

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十九日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
6 半年度财务会计报告 (未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	34
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	34
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43

8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末上市基金前十名持有人	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
9 开放式基金份额变动	45
10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录	48
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	中银沪深 300 等权重指数 (LOF)
场内简称	中银 300E
基金主代码	163821
交易代码	163821
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 17 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,267,591.99 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	2012 年 7 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数相似的回报。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值收益率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 等权重指数收益率×95%+同期银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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		中银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛文成	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	深圳市深南大道7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市银城中路200号中银大	深圳市深南大道7088号招商银

	厦26层、27层、45层	行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	白志中	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《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	http://www.bocim.com
基金半年度报告备置地点	上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	424,360.79
本期利润	1,247,733.50
加权平均基金份额本期利润	0.0507
本期加权平均净值利润率	3.52%
本期基金份额净值增长率	3.74%
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	10,980,198.53
期末可供分配基金份额利润	0.4719
期末基金资产净值	34,247,790.52
期末基金份额净值	1.472
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	47.20%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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	4.40%	0.56%	4.41%	0.57%	-0.01%	-0.01%
过去三个月	1.03%	0.63%	1.15%	0.64%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	3.74%	0.58%	4.37%	0.59%	-0.63%	-0.01%
过去一年	7.92%	0.70%	8.62%	0.71%	-0.70%	-0.01%
过去三年	60.17%	1.81%	63.15%	1.77%	-2.98%	0.04%
自基金合同生效起至今	47.20%	1.58%	35.45%	1.57%	11.75%	0.01%

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

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2012 年 5 月 17 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三部分（三）的规定，即本基金投资于沪深 300 等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为 5%-10%，其中权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债

券的比例不低于基金资产净值的 5%。

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

中银基金管理有限公司前身为中银国际基金管理有限公司，于 2004 年 8 月 12 日正式成立，由中银国际和美林投资管理合资组建（2006 年 9 月 29 日美林投资管理有限公司与贝莱德投资管理有限公司合并，合并后新公司名称为“贝莱德投资管理有限公司”）。2007 年 12 月 25 日，经中国证券监督管理委员会批复，同意中国银行股份有限公司直接控股中银基金。公司注册地为中国上海市，注册资本为一亿元人民币，其中中国银行拥有 83.5% 的股权，贝莱德投资管理拥有 16.5% 的股权。截至 2017 年 6 月 30 日，本管理人共管理八十五只开放式证券投资基金：中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略混合型证券投资基金、中银稳健增利债券型证券投资基金、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金、中银中证 100 指数增强型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、中银全球策略证券投资基金 (FOF)、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长混合型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银主题策略混合型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财 14 天债券型证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、中银消费主题混合型证券投资基金、中银美丽中国混合型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)、中银新回报混合型证券投资基金、中银互利分级债券型证券投资基金、中银惠利纯债半年定期开放债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、中银优秀企业混合型证券投资基金、中银活期宝货币市场基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、中银健康生活混合型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、中银薪钱包货币市场基金、中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金、中银新经济灵活配置混合型证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、中银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、中银恒利半年定期开放债券型证券投资基金、中银新动力股票型证券投资基金、中银宏观策略灵活配置混合型证券投资基金，中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、中银智能制造股票型证券投资基金、中银互联网+股票型证券投资基金、中银国有企业债债券型证券投资基金，中银新财富灵活配置混合型证

券投资基金, 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金, 中银战略新兴产业股票型证券投资基金, 中银机构现金管理货币市场基金, 中银美元债债券型证券投资基金 (QDII)、中银稳进保本混合型证券投资基金、中银宝利灵活配置混合型证券投资基金、中银瑞利灵活配置混合型证券投资基金、中银珍利灵活配置混合型证券投资基金、中银鑫利灵活配置混合型证券投资基金、中银益利灵活配置混合型证券投资基金、中银裕利灵活配置混合型证券投资基金、中银合利债券型证券投资基金、中银腾利灵活配置混合型证券投资基金、中银永利半年定期开放债券型证券投资基金、中银季季红定期开放债券型证券投资基金、中银宏利灵活配置混合型证券投资基金、中银颐利灵活配置混合型证券投资基金、中银丰利灵活配置混合型证券投资基金、中银尊享半年定期开放债券型证券投资基金、中银睿享债券型证券投资基金、中银悦享定期开放债券型证券投资基金、中银丰润定期开放债券型证券投资基金、中银量化精选灵活配置混合型证券投资基金、中银广利灵活配置混合型证券投资基金、中银润利灵活配置混合型证券投资基金、中银锦利灵活配置混合型证券投资基金、中银品质生活灵活配置混合型证券投资基金、中银理财 90 天债券型证券投资基金、中银丰庆定期开放债券型证券投资基金、中银富享债券型证券投资基金、中银文体娱乐灵活配置混合型证券投资基金、中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中银如意宝货币市场基金、中银丰实定期开放债券型发起式证券投资基金、中银丰和定期开放债券型发起式证券投资基金, 同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵建忠	本基金的基金经理、中银中证 100 指数增强基金基金经理、国企 ETF 基金基金经理、中银宏利基金基金经理、中银丰利基金基金经理	2015-06-08	-	10	金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司, 曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中银中证 100 指数基金基金经理, 2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金基金经理, 2015 年 6 月至今任中银沪深 300 等权重指数基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 8 月至今任中银宏利基金基金经理, 2016 年 8 月至今任中银丰利基金基金经理。具有 10 年证券从业年限。具备基金、期货从业资格。

