

易方达中证 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：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	7
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合规守信情况的说明	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	11
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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	65
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	65

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12	投资组合报告附注	65
8	基金份额持有人信息	66
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2	期末上市基金前十名持有人	67
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
9	开放式基金份额变动	68
10	重大事件揭示	68
10.1	基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4	基金投资策略的改变	68
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
10.8	其他重大事件	70
11	影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
12	备查文件目录	71
12.1	备查文件目录	71
12.2	存放地点	72
12.3	查阅方式	72

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500ETF
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,126,753.00 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	2015 年 9 月 14 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的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799

负责人	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

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	-8,576,548.69
本期利润	-9,586,177.38
加权平均基金份额本期利润	-0.8022
本期加权平均净值利润率	-13.12%
本期基金份额净值增长率	-6.04%
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	-6,566,870.11

期末可供分配基金份额利润	-0.3108
期末基金资产净值	130,539,152.70
期末基金份额净值	6.1789
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	-4.79%

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

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

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

4.本基金已于 2015 年 9 月 9 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.15409267。

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

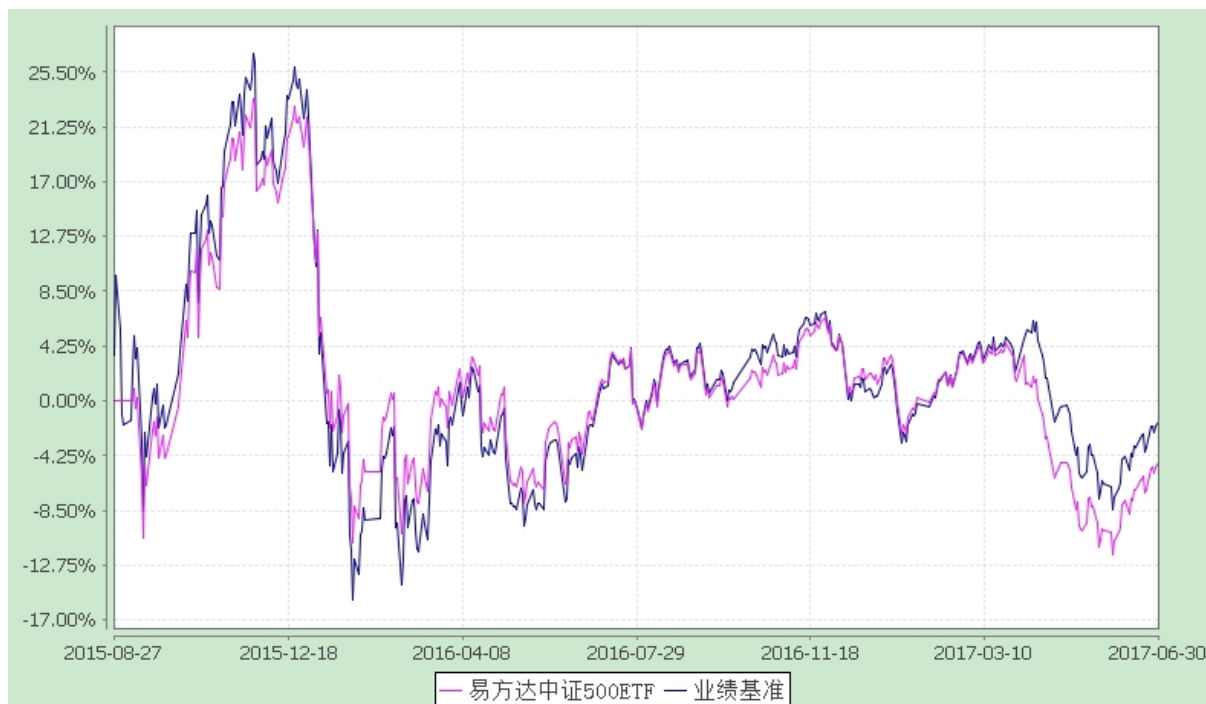
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.05%	0.93%	5.39%	0.93%	0.66%	0.00%
过去三个月	-6.17%	1.05%	-4.12%	1.02%	-2.05%	0.03%
过去六个月	-6.04%	0.90%	-2.00%	0.90%	-4.04%	0.00%
过去一年	-3.45%	0.89%	0.24%	0.91%	-3.69%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.79%	1.60%	-1.61%	1.85%	-3.18%	-0.25%

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

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 8 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-4.79%，同期业绩比较基准收益率为-1.61%。

