

诺安中证 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：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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.....	6
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.....	错误!未定义书签。
§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.....	11
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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58

10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	诺安中证 500ETF
场内简称	诺安 500
基金主代码	510520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 7 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
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	97,090,964.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 3 月 10 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	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法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		诺安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	王永民
	联系电话	0755-83026688	010-66594896
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95566
传真		0755-83026677	010-66594942
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 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		秦维舟	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》、《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.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 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	-4,984,121.06
本期利润	-3,324,853.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0338
本期加权平均净值利润率	-2.09%
本期基金份额净值增长率	-2.18%
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	57,714,675.69
期末可供分配基金份额利润	0.5944
期末基金资产净值	154,805,639.69
期末基金份额净值	1.5944
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	59.44%

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申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 期末可供分配利润是采用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。

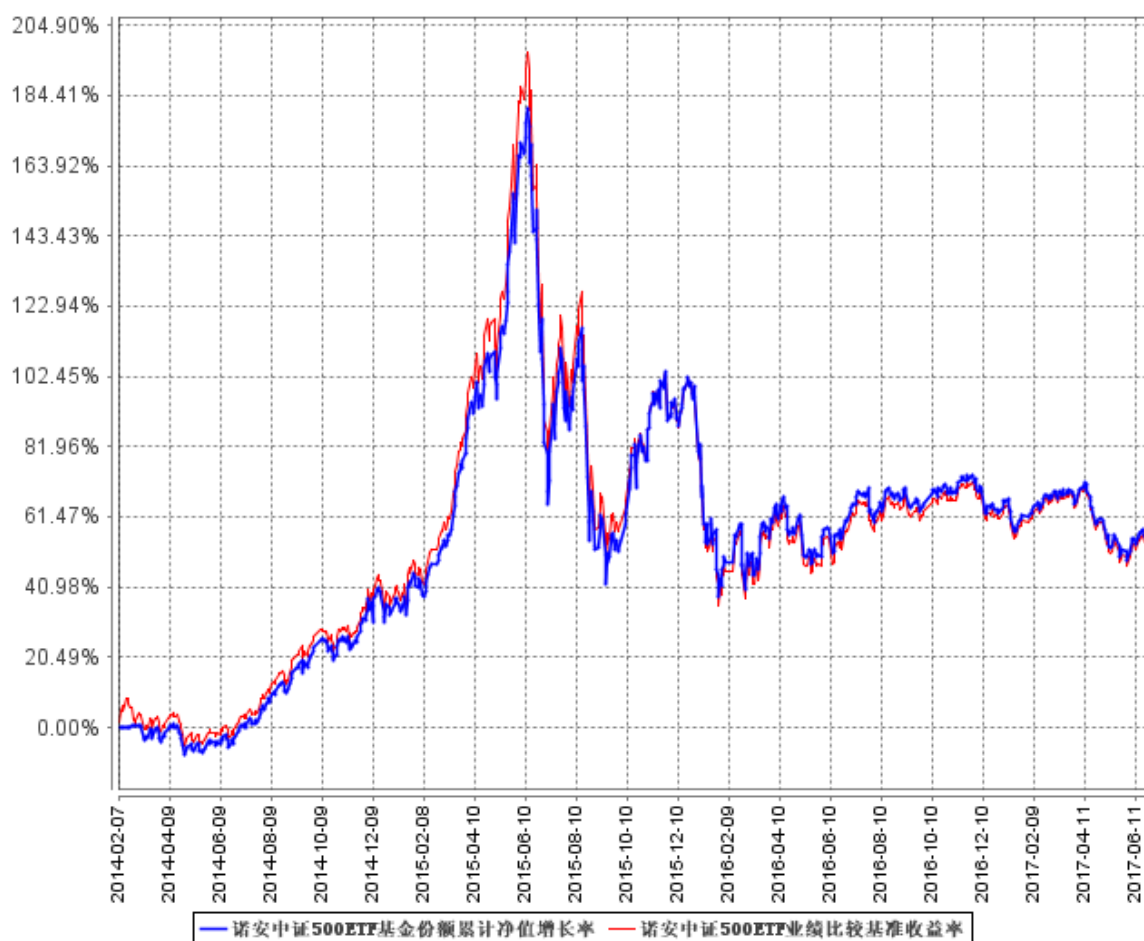
3.2 基金净值表现

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	5.24%	0.90%	5.39%	0.93%	-0.15%	-0.03%
过去三个月	-3.85%	0.98%	-4.12%	1.02%	0.27%	-0.04%
过去六个月	-2.18%	0.86%	-2.00%	0.90%	-0.18%	-0.04%
过去一年	-0.69%	0.87%	0.24%	0.91%	-0.93%	-0.04%
过去三年	62.18%	1.99%	56.39%	2.06%	5.79%	-0.07%
自基金合同生效起至今	59.44%	1.90%	57.98%	1.98%	1.46%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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：本基金的建仓期为 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2017 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 52 只开放式基金: 诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金等。

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		
梅律吾	指数组负责	2014 年 2 月 7 日	-	20	硕士, 具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金

	人，诺安中证 100 指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理			管理有限公司；2005 年 3 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监，现任指数组负责人。曾于 2007 年 11 月至 2009 年 10 月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2009 年 3 月至 2010 年 10 月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011 年 9 月至 2012 年 11 月担任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理，2012 年 7 月起任诺安中证 100 指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 2 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间，诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组

合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内，本基金在合同规定的股票投资占比下，完全复制指数，因此，跟踪误差来自三个方面，第一，来自两次指数成份股定期调整，第二，股票投资不能满仓运作导致的偏离，第三，由于停牌股票不能同步调整。本基金管理人在基金合同规定的最低股票投资比例下，满足篮子赎回所需预估现金要求的情况下，尽可能完全同步指数，以最优控制基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5944 元。本报告期基金份额净值增长率为-2.18%，同期业绩比较基准收益率为-2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一年,从技术角度,不要轻易看多大盘,也不应轻易看空小盘行情;从基本面角度,业绩的持续性确保了上市公司业绩大幅度变动的可能性很小,但是这并不意味着行情没有大的波动。从时点来看,所有的不确定,都是事前的,所有的确定,都是事后的;从时期来看,时期是由一个个时点构成,因此,时期的不确定性也是事前的。投资收益意味着,把不确定变成确定,这从理论上来说是矛盾的,也就是说,投资收益也是事前的,也是不确定的;那么,研究的作用既然不能消除事件本身的不确定,那就应该帮助投资者认识到这种不确定,消除投资损益给投资者带来的情绪躁动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本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务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部、风险控制部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定,本基金的收益分配原则为:每份基金份额享有同等分配权;基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,基金管理人有权进行收益分配;在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年至多分配 12 次,每次基金收益分配数额的确定原则为:使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率;本基金收益分配采取现金方式;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日出现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”）在对诺安中证 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：诺安中证 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	5,605,383.39	6,098,597.82
结算备付金		443.10	90.82
存出保证金		4,018.23	8,433.68
交易性金融资产	6.4.7.2	149,849,193.81	159,020,449.43
其中：股票投资		149,849,193.81	159,020,449.43
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	890.75	1,426.19
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		155,459,929.28	165,128,997.94
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		16,299.33	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		61,822.26	70,534.13
应付托管费		12,364.44	14,106.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	41,673.80	70,090.73
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	522,129.76	204,213.36
负债合计		654,289.59	358,945.04
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	97,090,964.00	101,090,964.00
未分配利润	6.4.7.10	57,714,675.69	63,679,088.90
所有者权益合计		154,805,639.69	164,770,052.90
负债和所有者权益总计		155,459,929.28	165,128,997.94

