

景顺长城中证 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：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 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 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
3.3 其他指标.....	9
§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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63

10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	192,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有

	与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	-------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	-2,421,118.62
本期利润	-11,265,508.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0846
本期加权平均净值利润率	-5.26%
本期基金份额净值增长率	-1.24%
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	117,394,741.67
期末可供分配基金份额利润	0.6096
期末基金资产净值	309,967,697.67
期末基金份额净值	1.6096
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	60.96%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.76%	0.92%	5.39%	0.93%	0.37%	-0.01%
过去三个月	-3.00%	1.02%	-4.12%	1.02%	1.12%	0.00%
过去六个月	-1.24%	0.89%	-2.00%	0.90%	0.76%	-0.01%
过去一年	0.24%	0.90%	0.24%	0.91%	0.00%	-0.01%
过去三年	54.49%	2.04%	56.39%	2.06%	-1.90%	-0.02%
自基金合同生效起至今	60.96%	1.94%	61.17%	1.96%	-0.21%	-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



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2017年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理67只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证800食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置

混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城景盈汇利债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐喻军	本基金的基金经理	2014 年 12 月 27 日	-	7 年	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等

有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，为公司旗下三只指数基金因指数成份股调整而发生的反向交易以及量化基金、指数增强基金根据基金合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间临近交易日虽然存在同向交易和反向交易行为，但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年 GDP 增长 6.9%，工业增加值累计增长 7.6%，增速维持稳定。6 月制造业 PMI 指数 51.7，在出口的拉动下出现短期回升；6 月 PPI 同比上涨 5.5%，环比下降 0.2%，同比涨幅缩小；6 月 CPI 同比上涨 1.5%，涨幅略有上升，通胀预期维持平稳。货币政策基调防风险，市场流动性继续维持中性。2017 年上半年市场出现分化行情，沪深 300 指数大幅跑赢创业板指数，业绩稳定的蓝筹股和部分具备竞争优势的白马成长股持续受到市场关注，靠并购和外延增长的高估值股票表现不好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金份额净值增长率为-1.24%，业绩比较基准收益率为-2.00%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，跟踪误差（年化）控制

在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面仍可能延续企稳态势，国内出口依然向好，消费平稳，经济复苏，企业盈利依然有改善的空间，但随着本轮补库存的完成，叠加金融去杠杆导致实体经济融资利率抬升，预计经济将面临小幅的下行压力。

本基金采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

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

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

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

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关

从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

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

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

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

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

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

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

从 2017 年 3 月 24 日至 2017 年 5 月 11 日，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	8,904,644.64	1,205,918.59
结算备付金		34,086.85	4,154.88
存出保证金		6,033.44	2,600.65
交易性金融资产	6.4.7.2	301,399,901.07	81,475,537.41
其中：股票投资		301,399,901.07	81,475,537.41
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	-	-
应收证券清算款		219,428.64	-
应收利息	6.4.7.5	1,578.98	260.31
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		310,565,673.62	82,688,471.84
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		124,419.65	35,601.36
应付托管费		24,883.93	7,120.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	70,565.31	21,482.39

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	378,107.06	200,000.00
负债合计		597,975.95	264,204.03
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	192,572,956.00	50,572,956.00
未分配利润	6.4.7.10	117,394,741.67	31,851,311.81
所有者权益合计		309,967,697.67	82,424,267.81
负债和所有者权益总计		310,565,673.62	82,688,471.84

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6096 元，基金份额总额 192,572,956.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		-10,184,224.66	-22,593,811.00
1.利息收入		26,552.53	9,456.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,552.53	9,437.76
债券利息收入		-	18.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,654,939.41	-4,707,620.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,339,027.71	-5,171,789.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	11,478.17
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,684,088.30	452,690.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,844,390.23	-17,895,646.69
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	288,552.45	-

减：二、费用		1,081,284.19	604,503.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	522,027.04	219,427.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,405.43	43,885.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	125,961.59	37,017.98
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	328,890.13	304,171.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,265,508.85	-23,198,314.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,265,508.85	-23,198,314.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	50,572,956.00	31,851,311.81	82,424,267.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,265,508.85	-11,265,508.85
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）	142,000,000.00	96,808,938.71	238,808,938.71
其中：1. 基金申购款	146,000,000.00	99,354,675.03	245,354,675.03
2. 基金赎回款	-4,000,000.00	-2,545,736.32	-6,545,736.32
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）	192,572,956.00	117,394,741.67	309,967,697.67

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）	60,572,956.00	59,547,912.55	120,120,868.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-23,198,314.00	-23,198,314.00
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）	-8,000,000.00	-4,498,981.63	-12,498,981.63
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-8,000,000.00	-4,498,981.63	-12,498,981.63
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）	52,572,956.00	31,850,616.92	84,423,572.92

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2017 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、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

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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	8,904,644.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,904,644.64

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	321,047,391.98	301,399,901.07	-19,647,490.91
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	321,047,391.98	301,399,901.07	-19,647,490.91
----	----------------	----------------	----------------

注：于 2017 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

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

本基金本期末的买入返售金融资产项目余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末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	1,562.78
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	13.77
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.43
合计	1,578.98

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

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	70,565.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	70,565.31

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	328,107.06
应付指数使用费	50,000.00
合计	378,107.06

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	50,572,956.00	50,572,956.00
本期申购	146,000,000.00	146,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-4,000,000.00	-4,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	192,572,956.00	192,572,956.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,877,029.89	-28,025,718.08	31,851,311.81
本期利润	-2,421,118.62	-8,844,390.23	-11,265,508.85
本期基金份额交易产生的变动数	166,542,396.41	-69,733,457.70	96,808,938.71
其中：基金申购款	171,224,805.88	-71,870,130.85	99,354,675.03
基金赎回款	-4,682,409.47	2,136,673.15	-2,545,736.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	223,998,307.68	-106,603,566.01	117,394,741.67

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	25,229.20
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	1,301.30
其他	22.03
合计	26,552.53

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	-2,780,309.13
股票投资收益——赎回差价收入	-558,718.58
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-3,339,027.71

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	38,652,736.31
减：卖出股票成本总额	41,433,045.44
买卖股票差价收入	-2,780,309.13