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

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连等分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持在“诚信规范”的前提下，通过“专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004年10月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008年2月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。2012年10月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016年12月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至2017年6月30日，易方达的总资产管理规模达到11000亿元，其中公募基金管理规模4842亿元。

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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2013 年 11 月 14 日至 2017 年 06 月 22 日）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理（自 2013 年 03 月 06 日至 2017 年 06 月 22 日）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、量化基金组合部副总经理	2015-08-27	2017-06-23	9 年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交	2016-04-16	-	12 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

	易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				
杨俊	本基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-06-23	-	8 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，林伟斌的“任职日期”为基金合同生效之日，余海燕、杨俊的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 16 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在产能出清、库存回补带动内需企稳，外需持续向好的背景下，2017 年上半年国内宏观经济增长延续了前期的回暖趋势，最新公布的宏观数据显示二季度 GDP 增速为 6.9%，上半年出口增速 8.5%，进口增速高达 18.9%，6 月份工业增速跳升至 7.6%，固定资产投资增速 6 月份同比回升至 8.8%。金融去杠杆主导了 2017 年以来央行的货币政策基调，叠加美联储加息和缩表的影响，宽松货币政策周期或已接近尾声，宏观流动性在二季度有所收紧。上半年人民币对美元汇率稳中有升扭转了去年四季度以来的走低趋势，半年末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均回落到 6.8 以下。资本市场方面，上证综指呈“N”型走势，最终以上涨 2.86% 收官。在风格方面，大小盘分化明显，上半年上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 11.50%、10.78%，而创业板综指、中证 500 指数分别下跌 10.12%、2.00%；行业方面，保险、家用电器、食品饮料、银行等板块涨幅居前，农林牧渔、纺织服装、传媒、商业贸易、国防军工等板块下跌。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术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

截至报告期末，本基金份额净值为 6.1789 元，本报告期份额净值增长率为-6.04%，同期业绩比较基准收益率为-2.00%，日跟踪偏离度的均值为 0.07%，年化跟踪误差为 3.725%，大于合同规定的目标控制范围，主要是由报告期内成份股停复牌数量较多，标的指数成份股调整以及基金申购赎回冲击等因素所导致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，金融强监管下流动性收紧、房地产市场降温对经济增长的负面影响以及宏观政策与改革力图稳增长是影响未来 A 股市场最值得关注的因素。从经济增长的角度来看，考虑到房地产投资在去库存超预期的背景下依然稳健增长、制造业产能周期已经见底并逐步回升、出口也稳步回升，下半年经济增长无需过度担忧。从金融监管政策来看，全国金融工作会议在监管方面传递的信号表明未来金融去杠杆将更依赖监管规则升级而非持续紧缩流动性。如果当前经济增长的回暖趋势能够延续、货币政策适度并使物价水平不出现大的波动，同时各项改革措施稳步推进的背景下，考虑到目前 A 股市场的估值风险已经很大程度上释放，下半年 A 股市场的机会将大于风险。

从长期来看改革与创新仍然值得期待，在就业与坏账压力之下，财政政策有望加码，而改革进程，包括国企、财税、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推进；通过供给侧改革、提高全要素生产率，将是中国经济长期可持续发展的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必太悲观。通过资本市场盘活存量，把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业并购、重组，改善上市公司业绩，A 股市场和产业发展的正反馈仍将重现。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期高成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司常务副总裁担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自本报告期初至 2017 年 4 月 6 日，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自本报告期初至 2017 年 4 月 24 日，本基金均存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

自本报告期初至 2017 年 4 月 6 日，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

自本报告期初至 2017 年 4 月 24 日，本基金均存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。鉴于基金份额持有人数量的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

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，本基金托管人在对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：易方达中证 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	2,960,715.29	383,686.88
结算备付金		505,524.90	833.73
存出保证金		55,582.88	309.31
交易性金融资产	6.4.7.2	127,180,584.08	6,900,709.25
其中：股票投资		127,180,584.08	6,900,709.25
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		146,146.00	-
应收利息	6.4.7.5	791.80	77.10
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		130,849,344.95	7,285,616.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		59,116.72	3,098.00
应付托管费		11,823.33	619.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	814.91	1,376.15

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	238,437.29	70,000.00
负债合计		310,192.25	75,093.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	137,106,022.81	7,116,059.83
未分配利润	6.4.7.10	-6,566,870.11	94,462.68
所有者权益合计		130,539,152.70	7,210,522.51
负债和所有者权益总计		130,849,344.95	7,285,616.27