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5944 元，基金份额总额 97,090,964.00 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中证 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		-2,526,515.62	-36,481,891.77
1.利息收入		23,752.32	25,022.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,752.32	25,022.70
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,230,057.17	-7,395,561.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,063,875.31	-8,305,236.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	833,818.14	909,674.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,659,267.21	-29,164,917.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,522.02	53,565.11
减：二、费用		798,338.23	871,538.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	395,451.18	416,144.89

2. 托管费	6.4.10.2.2	79,090.22	83,228.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	74,345.50	122,365.89
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	249,451.33	249,798.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,324,853.85	-37,353,430.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,324,853.85	-37,353,430.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中证 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）	101,090,964.00	63,679,088.90	164,770,052.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,324,853.85	-3,324,853.85
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）	-4,000,000.00	-2,639,559.36	-6,639,559.36
其中：1. 基金申购款	2,000,000.00	1,178,915.67	3,178,915.67
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-3,818,475.03	-9,818,475.03
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）	97,090,964.00	57,714,675.69	154,805,639.69
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）	105,090,964.00	101,253,185.55	206,344,149.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-37,353,430.09	-37,353,430.09
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）	2,000,000.00	946,135.14	2,946,135.14
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	3,241,342.35	9,241,342.35
2. 基金赎回款	-4,000,000.00	-2,295,207.21	-6,295,207.21
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）	107,090,964.00	64,845,890.60	171,936,854.60

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：

 奥成文 薛有为 薛有为
 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

诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2013]1513 号文《关于核准诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》批准,于 2014 年 1 月 6 日至 2014 年 1 月 24 日向社会进行公开募集,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本基金首次向社会公开募集且扣除认购费后的有效认购资金人民币 733,792,000.00 元,有效认购金额产生的利息为人民币 14,000.00 元,折成基金份额的净认购金额和利息为人民币 733,806,000.00 元,折合 733,806,000.00 份基金份额;本基金首次向社会公开发售的有效股票认购数量为 17,223,500.00 股,按照网下股票认购期最后一日(2014 年 1 月 24 日)均价折合有效认购股票市值金额合计人民币 145,284,964.00 元,折合 145,284,964.00 份基金份额。基金合同生效日为 2014 年 2 月 7 日,合同生效日基金份额为 879,090,964.00 份基金份额。

经上海证券交易所（以下简称：上交所）上证债字[2014]64 号文核准同意，本基金于 2014 年 3 月 10 日在上交所挂牌交易。上市交易前，本基金未进行份额折算。

本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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

[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税。

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

(4) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下简称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，资产管理产品管理人运营资产管理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。对资产管理产品在 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，已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(5) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(6) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2016 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2016 年 9 月 8 日及以后的，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) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和

企业所得税。

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	5,605,383.39
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,605,383.39

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	167,473,547.27	149,849,193.81	-17,624,353.46
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	167,473,547.27	149,849,193.81	-17,624,353.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告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	888.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.22
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	1.62
合计	890.75

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	41,673.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,673.80

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	148,765.71
指数使用费	50,000.00
可退替代款	18,455.00
应付替代款	304,909.05
合计	522,129.76

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	101,090,964.00	101,090,964.00
本期申购	2,000,000.00	2,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	97,090,964.00	97,090,964.00

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	99,430,345.79	-35,751,256.89	63,679,088.90
本期利润	-4,984,121.06	1,659,267.21	-3,324,853.85
本期基金份额交易产生的变动数	-3,910,576.86	1,271,017.50	-2,639,559.36
其中：基金申购款	1,865,595.01	-686,679.34	1,178,915.67
基金赎回款	-5,776,171.87	1,957,696.84	-3,818,475.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,535,647.87	-32,820,972.18	57,714,675.69

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	23,207.61
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	506.43
其他	38.28
合计	23,752.32

注：本报告期内“其他”为保证金利息收入。

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	-4,561,274.62

股票投资收益——赎回差价收入	-502,600.69
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,063,875.31

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	25,900,027.45
减：卖出股票成本总额	30,461,302.07
买卖股票差价收入	-4,561,274.62

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	9,818,475.03
减：现金支付赎回款总额	5,238,763.03
减：赎回股票成本总额	5,082,312.69
赎回差价收入	-502,600.69

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	833,818.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	833,818.14

6.4.7.17 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	1,659,267.21
——股票投资	1,659,267.21
——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	1,659,267.21

6.4.7.18 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	20,522.02
合计	20,522.02

注：替代损益是指投资者采用现金替代股票方式申购本基金时，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，或未补票强制退款的替代股票在强制退款日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 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	74,345.50
银行间市场交易费用	-
合计	74,345.50

6.4.7.20 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	19,835.79
信息披露费	99,177.14
上市费	29,752.78
银行汇划费	685.62
指数使用费	100,000.00
合计	249,451.33

注：(1)“上市费”为上交所向本基金征收的上市年费，上市年费为每年 60,000 元。

(2)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，逐日计提，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 50,000.00 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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

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
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、直销机构
中国银行股份有限公司	托管人
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

6.4.10 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

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	395,451.18	416,144.89
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	79,090.22	83,228.94

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
诺安中证 500 交易型开放式 指数证券投资 基金联接基金	90,000,000.00	92.7000%	94,000,000.00	92.9900%

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
中国银行股份有限公司	5,605,383.39	23,207.61	6,903,740.12	23,497.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 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 5 日	重大事项	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	140,600	767,749.93	919,524.00	-
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大事项	14.98	2017 年 8 月 2 日	16.48	56,040	775,010.71	839,479.20	-
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	重大事项	16.99	-	-	33,500	386,508.81	569,165.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事项	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	34,000	383,808.89	535,500.00	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项	7.29	-	-	68,692	539,289.29	500,764.68	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项	11.32	-	-	36,400	631,050.52	412,048.00	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事项	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	35,632	457,704.91	368,078.56	-
002127	南极电商	2017 年 6 月 29 日	重大事项	12.08	2017 年 7 月 6 日	12.61	27,100	335,084.16	327,368.00	-
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大事项	23.36	-	-	13,920	395,658.18	325,171.20	-
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事项	7.79	-	-	37,500	308,158.57	292,125.00	-
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事项	20.23	-	-	14,200	255,519.42	287,266.00	-
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事项	20.02	-	-	13,500	395,287.07	270,270.00	-
600277	亿利洁能	2017 年 3 月 6 日	重大事项	7.83	-	-	33,900	216,651.08	265,437.00	-
002025	航天	2016 年 9 月 12 日	重大事项	24.95	2017 年 7 月 4 日	22.46	9,640	293,651.60	240,518.00	-

