14
346	000061	农产品	133,100	1,205,886.00	0.14
347	600216	浙江医药	121,500	1,204,065.00	0.13
348	002106	莱宝高科	118,700	1,202,431.00	0.13

349	002123	梦网荣信	107,700	1,196,547.00	0.13
350	002254	泰和新材	89,960	1,196,468.00	0.13
351	002479	富春环保	100,500	1,195,950.00	0.13
352	002276	万马股份	118,500	1,195,665.00	0.13
353	600536	中国软件	62,317	1,193,993.72	0.13
354	300010	立思辰	91,700	1,187,515.00	0.13
355	002064	华峰氨纶	244,600	1,178,972.00	0.13
356	002482	广田集团	130,650	1,174,543.50	0.13
357	002073	软控股份	138,100	1,171,088.00	0.13
358	002707	众信旅游	88,700	1,164,631.00	0.13
359	002428	云南锗业	108,900	1,163,052.00	0.13
360	600171	上海贝岭	113,200	1,151,244.00	0.13
361	000652	泰达股份	217,200	1,151,160.00	0.13
362	002332	仙琚制药	133,700	1,149,820.00	0.13
363	600458	时代新材	100,310	1,148,549.50	0.13
364	000680	山推股份	208,600	1,136,870.00	0.13
365	000620	新华联	159,500	1,134,045.00	0.13
366	000541	佛山照明	123,544	1,125,485.84	0.13
367	600859	王府井	69,650	1,124,847.50	0.13
368	600428	中远海特	180,588	1,123,257.36	0.13
369	000726	鲁泰 A	94,600	1,121,956.00	0.13
370	002463	沪电股份	246,200	1,120,210.00	0.13
371	000969	安泰科技	128,300	1,120,059.00	0.13
372	600058	五矿发展	90,100	1,118,141.00	0.13
373	001696	宗申动力	144,500	1,093,865.00	0.12
374	603883	老百姓	22,400	1,089,760.00	0.12
375	002690	美亚光电	56,800	1,089,424.00	0.12
376	600329	中新药业	59,800	1,082,978.00	0.12
377	300297	蓝盾股份	98,800	1,081,860.00	0.12
378	600517	置信电气	142,500	1,078,725.00	0.12
379	601233	桐昆股份	77,800	1,078,308.00	0.12
380	600894	广日股份	90,400	1,070,336.00	0.12
381	600736	苏州高新	150,600	1,064,742.00	0.12
382	000426	兴业矿业	117,900	1,063,458.00	0.12
383	300043	星辉娱乐	129,400	1,062,374.00	0.12
384	601777	力帆股份	132,100	1,062,084.00	0.12
385	002063	远光软件	101,405	1,056,640.10	0.12
386	600805	XD 悦达投	143,097	1,051,762.95	0.12
387	600880	博瑞传播	161,000	1,051,330.00	0.12
388	600586	金晶科技	214,700	1,049,883.00	0.12
389	600790	轻纺城	153,970	1,048,535.70	0.12
390	600338	西藏珠峰	27,500	1,044,725.00	0.12
391	603369	今世缘	79,100	1,044,120.00	0.12

392	000616	海航投资	240,618	1,034,657.40	0.12
393	603888	新华网	31,850	1,031,621.50	0.12
394	000552	靖远煤电	288,500	1,029,945.00	0.12
395	600289	亿阳信通	94,100	1,029,454.00	0.12
396	600220	江苏阳光	300,100	1,029,343.00	0.12
397	002277	友阿股份	158,600	1,022,970.00	0.11
398	603556	海兴电力	23,300	1,022,637.00	0.11
399	600720	祁连山	130,500	1,021,815.00	0.11
400	600395	盘江股份	139,200	1,020,336.00	0.11
401	002663	普邦股份	187,805	1,019,781.15	0.11
402	000099	中信海直	90,500	1,019,030.00	0.11
403	600773	西藏城投	91,900	1,017,333.00	0.11
404	002727	一心堂	54,677	1,006,056.80	0.11
405	300147	香雪制药	97,390	1,000,195.30	0.11
406	601886	江河集团	97,006	994,311.50	0.11
407	603816	顾家家居	16,900	993,382.00	0.11
408	603355	莱克电气	16,900	993,213.00	0.11
409	002269	美邦服饰	264,200	985,466.00	0.11
410	002681	奋达科技	78,260	985,293.40	0.11
411	300039	上海凯宝	135,440	984,648.80	0.11
412	600006	东风汽车	168,100	983,385.00	0.11
413	002005	德豪润达	205,700	981,189.00	0.11
414	002041	登海种业	74,050	981,162.50	0.11
415	603377	东方时尚	26,000	977,340.00	0.11
416	600801	华新水泥	102,300	974,919.00	0.11
417	600460	士兰微	160,300	973,021.00	0.11
418	002190	成飞集成	36,300	972,840.00	0.11
419	002345	潮宏基	88,800	965,256.00	0.11
420	600596	新安股份	114,000	963,300.00	0.11
421	603198	迎驾贡酒	50,500	961,015.00	0.11
422	002120	韵达股份	18,600	959,760.00	0.11
423	600053	九鼎投资	27,400	957,904.00	0.11
424	600280	中央商场	120,700	957,151.00	0.11
425	300032	金龙机电	68,400	954,180.00	0.11
426	300202	聚龙股份	57,694	953,104.88	0.11
427	600757	长江传媒	127,572	952,962.84	0.11
428	000417	合肥百货	114,900	947,925.00	0.11
429	600059	古越龙山	102,100	944,425.00	0.11
430	600869	智慧能源	140,000	942,200.00	0.11
431	600628	新世界	81,541	941,798.55	0.11
432	600141	兴发集团	75,400	932,698.00	0.10
433	600657	信达地产	161,400	929,664.00	0.10
434	002588	史丹利	120,500	926,645.00	0.10