注: 1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日, 非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期, 基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期; 2、证券从

业年限的计算标准及含义遵从《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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定, 严格遵循本基金基金合同, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内, 本基金运作合法合规, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》, 建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系, 通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待, 严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度, 以科学规范的投资决策体系, 采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制, 通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现; 通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库, 完善各类具体资产管理业务组织结构, 规范各项业务之间的关系, 在保证各投资组合既具有相对独立性的同时, 确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会; 通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内, 本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定, 确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易, 本报告期内未发生异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未发现异常交易行为。

本报告期内, 基金管理人未发生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

1、宏观经济分析

国外经济方面, 全球经济继续处于较为稳定的复苏通道, 美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看, 上半年美国 ISM 制造业 PMI 指数从 54.5 大幅上升至 57.8 水平, 就业市场整体改善,

失业率稳定在 4.4%左右。上半年欧元区经济强势复苏，制造业 PMI 指数从 54.9 上升至 57.4，CPI 同比增速稳定至 1.3%左右；不过，英国公投脱欧后受到负面冲击，上半年制造业 PMI 从 56.1 小幅回落至 54.3；日本经济窄幅震荡，上半年 PMI 持平于 52.4。综合来看，美国仍是全球复苏前景最好的经济体，受美联储加息预期反复影响，美元指数一度攀升至 103 上方，后一路回落至 96 左右。

国内经济方面，在前期“稳增长”政策刺激及国内外需求复苏影响下，经济领先指标整体仍是震荡走强，经济下行压力降低。具体来看，二季度领先指标制造业 PMI 震荡上行至 51.7，上半年持续保持在 51 上方，同步指标工业增加值同比增速 1-6 月累计增长 6.9%，较去年末上行 0.9 个百分点。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车以稳中有升为主：1-6 月消费增速小幅回升至 11%，6 月美元计价出口增速大幅回升至 11.3%左右，1-6 月固定资产投资增速小幅上升至 8.6%的水平。通胀方面，CPI 持续低位徘徊，6 月下行至 1.5%的水平，PPI 冲高回落，6 月同比涨幅持平于 5.5%左右。

2、行情回顾

上半年行情总体呈现震荡上行的态势，行业轮动现象明显，年初伴随春季躁动的行情，走到 3250 点的平台；进入 4 月份后，市场开始走落，点数开始逐渐下跌，沪深日均交易金额疲软，市场于 5 月上旬陷入低谷，资金开始青睐大盘蓝筹股，大盘股与中小盘股在 5 月走势有所分化；随着 A 股加入 MSCI 以及央行较松的货币政策等因素的刺激下，6 月大盘股走出一波反弹的行情。从整个上半年表现来看，家电及食品饮料行业由于基本面相对稳健、业绩预期确定性较高，涨幅最为靠前；而农林牧渔、纺织服装、传媒等行业由于基本面没有亮点、板块催化缺乏，跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为 4.58%；中证 100 涨跌幅 15.13%；上证国企指数涨跌幅 7.97%。

3. 运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 06 月 30 日为止，本基金的单位净值为 1.472 元，本基金的累计单位净值为 1.472 元。报告期内本基金份额净值增长率为 3.74%，同期业绩比较基准收益率为 4.37%。

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，海外经济稳中向好，国内实体经济韧性较强，但我们也看到在金融去杠杆的监管

环境下，金融利率上行已开始向实体融资成本传导；同时，今年的信贷额度控制、银监会监管负面影响表外信贷、同时地方债务置换额度有所减少等也将减少对实体融资支持，考虑到信贷对实体经济传导的滞后性，预计四季度至明年一季度，经济仍面临一定向下回落的压力。流动性方面，预计央行将继续贯彻中性偏紧货币政策目标，金融去杠杆将持续推进，流动性削峰填谷成常态。我们继续关注白马龙头及金融价值股，在配置方面，相对看好低估值板块，主要以受益于供给侧改革和混合所有制改革的蓝筹和国企为主。

本基金将严格按照契约规定，采用完全复制投资策略，被动跟踪指数，保持跟踪误差在较小范围内。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金运营部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金运营部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例

不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%

本报告期末可供分配利润为 10,980,198.53 元，未进行利润分配。

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

截至本报告期末，本基金的基金资产净值自 2017 年 1 月 3 日起已连续超过 60 个工作日低于 5000 万元。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人—招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)

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	1,897,609.84	2,248,389.79
结算备付金	-	1,865.59	4,437.41
存出保证金	-	1,947.83	1,891.84
交易性金融资产	6.4.7.2	32,499,843.84	33,418,848.94
其中：股票投资	-	32,499,843.84	33,418,848.94
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	-	70,836.37	-
应收利息	6.4.7.5	417.87	535.68
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	990.49	891.44
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	34,473,511.83	35,674,995.10
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	-	62,535.23	-
应付管理人报酬	-	21,203.93	23,415.84
应付托管费	-	4,240.79	4,683.20
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,133.65	11,213.85
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	124,607.71	100,000.00
负债合计	-	225,721.31	139,312.89
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	23,267,591.99	25,048,979.44
未分配利润	6.4.7.10	10,980,198.53	10,486,702.77
所有者权益合计	-	34,247,790.52	35,535,682.21
负债和所有者权益总计	-	34,473,511.83	35,674,995.10