	电器	日									
002122	天马股份	2017年4月24日	重大事项	10.30	2017年7月24日	11.15	22,800	199,464.70	234,840.00	-	
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事项	25.06	2017年7月7日	22.54	9,272	264,717.32	232,356.32	-	
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项	3.50		-	65,780	245,352.40	230,230.00	-	
002358	森源电气	2017年5月12日	重大事项	17.02	2017年7月12日	16.68	13,512	233,488.91	229,974.24	-	
600545	新疆城建	2017年6月22日	重大事项	11.96	2017年7月3日	12.44	18,700	254,386.21	223,652.00	-	
000061	农产品	2017年6月28日	重大事项	9.06		-	23,300	211,813.91	211,098.00	-	
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事项	8.70	2017年8月14日	9.57	24,000	226,990.83	208,800.00	-	
000099	中信海直	2017年5月4日	重大事项	11.26		-	18,200	315,811.29	204,932.00	-	
600289	亿阳信通	2017年5月10日	重大事项	10.94	2017年8月18日	12.03	18,600	318,802.67	203,484.00	-	
000693	*ST华泽	2016年3月1日	重大事项	12.50		-	15,000	252,883.18	187,500.00	-	
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项	12.59	2017年7月3日	12.70	13,940	226,345.05	175,504.60	-	
601001	大同煤业	2017年6月22日	重大事项	5.25	2017年7月21日	5.78	32,400	220,532.39	170,100.00	-	
600657	信达地产	2017年2月20日	重大事项	5.76	2017年8月10日	6.19	29,294	207,934.81	168,733.44	-	
600460	士兰微	2017年5月12日	重大事项	6.07	2017年8月15日	6.68	27,250	202,583.84	165,407.50	-	
600468	百利电气	2017年5月16日	重大事项	6.50		-	13,800	151,241.33	89,700.00	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险,并设定适当的投资限额,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成:第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导;第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、监察稽核部、风险控制部所监控;第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券,并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外,本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易,资产变现能力强。

本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率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市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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

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	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	5,605,383.39	-	-	-	-	5,605,383.39
结算备付金	443.10	-	-	-	-	443.10
存出保证金	4,018.23	-	-	-	-	4,018.23
交易性金融资产	-	-	-	-	149,849,193.81	149,849,193.81
应收利息	-	-	-	-	890.75	890.75
资产总计	5,609,844.72	-	-	-	149,850,084.56	155,459,929.28
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	16,299.33	16,299.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	61,822.26	61,822.26
应付托管费	-	-	-	-	12,364.44	12,364.44
应付交易费用	-	-	-	-	41,673.80	41,673.80

其他负债	-	-	-	-	522,129.76	522,129.76
负债总计	-	-	-	-	654,289.59	654,289.59
利率敏感度缺口	5,609,844.72	-	-	-	-149,195,794.97	154,805,639.69
上年度末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	6,098,597.82	-	-	-	-	6,098,597.82
结算备付金	90.82	-	-	-	-	90.82
存出保证金	8,433.68	-	-	-	-	8,433.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-159,020,449.43	159,020,449.43
应收利息	-	-	-	-	1,426.19	1,426.19
资产总计	6,107,122.32	-	-	-	-159,021,875.62	165,128,997.94
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	70,534.13	70,534.13
应付托管费	-	-	-	-	14,106.82	14,106.82
应付交易费用	-	-	-	-	70,090.73	70,090.73
其他负债	-	-	-	-	204,213.36	204,213.36
负债总计	-	-	-	-	358,945.04	358,945.04
利率敏感度缺口	6,107,122.32	-	-	-	-158,662,930.58	164,770,052.90

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无债券投资,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、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、货币市场工具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)。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资,本基金有效降低了投资组合的其他价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。于 2017 年 6 月 30 日,

本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	149,849,193.81	96.80	159,020,449.43	96.51
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	149,849,193.81	96.80	159,020,449.43	96.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化 其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5	7,449,439.24	7,775,379.54
	2. 业绩比较基准下降 5	-7,449,439.24	-7,775,379.54

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布，在 95%的置信度下，使用过去一年的历史数据，按照 VaR 正态算法，计算未来一个交易日里，基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信区间 95%		
	2. 观察期 一年		
分析	风险价值 (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）
	基金投资组合的风险价值	2,207,935.62	2,263,324.74
	合计	2,207,935.62	2,263,324.74

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

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

② 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 140,760,167.07 元，属于第二层级的余额为 9,089,026.74 元，无属于第三层级的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层级 146,855,558.22 元，第二层级 12,164,891.21 元，无属于第三层级的余额)。

③ 公允价值所属层级间的重大变动

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、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票的公允价值列入第一层级。

④ 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	149,849,193.81	96.39
	其中：股票	149,849,193.81	96.39
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	5,605,826.49	3.61
7	其他各项资产	4,908.98	0.00
8	合计	155,459,929.28	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,885,220.20	1.22
B	采矿业	4,615,678.77	2.98
C	制造业	91,408,597.42	59.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,121,080.74	3.31
E	建筑业	3,415,785.67	2.21
F	批发和零售业	7,503,313.88	4.85
G	交通运输、仓储和邮政业	4,006,678.76	2.59
H	住宿和餐饮业	124,660.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,137,083.95	7.19
J	金融业	2,349,821.20	1.52
K	房地产业	9,251,025.05	5.98
L	租赁和商务服务业	3,035,990.77	1.96
M	科学研究和技术服务业	315,219.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	1,259,951.40	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	172,914.00	0.11
Q	卫生和社会工作	434,148.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,752,601.00	1.13
S	综合	685,275.00	0.44
	合计	148,475,044.81	95.91

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	187,500.00	0.12
C	制造业	1,186,649.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	1,374,149.00	0.89

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	603444	吉比特	4,600	1,303,318.00	0.84
2	300136	信维通信	28,100	1,124,562.00	0.73
3	000656	金科股份	140,600	919,524.00	0.59
4	600487	亨通光电	32,350	907,417.50	0.59
5	002460	赣锋锂业	18,400	851,000.00	0.55