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	6,545,736.32
减：现金支付赎回款总额	135,198.32
减：赎回股票成本总额	6,969,256.58

赎回差价收入	-558,718.58
--------	-------------

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期债券投资收益无发生额。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期的衍生工具收益项目发生额为零。

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	1,684,088.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,684,088.30

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	-8,844,390.23
——股票投资	-8,844,390.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,844,390.23

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元。

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	-
替代损益收入	288,552.45
合计	288,552.45

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

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	125,961.59
银行间市场交易费用	-
合计	125,961.59

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	49,588.57
信息披露费	148,765.71
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	783.07
合计	328,890.13

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

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	40,566,469.47	47.23%	9,249,805.95	37.30%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
长城证券	37,779.79	47.23%	33,136.46	46.96%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
长城证券	8,614.31	37.30%	7,977.50	37.11%

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

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

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 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管理费	522,027.04	219,427.98
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 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	104,405.43	43,885.64

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 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

本基金本期和上年度可比期间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**

本基金基金管理人于本期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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
景顺长城中证 500ETF 联接基金	188,000,000.00	97.63%	46,000,000.00	90.96%

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
中国银行	8,904,644.64	25,229.20	2,038,301.15	9,144.64

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内均未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	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 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000656	金科股份	2017 年 5 月	重大事项停牌	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	297,800	1,692,885.98	1,947,612.00	-

		月 5 日									
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	113,478	1,578,202.97	1,699,900.44	-	
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	72,904	846,519.04	753,098.32	-	
002127	南极电商	2017 年 6 月 29 日	重大事项停牌	12.08	2017 年 7 月 6 日	12.61	58,500	725,318.83	706,680.00	-	
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事项停牌	20.23		-	29,300	612,710.84	592,739.00	-	
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事项停牌	20.02		-	27,400	677,972.58	548,548.00	-	
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事项停牌	7.79		-	68,110	586,374.73	530,576.90	-	
002358	森源电气	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	28,900	574,248.74	491,878.00	-	
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	41,095	513,843.22	491,496.20	-	
002122	天马股份	2017 年 4 月 24 日	重大事项停牌	10.30	2017 年 7 月 24 日	11.15	47,118	496,282.81	485,315.40	-	
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	重大事项停牌	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	19,150	556,673.06	479,899.00	-	
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.06		-	51,500	467,774.79	466,590.00	-	
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	37,446	523,998.94	409,659.24	-	
002681	奋达科技	2017 年 6 月 22 日	重大事项停牌	12.59	2017 年 7 月 3 日	12.70	28,420	432,306.48	357,807.80	-	
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	58,442	405,357.58	354,742.94	-	
000099	中信海直	2017 年 5 月 4 日	重大事项停牌	11.26		-	30,390	413,872.71	342,191.40	-	
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	63,600	412,321.93	333,900.00	-	
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	重大事项停牌	16.99		-	16,920	205,105.20	287,470.80	-	
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	18,000	211,757.43	283,500.00	-	
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项停牌	7.29		-	37,500	297,614.65	273,375.00	-	
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项停牌	11.32		-	20,672	386,007.96	234,007.04	-	
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大事项停牌	23.36		-	7,900	222,589.73	184,544.00	-	

600468	百利电气	2017 年 5 月 16 日	重大事项停牌	6.50	-	-	28,251	259,328.02	183,631.50	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	24.95	2017 年 7 月 4 日	22.46	5,490	144,118.50	136,975.50	-
600277	亿利洁能	2017 年 3 月 6 日	重大事项停牌	7.83	-	-	17,100	112,077.44	133,893.00	-
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事项停牌	3.50	-	-	33,770	125,562.91	118,195.00	-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项停牌	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	13,431	128,061.18	116,849.70	-
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	15,610	103,785.71	89,913.60	-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项停牌	12.50	-	-	6,242	130,240.24	78,025.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四层次风险

管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

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

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于本期末，本基金未持有债券投资(上年末：同)。

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。

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

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主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,904,644.64	-	-	-	-	-	8,904,644.64
结算备付金	34,086.85	-	-	-	-	-	34,086.85
存出保证金	6,033.44	-	-	-	-	-	6,033.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	301,399,901.07	301,399,901.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	219,428.64	219,428.64
应收利息	-	-	-	-	-	1,578.98	1,578.98
资产总计	8,944,764.93	-	-	-	-	301,620,908.69	310,565,673.62
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,419.65	124,419.65
应付托管费	-	-	-	-	-	24,883.93	24,883.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	70,565.31	70,565.31
其他负债	-	-	-	-	-	378,107.06	378,107.06
负债总计	-	-	-	-	-	597,975.95	597,975.95
利率敏感度缺口	8,944,764.93	-	-	-	-	-	-
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,205,918.59	-	-	-	-	-	1,205,918.59

结算备付金	4,154.88	-	-	-	-	-	4,154.88
存出保证金	2,600.65	-	-	-	-	-	2,600.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,475,537.41	81,475,537.41
应收利息	-	-	-	-	-	260.31	260.31
资产总计	1,212,674.12	-	-	-	-	81,475,797.72	82,688,471.84
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,601.36	35,601.36
应付托管费	-	-	-	-	-	7,120.28	7,120.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,482.39	21,482.39
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	264,204.03	264,204.03
利率敏感度缺口	1,212,674.12	-	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年末：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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	301,399,901.07	97.24	81,475,537.41	98.85
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	301,399,901.07	97.24	81,475,537.41	98.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。		
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）
	沪深300指数上升5%	15,196,796.45	5,087,388.90
	沪深300指数下降5%	-15,196,796.45	-5,087,388.90

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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 288,163,203.19 元，属于第二层次的余额为 13,236,697.88 元，无属于第三层次的余额(于 2016 年 12 月 31 日，第一层次：75,222,410.08 元，第二层次：6,253,127.33 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 基金申购款

本报告期内，本基金申购基金份额的对价总额为 245,354,675.03 元，其中包括以股票支付的申购款 228,032,184.20 元和以现金支付的申购款 17,322,490.83 元(于 2016 年上半年，本基金无申购)。

(3) 于 2017 年上半年，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。本基金的基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，在相应定期报告中予以披露。