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.472 元，基金份额总额 23,267,591.99 份。

6.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)

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		1,610,106.14	-6,711,122.12
1.利息收入		8,237.92	9,465.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,235.73	9,457.00
债券利息收入	-	2.19	8.34
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）	-	774,185.95	-174,882.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	527,842.68	-451,989.91
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	672.81	3,053.23
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	245,670.46	274,054.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	823,372.71	-6,549,272.02
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	4,309.56	3,566.68
减：二、费用	-	362,372.64	351,203.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2	131,857.49	130,615.14
2. 托管费	6.4.10.2	26,371.48	26,122.98
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	29,161.72	17,753.52
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	174,981.95	176,712.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,247,733.50	-7,062,326.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,247,733.50	-7,062,326.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)

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）	25,048,979.44	10,486,702.77	35,535,682.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,247,733.50	1,247,733.50
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）	-1,781,387.45	-754,237.74	-2,535,625.19
其中：1.基金申购款	2,382,281.55	1,064,677.04	3,446,958.59
2.基金赎回款	-4,163,669.00	-1,818,914.78	-5,982,583.78
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）	23,267,591.99	10,980,198.53	34,247,790.52
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）	25,051,651.24	16,168,411.05	41,220,062.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,062,326.00	-7,062,326.00
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）	547,662.77	214,087.71	761,750.48
其中：1.基金申购款	3,664,153.25	1,321,849.90	4,986,003.15
2.基金赎回款	-3,116,490.48	-1,107,762.19	-4,224,252.67
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）	25,599,314.01	9,320,172.76	34,919,486.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李道滨，主管会计工作负责人：王圣明，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会

员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1752号《关于核准中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2012 年 5 月 17 日正式生效，首次设立募集规模为 1,490,796,733.31 份基金份额。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 等权重指数的成份股及备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他证券品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于沪深 300 等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为 5%-10%，其中权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 等权重指数收益率×95% + 同期银行活期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 年上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 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的通知》的规定，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。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,897,609.84
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,897,609.84

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	30,772,193.58	32,499,843.84	1,727,650.26
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	30,772,193.58	32,499,843.84	1,727,650.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	415.85
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	0.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.22

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.90
合计	417.87

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	13,133.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,133.65

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	225.76
预提费用	74,381.95
其他	50,000.00
合计	124,607.71

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	25,048,979.44	25,048,979.44
本期申购	2,382,281.55	2,382,281.55
本期赎回(以“-”号填列)	-4,163,669.00	-4,163,669.00
本期末	23,267,591.99	23,267,591.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	23,641,488.85	-13,154,786.08	10,486,702.77
本期利润	424,360.79	823,372.71	1,247,733.50
本期基金份额交易产生的变动数	-1,696,803.89	942,566.15	-754,237.74

其中：基金申购款	2,242,501.43	-1,177,824.39	1,064,677.04
基金赎回款	-3,939,305.32	2,120,390.54	-1,818,914.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,369,045.75	-11,388,847.22	10,980,198.53

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	8,112.74	
定期存款利息收入	0.00	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	92.08	
其他	30.91	
合计	8,235.73	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	10,570,578.07	
减：卖出股票成本总额	10,042,735.39	
买卖股票差价收入	527,842.68	

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,675.00	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,000.00	
减：应收利息总额	2.19	
买卖债券差价收入	672.81	

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	245,670.46
基金投资产生的股利收益	0.00
合计	245,670.46

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	823,372.71
——股票投资	823,372.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	823,372.71

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	4,309.56
合计	4,309.56

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	29,161.72
银行间市场交易费用	0.00
合计	29,161.72

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	24,795.19
信息披露费	19,833.98
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78

银行汇划费用	600.00
合计	174,981.95

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重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无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
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构

注: 以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	131,857.49	130,615.14
其中：支付销售机构的客户维护费	45,256.34	46,074.19

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,371.48	26,122.98

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,897,609.84	8,112.74	2,323,961.55	9,309.01
合计	1,897,609.84	8,112.74	2,323,961.55	9,309.01

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	6,550	128,258.11	145,999.50	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	16,900	75,394.56	126,243.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项	3.60	-	-	33,900	111,688.00	122,040.00	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项	7.57	2017-07-03	7.54	15,900	137,873.44	120,363.00	-
000100	TCL 集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	33,650	108,939.75	115,419.50	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	5,520	81,874.53	111,724.80	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	6,400	127,775.54	111,360.00	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12	-	-	7,827	90,719.50	110,517.24	-
601608	中信重工	2017-04-19	重大事项	5.54	2017-07-26	5.26	19,600	131,434.07	108,584.00	-
601872	招商轮船	2017-05-02	重大事项	5.16	-	-	20,800	137,343.06	107,328.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项	30.82	2017-07-17	27.74	3,400	114,964.69	104,788.00	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项	10.57	-	-	9,840	139,679.05	104,008.80	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大事项	5.35	2017-07-26	5.89	18,700	165,077.18	100,045.00	-
60198	中国重	2017-	重大事	6.21	-	-	15,310	106,645.17	95,075.10	-