6	600643	爱建集团	56,040	839,479.20	0.54
7	600201	生物股份	23,005	818,287.85	0.53
8	601012	隆基股份	46,000	786,600.00	0.51
9	300156	神雾环保	23,100	756,756.00	0.49
10	002572	索菲亚	18,400	754,400.00	0.49
11	600176	中国巨石	64,600	709,308.00	0.46
12	600525	长园集团	51,600	701,244.00	0.45
13	600219	南山铝业	205,050	695,119.50	0.45
14	002271	东方雨虹	18,500	686,350.00	0.44
15	000050	深天马 A	32,700	672,639.00	0.43
16	002405	四维图新	32,679	645,737.04	0.42
17	600642	申能股份	102,300	644,490.00	0.42
18	600079	人福医药	32,500	637,650.00	0.41
19	000998	隆平高科	28,010	616,780.20	0.40
20	300296	利亚德	32,300	607,240.00	0.39
21	600315	上海家化	18,700	606,815.00	0.39
22	000661	长春高新	4,630	597,779.30	0.39
23	002092	中泰化学	46,800	594,360.00	0.38
24	002340	格林美	98,130	593,686.50	0.38
25	600584	长电科技	36,959	593,191.95	0.38
26	000066	中国长城	65,182	587,289.82	0.38
27	300266	兴源环境	18,600	571,392.00	0.37
28	603799	华友钴业	9,300	565,254.00	0.37
29	600266	北京城建	37,500	545,250.00	0.35
30	600325	华发股份	65,080	543,418.00	0.35
31	300115	长盈精密	18,560	541,580.80	0.35
32	002422	科伦药业	32,700	540,204.00	0.35
33	300088	长信科技	34,000	535,500.00	0.35
34	600879	航天电子	60,700	533,553.00	0.34
35	600516	方大炭素	37,500	533,250.00	0.34
36	601168	西部矿业	69,300	532,917.00	0.34
37	002050	三花智控	32,400	528,768.00	0.34
38	000997	新大陆	23,060	523,231.40	0.34
39	000786	北新建材	32,530	515,275.20	0.33
40	600022	山东钢铁	247,440	509,726.40	0.33
41	600388	龙净环保	32,800	509,384.00	0.33
42	600291	西水股份	23,100	508,200.00	0.33
43	002407	多氟多	23,000	505,770.00	0.33
44	600673	东阳光科	68,692	500,764.68	0.32

45	000039	中集集团	27,600	497,628.00	0.32
46	000778	新兴铸管	74,000	495,800.00	0.32
47	600426	华鲁恒升	42,169	495,064.06	0.32
48	600138	中青旅	23,338	491,498.28	0.32
49	600521	华海药业	23,320	490,652.80	0.32
50	600600	青岛啤酒	13,953	489,750.30	0.32
51	600839	四川长虹	134,300	486,166.00	0.31
52	600166	福田汽车	170,900	485,356.00	0.31
53	000581	威孚高科	18,500	479,150.00	0.31
54	000970	中科三环	32,400	478,872.00	0.31
55	600056	中国医药	18,400	477,480.00	0.31
56	600435	北方导航	32,500	465,075.00	0.30
57	600161	天坛生物	11,960	464,167.60	0.30
58	600260	凯乐科技	18,300	463,722.00	0.30
59	600528	中铁工业	32,400	462,996.00	0.30
60	002217	合力泰	46,800	462,384.00	0.30
61	002583	海能达	28,002	450,552.18	0.29
62	600699	均胜电子	13,991	448,971.19	0.29
63	300383	光环新网	32,800	444,768.00	0.29
64	002223	鱼跃医疗	18,710	443,052.80	0.29
65	000999	华润三九	13,900	441,325.00	0.29
66	601000	唐山港	83,920	438,062.40	0.28
67	002573	清新环境	23,260	437,753.20	0.28
68	002366	台海核电	9,300	436,263.00	0.28
69	300244	迪安诊断	13,800	434,148.00	0.28
70	002179	中航光电	13,902	433,603.38	0.28
71	000878	云南铜业	32,800	432,632.00	0.28
72	002410	广联达	23,000	432,400.00	0.28
73	300055	万邦达	23,400	430,560.00	0.28
74	000418	小天鹅 A	9,200	430,468.00	0.28
75	300002	神州泰岳	51,000	425,340.00	0.27
76	300324	旋极信息	23,300	424,992.00	0.27
77	002311	海大集团	23,258	424,923.66	0.27
78	000488	晨鸣纸业	32,800	423,120.00	0.27
79	600978	宜华生活	42,100	423,105.00	0.27
80	600503	华丽家族	60,200	415,982.00	0.27
81	000400	许继电气	23,000	413,080.00	0.27
82	002078	太阳纸业	56,100	412,335.00	0.27
83	600655	豫园商城	36,400	412,048.00	0.27

84	600614	鹏起科技	37,300	410,300.00	0.27
85	002030	达安基因	18,763	408,845.77	0.26
86	600717	天津港	32,600	407,174.00	0.26
87	002038	双鹭药业	13,900	405,185.00	0.26
88	002004	华邦健康	51,500	403,245.00	0.26
89	000930	中粮生化	37,300	402,094.00	0.26
90	600158	中体产业	23,400	400,140.00	0.26
91	002354	天神娱乐	18,600	399,900.00	0.26
92	600418	江淮汽车	37,200	392,460.00	0.25
93	000547	航天发展	37,500	391,875.00	0.25
94	600160	巨化股份	32,567	391,781.01	0.25
95	600808	马钢股份	110,500	391,170.00	0.25
96	603019	中科曙光	13,900	391,146.00	0.25
97	002019	亿帆医药	23,200	386,976.00	0.25
98	002244	滨江集团	55,500	384,060.00	0.25
99	600062	华润双鹤	14,000	384,020.00	0.25
100	002601	龙蟠佰利	23,400	383,292.00	0.25
101	002051	中工国际	18,472	382,924.56	0.25
102	002273	水晶光电	18,550	382,686.50	0.25
103	300146	汤臣倍健	27,800	381,972.00	0.25
104	600635	大众公用	69,661	379,652.45	0.25
105	000028	国药一致	4,680	378,612.00	0.24
106	600240	华业资本	41,700	377,802.00	0.24
107	600755	厦门国贸	41,400	377,568.00	0.24
108	000960	锡业股份	27,700	376,997.00	0.24
109	000697	炼石有色	18,400	376,648.00	0.24
110	300113	顺网科技	14,000	376,600.00	0.24
111	002491	通鼎互联	27,800	373,632.00	0.24
112	600120	浙江东方	13,800	370,944.00	0.24
113	300159	新研股份	28,000	370,720.00	0.24
114	002400	省广股份	46,083	370,046.49	0.24
115	000598	兴蓉环境	65,500	368,110.00	0.24
116	002013	中航机电	35,632	368,078.56	0.24
117	601231	环旭电子	23,400	367,614.00	0.24
118	600392	盛和资源	27,800	366,682.00	0.24
119	300058	蓝色光标	46,800	365,976.00	0.24
120	000566	海南海药	27,600	365,976.00	0.24
121	002176	江特电机	41,800	364,496.00	0.24
122	002408	齐翔腾达	32,878	364,288.24	0.24