(4) 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。

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

§ 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	301,399,901.07	97.05
	其中：股票	301,399,901.07	97.05
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,938,731.49	2.88
7	其他各项资产	227,041.06	0.07
8	合计	310,565,673.62	100.00

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境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,525,753.29	1.14
B	采矿业	8,975,459.50	2.90
C	制造业	187,813,734.98	60.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,458,227.74	3.37
E	建筑业	6,880,885.99	2.22
F	批发和零售业	15,196,313.00	4.90
G	交通运输、仓储和邮政业	8,080,344.74	2.61
H	住宿和餐饮业	330,620.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,020,544.34	6.78
J	金融业	4,649,019.44	1.50
K	房地产业	18,846,747.46	6.08
L	租赁和商务服务业	5,721,058.34	1.85
M	科学研究和技术服务业	736,464.90	0.24

N	水利、环境和公共设施管理业	2,645,978.44	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	364,623.00	0.12
Q	卫生和社会工作	783,354.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	3,588,881.06	1.16
S	综合	1,403,474.85	0.45
	合计	301,021,485.07	97.11

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	370,776.38	0.12
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	378,416.00	0.12

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	59,800	2,393,196.00	0.77
2	000656	金科股份	297,800	1,947,612.00	0.63
3	002460	赣锋锂业	40,100	1,854,625.00	0.60
4	600487	亨通光电	65,999	1,851,271.95	0.60
5	002572	索菲亚	42,100	1,726,100.00	0.56
6	600643	爱建集团	113,478	1,699,900.44	0.55
7	600201	生物股份	46,542	1,655,498.94	0.53
8	601012	隆基股份	91,000	1,556,100.00	0.50
9	300156	神雾环保	46,000	1,506,960.00	0.49
10	002271	东方雨虹	40,232	1,492,607.20	0.48
11	600176	中国巨石	133,074	1,461,152.52	0.47
12	600219	南山铝业	421,722	1,429,637.58	0.46
13	603799	华友钴业	22,600	1,373,628.00	0.44
14	600525	长园集团	100,039	1,359,530.01	0.44
15	002405	四维图新	68,279	1,349,193.04	0.44
16	600079	人福医药	68,400	1,342,008.00	0.43
17	000661	长春高新	10,315	1,331,769.65	0.43
18	600315	上海家化	41,000	1,330,450.00	0.43
19	000050	深天马 A	63,900	1,314,423.00	0.42
20	600642	申能股份	207,500	1,307,250.00	0.42
21	600584	长电科技	78,746	1,263,873.30	0.41
22	000998	隆平高科	57,309	1,261,944.18	0.41
23	002092	中泰化学	97,900	1,243,330.00	0.40
24	002340	格林美	202,942	1,227,799.10	0.40
25	000066	中国长城	134,221	1,209,331.21	0.39
26	300115	长盈精密	41,180	1,201,632.40	0.39
27	300266	兴源环境	38,600	1,185,792.00	0.38
28	300296	利亚德	61,800	1,161,840.00	0.37
29	000997	新大陆	49,952	1,133,410.88	0.37
30	002050	三花智控	68,450	1,117,104.00	0.36
31	600516	方大炭素	78,400	1,114,848.00	0.36
32	601168	西部矿业	144,900	1,114,281.00	0.36
33	600291	西水股份	49,900	1,097,800.00	0.35
34	600879	航天电子	123,792	1,088,131.68	0.35
35	002422	科伦药业	65,600	1,083,712.00	0.35
36	000786	北新建材	67,938	1,076,137.92	0.35
37	600325	华发股份	128,712	1,074,745.20	0.35

38	600056	中国医药	40,598	1,053,518.10	0.34
39	002407	多氟多	47,700	1,048,923.00	0.34
40	600266	北京城建	71,400	1,038,156.00	0.33
41	000039	中集集团	57,500	1,036,725.00	0.33
42	600022	山东钢铁	499,010	1,027,960.60	0.33
43	600839	四川长虹	280,600	1,015,772.00	0.33
44	000778	新兴铸管	151,600	1,015,720.00	0.33
45	600426	华鲁恒升	86,156	1,011,471.44	0.33
46	600388	龙净环保	65,000	1,009,450.00	0.33
47	600166	福田汽车	354,700	1,007,348.00	0.33
48	600521	华海药业	47,488	999,147.52	0.32
49	600161	天坛生物	25,427	986,821.87	0.32
50	000581	威孚高科	38,100	986,790.00	0.32
51	600435	北方导航	67,920	971,935.20	0.31
52	600528	中铁工业	67,499	964,560.71	0.31
53	002410	广联达	51,100	960,680.00	0.31
54	000970	中科三环	64,700	956,266.00	0.31
55	000999	华润三九	29,800	946,150.00	0.31
56	002217	合力泰	95,100	939,588.00	0.30
57	002179	中航光电	30,057	937,477.83	0.30
58	002366	台海核电	19,800	928,818.00	0.30
59	600699	均胜电子	28,898	927,336.82	0.30
60	600600	青岛啤酒	26,400	926,640.00	0.30
61	600138	中青旅	43,926	925,081.56	0.30
62	000028	国药一致	11,338	917,244.20	0.30
63	002573	清新环境	48,600	914,652.00	0.30
64	002038	双鹭药业	31,300	912,395.00	0.29
65	600978	宜华生活	90,100	905,505.00	0.29
66	601000	唐山港	173,247	904,349.34	0.29
67	002223	鱼跃医疗	38,126	902,823.68	0.29
68	600260	凯乐科技	35,408	897,238.72	0.29
69	300383	光环新网	65,900	893,604.00	0.29
70	603589	口子窖	22,800	884,412.00	0.29
71	600614	鹏起科技	80,332	883,652.00	0.29
72	002311	海大集团	48,060	878,056.20	0.28
73	600158	中体产业	51,301	877,247.10	0.28
74	000566	海南海药	66,118	876,724.68	0.28
75	000488	晨鸣纸业	67,697	873,291.30	0.28
76	300002	神州泰岳	104,300	869,862.00	0.28