9	工	05-31	项							
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	-	-	12,300	115,402.31	94,464.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	6,100	187,700.45	88,999.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项	30.68	-	-	2,900	132,192.80	88,972.00	-
600654	*ST 中安	2017-06-07	重大事项	13.48	-	-	6,100	115,351.00	82,228.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	9,880	102,666.56	81,707.60	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项	24.93	-	-	2,300	57,916.46	57,339.00	-

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, 本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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, 本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规部、稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司执行总裁负责, 并由督察长分管。

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,将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。(2016 年 12 月 31 日:同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险,是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言,体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市,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,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期

资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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、存出保证金、债券投资及部分应收申购款等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,897,609.84	-	-	-	1,897,609.84
结算备付金	1,865.59	-	-	-	1,865.59
存出保证金	1,947.83	-	-	-	1,947.83
交易性金融资产	-	-	-	32,499,843.84	32,499,843.84
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	70,836.37	70,836.37
应收利息	-	-	-	417.87	417.87
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	0.00	-	-	990.49	990.49
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	1,901,423.26	0.00	0.00	32,572,088.57	34,473,511.83
负债					

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	62,535.23	62,535.23
应付管理人报酬	-	-	-	21,203.93	21,203.93
应付托管费	-	-	-	4,240.79	4,240.79
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	13,133.65	13,133.65
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	124,607.71	124,607.71
负债总计	0.00	0.00	0.00	225,721.31	225,721.31
利率敏感度缺口	1,901,423.26	0.00	0.00	32,346,367.26	34,247,790.52
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,248,389.79	-	-	-	2,248,389.79
结算备付金	4,437.41	-	-	-	4,437.41
存出保证金	1,891.84	-	-	-	1,891.84
交易性金融资产	-	-	-	33,418,848.94	33,418,848.94
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	535.68	535.68
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	0.00	-	-	891.44	891.44
资产总计	2,254,719.04	0.00	0.00	33,420,276.06	35,674,995.10
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	23,415.84	23,415.84
应付托管费	-	-	-	4,683.20	4,683.20
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	11,213.85	11,213.85
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	139,312.89	139,312.89
利率敏感度缺口	2,254,719.04	0.00	0.00	33,280,963.17	35,535,682.21

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，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。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

本基金力求基金净值收益率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于沪深 300 等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为 5%-10%，其中权证的投资比例不超过基金净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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，通过特定指标测试本基金面临的潜在价格风险，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	公允价值	占基金资产 净值比例

		例 (%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	32,499,843.84	94.90	33,418,848.94	94.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	32,499,843.84	94.90	33,418,848.94	94.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		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(附注7.4.1)上升5%	增加约 170	增加约 177
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	减少约 170	减少约 177

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	32,499,843.84	94.27
	其中：股票	32,499,843.84	94.27
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	1,899,475.43	5.51
7	其他各项资产	74,192.56	0.22
8	合计	34,473,511.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	338,893.28	0.99
B	采矿业	1,640,339.50	4.79
C	制造业	12,525,236.92	36.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	834,756.28	2.44
E	建筑业	1,480,667.14	4.32
F	批发和零售业	1,023,628.65	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	1,542,528.26	4.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,010,705.33	8.79
J	金融业	5,936,513.70	17.33
K	房地产业	1,771,313.97	5.17
L	租赁和商务服务业	521,192.96	1.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	331,489.25	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,600.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	936,331.53	2.73
S	综合	215,351.47	0.63
	合计	32,224,548.24	94.09

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	193,067.60	0.56
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	82,228.00	0.24
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	275,295.60	0.80

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

截至本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601088	中国神华	6,550	145,999.50	0.43
2	601009	南京银行	12,769	143,140.49	0.42
3	601288	农业银行	39,650	139,568.00	0.41
4	601398	工商银行	26,550	139,387.50	0.41
5	601328	交通银行	22,604	139,240.64	0.41
6	601939	建设银行	22,450	138,067.50	0.40
7	600000	浦发银行	10,866	137,454.90	0.40
8	002230	科大讯飞	3,415	136,258.50	0.40
9	600816	安信信托	9,600	130,464.00	0.38
10	002466	天齐锂业	2,400	130,440.00	0.38
11	603993	洛阳钼业	25,200	127,512.00	0.37
12	600519	贵州茅台	270	127,399.50	0.37
13	600309	万华化学	4,440	127,161.60	0.37
14	000651	格力电器	3,082	126,885.94	0.37
15	600050	中国联通	16,900	126,243.00	0.37
16	600570	恒生电子	2,690	125,569.20	0.37
17	000063	中兴通讯	5,260	124,872.40	0.36
18	600741	华域汽车	5,150	124,836.00	0.36
19	600031	三一重工	15,100	122,763.00	0.36
20	000858	五粮液	2,200	122,452.00	0.36