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.1789 元，基金份额总额 21,126,753.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-8,822,699.81	-2,088,559.48
1.利息收入		13,683.90	3,450.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,683.62	3,449.19
债券利息收入		0.28	1.23
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）		-8,031,180.90	-563,276.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,925,422.41	-601,393.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	59.72	1,441.85
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	894,181.79	36,674.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,009,628.69	-1,521,377.34
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	204,425.88	-7,355.85
减：二、费用		763,477.57	345,279.77

1. 管理人报酬		176,383.81	21,963.67
2. 托管费		35,276.75	4,392.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	262,019.38	9,883.92
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	289,797.63	309,039.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,586,177.38	-2,433,839.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,586,177.38	-2,433,839.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 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）	7,116,059.83	94,462.68	7,210,522.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,586,177.38	-9,586,177.38
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）	129,989,962.98	2,924,844.59	132,914,807.57
其中：1.基金申购款	203,966,533.87	-2,067,483.38	201,899,050.49
2.基金赎回款	-73,976,570.89	4,992,327.97	-68,984,242.92
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）	137,106,022.81	-6,566,870.11	130,539,152.70
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）	11,009,883.36	2,253,140.58	13,263,023.94

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,433,839.25	-2,433,839.25
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）	-3,893,823.53	82,264.21	-3,811,559.32
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-3,893,823.53	82,264.21	-3,811,559.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,116,059.83	-98,434.46	7,017,625.37

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：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]999 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2015]2176 号《关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,259,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与中证 500 指数进行对比，根据《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，易方达基金管理有限公司确定 2015 年 9 月 9 日为本基金的基金份额折算日。当日中证 500 指数收盘值为 6551.01 点，本基金资产净值为 298,052,917.95 元，折算前基金份额总额为 295,259,000 份，折算前基金份

额净值为 1.0095 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.15409267，折算后基金份额总额为 45,496,515 份，折算后基金份额净值为 6.5511 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2015 年 9 月 10 日进行了变更登记。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

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

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

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

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	2,960,715.29
定期存款	-	
其中：存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月-1 年	-	
存款期限 1 个月以内	-	
其他存款	-	
合计	2,960,715.29	

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	128,589,697.06	127,180,584.08	-1,409,112.98
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	128,589,697.06	127,180,584.08	-1,409,112.98

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	632.41
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	136.89
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	22.50
合计	791.80

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	814.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	814.91

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	188,437.29
其他应付款	50,000.00
合计	238,437.29

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	1,096,515.00	7,116,059.83
本期申购	31,429,302.00	203,966,533.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-11,399,064.00	-73,976,570.89
本期末	21,126,753.00	137,106,022.81

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	3,247,887.68	-3,153,425.00	94,462.68
本期利润	-8,576,548.69	-1,009,628.69	-9,586,177.38
本期基金份额交易产生的变动数	57,734,497.17	-54,809,652.58	2,924,844.59
其中: 基金申购款	86,313,249.40	-88,380,732.78	-2,067,483.38
基金赎回款	-28,578,752.23	33,571,080.20	4,992,327.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,405,836.16	-58,972,706.27	-6,566,870.11

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	8,662.29
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	4,893.60	
其他	127.73	
合计	13,683.62	

6.4.7.12 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	212,051,243.80
减: 卖出股票成本总额	220,976,666.21	
买卖股票差价收入	-8,925,422.41	

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	卖出债券 (、债转股及债券到期兑付)	1,060.00

成交总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应收利息总额	0.28
买卖债券差价收入	59.72

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	894,181.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	894,181.79

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	-1,009,628.69
——股票投资	-1,009,628.69
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,009,628.69

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	103,476.37
基金申购费收入	100,949.51
替代损益收入	-
其他	-
合计	204,425.88

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	262,019.38
银行间市场交易费用	-
合计	262,019.38

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	1,360.34
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	289,797.63

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内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
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人

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未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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	176,383.81	21,963.67
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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，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	35,276.75	4,392.72

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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
中国工商银行-活期存款	2,960,715.29	8,662.29	403,898.39	2,788.40