123	601699	潞安环能	46,400	362,848.00	0.23
124	000078	海王生物	60,050	362,101.50	0.23
125	002431	棕榈股份	32,850	362,007.00	0.23
126	000825	太钢不锈	83,200	361,920.00	0.23
127	600122	宏图高科	32,600	361,860.00	0.23
128	600633	浙数文化	18,700	361,284.00	0.23
129	002001	新和成	18,600	361,026.00	0.23
130	603589	口子窖	9,300	360,747.00	0.23
131	600143	金发科技	59,800	360,594.00	0.23
132	000685	中山公用	32,875	359,981.25	0.23
133	600298	安琪酵母	13,800	357,006.00	0.23
134	000979	中弘股份	135,840	355,900.80	0.23
135	000401	冀东水泥	23,100	355,509.00	0.23
136	600566	济川药业	9,300	353,679.00	0.23
137	600594	益佰制药	23,100	352,506.00	0.23
138	300122	智飞生物	18,400	351,624.00	0.23
139	000089	深圳机场	37,200	347,820.00	0.22
140	600183	生益科技	28,100	346,754.00	0.22
141	002384	东山精密	14,032	346,590.40	0.22
142	002439	启明星辰	18,518	344,434.80	0.22
143	000729	燕京啤酒	51,200	344,064.00	0.22
144	000600	建投能源	28,000	343,560.00	0.22
145	601880	大连港	115,690	342,442.40	0.22
146	000988	华工科技	23,400	341,406.00	0.22
147	600872	中炬高新	18,565	339,739.50	0.22
148	600511	国药股份	9,354	338,988.96	0.22
149	600026	中远海能	51,000	338,130.00	0.22
150	000926	福星股份	27,700	337,940.00	0.22
151	000690	宝新能源	56,100	335,478.00	0.22
152	002635	安洁科技	9,250	335,035.00	0.22
153	600787	中储股份	41,900	331,429.00	0.21
154	600811	东方集团	50,800	331,216.00	0.21
155	600307	酒钢宏兴	115,800	330,030.00	0.21
156	600499	科达洁能	41,400	328,716.00	0.21
157	600409	三友化工	32,600	328,282.00	0.21
158	002127	南极电商	27,100	327,368.00	0.21
159	600664	哈药股份	56,260	326,870.60	0.21
160	000006	深振业 A	37,100	326,851.00	0.21
161	002390	信邦制药	37,500	326,625.00	0.21

162	002701	奥瑞金	51,016	325,992.24	0.21
163	300134	大富科技	13,920	325,171.20	0.21
164	600970	中材国际	37,400	325,006.00	0.21
165	300253	卫宁健康	41,596	324,864.76	0.21
166	002603	以岭药业	18,600	324,756.00	0.21
167	600863	内蒙华电	107,700	324,177.00	0.21
168	002517	恺英网络	9,200	323,748.00	0.21
169	600478	科力远	37,555	323,348.55	0.21
170	600809	山西汾酒	9,300	322,617.00	0.21
171	600094	大名城	42,000	322,140.00	0.21
172	600572	康恩贝	46,500	321,780.00	0.21
173	600312	平高电气	23,400	321,516.00	0.21
174	600416	湘电股份	23,400	320,580.00	0.21
175	000031	中粮地产	42,200	317,766.00	0.21
176	600348	阳泉煤业	46,800	317,304.00	0.20
177	600017	日照港	70,100	315,450.00	0.20
178	002373	千方科技	23,100	315,084.00	0.20
179	600967	内蒙一机	23,100	314,853.00	0.20
180	000513	丽珠集团	4,620	314,622.00	0.20
181	002672	东江环保	18,625	314,576.25	0.20
182	000806	银河生物	23,300	314,550.00	0.20
183	300166	东方国信	23,419	314,517.17	0.20
184	000027	深圳能源	46,300	311,599.00	0.20
185	601689	拓普集团	9,300	311,457.00	0.20
186	002281	光迅科技	14,016	311,435.52	0.20
187	000816	智慧农业	41,800	310,992.00	0.20
188	000667	美好置业	93,700	310,147.00	0.20
189	000592	平潭发展	56,000	309,120.00	0.20
190	300001	特锐德	18,429	308,870.04	0.20
191	600881	亚泰集团	60,800	308,864.00	0.20
192	300274	阳光电源	27,840	308,745.60	0.20
193	002477	雏鹰农牧	69,600	308,328.00	0.20
194	600884	杉杉股份	18,660	307,330.20	0.20
195	603077	和邦生物	60,300	306,927.00	0.20
196	000732	泰禾集团	18,400	306,912.00	0.20
197	600565	迪马股份	55,600	306,356.00	0.20
198	600200	江苏吴中	23,200	306,240.00	0.20
199	002221	东华能源	27,900	304,389.00	0.20
200	300026	红日药业	64,600	304,266.00	0.20

201	002308	威创股份	23,300	304,065.00	0.20
202	000012	南玻A	32,500	303,225.00	0.20
203	002512	达华智能	18,700	302,005.00	0.20
204	002665	首航节能	41,880	301,536.00	0.19
205	002191	劲嘉股份	32,200	301,392.00	0.19
206	000712	锦龙股份	18,400	301,208.00	0.19
207	300287	飞利信	32,800	301,104.00	0.19
208	002028	思源电气	18,720	298,396.80	0.19
209	300116	坚瑞沃能	27,700	297,775.00	0.19
210	600687	刚泰控股	23,100	297,528.00	0.19
211	002640	跨境通	14,000	297,500.00	0.19
212	600835	上海机电	14,000	295,960.00	0.19
213	002353	杰瑞股份	18,700	295,834.00	0.19
214	600597	光明乳业	23,200	295,800.00	0.19
215	002670	国盛金控	18,560	295,104.00	0.19
216	000877	天山股份	23,260	294,704.20	0.19
217	002266	浙富控股	60,200	293,776.00	0.19
218	600198	大唐电信	23,000	293,710.00	0.19
219	000758	中色股份	41,800	293,018.00	0.19
220	601717	郑煤机	37,500	292,125.00	0.19
221	000975	银泰资源	23,100	291,753.00	0.19
222	300257	开山股份	13,832	291,578.56	0.19
223	000158	常山股份	18,400	290,720.00	0.19
224	002444	巨星科技	18,655	290,644.90	0.19
225	000727	华东科技	102,700	290,641.00	0.19
226	000563	陕国投A	56,200	290,554.00	0.19
227	002002	鸿达兴业	37,097	290,469.51	0.19
228	600125	铁龙物流	32,401	290,312.96	0.19
229	002048	宁波华翔	13,900	289,954.00	0.19
230	002589	瑞康医药	18,700	287,980.00	0.19
231	002440	闰土股份	18,700	285,362.00	0.18
232	600410	华胜天成	32,200	285,292.00	0.18
233	603868	飞科电器	4,600	284,464.00	0.18
234	000939	凯迪生态	55,600	283,560.00	0.18
235	300199	翰宇药业	18,400	282,256.00	0.18
236	600466	蓝光发展	32,500	280,475.00	0.18
237	600064	南京高科	18,500	279,350.00	0.18
238	600582	天地科技	60,700	278,613.00	0.18
239	000860	顺鑫农业	13,900	278,139.00	0.18