77	300113	顺网科技	31,800	855,420.00	0.28
78	002583	海能达	53,000	852,770.00	0.28
79	000878	云南铜业	64,600	852,074.00	0.27
80	002078	太阳纸业	115,626	849,851.10	0.27
81	002004	华邦健康	108,210	847,284.30	0.27
82	300055	万邦达	46,000	846,400.00	0.27
83	600511	国药股份	23,286	843,884.64	0.27
84	600503	华丽家族	121,700	840,947.00	0.27
85	002030	达安基因	38,498	838,871.42	0.27
86	002019	亿帆医药	50,200	837,336.00	0.27
87	002273	水晶光电	40,288	831,141.44	0.27
88	002001	新和成	42,800	830,748.00	0.27
89	000400	许继电气	45,994	826,052.24	0.27
90	603019	中科曙光	29,300	824,502.00	0.27
91	002244	滨江集团	118,124	817,418.08	0.26
92	600392	盛和资源	61,527	811,541.13	0.26
93	600298	安琪酵母	31,300	809,731.00	0.26
94	600755	厦门国贸	88,602	808,050.24	0.26
95	002384	东山精密	32,613	805,541.10	0.26
96	600808	马钢股份	226,700	802,518.00	0.26
97	600635	大众公用	147,000	801,150.00	0.26
98	300324	旋极信息	43,600	795,264.00	0.26
99	600717	天津港	63,600	794,364.00	0.26
100	000547	航天发展	76,000	794,200.00	0.26
101	000930	中粮生化	73,288	790,044.64	0.25
102	000401	冀东水泥	51,217	788,229.63	0.25
103	600240	华业资本	86,581	784,423.86	0.25
104	600409	三友化工	77,794	783,385.58	0.25
105	300244	迪安诊断	24,900	783,354.00	0.25
106	000418	小天鹅A	16,734	782,983.86	0.25
107	600122	宏图高科	70,411	781,562.10	0.25
108	002176	江特电机	89,400	779,568.00	0.25
109	601231	环旭电子	49,600	779,216.00	0.25
110	600872	中炬高新	42,350	775,005.00	0.25
111	002491	通鼎互联	57,600	774,144.00	0.25
112	600160	巨化股份	64,200	772,326.00	0.25
113	300146	汤臣倍健	55,900	768,066.00	0.25
114	000598	兴蓉环境	136,200	765,444.00	0.25
115	600633	浙数文化	39,600	765,072.00	0.25

116	300058	蓝色光标	97,700	764,014.00	0.25
117	000960	锡业股份	55,900	760,799.00	0.25
118	002439	启明星辰	40,900	760,740.00	0.25
119	002601	龙麟佰利	46,300	758,394.00	0.24
120	600418	江淮汽车	71,862	758,144.10	0.24
121	600500	中化国际	79,200	757,152.00	0.24
122	600062	华润双鹤	27,500	754,325.00	0.24
123	000825	太钢不锈	173,200	753,420.00	0.24
124	002013	中航机电	72,904	753,098.32	0.24
125	300159	新研股份	56,600	749,384.00	0.24
126	002408	齐翔腾达	67,463	747,490.04	0.24
127	600143	金发科技	123,900	747,117.00	0.24
128	002400	省广股份	92,688	744,284.64	0.24
129	000685	中山公用	67,244	736,321.80	0.24
130	002354	天神娱乐	34,180	734,870.00	0.24
131	600594	益佰制药	48,100	734,006.00	0.24
132	000513	丽珠集团	10,698	728,533.80	0.24
133	000089	深圳机场	77,900	728,365.00	0.24
134	000078	海王生物	120,750	728,122.50	0.23
135	000729	燕京啤酒	107,100	719,712.00	0.23
136	000979	中弘股份	273,190	715,757.80	0.23
137	601699	潞安环能	90,900	710,838.00	0.23
138	600312	平高电气	51,500	707,610.00	0.23
139	600811	东方集团	108,500	707,420.00	0.23
140	600967	内蒙一机	51,901	707,410.63	0.23
141	002127	南极电商	58,500	706,680.00	0.23
142	000926	福星股份	57,690	703,818.00	0.23
143	600566	济川药业	18,500	703,555.00	0.23
144	600881	亚泰集团	138,210	702,106.80	0.23
145	600884	杉杉股份	42,572	701,160.84	0.23
146	002051	中工国际	33,740	699,430.20	0.23
147	000697	炼石有色	34,122	698,477.34	0.23
148	300122	智飞生物	36,500	697,515.00	0.23
149	601880	大连港	235,099	695,893.04	0.22
150	002640	跨境通	32,700	694,875.00	0.22
151	600970	中材国际	79,950	694,765.50	0.22
152	000690	宝新能源	115,751	692,190.98	0.22
153	002431	棕榈股份	62,750	691,505.00	0.22
154	000988	华工科技	47,359	690,967.81	0.22

155	600026	中远海能	103,970	689,321.10	0.22
156	002373	千方科技	50,400	687,456.00	0.22
157	600809	山西汾酒	19,800	686,862.00	0.22
158	002701	奥瑞金	107,420	686,413.80	0.22
159	600499	科达洁能	85,800	681,252.00	0.22
160	600183	生益科技	55,110	680,057.40	0.22
161	600307	酒钢宏兴	238,000	678,300.00	0.22
162	000806	银河生物	50,200	677,700.00	0.22
163	002390	信邦制药	77,700	676,767.00	0.22
164	002048	宁波华翔	32,311	674,007.46	0.22
165	002512	达华智能	41,700	673,455.00	0.22
166	600664	哈药股份	115,870	673,204.70	0.22
167	002221	东华能源	61,504	671,008.64	0.22
168	000600	建投能源	54,400	667,488.00	0.22
169	600863	内蒙华电	220,700	664,307.00	0.21
170	300253	卫宁健康	85,030	664,084.30	0.21
171	600787	中储股份	83,924	663,838.84	0.21
172	600094	大名城	86,500	663,455.00	0.21
173	600572	康恩贝	95,399	660,161.08	0.21
174	000012	南玻A	69,900	652,167.00	0.21
175	002191	劲嘉股份	69,474	650,276.64	0.21
176	000592	平潭发展	117,400	648,048.00	0.21
177	002665	首航节能	89,835	646,812.00	0.21
178	002635	安洁科技	17,850	646,527.00	0.21
179	300026	红日药业	137,202	646,221.42	0.21
180	600874	创业环保	32,979	645,399.03	0.21
181	002028	思源电气	40,420	644,294.80	0.21
182	000667	美好置业	194,400	643,464.00	0.21
183	300166	东方国信	47,818	642,195.74	0.21
184	000816	智慧农业	86,250	641,700.00	0.21
185	002603	以岭药业	36,600	639,036.00	0.21
186	002444	巨星科技	40,911	637,393.38	0.21
187	600478	科力远	74,000	637,140.00	0.21
188	000732	泰禾集团	38,100	635,508.00	0.21
189	300001	特锐德	37,900	635,204.00	0.20
190	002477	雏鹰农牧	142,977	633,388.11	0.20
191	000006	深振业A	71,719	631,844.39	0.20
192	600017	日照港	140,180	630,810.00	0.20
193	000758	中色股份	89,700	628,797.00	0.20