21	000002	万科 A	4,900	122,353.00	0.36
22	600373	中文传媒	5,200	122,252.00	0.36
23	600795	国电电力	33,900	122,040.00	0.36
24	600498	烽火通信	4,800	121,680.00	0.36
25	000983	西山煤电	13,800	121,026.00	0.35
26	000333	美的集团	2,811	120,985.44	0.35
27	600588	用友网络	7,036	120,456.32	0.35
28	600372	中航电子	6,933	120,426.21	0.35
29	601727	上海电气	15,900	120,363.00	0.35
30	002195	二三四五	16,720	119,548.00	0.35
31	601225	陕西煤业	16,900	119,483.00	0.35
32	002236	大华股份	5,220	119,068.20	0.35
33	002415	海康威视	3,684	118,993.20	0.35
34	000338	潍柴动力	8,966	118,351.20	0.35
35	601127	小康股份	5,900	117,705.00	0.34
36	300124	汇川技术	4,599	117,458.46	0.34
37	600893	航发动力	4,300	117,390.00	0.34
38	601601	中国太保	3,460	117,190.20	0.34
39	000627	天茂集团	14,500	117,160.00	0.34
40	600887	伊利股份	5,408	116,758.72	0.34
41	002450	康得新	5,184	116,743.68	0.34
42	601966	玲珑轮胎	5,200	116,636.00	0.34
43	000069	华侨城 A	11,590	116,595.40	0.34
44	600153	建发股份	8,983	116,150.19	0.34
45	000938	紫光股份	1,900	116,128.00	0.34
46	600549	厦门钨业	5,400	116,046.00	0.34
47	002299	圣农发展	7,800	115,986.00	0.34
48	600436	片仔癀	1,900	115,976.00	0.34
49	002153	石基信息	5,100	115,923.00	0.34
50	000559	万向钱潮	10,904	115,800.48	0.34
51	600188	兖州煤业	9,445	115,606.80	0.34
52	002044	美年健康	6,800	115,600.00	0.34
53	601607	上海医药	4,000	115,520.00	0.34
54	000423	东阿阿胶	1,606	115,455.34	0.34
55	000100	TCL 集团	33,650	115,419.50	0.34
56	000060	中金岭南	10,300	115,360.00	0.34
57	000963	华东医药	2,312	114,906.40	0.34
58	000413	东旭光电	10,200	114,444.00	0.33
59	600038	中直股份	2,500	114,425.00	0.33
60	600718	东软集团	7,350	114,292.50	0.33
61	601318	中国平安	2,300	114,103.00	0.33
62	600085	同仁堂	3,256	113,829.76	0.33
63	002142	宁波银行	5,887	113,619.10	0.33
64	002074	国轩高科	3,600	113,580.00	0.33

65	002292	奥飞娱乐	6,700	113,230.00	0.33
66	002424	贵州百灵	6,000	113,160.00	0.33
67	600362	江西铜业	6,700	112,962.00	0.33
68	002411	必康股份	3,900	112,788.00	0.33
69	601877	正泰电器	5,600	112,504.00	0.33
70	002831	裕同科技	1,500	112,500.00	0.33
71	600271	航天信息	5,450	112,488.00	0.33
72	002602	世纪华通	3,100	112,406.00	0.33
73	000839	中信国安	11,250	112,387.50	0.33
74	000425	徐工机械	29,960	112,350.00	0.33
75	601901	方正证券	11,300	112,209.00	0.33
76	002152	广电运通	13,500	112,185.00	0.33
77	002558	世纪游轮	2,420	111,852.40	0.33
78	002252	上海莱士	5,520	111,724.80	0.33
79	002714	牧原股份	4,100	111,602.00	0.33
80	000792	盐湖股份	10,675	111,553.75	0.33
81	600660	福耀玻璃	4,281	111,477.24	0.33
82	002024	苏宁云商	9,900	111,375.00	0.33
83	000826	启迪桑德	3,170	111,330.40	0.33
84	601118	海南橡胶	19,596	111,305.28	0.32
85	002241	歌尔股份	5,772	111,284.16	0.32
86	601633	长城汽车	8,372	111,263.88	0.32
87	002174	游族网络	3,500	111,160.00	0.32
88	601117	中国化学	15,900	111,141.00	0.32
89	000895	双汇发展	4,673	110,983.75	0.32
90	600637	东方明珠	5,120	110,950.40	0.32
91	002008	大族激光	3,200	110,848.00	0.32
92	002081	金螳螂	10,094	110,832.12	0.32
93	601211	国泰君安	5,400	110,754.00	0.32
94	600060	海信电器	7,300	110,741.00	0.32
95	000009	中国宝安	13,683	110,695.47	0.32
96	600804	鹏博士	6,235	110,671.25	0.32
97	600100	同方股份	7,827	110,517.24	0.32
98	000540	中天金融	15,900	110,505.00	0.32
99	600737	中粮糖业	11,700	110,448.00	0.32
100	603160	汇顶科技	1,100	110,330.00	0.32
101	600068	葛洲坝	9,800	110,152.00	0.32
102	600170	上海建工	28,821	110,096.22	0.32
103	001979	招商蛇口	5,147	109,939.92	0.32
104	600535	天士力	2,646	109,914.84	0.32
105	000623	吉林敖东	4,798	109,826.22	0.32
106	000725	京东方 A	26,400	109,824.00	0.32
107	300017	网宿科技	9,085	109,655.95	0.32
108	600522	中天科技	9,100	109,655.00	0.32