435	600580	卧龙电气	135,400	923,428.00	0.10
436	000681	视觉中国	58,925	922,765.50	0.10
437	002371	北方华创	38,550	922,116.00	0.10
438	601001	大同煤业	175,600	921,900.00	0.10
439	002233	塔牌集团	75,200	915,184.00	0.10
440	600481	双良节能	169,980	902,593.80	0.10
441	002344	海宁皮城	108,000	898,560.00	0.10
442	002147	新光圆成	57,300	890,442.00	0.10
443	600754	锦江股份	32,700	886,170.00	0.10
444	600292	远达环保	81,970	883,636.60	0.10
445	600195	中牧股份	45,200	876,428.00	0.10
446	601002	晋亿实业	100,000	865,000.00	0.10
447	600537	亿晶光电	173,200	862,536.00	0.10
448	002699	美盛文化	62,220	858,636.00	0.10
449	600971	恒源煤电	105,200	855,276.00	0.10
450	600862	中航高科	87,800	850,782.00	0.10
451	600640	号百控股	50,200	848,380.00	0.09
452	002309	中利集团	67,426	843,499.26	0.09
453	600748	上实发展	116,350	837,720.00	0.09
454	600743	华远地产	197,150	831,973.00	0.09
455	000693	*ST 华泽	66,000	825,000.00	0.09
456	600826	兰生股份	44,200	800,020.00	0.09
457	600184	光电股份	42,300	793,548.00	0.09
458	600251	冠农股份	99,100	789,827.00	0.09
459	603169	兰石重装	64,600	784,890.00	0.09
460	600335	国机汽车	64,900	776,204.00	0.09
461	600996	贵广网络	63,700	762,489.00	0.09
462	600831	广电网络	76,400	760,180.00	0.09
463	002551	尚荣医疗	46,692	753,141.96	0.08
464	002392	北京利尔	126,100	747,773.00	0.08
465	002093	国脉科技	84,500	743,600.00	0.08
466	002118	紫鑫药业	107,600	734,908.00	0.08
467	002414	高德红外	39,400	721,020.00	0.08
468	002416	爱施德	65,100	702,429.00	0.08
469	600776	东方通信	100,500	681,390.00	0.08
470	600551	时代出版	42,876	677,012.04	0.08
471	002251	步步高	54,510	675,378.90	0.08
472	603005	晶方科技	23,900	668,961.00	0.07
473	002646	青青稞酒	37,800	659,988.00	0.07
474	603698	航天工程	26,100	657,720.00	0.07
475	000536	华映科技	112,600	654,206.00	0.07
476	603001	奥康国际	33,700	633,223.00	0.07
477	603868	飞科电器	10,200	630,768.00	0.07

478	603568	伟明环保	28,900	624,818.00	0.07
479	000517	荣安地产	133,900	622,635.00	0.07
480	603528	多伦科技	43,300	622,221.00	0.07
481	000025	特力A	11,700	605,358.00	0.07
482	603567	珍宝岛	35,700	600,831.00	0.07
483	603328	依顿电子	41,900	592,885.00	0.07
484	600936	广西广电	68,000	548,760.00	0.06
485	600126	杭钢股份	79,300	543,998.00	0.06
486	002807	江阴银行	43,200	541,296.00	0.06
487	603806	福斯特	16,900	540,969.00	0.06
488	002315	焦点科技	21,200	528,728.00	0.06
489	600618	氯碱化工	47,300	505,164.00	0.06
490	603228	景旺电子	10,100	487,325.00	0.05
491	601020	华钰矿业	21,400	471,442.00	0.05
492	603866	桃李面包	13,200	469,656.00	0.05
493	603515	欧普照明	13,000	469,560.00	0.05
494	600468	百利电气	69,600	452,400.00	0.05
495	002194	武汉凡谷	47,500	420,375.00	0.05
496	603658	安图生物	8,700	374,970.00	0.04
497	002815	崇达技术	10,900	360,136.00	0.04
498	002818	富森美	9,000	355,230.00	0.04
499	600917	重庆燃气	36,000	339,480.00	0.04
500	000761	本钢板材	63,100	330,013.00	0.04
501	601811	新华文轩	21,000	326,760.00	0.04
502	603877	太平鸟	11,600	324,684.00	0.04
503	603569	长久物流	9,100	304,213.00	0.03
504	603025	大豪科技	10,500	277,200.00	0.03
505	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
506	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
507	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
508	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
509	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
510	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
511	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
512	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
513	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
514	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
515	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
516	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
517	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
518	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
519	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
520	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00