194	000975	银泰资源	49,360	623,416.80	0.20
195	600125	铁龙物流	69,487	622,603.52	0.20
196	000031	中粮地产	82,657	622,407.21	0.20
197	600064	南京高科	41,161	621,531.10	0.20
198	603077	和邦生物	121,974	620,847.66	0.20
199	600120	浙江东方	23,034	619,153.92	0.20
200	600348	阳泉煤业	91,300	619,014.00	0.20
201	002672	东江环保	36,545	617,245.05	0.20
202	000158	常山股份	38,700	611,460.00	0.20
203	600565	迪马股份	110,700	609,957.00	0.20
204	000939	凯迪生态	119,308	608,470.80	0.20
205	000027	深圳能源	90,300	607,719.00	0.20
206	000563	陕国投 A	117,500	607,475.00	0.20
207	000860	顺鑫农业	30,326	606,823.26	0.20
208	002250	联化科技	42,174	603,088.20	0.19
209	300287	飞利信	65,400	600,372.00	0.19
210	600198	大唐电信	46,935	599,359.95	0.19
211	300274	阳光电源	53,720	595,754.80	0.19
212	300116	坚瑞沃能	55,400	595,550.00	0.19
213	600597	光明乳业	46,700	595,425.00	0.19
214	600410	华胜天成	67,123	594,709.78	0.19
215	002261	拓维信息	50,697	593,661.87	0.19
216	000877	天山股份	46,795	592,892.65	0.19
217	002399	海普瑞	29,300	592,739.00	0.19
218	600416	湘电股份	43,032	589,538.40	0.19
219	002468	申通快递	23,200	589,512.00	0.19
220	002308	威创股份	45,093	588,463.65	0.19
221	002266	浙富控股	120,245	586,795.60	0.19
222	000727	华东科技	206,500	584,395.00	0.19
223	603766	隆鑫通用	80,248	584,205.44	0.19
224	600687	刚泰控股	45,200	582,176.00	0.19
225	600200	江苏吴中	43,866	579,031.20	0.19
226	600582	天地科技	125,800	577,422.00	0.19
227	002002	鸿达兴业	73,577	576,107.91	0.19
228	002353	杰瑞股份	36,400	575,848.00	0.19
229	002517	恺英网络	16,300	573,597.00	0.19
230	600039	四川路桥	137,639	572,578.24	0.18
231	601929	吉视传媒	165,400	572,284.00	0.18
232	600557	康缘药业	34,434	571,948.74	0.18

233	601928	凤凰传媒	58,000	566,080.00	0.18
234	002544	杰赛科技	24,700	563,160.00	0.18
235	600466	蓝光发展	64,900	560,087.00	0.18
236	600282	南钢股份	150,500	558,355.00	0.18
237	600751	天海投资	97,800	556,482.00	0.18
238	601689	拓普集团	16,600	555,934.00	0.18
239	600086	东方金钰	51,349	555,082.69	0.18
240	002396	星网锐捷	28,671	554,783.85	0.18
241	603000	人民网	42,100	554,457.00	0.18
242	300257	开山股份	26,073	549,618.84	0.18
243	300291	华录百纳	27,400	548,548.00	0.18
244	600380	健康元	60,268	547,233.44	0.18
245	002375	亚厦股份	61,100	544,401.00	0.18
246	002670	国盛金控	34,140	542,826.00	0.18
247	002022	科华生物	31,200	541,944.00	0.17
248	000501	鄂武商 A	29,229	539,567.34	0.17
249	600151	航天机电	65,355	537,871.65	0.17
250	000830	鲁西化工	77,907	537,558.30	0.17
251	000519	中兵红箭	42,627	537,100.20	0.17
252	002268	卫士通	31,920	536,894.40	0.17
253	300199	翰宇药业	34,900	535,366.00	0.17
254	002440	闰土股份	34,900	532,574.00	0.17
255	002368	太极股份	19,180	531,094.20	0.17
256	601717	郑煤机	68,110	530,576.90	0.17
257	002281	光迅科技	23,869	530,369.18	0.17
258	002589	瑞康医药	34,270	527,758.00	0.17
259	002489	浙江永强	82,594	526,949.72	0.17
260	600169	太原重工	136,400	526,504.00	0.17
261	600316	洪都航空	32,700	525,489.00	0.17
262	000703	恒逸石化	36,900	525,456.00	0.17
263	600611	大众交通	95,037	524,604.24	0.17
264	002155	湖南黄金	54,800	524,436.00	0.17
265	600366	宁波韵升	29,645	522,937.80	0.17
266	000528	柳工	60,500	522,720.00	0.17
267	600694	大商股份	13,400	522,198.00	0.17
268	600270	外运发展	27,560	521,710.80	0.17
269	600759	洲际油气	86,013	521,238.78	0.17
270	002657	中科金财	17,900	518,921.00	0.17
271	600835	上海机电	24,494	517,803.16	0.17