109	000738	航发控制	5,600	109,592.00	0.32
110	600089	特变电工	10,606	109,559.98	0.32
111	600685	中船防务	4,000	109,520.00	0.32
112	000568	泸州老窖	2,165	109,505.70	0.32
113	600585	海螺水泥	4,810	109,331.30	0.32
114	600406	国电南瑞	6,193	109,306.45	0.32
115	600446	金证股份	6,200	108,996.00	0.32
116	600690	青岛海尔	7,234	108,871.70	0.32
117	600332	白云山	3,749	108,870.96	0.32
118	601888	中国国旅	3,612	108,865.68	0.32
119	002310	东方园林	6,500	108,680.00	0.32
120	601608	中信重工	19,600	108,584.00	0.32
121	600019	宝钢股份	16,182	108,581.22	0.32
122	000555	神州信息	6,500	108,550.00	0.32
123	002839	张家港行	6,900	108,468.00	0.32
124	002470	金正大	14,400	108,432.00	0.32
125	600827	百联股份	6,672	108,420.00	0.32
126	600276	恒瑞医药	2,143	108,414.37	0.32
127	000768	中航飞机	5,871	108,261.24	0.32
128	600111	北方稀土	9,550	108,201.50	0.32
129	600104	上汽集团	3,478	107,991.90	0.32
130	600909	华安证券	10,700	107,963.00	0.32
131	000538	云南白药	1,150	107,927.50	0.32
132	600066	宇通客车	4,912	107,916.64	0.32
133	600383	金地集团	9,400	107,818.00	0.31
134	600037	歌华有线	7,400	107,744.00	0.31
135	000415	渤海金控	16,000	107,680.00	0.31
136	601600	中国铝业	23,822	107,675.44	0.31
137	600074	保千里	8,400	107,604.00	0.31
138	601155	新城控股	5,800	107,532.00	0.31
139	600900	长江电力	6,988	107,475.44	0.31
140	300072	三聚环保	2,900	107,445.00	0.31
141	002555	三七互娱	4,200	107,394.00	0.31
142	601333	广深铁路	23,750	107,350.00	0.31
143	601169	北京银行	11,706	107,344.02	0.31
144	000001	平安银行	11,431	107,337.09	0.31
145	601872	招商轮船	20,800	107,328.00	0.31
146	000686	东北证券	10,678	107,313.90	0.31
147	600739	辽宁成大	5,950	107,278.50	0.31
148	601229	上海银行	4,200	107,268.00	0.31
149	600030	中信证券	6,300	107,226.00	0.31
150	000776	广发证券	6,212	107,157.00	0.31
151	600820	隧道股份	10,600	107,060.00	0.31
152	000876	新希望	13,014	106,975.08	0.31

153	601998	中信银行	17,000	106,930.00	0.31
154	000630	铜陵有色	37,650	106,926.00	0.31
155	600703	三安光电	5,420	106,774.00	0.31
156	002673	西部证券	7,500	106,650.00	0.31
157	601166	兴业银行	6,325	106,639.50	0.31
158	600016	民生银行	12,960	106,531.20	0.31
159	600015	华夏银行	11,549	106,481.78	0.31
160	300024	机器人	5,460	106,470.00	0.31
161	600177	雅戈尔	10,510	106,361.20	0.31
162	002500	山西证券	11,100	106,338.00	0.31
163	000917	电广传媒	9,400	106,220.00	0.31
164	600482	中国动力	4,200	106,218.00	0.31
165	600118	中国卫星	3,812	106,126.08	0.31
166	600649	城投控股	10,082	105,961.82	0.31
167	600018	上港集团	16,700	105,878.00	0.31
168	000156	华数传媒	7,100	105,861.00	0.31
169	601933	永辉超市	14,952	105,860.16	0.31
170	002385	大北农	16,816	105,772.64	0.31
171	600061	国投安信	6,800	105,740.00	0.31
172	601958	金铂股份	14,747	105,735.99	0.31
173	002475	立讯精密	3,615	105,702.60	0.31
174	000959	首钢股份	15,100	105,549.00	0.31
175	600048	保利地产	10,585	105,532.45	0.31
176	600674	川投能源	10,742	105,486.44	0.31
177	300133	华策影视	9,411	105,403.20	0.31
178	601611	中国核建	8,800	105,336.00	0.31
179	601006	大秦铁路	12,550	105,294.50	0.31
180	000157	中联重科	23,450	105,290.50	0.31
181	002183	怡亚通	12,200	105,286.00	0.31
182	601866	中远海发	29,232	105,235.20	0.31
183	600518	康美药业	4,840	105,221.60	0.31
184	600999	招商证券	6,110	105,214.20	0.31
185	002202	金风科技	6,801	105,211.47	0.31
186	600369	西南证券	18,754	105,209.94	0.31
187	601555	东吴证券	9,359	105,101.57	0.31
188	600150	中国船舶	4,590	104,973.30	0.31
189	600352	浙江龙盛	11,008	104,906.24	0.31
190	601800	中国交建	6,600	104,874.00	0.31
191	000008	神州高铁	14,400	104,832.00	0.31
192	002049	紫光国芯	3,400	104,788.00	0.31
193	601688	华泰证券	5,850	104,715.00	0.31
194	002736	国信证券	7,900	104,675.00	0.31
195	600157	永泰能源	29,320	104,672.40	0.31
196	600895	张江高科	6,200	104,656.00	0.31