240	600282	南钢股份	74,100	274,911.00	0.18
241	601928	凤凰传媒	28,100	274,256.00	0.18
242	603766	隆鑫通用	37,530	273,218.40	0.18
243	600039	四川路桥	65,400	272,064.00	0.18
244	600874	创业环保	13,900	272,023.00	0.18
245	601929	吉视传媒	78,200	270,572.00	0.17
246	002261	拓维信息	23,100	270,501.00	0.17
247	603816	顾家家居	4,600	270,388.00	0.17
248	603355	莱克电气	4,600	270,342.00	0.17
249	300291	华录百纳	13,500	270,270.00	0.17
250	600267	海正药业	23,100	269,808.00	0.17
251	002657	中科金财	9,300	269,607.00	0.17
252	002489	浙江永强	42,184	269,133.92	0.17
253	002396	星网锐捷	13,800	267,030.00	0.17
254	002250	联化科技	18,600	265,980.00	0.17
255	600751	天海投资	46,700	265,723.00	0.17
256	600277	亿利洁能	33,900	265,437.00	0.17
257	600151	航天机电	32,200	265,006.00	0.17
258	002155	湖南黄金	27,600	264,132.00	0.17
259	002503	搜于特	37,540	263,906.20	0.17
260	000703	恒逸石化	18,500	263,440.00	0.17
261	600270	外运发展	13,900	263,127.00	0.17
262	002285	世联行	32,676	262,061.52	0.17
263	000612	焦作万方	32,480	261,464.00	0.17
264	000090	天健集团	23,480	260,628.00	0.17
265	600187	国中水务	51,300	259,065.00	0.17
266	000501	鄂武商 A	14,020	258,809.20	0.17
267	600611	大众交通	46,750	258,060.00	0.17
268	600098	广州发展	32,600	257,866.00	0.17
269	601678	滨化股份	37,100	257,845.00	0.17
270	600765	中航重机	18,700	257,686.00	0.17
271	000830	鲁西化工	37,000	255,300.00	0.16
272	002368	太极股份	9,200	254,748.00	0.16
273	600759	洲际油气	41,967	254,320.02	0.16
274	000669	金鸿能源	13,968	253,239.84	0.16
275	000829	天音控股	23,400	252,720.00	0.16
276	600380	健康元	27,800	252,424.00	0.16
277	600639	浦东金桥	13,900	251,868.00	0.16
278	600086	东方金钰	23,200	250,792.00	0.16

279	300376	易事特	27,600	250,332.00	0.16
280	600587	新华医疗	14,000	248,920.00	0.16
281	600169	太原重工	64,400	248,584.00	0.16
282	600729	重庆百货	9,200	246,928.00	0.16
283	002249	大洋电机	37,500	246,750.00	0.16
284	000062	深圳华强	9,300	246,729.00	0.16
285	002375	亚厦股份	27,600	245,916.00	0.16
286	002056	横店东磁	32,680	245,100.00	0.16
287	603000	人民网	18,600	244,962.00	0.16
288	603188	亚邦股份	14,000	244,160.00	0.16
289	600366	宁波韵升	13,800	243,432.00	0.16
290	000528	柳工	28,100	242,784.00	0.16
291	000543	皖能电力	41,640	242,761.20	0.16
292	002022	科华生物	13,903	241,495.11	0.16
293	000049	德赛电池	4,650	240,916.50	0.16
294	000021	深科技	28,000	240,240.00	0.16
295	000636	风华高科	28,100	239,131.00	0.15
296	000025	特力A	4,600	238,004.00	0.15
297	600108	亚盛集团	55,200	237,912.00	0.15
298	002325	洪涛股份	32,540	237,542.00	0.15
299	002120	韵达股份	4,600	237,360.00	0.15
300	002106	莱宝高科	23,400	237,042.00	0.15
301	002437	誉衡药业	32,500	236,600.00	0.15
302	002468	申通快递	9,300	236,313.00	0.15
303	600651	飞乐音响	27,900	236,313.00	0.15
304	002122	天马股份	22,800	234,840.00	0.15
305	000596	古井贡酒	4,600	234,370.00	0.15
306	002342	巨力索具	23,200	233,624.00	0.15
307	000848	承德露露	23,312	232,653.76	0.15
308	002642	荣之联	9,272	232,356.32	0.15
309	002268	卫士通	13,800	232,116.00	0.15
310	002276	万马股份	23,000	232,070.00	0.15
311	000519	中兵红箭	18,410	231,966.00	0.15
312	600216	浙江医药	23,400	231,894.00	0.15
313	002505	大康农业	65,780	230,230.00	0.15
314	002358	森源电气	13,512	229,974.24	0.15
315	002317	众生药业	18,400	228,528.00	0.15
316	300273	和佳股份	18,760	228,121.60	0.15
317	600563	法拉电子	4,600	227,286.00	0.15

318	000937	冀中能源	36,800	225,216.00	0.15
319	603883	老百姓	4,600	223,790.00	0.14
320	600496	精工钢构	46,320	223,725.60	0.14
321	600545	新疆城建	18,700	223,652.00	0.14
322	000810	创维数字	18,400	223,192.00	0.14
323	600648	外高桥	12,000	222,240.00	0.14
324	600300	维维股份	41,600	222,144.00	0.14
325	603228	景旺电子	4,600	221,950.00	0.14
326	600316	洪都航空	13,800	221,766.00	0.14
327	002479	富春环保	18,600	221,340.00	0.14
328	002018	华信国际	32,300	221,255.00	0.14
329	601016	节能风电	60,000	220,800.00	0.14
330	000726	鲁泰A	18,601	220,607.86	0.14
331	000766	通化金马	13,800	220,524.00	0.14
332	600073	上海梅林	23,000	219,650.00	0.14
333	000897	津滨发展	46,500	218,550.00	0.14
334	000572	海马汽车	41,600	215,072.00	0.14
335	002544	杰赛科技	9,300	212,040.00	0.14
336	000541	佛山照明	23,200	211,352.00	0.14
337	000061	农产品	23,300	211,098.00	0.14
338	600458	时代新材	18,400	210,680.00	0.14
339	002011	盾安环境	18,500	209,975.00	0.14
340	600557	康缘药业	12,640	209,950.40	0.14
341	002482	广田集团	23,277	209,260.23	0.14
342	600770	综艺股份	27,900	209,250.00	0.14
343	600422	昆药集团	18,428	208,973.52	0.13
344	002128	露天煤业	24,000	208,800.00	0.13
345	000587	金洲慈航	13,900	207,110.00	0.13
346	002123	梦网荣信	18,500	205,535.00	0.13
347	000099	中信海直	18,200	204,932.00	0.13
348	600428	中远海特	32,800	204,016.00	0.13
349	300297	蓝盾股份	18,600	203,670.00	0.13
350	600289	亿阳信通	18,600	203,484.00	0.13
351	000969	安泰科技	23,300	203,409.00	0.13
352	603658	安图生物	4,692	202,225.20	0.13
353	603556	海兴电力	4,600	201,894.00	0.13
354	002332	仙琚制药	23,400	201,240.00	0.13
355	600993	马应龙	9,214	200,680.92	0.13
356	000680	山推股份	36,800	200,560.00	0.13