272	002342	巨力索具	51,071	514,284.97	0.17
273	600267	海正药业	44,000	513,920.00	0.17
274	300273	和佳股份	41,990	510,598.40	0.16
275	002709	天赐材料	12,400	510,508.00	0.16
276	000612	焦作万方	63,381	510,217.05	0.16
277	600108	亚盛集团	118,300	509,873.00	0.16
278	600187	国中水务	100,500	507,525.00	0.16
279	600648	外高桥	27,400	507,448.00	0.16
280	600563	法拉电子	10,219	504,920.79	0.16
281	000090	天健集团	45,443	504,417.30	0.16
282	600645	中源协和	23,430	502,104.90	0.16
283	601678	滨化股份	72,139	501,366.05	0.16
284	002503	搜于特	71,198	500,521.94	0.16
285	600993	马应龙	22,947	499,785.66	0.16
286	000712	锦龙股份	30,500	499,285.00	0.16
287	000937	冀中能源	81,400	498,168.00	0.16
288	002285	世联行	62,103	498,066.06	0.16
289	600848	上海临港	23,100	498,036.00	0.16
290	600729	重庆百货	18,500	496,540.00	0.16
291	002358	森源电气	28,900	491,878.00	0.16
292	600545	新疆城建	41,095	491,496.20	0.16
293	600098	广州发展	62,100	491,211.00	0.16
294	600765	中航重机	35,489	489,038.42	0.16
295	002437	誉衡药业	66,775	486,122.00	0.16
296	002122	天马股份	47,118	485,315.40	0.16
297	000049	德赛电池	9,337	483,749.97	0.16
298	002325	洪涛股份	66,150	482,895.00	0.16
299	603444	吉比特	1,700	481,661.00	0.16
300	000587	金洲慈航	32,317	481,523.30	0.16
301	002642	荣之联	19,150	479,899.00	0.15
302	000021	深科技	55,930	479,879.40	0.15
303	000810	创维数字	39,300	476,709.00	0.15
304	600750	江中药业	13,716	476,631.00	0.15
305	600073	上海梅林	49,900	476,545.00	0.15
306	300376	易事特	52,500	476,175.00	0.15
307	002018	华信国际	69,500	476,075.00	0.15
308	600422	昆药集团	41,964	475,871.76	0.15
309	002011	盾安环境	41,892	475,474.20	0.15
310	000543	皖能电力	81,541	475,384.03	0.15

311	600300	维维股份	88,980	475,153.20	0.15
312	002249	大洋电机	71,957	473,477.06	0.15
313	000829	天音控股	43,768	472,694.40	0.15
314	000777	中核科技	23,545	469,958.20	0.15
315	000766	通化金马	29,400	469,812.00	0.15
316	000669	金鸿能源	25,870	469,023.10	0.15
317	002056	横店东磁	62,364	467,730.00	0.15
318	600639	浦东金桥	25,812	467,713.44	0.15
319	000061	农产品	51,500	466,590.00	0.15
320	601016	节能风电	126,300	464,784.00	0.15
321	000636	风华高科	54,443	463,309.93	0.15
322	000897	津滨发展	98,399	462,475.30	0.15
323	002317	众生药业	37,173	461,688.66	0.15
324	002242	九阳股份	23,249	457,307.83	0.15
325	601311	骆驼股份	32,276	457,028.16	0.15
326	603188	亚邦股份	26,200	456,928.00	0.15
327	000572	海马汽车	87,500	452,375.00	0.15
328	600284	浦东建设	42,053	450,808.16	0.15
329	000762	西藏矿业	31,696	449,132.32	0.14
330	600259	广晟有色	11,500	448,960.00	0.14
331	600651	飞乐音响	52,700	446,369.00	0.14
332	000596	古井贡酒	8,754	446,016.30	0.14
333	600770	综艺股份	59,300	444,750.00	0.14
334	000848	承德露露	44,559	444,698.82	0.14
335	600496	精工钢构	91,798	443,384.34	0.14
336	600587	新华医疗	24,696	439,094.88	0.14
337	002123	梦网荣信	39,300	436,623.00	0.14
338	000062	深圳华强	16,400	435,092.00	0.14
339	600216	浙江医药	43,900	435,049.00	0.14
340	002106	莱宝高科	42,900	434,577.00	0.14
341	002254	泰和新材	32,559	433,034.70	0.14
342	600536	中国软件	22,567	432,383.72	0.14
343	002479	富春环保	36,300	431,970.00	0.14
344	002276	万马股份	42,752	431,367.68	0.14
345	002064	华峰氨纶	89,100	429,462.00	0.14
346	300010	立思辰	33,100	428,645.00	0.14
347	002482	广田集团	47,165	424,013.35	0.14
348	002073	软控股份	50,000	424,000.00	0.14
349	002428	云南锗业	39,696	423,953.28	0.14

350	002707	众信旅游	32,100	421,473.00	0.14
351	002332	仙琚制药	48,795	419,637.00	0.14
352	600458	时代新材	36,553	418,531.85	0.14
353	600171	上海贝岭	41,002	416,990.34	0.13
354	000652	泰达股份	78,465	415,864.50	0.13
355	000680	山推股份	75,404	410,951.80	0.13
356	000620	新华联	57,700	410,247.00	0.13
357	600289	亿阳信通	37,446	409,659.24	0.13
358	000969	安泰科技	46,784	408,424.32	0.13
359	000541	佛山照明	44,572	406,050.92	0.13
360	600428	中远海特	65,243	405,811.46	0.13
361	002463	沪电股份	89,099	405,400.45	0.13
362	600058	五矿发展	32,600	404,566.00	0.13
363	000726	鲁 泰 A	34,080	404,188.80	0.13
364	603883	老百姓	8,200	398,930.00	0.13
365	001696	宗申动力	52,200	395,154.00	0.13
366	002690	美亚光电	20,600	395,108.00	0.13
367	600329	中新药业	21,655	392,172.05	0.13
368	300297	蓝盾股份	35,700	390,915.00	0.13
369	600517	置信电气	51,503	389,877.71	0.13
370	601233	桐昆股份	28,100	389,466.00	0.13
371	300043	星辉娱乐	47,300	388,333.00	0.13
372	600894	广日股份	32,743	387,677.12	0.13
373	600736	苏州高新	54,412	384,692.84	0.12
374	000426	兴业矿业	42,588	384,143.76	0.12
375	601777	力帆股份	47,729	383,741.16	0.12
376	603556	海兴电力	8,700	381,843.00	0.12
377	603888	新华网	11,750	380,582.50	0.12
378	002063	远光软件	36,522	380,559.24	0.12
379	600859	王府井	23,564	380,558.60	0.12
380	600880	博瑞传播	58,216	380,150.48	0.12
381	600805	悦达投资	51,659	379,693.65	0.12
382	600586	金晶科技	77,600	379,464.00	0.12
383	600790	轻纺城	55,674	379,139.94	0.12
384	603369	今世缘	28,600	377,520.00	0.12
385	600338	西藏珠峰	9,900	376,101.00	0.12
386	000616	海航投资	86,935	373,820.50	0.12
387	000552	靖远煤电	104,220	372,065.40	0.12
388	600220	江苏阳光	108,381	371,746.83	0.12