197	601985	中国核电	13,400	104,654.00	0.31
198	600010	包钢股份	47,740	104,550.60	0.31
199	600688	上海石化	15,800	104,438.00	0.30
200	002007	华兰生物	2,860	104,390.00	0.30
201	002508	老板电器	2,400	104,352.00	0.30
202	300027	华谊兄弟	12,897	104,336.73	0.30
203	600958	东方证券	7,500	104,325.00	0.30
204	601818	光大银行	25,750	104,287.50	0.30
205	600109	国金证券	8,896	104,261.12	0.30
206	601021	春秋航空	3,100	104,253.00	0.30
207	000783	长江证券	11,000	104,170.00	0.30
208	000750	国海证券	18,911	104,010.50	0.30
209	600959	江苏有线	9,840	104,008.80	0.30
210	601336	新华保险	2,023	103,982.20	0.30
211	600705	中航资本	18,400	103,960.00	0.30
212	002841	视源股份	1,400	103,908.00	0.30
213	601099	太平洋	25,840	103,876.80	0.30
214	600233	圆通速递	5,300	103,827.00	0.30
215	601669	中国电建	13,099	103,744.08	0.30
216	601718	际华集团	11,800	103,722.00	0.30
217	601668	中国建筑	10,704	103,614.72	0.30
218	300070	碧水源	5,553	103,563.45	0.30
219	601198	东兴证券	6,000	103,440.00	0.30
220	300251	光线传媒	12,620	103,357.80	0.30
221	600256	广汇能源	24,934	103,226.76	0.30
222	601618	中国中冶	20,600	103,206.00	0.30
223	601018	宁波港	18,250	103,112.50	0.30
224	002465	海格通信	9,600	103,104.00	0.30
225	600009	上海机场	2,762	103,050.22	0.30
226	002304	洋河股份	1,187	103,043.47	0.30
227	601216	君正集团	21,068	103,022.52	0.30
228	600376	首开股份	9,000	102,960.00	0.30
229	601997	贵阳银行	6,500	102,765.00	0.30
230	601377	兴业证券	13,820	102,682.60	0.30
231	600008	首创股份	15,600	102,648.00	0.30
232	002594	比亚迪	2,054	102,597.30	0.30
233	601163	三角轮胎	3,900	102,570.00	0.30
234	601628	中国人寿	3,800	102,524.00	0.30
235	600489	中金黄金	10,220	102,506.60	0.30
236	601766	中国中车	10,115	102,363.80	0.30
237	601186	中国铁建	8,500	102,255.00	0.30
238	600886	国投电力	12,940	102,226.00	0.30
239	600919	江苏银行	11,000	102,190.00	0.30
240	000793	华闻传媒	10,090	102,110.80	0.30

241	000625	长安汽车	7,080	102,093.60	0.30
242	000728	国元证券	8,350	102,037.00	0.30
243	000402	金融街	8,700	101,964.00	0.30
244	601857	中国石油	13,250	101,892.50	0.30
245	300059	东方财富	8,472	101,833.44	0.30
246	002027	分众传媒	7,400	101,824.00	0.30
247	600029	南方航空	11,700	101,790.00	0.30
248	600196	复星医药	3,279	101,616.21	0.30
249	601375	中原证券	10,100	101,606.00	0.30
250	600837	海通证券	6,837	101,529.45	0.30
251	601788	光大证券	6,800	101,524.00	0.30
252	000166	申万宏源	18,120	101,472.00	0.30
253	600606	绿地控股	12,974	101,456.68	0.30
254	600115	东方航空	14,900	101,320.00	0.30
255	600547	山东黄金	3,502	101,312.86	0.30
256	000671	阳光城	17,400	101,268.00	0.30
257	600977	中国电影	5,400	101,088.00	0.30
258	600221	海航控股	31,322	100,856.84	0.29
259	601881	中国银河	8,500	100,810.00	0.29
260	600663	陆家嘴	4,260	100,706.40	0.29
261	601390	中国中铁	11,600	100,572.00	0.29
262	000977	浪潮信息	5,800	100,456.00	0.29
263	002797	第一创业	10,900	100,389.00	0.29
264	603858	步长制药	1,400	100,296.00	0.29
265	000718	苏宁环球	17,100	100,206.00	0.29
266	300144	宋城演艺	4,800	100,176.00	0.29
267	601899	紫金矿业	29,200	100,156.00	0.29
268	000709	河钢股份	23,900	100,141.00	0.29
269	601919	中远海控	18,700	100,045.00	0.29
270	002065	东华软件	4,578	99,754.62	0.29
271	600682	南京新百	2,700	99,630.00	0.29
272	300033	同花顺	1,600	99,536.00	0.29
273	600028	中国石化	16,757	99,369.01	0.29
274	600583	海油工程	15,917	99,322.08	0.29
275	000961	中南建设	15,200	99,104.00	0.29
276	600926	杭州银行	6,600	98,010.00	0.29
277	601992	金隅股份	15,100	97,697.00	0.29
278	600415	小商品城	13,472	97,537.28	0.28
279	601111	中国国航	10,000	97,500.00	0.28
280	600340	华夏幸福	2,900	97,382.00	0.28
281	600023	浙能电力	17,790	97,133.40	0.28
282	002146	荣盛发展	9,800	96,726.00	0.28
283	300315	掌趣科技	11,800	96,288.00	0.28
284	300168	万达信息	6,600	96,030.00	0.28