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

				受限						
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

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
000061	农产品	2017-06-28	重大事项停牌	9.06	-	-	23,754	215,253.19	215,211.24	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大事项停牌	11.26	-	-	16,110	188,914.99	181,398.60	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大事项停牌	6.54	2017-07-05	5.92	135,845	820,747.78	888,426.30	-
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	700	12,897.87	8,750.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项停牌	10.33	2017-08-02	11.36	27,648	321,284.01	285,603.84	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项停牌	24.95	2017-07-04	22.46	547	12,960.44	13,647.65	-
002122	天马股份	2017-04-24	重大事项停牌	10.30	2017-07-24	11.15	23,869	240,897.29	245,850.70	-
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项停牌	12.08	2017-07-06	12.61	23,169	286,369.65	279,881.52	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项停牌	8.70	2017-08-14	9.57	1,066	9,154.58	9,274.20	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项停牌	16.99	-	-	1,346	14,466.45	22,868.54	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项停牌	17.02	2017-07-12	16.68	12,811	239,674.54	218,043.22	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项停牌	20.23	-	-	15,000	304,054.41	303,450.00	-
002505	大康农业	2017-03-13	重大事项停牌	3.50	-	-	2,684	10,048.85	9,394.00	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项停牌	25.06	2017-07-07	22.54	515	13,800.64	12,905.90	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项停牌	12.59	2017-07-03	12.70	13,082	172,885.61	164,702.38	-

300088	长信科技	2016-09-12	重大事项停牌	15.75	2017-08-09	14.50	1,420	15,944.44	22,365.00	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大事项停牌	23.36	-	-	726	20,761.05	16,959.36	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大事项停牌	20.02	-	-	530	14,797.85	10,610.60	-
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大事项停牌	7.83	-	-	1,363	8,751.27	10,672.29	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项停牌	10.94	2017-08-18	12.03	16,033	190,727.46	175,401.02	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大事项停牌	6.07	2017-08-15	6.68	27,161	163,763.14	164,867.27	-
600468	百利电气	2017-05-16	重大事项停牌	6.50	-	-	11,777	103,228.06	76,550.50	-
600545	新疆城建	2017-06-22	重大事项停牌	11.96	2017-07-03	12.44	18,858	243,610.32	225,541.68	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项停牌	14.98	2017-08-02	16.48	2,373	31,193.42	35,547.54	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项停牌	11.32	-	-	1,641	24,484.56	18,576.12	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大事项停牌	5.76	2017-08-10	6.19	1,343	8,446.33	7,735.68	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大事项停牌	7.29	-	-	2,970	24,095.10	21,651.30	-
601001	大同煤业	2017-06-22	重大事项停牌	5.25	2017-07-21	5.78	29,191	163,385.81	153,252.75	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大事项停牌	7.79	-	-	35,347	314,124.97	275,353.13	-

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券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。

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。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2016 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

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的基金。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

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	2,960,715.29	-	-	-	2,960,715.29
结算备付金	505,524.90	-	-	-	505,524.90
存出保证金	55,582.88	-	-	-	55,582.88
交易性金融资产	-	-	-	127,180,584.08	127,180,584.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	146,146.00	146,146.00
应收利息	-	-	-	791.80	791.80
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,521,823.07	-	-	127,327,521.88	130,849,344.9

					5
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	59,116.72	59,116.72
应付托管费	-	-	-	11,823.33	11,823.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	814.91	814.91
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	238,437.29	238,437.29
负债总计	-	-	-	310,192.25	310,192.25
利率敏感度缺口	3,521,823.07	-	-	127,017,329.63	130,539,152.70
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	383,686.88	-	-	-	383,686.88
结算备付金	833.73	-	-	-	833.73
存出保证金	309.31	-	-	-	309.31
交易性金融资产	-	-	-	6,900,709.25	6,900,709.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	77.10	77.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	384,829.92	-	-	6,900,786.35	7,285,616.27

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,098.00	3,098.00
应付托管费	-	-	-	619.61	619.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,376.15	1,376.15
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债总计	-	-	-	75,093.76	75,093.76
利率敏感度缺口	384,829.92	-	-	6,825,692.59	7,210,522.51

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2017 年 6 月 30 日		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	127,180,584.08	97.43	6,900,709.25	95.70
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	127,180,584.08	97.43	6,900,709.25	95.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	6,383,115.05	342,941.31
	2.业绩比较基准下降 5%	-6,383,115.05	-342,941.31