389	002663	普邦股份	68,215	370,407.45	0.12
390	600720	祁连山	47,178	369,403.74	0.12
391	600395	盘江股份	50,300	368,699.00	0.12
392	600773	西藏城投	33,204	367,568.28	0.12
393	603377	东方时尚	9,700	364,623.00	0.12
394	002727	一心堂	19,808	364,467.20	0.12
395	603816	顾家家居	6,200	364,436.00	0.12
396	603355	莱克电气	6,200	364,374.00	0.12
397	300147	香雪制药	35,160	361,093.20	0.12
398	601886	江河集团	35,039	359,149.75	0.12
399	002681	奋达科技	28,420	357,807.80	0.12
400	002269	美邦服饰	95,500	356,215.00	0.11
401	600801	华新水泥	37,365	356,088.45	0.11
402	002120	韵达股份	6,900	356,040.00	0.11
403	600006	东风汽车	60,800	355,680.00	0.11
404	300039	上海凯宝	48,913	355,597.51	0.11
405	600460	士兰微	58,442	354,742.94	0.11
406	002005	德豪润达	74,300	354,411.00	0.11
407	002041	登海种业	26,740	354,305.00	0.11
408	002190	成飞集成	13,200	353,760.00	0.11
409	002345	潮宏基	32,180	349,796.60	0.11
410	600596	新安股份	41,314	349,103.30	0.11
411	002277	友阿股份	53,766	346,790.70	0.11
412	603198	迎驾贡酒	18,200	346,346.00	0.11
413	600053	九鼎投资	9,900	346,104.00	0.11
414	600280	中央商场	43,541	345,280.13	0.11
415	300202	聚龙股份	20,900	345,268.00	0.11
416	300032	金龙机电	24,700	344,565.00	0.11
417	600757	长江传媒	46,069	344,135.43	0.11
418	000417	合肥百货	41,552	342,804.00	0.11
419	000099	中信海直	30,390	342,191.40	0.11
420	600628	新世界	29,567	341,498.85	0.11
421	600059	古越龙山	36,900	341,325.00	0.11
422	600869	智慧能源	50,672	341,022.56	0.11
423	002588	史丹利	43,952	337,990.88	0.11
424	600141	兴发集团	27,200	336,464.00	0.11
425	600580	卧龙电气	48,977	334,023.14	0.11
426	601001	大同煤业	63,600	333,900.00	0.11
427	000681	视觉中国	21,300	333,558.00	0.11

428	002147	新光圆成	21,400	332,556.00	0.11
429	002371	北方华创	13,852	331,339.84	0.11
430	002233	塔牌集团	27,181	330,792.77	0.11
431	600754	锦江股份	12,200	330,620.00	0.11
432	600481	双良节能	61,522	326,681.82	0.11
433	002344	海宁皮城	39,000	324,480.00	0.10
434	600292	远达环保	29,648	319,605.44	0.10
435	600195	中牧股份	16,276	315,591.64	0.10
436	601002	晋亿实业	36,077	312,066.05	0.10
437	600537	亿晶光电	62,484	311,170.32	0.10
438	600971	恒源煤电	37,980	308,777.40	0.10
439	600862	中航高科	31,800	308,142.00	0.10
440	600640	号百控股	18,128	306,363.20	0.10
441	002309	中利集团	24,300	303,993.00	0.10
442	600748	上实发展	41,946	302,011.20	0.10
443	600743	华远地产	71,225	300,569.50	0.10
444	600826	兰生股份	15,982	289,274.20	0.09
445	600184	光电股份	15,380	288,528.80	0.09
446	002168	深圳惠程	16,920	287,470.80	0.09
447	002699	美盛文化	20,800	287,040.00	0.09
448	600251	冠农股份	35,722	284,704.34	0.09
449	600996	贵广网络	23,700	283,689.00	0.09
450	300088	长信科技	18,000	283,500.00	0.09
451	603169	兰石重装	23,300	283,095.00	0.09
452	600335	国机汽车	23,451	280,473.96	0.09
453	600831	广电网络	27,545	274,072.75	0.09
454	600673	东阳光科	37,500	273,375.00	0.09
455	002551	尚荣医疗	16,894	272,500.22	0.09
456	002093	国脉科技	30,691	270,080.80	0.09
457	002392	北京利尔	45,502	269,826.86	0.09
458	002118	紫鑫药业	38,920	265,823.60	0.09
459	002414	高德红外	14,192	259,713.60	0.08
460	002416	爱施德	23,500	253,565.00	0.08
461	600776	东方通信	36,281	245,985.18	0.08
462	000536	华映科技	42,000	244,020.00	0.08
463	002251	步步高	19,662	243,612.18	0.08
464	600551	时代出版	15,385	242,929.15	0.08
465	603005	晶方科技	8,600	240,714.00	0.08
466	002646	青青稞酒	13,769	240,406.74	0.08