357	600848	上海临港	9,300	200,508.00	0.13
358	600284	浦东建设	18,700	200,464.00	0.13
359	000620	新华联	28,100	199,791.00	0.13
360	002064	华峰氨纶	41,400	199,548.00	0.13
361	600645	中源协和	9,300	199,299.00	0.13
362	600736	苏州高新	28,100	198,667.00	0.13
363	002428	云南锗业	18,500	197,580.00	0.13
364	601311	骆驼股份	13,949	197,517.84	0.13
365	000652	泰达股份	37,100	196,630.00	0.13
366	000762	西藏矿业	13,875	196,608.75	0.13
367	002073	软控股份	23,100	195,888.00	0.13
368	300032	金龙机电	14,000	195,300.00	0.13
369	002709	天赐材料	4,686	192,922.62	0.12
370	002063	远光软件	18,463	192,384.46	0.12
371	601886	江河集团	18,700	191,675.00	0.12
372	300147	香雪制药	18,660	191,638.20	0.12
373	002463	沪电股份	42,060	191,373.00	0.12
374	600790	轻纺城	28,100	191,361.00	0.12
375	300043	星辉娱乐	23,300	191,293.00	0.12
376	601233	桐昆股份	13,800	191,268.00	0.12
377	600171	上海贝岭	18,500	188,145.00	0.12
378	601777	力帆股份	23,400	188,136.00	0.12
379	000777	中核科技	9,370	187,025.20	0.12
380	002254	泰和新材	13,840	184,072.00	0.12
381	002707	众信旅游	14,000	183,820.00	0.12
382	600880	博瑞传播	28,100	183,493.00	0.12
383	603369	今世缘	13,900	183,480.00	0.12
384	600720	祁连山	23,400	183,222.00	0.12
385	600586	金晶科技	37,400	182,886.00	0.12
386	002041	登海种业	13,800	182,850.00	0.12
387	600280	中央商场	23,000	182,390.00	0.12
388	002818	富森美	4,600	181,562.00	0.12
389	002277	友阿股份	28,100	181,245.00	0.12
390	000616	海航投资	42,100	181,030.00	0.12
391	002242	九阳股份	9,200	180,964.00	0.12
392	000552	靖远煤电	50,600	180,642.00	0.12
393	002690	美亚光电	9,399	180,272.82	0.12
394	600259	广晟有色	4,600	179,584.00	0.12
395	600694	大商股份	4,600	179,262.00	0.12

396	300010	立思辰	13,800	178,710.00	0.12
397	600195	中牧股份	9,200	178,388.00	0.12
398	600536	中国软件	9,300	178,188.00	0.12
399	002588	史丹利	23,080	177,485.20	0.11
400	002005	德豪润达	37,200	177,444.00	0.11
401	600801	华新水泥	18,600	177,258.00	0.11
402	600220	江苏阳光	51,600	176,988.00	0.11
403	603198	迎驾贡酒	9,300	176,979.00	0.11
404	001696	宗申动力	23,200	175,624.00	0.11
405	002681	奋达科技	13,940	175,504.60	0.11
406	002663	普邦股份	32,296	175,367.28	0.11
407	600517	置信电气	23,100	174,867.00	0.11
408	600338	西藏珠峰	4,600	174,754.00	0.11
409	600059	古越龙山	18,758	173,511.50	0.11
410	600184	光电股份	9,246	173,454.96	0.11
411	002269	美邦服饰	46,500	173,445.00	0.11
412	600757	长江传媒	23,200	173,304.00	0.11
413	600481	双良节能	32,600	173,106.00	0.11
414	603377	东方时尚	4,600	172,914.00	0.11
415	002309	中利集团	13,800	172,638.00	0.11
416	600058	五矿发展	13,800	171,258.00	0.11
417	600141	兴发集团	13,800	170,706.00	0.11
418	002233	塔牌集团	14,000	170,380.00	0.11
419	601001	大同煤业	32,400	170,100.00	0.11
420	600805	悦达投资	23,100	169,785.00	0.11
421	600395	盘江股份	23,100	169,323.00	0.11
422	002727	一心堂	9,200	169,280.00	0.11
423	600329	中新药业	9,341	169,165.51	0.11
424	600657	信达地产	29,294	168,733.44	0.11
425	600996	贵广网络	14,000	167,580.00	0.11
426	300039	上海凯宝	23,004	167,239.08	0.11
427	600826	兰生股份	9,200	166,520.00	0.11
428	603515	欧普照明	4,600	166,152.00	0.11
429	000426	兴业矿业	18,400	165,968.00	0.11
430	600460	士兰微	27,250	165,407.50	0.11
431	600894	广日股份	13,900	164,576.00	0.11
432	600006	东风汽车	28,000	163,800.00	0.11
433	603866	桃李面包	4,600	163,668.00	0.11
434	600537	亿晶光电	32,500	161,850.00	0.10

435	601002	晋亿实业	18,700	161,755.00	0.10
436	600053	九鼎投资	4,600	160,816.00	0.10
437	600628	新世界	13,900	160,545.00	0.10
438	600750	江中药业	4,600	159,850.00	0.10
439	600580	卧龙电气	23,239	158,489.98	0.10
440	600640	号百控股	9,300	157,170.00	0.10
441	600869	智慧能源	23,302	156,822.46	0.10
442	002344	海宁皮城	18,700	155,584.00	0.10
443	600596	新安股份	18,400	155,480.00	0.10
444	600773	西藏城投	13,967	154,614.69	0.10
445	603569	长久物流	4,600	153,778.00	0.10
446	300202	聚龙股份	9,300	153,636.00	0.10
447	000417	合肥百货	18,500	152,625.00	0.10
448	002815	崇达技术	4,600	151,984.00	0.10
449	600859	王府井	9,370	151,325.50	0.10
450	600971	恒源煤电	18,500	150,405.00	0.10
451	600292	远达环保	13,940	150,273.20	0.10
452	002345	潮宏基	13,820	150,223.40	0.10
453	002551	尚荣医疗	9,260	149,363.80	0.10
454	600251	冠农股份	18,498	147,429.06	0.10
455	603806	福斯特	4,600	147,246.00	0.10
456	603888	新华网	4,500	145,755.00	0.09
457	000681	视觉中国	9,300	145,638.00	0.09
458	600551	时代出版	9,200	145,268.00	0.09
459	002147	新光圆成	9,300	144,522.00	0.09
460	600831	广电网络	14,000	139,300.00	0.09
461	600743	华远地产	32,780	138,331.60	0.09
462	002392	北京利尔	23,300	138,169.00	0.09
463	600862	中航高科	14,000	135,660.00	0.09
464	600748	上实发展	18,690	134,568.00	0.09
465	603877	太平鸟	4,680	130,993.20	0.08
466	603328	依顿电子	9,200	130,180.00	0.08
467	603005	晶方科技	4,600	128,754.00	0.08
468	002699	美盛文化	9,240	127,512.00	0.08
469	002118	紫鑫药业	18,600	127,038.00	0.08
470	600776	东方通信	18,600	126,108.00	0.08
471	600754	锦江股份	4,600	124,660.00	0.08
472	002190	成飞集成	4,600	123,280.00	0.08
473	002093	国脉科技	13,925	122,540.00	0.08