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 123,106,091.75 元,属于第二层次的余额为 4,074,492.33 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:第一层次 6,368,333.07 元,第二层次 532,376.18 元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)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	127,180,584.08	97.20
	其中：股票	127,180,584.08	97.20
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	3,466,240.19	2.65
7	其他各项资产	202,520.68	0.15
8	合计	130,849,344.95	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	1,394,634.85	1.07
B	采矿业	3,562,043.25	2.73
C	制造业	79,952,453.14	61.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,468,873.66	3.42
E	建筑业	2,884,063.79	2.21
F	批发和零售业	6,782,581.68	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	3,713,190.79	2.84
H	住宿和餐饮业	154,334.50	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,437,556.65	6.46
J	金融业	1,287,058.29	0.99
K	房地产业	8,208,388.86	6.29
L	租赁和商务服务业	2,420,492.73	1.85
M	科学研究和技术服务业	344,287.82	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	1,061,405.32	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	168,967.05	0.13
Q	卫生和社会工作	309,346.18	0.24
R	文化、体育和娱乐业	1,380,045.77	1.06
S	综合	650,859.75	0.50
	合计	127,180,584.08	97.43

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
1	300136	信维通信	23,641	946,112.82	0.72
2	000656	金科股份	135,845	888,426.30	0.68
3	600487	亨通光电	30,609	858,582.45	0.66
4	600201	生物股份	21,588	767,885.16	0.59
5	002460	赣锋锂业	15,785	730,056.25	0.56
6	601012	隆基股份	42,173	721,158.30	0.55
7	002572	索菲亚	16,691	684,331.00	0.52
8	600176	中国巨石	61,585	676,203.30	0.52

9	600219	南山铝业	195,121	661,460.19	0.51
10	603799	华友钴业	10,437	634,360.86	0.49
11	600525	长园集团	46,351	629,910.09	0.48
12	600079	人福医药	31,702	621,993.24	0.48
13	600315	上海家化	18,992	616,290.40	0.47
14	600642	申能股份	96,072	605,253.60	0.46
15	300156	神雾环保	18,326	600,359.76	0.46
16	002271	东方雨虹	15,875	588,962.50	0.45
17	600584	长电科技	36,435	584,781.75	0.45
18	002405	四维图新	27,065	534,804.40	0.41
19	000661	长春高新	4,142	534,773.62	0.41
20	000050	深天马 A	25,256	519,515.92	0.40
21	600516	方大炭素	36,281	515,915.82	0.40
22	601168	西部矿业	67,000	515,230.00	0.39
23	600291	西水股份	23,077	507,694.00	0.39
24	600879	航天电子	57,412	504,651.48	0.39
25	000998	隆平高科	22,755	501,065.10	0.38
26	600325	华发股份	59,614	497,776.90	0.38
27	002092	中泰化学	38,782	492,531.40	0.38
28	600056	中国医药	18,836	488,794.20	0.37
29	002340	格林美	80,348	486,105.40	0.37
30	600266	北京城建	33,097	481,230.38	0.37
31	300115	长盈精密	16,384	478,085.12	0.37
32	000066	中国长城	53,054	478,016.54	0.37
33	600022	山东钢铁	230,806	475,460.36	0.36
34	600839	四川长虹	129,821	469,952.02	0.36
35	600426	华鲁恒升	39,869	468,062.06	0.36
36	600388	龙净环保	30,133	467,965.49	0.36
37	600166	福田汽车	164,070	465,958.80	0.36
38	600521	华海药业	22,020	463,300.80	0.35
39	300296	利亚德	24,581	462,122.80	0.35
40	600161	天坛生物	11,787	457,453.47	0.35
41	600435	北方导航	31,471	450,350.01	0.34
42	000997	新大陆	19,723	447,514.87	0.34
43	600528	中铁工业	31,297	447,234.13	0.34
44	300266	兴源环境	14,472	444,579.84	0.34
45	002050	三花智控	26,812	437,571.84	0.34
46	002422	科伦药业	26,035	430,098.20	0.33
47	600138	中青旅	20,399	429,602.94	0.33
48	600600	青岛啤酒	12,238	429,553.80	0.33
49	600699	均胜电子	13,345	428,241.05	0.33
50	000786	北新建材	26,946	426,824.64	0.33
51	600978	宜华生活	41,781	419,899.05	0.32
52	601000	唐山港	80,104	418,142.88	0.32