467	603698	航天工程	9,300	234,360.00	0.08
468	600655	豫园商城	20,672	234,007.04	0.08
469	603001	奥康国际	12,196	229,162.84	0.07
470	603868	飞科电器	3,700	228,808.00	0.07
471	603568	伟明环保	10,450	225,929.00	0.07
472	000517	荣安地产	48,300	224,595.00	0.07
473	000025	特力A	4,200	217,308.00	0.07
474	603567	珍宝岛	12,900	217,107.00	0.07
475	603328	依顿电子	15,200	215,080.00	0.07
476	600936	广西广电	25,400	204,978.00	0.07
477	600126	杭钢股份	29,600	203,056.00	0.07
478	603528	多伦科技	14,100	202,617.00	0.07
479	002807	江阴银行	16,100	201,733.00	0.07
480	603806	福斯特	6,100	195,261.00	0.06
481	300134	大富科技	7,900	184,544.00	0.06
482	600468	百利电气	28,251	183,631.50	0.06
483	603228	景旺电子	3,800	183,350.00	0.06
484	600618	氯碱化工	17,117	182,809.56	0.06
485	002315	焦点科技	7,252	180,864.88	0.06
486	603515	欧普照明	4,900	176,988.00	0.06
487	601020	华钰矿业	8,000	176,240.00	0.06
488	603866	桃李面包	4,800	170,784.00	0.06
489	002194	武汉凡谷	17,193	152,158.05	0.05
490	603658	安图生物	3,200	137,920.00	0.04
491	002025	航天电器	5,490	136,975.50	0.04
492	002815	崇达技术	4,100	135,464.00	0.04
493	002818	富森美	3,400	134,198.00	0.04
494	600277	亿利洁能	17,100	133,893.00	0.04
495	603877	太平鸟	4,400	123,156.00	0.04
496	600917	重庆燃气	13,000	122,590.00	0.04
497	601811	新华文轩	7,800	121,368.00	0.04
498	000761	本钢板材	22,900	119,767.00	0.04
499	002505	大康农业	33,770	118,195.00	0.04
500	002128	露天煤业	13,431	116,849.70	0.04
501	603569	长久物流	3,400	113,662.00	0.04
502	603025	大豪科技	3,800	100,320.00	0.03
503	600657	信达地产	15,610	89,913.60	0.03
504	000693	*ST 华泽	6,242	78,025.00	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	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
2	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
3	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
4	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
5	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
6	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
7	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
8	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
9	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
10	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
11	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
12	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
13	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
14	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
15	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
16	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
17	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
18	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	1,300,303.01	1.58
2	000778	新兴铸管	1,079,570.98	1.31
3	603799	华友钴业	1,022,741.00	1.24
4	000039	中集集团	983,985.68	1.19
5	600839	四川长虹	982,939.00	1.19
6	000050	深天马 A	968,893.00	1.18
7	601168	西部矿业	918,704.00	1.11
8	300002	神州泰岳	883,694.30	1.07

9	300383	光环新网	838,340.00	1.02
10	002583	海能达	812,748.00	0.99
11	300058	蓝色光标	799,923.43	0.97
12	002127	南极电商	732,758.00	0.89
13	000729	燕京啤酒	727,613.00	0.88
14	002601	龙麟佰利	715,530.00	0.87
15	600566	济川药业	711,062.00	0.86
16	300266	兴源环境	709,041.00	0.86
17	002050	三花智控	679,608.00	0.82
18	300146	汤臣倍健	660,578.64	0.80
19	000732	泰禾集团	635,249.00	0.77
20	000027	深圳能源	630,432.00	0.76

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	1,710,235.60	2.07
2	600522	中天科技	1,680,622.00	2.04
3	600682	南京新百	1,436,822.00	1.74
4	600436	片仔癀	1,351,340.00	1.64
5	002602	世纪华通	977,820.00	1.19
6	000959	首钢股份	860,032.00	1.04
7	600497	驰宏锌锗	790,363.00	0.96
8	002595	豪迈科技	694,821.96	0.84
9	600601	方正科技	651,222.12	0.79
10	000961	中南建设	595,259.00	0.72
11	600067	冠城大通	558,333.47	0.68
12	600575	皖江物流	530,770.58	0.64
13	600175	美都能源	483,806.95	0.59
14	600851	海欣股份	473,559.00	0.57
15	600823	世茂股份	455,739.08	0.55
16	601010	文峰股份	439,878.81	0.53
17	002581	未名医药	432,352.00	0.52
18	000973	佛塑科技	429,607.41	0.52
19	600850	华东电脑	395,794.50	0.48

20	002498	汉缆股份	383,190.00	0.46
----	--------	------	------------	------

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	49,138,871.71
卖出股票收入（成交）总额	38,652,736.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	6,033.44
2	应收证券清算款	219,428.64
3	应收股利	-
4	应收利息	1,578.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	227,041.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	1,947,612.00	0.63	重大事项停牌
2	600643	爱建集团	1,699,900.44	0.55	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	002879	长缆科技	23,660.26	0.01	新股流通受限

§ 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
211	912,668.04	3,220,148.00	1.67%	1,352,808.00	0.70%

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
景顺长城中证 500 交易型开放式指 数证券投资基金联接基金	188,000,000.00	97.63%

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	中国银行股份有限公司—景顺长城 中证 500 交易型开放式指数证券投 资基金联接基金	188,000,000.00	97.63%
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000.00	1.04%
3	福建道冲投资管理有限公司—道冲 补天 1 号私募基金	630,014.00	0.33%
4	上海道策信息技术有限公司	505,200.00	0.26%
5	杜月仙	100,000.00	0.05%
6	张舒云	97,400.00	0.05%
7	沈健美	78,000.00	0.04%
8	田凯平	74,202.00	0.04%
9	邱雨	71,800.00	0.04%
10	郭志峰	60,000.00	0.03%
11	马宝茹	51,800.00	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

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

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 26 日）基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	50,572,956.00
本报告期基金总申购份额	146,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	192,572,956.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

在本报告期内，基金管理人、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

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中国银河证 券股份有限 公司	1	45,324,966.15	52.77%	42,211.83	52.77%	-
长城证券股 份有限公司	3	40,566,469.47	47.23%	37,779.79	47.23%	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准：

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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

2、本基金本期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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东方证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 19 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易“精明 i 定投” PE 区间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 6 日
3	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 9 日
4	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 9 日
5	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
6	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 17 日
8	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 24 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2017 年 6 月 30 日

	金管理人网站	
--	--------	--

§ 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
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20170101—20170630	46,000,000.00	146,000,000.00	4,000,000.00	188,000,000.00	97.63%

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日