474	603025	大豪科技	4,600	121,440.00	0.08
475	603698	航天工程	4,600	115,920.00	0.07
476	002251	步步高	9,320	115,474.80	0.07
477	002807	江阴银行	9,200	115,276.00	0.07
478	002315	焦点科技	4,600	114,724.00	0.07
479	600936	广西广电	14,000	112,980.00	0.07
480	603169	兰石重装	9,200	111,780.00	0.07
481	600335	国机汽车	9,200	110,032.00	0.07
482	002371	北方华创	4,600	110,032.00	0.07
483	000536	华映科技	18,700	108,647.00	0.07
484	000517	荣安地产	23,000	106,950.00	0.07
485	601020	华钰矿业	4,600	101,338.00	0.07
486	603568	伟明环保	4,650	100,533.00	0.06
487	002416	爱施德	9,300	100,347.00	0.06
488	600618	氯碱化工	9,300	99,324.00	0.06
489	600126	杭钢股份	13,800	94,668.00	0.06
490	603001	奥康国际	4,600	86,434.00	0.06
491	002414	高德红外	4,700	86,010.00	0.06
492	002194	武汉凡谷	9,300	82,305.00	0.05
493	002646	青青稞酒	4,646	81,119.16	0.05
494	603567	珍宝岛	4,600	77,418.00	0.05
495	601811	新华文轩	4,600	71,576.00	0.05
496	603528	多伦科技	4,600	66,102.00	0.04
497	000761	本钢板材	9,300	48,639.00	0.03
498	600917	重庆燃气	4,600	43,378.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002168	深圳惠程	33,500	569,165.00	0.37
2	002399	海普瑞	14,200	287,266.00	0.19
3	002025	航天电器	9,640	240,518.00	0.16
4	000693	*ST 华泽	15,000	187,500.00	0.12
5	600468	百利电气	13,800	89,700.00	0.06

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	603444	吉比特	1,275,493.25	0.77
2	600642	申能股份	634,931.00	0.39
3	000778	新兴铸管	539,239.00	0.33
4	600839	四川长虹	483,917.00	0.29
5	000039	中集集团	478,018.00	0.29
6	300002	神州泰岳	434,264.00	0.26
7	002583	海能达	430,562.26	0.26
8	603799	华友钴业	421,432.00	0.26
9	300383	光环新网	416,036.00	0.25
10	603888	新华网	391,064.00	0.24
11	300058	蓝色光标	383,459.00	0.23
12	002601	龙麟佰利	365,403.00	0.22
13	600566	济川药业	351,663.00	0.21
14	000729	燕京啤酒	350,422.00	0.21
15	002127	南极电商	342,503.00	0.21
16	300146	汤臣倍健	332,776.00	0.20
17	002517	恺英网络	329,890.00	0.20
18	000027	深圳能源	318,953.00	0.19
19	000732	泰禾集团	309,508.00	0.19
20	002670	国盛金控	306,008.60	0.19

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，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	822,803.50	0.50
2	600522	中天科技	813,038.00	0.49
3	600682	南京新百	682,485.00	0.41
4	600436	片仔癀	680,982.51	0.41
5	000887	中鼎股份	560,490.00	0.34
6	002602	世纪华通	501,320.00	0.30
7	600549	厦门钨业	444,122.00	0.27
8	000959	首钢股份	421,255.00	0.26
9	600497	驰宏锌锗	393,621.00	0.24
10	002595	豪迈科技	325,932.80	0.20

11	000961	中南建设	316,840.00	0.19
12	600601	方正科技	313,875.00	0.19
13	600067	冠城大通	271,320.00	0.16
14	600575	皖江物流	258,119.00	0.16
15	600851	海欣股份	229,144.00	0.14
16	603888	新华网	228,090.00	0.14
17	600175	美都能源	227,967.00	0.14
18	600823	世茂股份	223,409.32	0.14
19	002581	未名医药	217,166.00	0.13
20	000973	佛塑科技	214,356.00	0.13

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,264,501.93
卖出股票收入（成交）总额	25,900,027.45

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，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

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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,除生物股份外,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2016 年 12 月 1 日,金宇生物技术股份有限公司收到中国证券监督管理委员会内蒙古证监局出具的《行政监管措施决定书》,主要是因为公司会计估计变更未披露、公司财务报表列报不准确和内幕信息知情人登记执行不到位。内蒙古证监局决定对公司采取责令改正的行政监管措施,要求公司在收到决定书之日起 30 日内向内蒙古证监局提交书面整改报告,内蒙古证监局将适时组织检查验收。

截至本报告期末,生物股份(600201)为本基金成分股。本基金属于完全复制指数的被动投资,因此本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,018.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	890.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,908.98
---	----	----------

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	919,524.00	0.59	重大事项
2	600643	爱建集团	839,479.20	0.54	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002168	深圳惠程	569,165.00	0.37	重大事项
2	002399	海普瑞	287,266.00	0.19	重大事项
3	002025	航天电器	240,518.00	0.16	重大事项
4	000693	*ST 华泽	187,500.00	0.12	重大事项
5	600468	百利电气	89,700.00	0.06	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

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
225.00	431,515.40	91,339,243.00	94.08%	5,751,721.00	5.92%

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—诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资	90,000,000.00	92.70%
2	李光英	1,680,000.00	1.73%
3	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍盛稳进	1,331,720.00	1.37%
4	徐军	450,102.00	0.46%
5	肖小兰	294,200.00	0.30%
6	许良	205,018.00	0.21%
7	林宏	193,543.00	0.20%
8	沈恺	150,000.00	0.15%
9	凌军	135,901.00	0.14%
10	文红梅	134,010.00	0.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本开放式基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部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（2014 年 2 月 7 日）基金份额总额	879,090,964.00
本报告期期初基金份额总额	101,090,964.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
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	97,090,964.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金管理人于 2017 年 4 月 29 日于《证券时报》、《上海证券报》及《中国证券报》发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》的公告，自 2017 年 4 月 29 日起，旗下基金的会计师事务所由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中信证券	2	48,043,417.38	100.00%	44,743.42	100.00%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1)、实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2)、财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3)、经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4)、内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5)、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需, 并能为本基金提供全面的信息服。
- (6)、研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

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

本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 1 月 19 日
3	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2017 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2017 年 3 月 24 日
4	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2017 年第 1 期-摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 24 日
5	诺安基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 29 日
6	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人网站	2017 年 3 月 30 日
7	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	《证券时报》、	2017 年 3 月 30 日

	金 2016 年年度报告摘要	《中国证券报》	
8	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 24 日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 29 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

§ 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
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2017.1.3-2017.6.30	94,000,000.00	2,000,000.00	6,000,000.00	90,000,000.00	92.70%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公开募集的文件。
- ②《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日