285	002352	顺丰控股	1,800	95,688.00	0.28
286	601989	中国重工	15,310	95,075.10	0.28
287	002426	胜利精密	12,300	94,464.00	0.28
288	002131	利欧股份	28,500	93,765.00	0.27
289	600021	上海电力	7,700	93,093.00	0.27
290	600208	新湖中宝	20,587	92,641.50	0.27
291	600871	石化油服	27,700	92,518.00	0.27
292	002739	万达电影	1,800	91,746.00	0.27
293	600485	信威集团	6,100	88,999.00	0.26
294	300104	乐视网	2,900	88,972.00	0.26
295	600297	广汇汽车	10,330	77,784.90	0.23
296	600704	物产中大	9,150	66,703.50	0.19
297	000503	海虹控股	2,300	57,339.00	0.17
298	002456	欧菲光	2,505	45,515.85	0.13

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(%)
2	600666	奥瑞德	6,400.00	111,360.00	0.33
3	600654	*ST 中安	6,100.00	82,228.00	0.24
4	002129	中环股份	9,880.00	81,707.60	0.24

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	002558	巨人网络	132,730.00	0.37
2	600549	厦门钨业	132,494.00	0.37
3	002602	世纪华通	113,140.00	0.32
4	601117	中国化学	113,085.00	0.32
5	601992	金隅股份	111,703.00	0.31
6	600682	南京新百	111,474.00	0.31
7	603160	汇顶科技	111,317.00	0.31
8	603858	步长制药	111,201.00	0.31
9	601966	玲珑轮胎	110,920.00	0.31
10	600977	中国电影	110,635.00	0.31
11	600436	片仔癀	109,991.00	0.31
12	002411	必康股份	109,500.00	0.31
13	002044	美年健康	109,401.00	0.31
14	002555	三七互娱	109,337.00	0.31

15	601881	中国银河	108,841.00	0.31
16	601375	中原证券	108,667.00	0.31
17	002508	老板电器	108,635.20	0.31
18	601997	贵阳银行	108,129.00	0.30
19	600522	中天科技	108,121.00	0.30
20	601163	三角轮胎	107,816.00	0.30

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000778	新兴铸管	152,977.14	0.43
2	600019	宝钢股份	146,805.00	0.41
3	000039	中集集团	129,417.00	0.36
4	601258	庞大集团	128,294.82	0.36
5	002456	欧菲光	125,966.00	0.35
6	000027	深圳能源	115,448.00	0.32
7	300015	爱尔眼科	113,572.01	0.32
8	002085	万丰奥威	111,510.20	0.31
9	600648	外高桥	110,713.00	0.31
10	300146	汤臣倍健	110,465.86	0.31
11	300002	神州泰岳	110,017.00	0.31
12	603885	吉祥航空	109,642.00	0.31
13	600309	万华化学	106,816.00	0.30
14	600867	通化东宝	106,729.68	0.30
15	000568	泸州老窖	106,668.00	0.30
16	600754	锦江股份	105,639.00	0.30
17	600252	中恒集团	105,172.00	0.30
18	300182	捷成股份	104,953.00	0.30
19	601928	凤凰传媒	104,308.96	0.29
20	000800	一汽轿车	103,431.80	0.29

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	8,143,358.66
卖出股票的收入（成交）总额	10,570,578.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

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**

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有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	1,947.83
2	应收证券清算款	70,836.37

3	应收股利	-
4	应收利息	417.87
5	应收申购款	990.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,192.56

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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	601088	中国神华	145,999.50	0.43	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	600666	奥瑞德	111,360.00	0.33	重大事项
2	600654	*ST 中安	82,228.00	0.24	重大事项
3	002129	中环股份	81,707.60	0.24	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,213	19,181.86	21,053.78	0.09%	23,246,538.21	99.91%

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	李翔	143,037.00	27.39%
2	林凤英	49,500.00	9.48%
3	沈思思	35,200.00	6.74%
4	郭述文	30,000.00	5.74%
5	黄晖	28,300.00	5.42%
6	熊祥芬	16,000.00	3.06%
7	关海燕	15,822.00	3.03%
8	欧阳文	15,430.00	2.95%
9	张东	14,600.00	2.80%
10	黄英	12,671.00	2.43%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末本公司从业人员未持有本公司基金。

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 (2012 年 5 月 17 日) 基金份额总额	1,490,796,733.31
本报告期期初基金份额总额	25,048,979.44
本报告期基金总申购份额	2,382,281.55
减：本报告期基金总赎回份额	4,163,669.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,267,591.99

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
财富里昂证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	10,585,591.35	57.11%	9,859.63	57.64%	-
方正证券	1	7,949,423.42	42.89%	7,244.54	42.36%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：退租首创证券交易单元 1 个，退租华泰联合证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		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
天风证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
财富里昂证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	25,675.00	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-

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	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com	2017-01-20
2	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告	www.bocim.com	2017-03-31
3	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告 (摘要)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com	2017-03-31
4	中银基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com	2017-04-14
5	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 2017 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com	2017-04-21
6	中银基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com	2017-05-12
7	中银基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金开通定期定额投资及转换的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com	2017-05-19
8	中银基金管理有限公司关于提请投资者及时更新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》、www.bocim.com	2017-06-15
9	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2017 年第 1 号)	www.bocim.com	2017-06-29
10	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要 (2017 年第	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017-06-29

1 号)	报》、www.bocim.com	
------	------------------	--

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司
二〇一七年八月二十九日