521	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
522	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	600642	申能股份	3,430,352.01	0.36
2	000066	中国长城	3,331,297.00	0.35
3	603799	华友钴业	2,884,908.73	0.30
4	000778	新兴铸管	2,863,776.00	0.30
5	600839	四川长虹	2,619,150.00	0.28
6	000039	中集集团	2,590,776.36	0.27
7	300002	神州泰岳	2,347,223.05	0.25
8	300383	光环新网	2,198,066.00	0.23
9	002583	海能达	2,112,084.95	0.22
10	300058	蓝色光标	2,090,412.97	0.22
11	002601	龙麟佰利	1,900,862.00	0.20
12	000729	燕京啤酒	1,885,580.60	0.20
13	002127	南极电商	1,852,998.00	0.20
14	600566	济川药业	1,841,620.45	0.19
15	300146	汤臣倍健	1,765,371.68	0.19
16	000732	泰禾集团	1,673,344.86	0.18
17	000027	深圳能源	1,620,512.00	0.17
18	002468	申通快递	1,544,449.60	0.16
19	002517	恺英网络	1,511,325.89	0.16
20	601928	凤凰传媒	1,500,034.71	0.16

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

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	4,726,911.41	0.50
2	600522	中天科技	4,524,647.43	0.48
3	600682	南京新百	3,891,874.27	0.41
4	600436	片仔癀	3,647,158.76	0.39
5	000887	中鼎股份	3,415,538.00	0.36
6	000748	长城信息	3,115,554.00	0.33
7	002602	世纪华通	2,480,147.68	0.26
8	000959	首钢股份	2,449,517.96	0.26

9	600549	厦门钨业	2,198,709.00	0.23
10	600497	驰宏锌锗	2,158,810.00	0.23
11	002595	豪迈科技	2,009,641.10	0.21
12	600601	方正科技	1,728,254.00	0.18
13	000961	中南建设	1,709,878.88	0.18
14	600067	冠城大通	1,465,561.65	0.15
15	600575	皖江物流	1,424,378.00	0.15
16	000973	佛塑科技	1,320,411.49	0.14
17	600851	海欣股份	1,314,309.91	0.14
18	002581	未名医药	1,276,506.27	0.13
19	600175	美都能源	1,267,552.05	0.13
20	600823	世茂股份	1,174,210.99	0.12

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

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	136,977,655.02
卖出股票的收入（成交）总额	120,501,028.42

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

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）	438,770.20	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	438,770.20	0.05

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	128013	洪涛转债	2,064	209,083.20	0.02
2	127003	海印转债	1,448	147,189.20	0.02
3	113012	骆驼转债	770	82,497.80	0.01
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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
IC1707	中证 500 股指期货 IC1707 合约	31.00	37,838,600.00	954,120.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理
IC1709	中证 500 股指期货 IC1709 合约	6.00	7,226,160.00	144,200.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理
公允价值变动总额合计					1,098,320.00
股指期货投资本期收益					-1,259,160.00
股指期货投资本期公允价值变动					811,880.00

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。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	9,039,548.15
2	应收证券清算款	260,153.14
3	应收股利	-
4	应收利息	16,109.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,315,810.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128013	洪涛转债	209,083.20	0.02
2	127003	海印转债	147,189.20	0.02

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	5,237,886.00	0.59	重大事项
2	600643	爱建集团	4,600,807.40	0.52	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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		华夏中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,762	62,832.59	12,306,400.00	4.11%	60,208,276.00	20.12%	226,694,118.00	75.76%

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	百年人寿保险股份有限公司—分红保险产品	7,391,500.00	2.47%
2	国信证券股份有限公司	1,783,590.00	0.60%
3	李章华	1,036,900.00	0.35%
4	姚文波	970,568.00	0.32%
5	吕爱平	700,000.00	0.23%
6	倪光新	582,546.00	0.19%
7	梁鹏飞	493,868.00	0.17%
8	贺承祥	440,113.00	0.15%
9	陈洁玲	437,784.00	0.15%
9	王虎俊	437,784.00	0.15%
11	中国建设银行股份有限公司—华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	226,694,118.00	75.76%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

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、基金投资和研发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（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	2,134,473,505
本报告期期初基金份额总额	312,408,794
本报告期基金总申购份额	4,800,000
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	299,208,794

§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，本基金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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

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

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	
申万宏源证券	2	116,205,163.75	46.60%	15,258.90	46.60%	-
国泰君安证券	2	98,147,672.86	39.36%	12,886.96	39.35%	-

中信建投证券	3	35,036,233.05	14.05%	4,600.48	14.05%	-
--------	---	---------------	--------	----------	--------	---

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	165,500,000.00	100.00%
中信建投证券	-	-	-	-

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	华夏基金管理有限公司关于调整华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-25
2	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-03

§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
华夏中证 500ETF 联接	1	2017-01-01 至 2017-06-30	236,097,342.00	429,988.00	9,833,212.00	226,694,118.00	75.76%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于 5000 万元，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

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日