53	600260	凯乐科技	16,480	417,603.20	0.32
54	000039	中集集团	22,767	410,489.01	0.31
55	603589	口子窖	10,565	409,816.35	0.31
56	600614	鹏起科技	37,207	409,277.00	0.31
57	600158	中体产业	23,745	406,039.50	0.31
58	000778	新兴铸管	59,997	401,979.90	0.31
59	002407	多氟多	17,962	394,984.38	0.30
60	000581	威孚高科	15,151	392,410.90	0.30
61	600511	国药股份	10,801	391,428.24	0.30
62	600503	华丽家族	56,392	389,668.72	0.30
63	603019	中科曙光	13,558	381,522.12	0.29
64	002410	广联达	20,215	380,042.00	0.29
65	000970	中科三环	25,640	378,959.20	0.29
66	600298	安琪酵母	14,573	377,003.51	0.29
67	600392	盛和资源	28,558	376,680.02	0.29
68	000999	华润三九	11,767	373,602.25	0.29
69	600755	厦门国贸	40,944	373,409.28	0.29
70	600808	马钢股份	104,885	371,292.90	0.28
71	002179	中航光电	11,899	371,129.81	0.28
72	002217	合力泰	37,562	371,112.56	0.28
73	000028	国药一致	4,582	370,683.80	0.28
74	600635	大众公用	67,999	370,594.55	0.28
75	600717	天津港	29,510	368,579.90	0.28
76	002366	台海核电	7,781	365,006.71	0.28
77	600240	华业资本	40,045	362,807.70	0.28
78	002573	清新环境	19,238	362,059.16	0.28
79	002038	双鹭药业	12,415	361,897.25	0.28
80	601231	环旭电子	22,970	360,858.70	0.28
81	600122	宏图高科	32,508	360,838.80	0.28
82	600872	中炬高新	19,652	359,631.60	0.28
83	002223	鱼跃医疗	15,128	358,231.04	0.27
84	600160	巨化股份	29,764	358,060.92	0.27
85	600633	浙数文化	18,366	354,831.12	0.27
86	300383	光环新网	26,162	354,756.72	0.27
87	600418	江淮汽车	33,322	351,547.10	0.27
88	600500	中化国际	36,630	350,182.80	0.27
89	600062	华润双鹤	12,736	349,348.48	0.27
90	002311	海大集团	19,016	347,422.32	0.27
91	000488	晨鸣纸业	26,824	346,029.60	0.27
92	600143	金发科技	57,361	345,886.83	0.26
93	300002	神州泰岳	41,315	344,567.10	0.26
94	600594	益佰制药	22,300	340,298.00	0.26
95	300113	顺网科技	12,577	338,321.30	0.26
96	002583	海能达	21,006	337,986.54	0.26

97	000878	云南铜业	25,563	337,175.97	0.26
98	300055	万邦达	18,312	336,940.80	0.26
99	002078	太阳纸业	45,679	335,740.65	0.26
100	002004	华邦健康	42,837	335,413.71	0.26
101	002030	达安基因	15,235	331,970.65	0.25
102	002019	亿帆医药	19,843	330,981.24	0.25
103	002273	水晶光电	15,999	330,059.37	0.25
104	601699	潞安环能	42,139	329,526.98	0.25
105	000400	许继电气	18,291	328,506.36	0.25
106	600409	三友化工	32,573	328,010.11	0.25
107	600312	平高电气	23,866	327,918.84	0.25
108	600811	东方集团	50,236	327,538.72	0.25
109	600566	济川药业	8,573	326,031.19	0.25
110	600884	杉杉股份	19,782	325,809.54	0.25
111	600881	亚泰集团	63,985	325,043.80	0.25
112	600967	内蒙一机	23,775	324,053.25	0.25
113	002244	滨江集团	46,822	324,008.24	0.25
114	601880	大连港	108,738	321,864.48	0.25
115	600970	中材国际	37,016	321,669.04	0.25
116	000566	海南海药	24,153	320,268.78	0.25
117	600120	浙江东方	11,909	320,113.92	0.25
118	002001	新和成	16,471	319,702.11	0.24
119	600026	中远海能	48,120	319,035.60	0.24
120	002384	东山精密	12,898	318,580.60	0.24
121	600809	山西汾酒	9,161	317,795.09	0.24
122	000547	航天发展	30,199	315,579.55	0.24
123	300324	旋极信息	17,279	315,168.96	0.24
124	600499	科达洁能	39,688	315,122.72	0.24
125	600183	生益科技	25,502	314,694.68	0.24
126	600307	酒钢宏兴	110,141	313,901.85	0.24
127	000930	中粮生化	28,987	312,479.86	0.24
128	000401	冀东水泥	20,286	312,201.54	0.24
129	000418	小天鹅 A	6,667	311,948.93	0.24
130	600664	哈药股份	53,587	311,340.47	0.24
131	300244	迪安诊断	9,833	309,346.18	0.24
132	002176	江特电机	35,326	308,042.72	0.24
133	600863	内蒙华电	102,094	307,302.94	0.24
134	600094	大名城	40,007	306,853.69	0.24
135	002491	通鼎互联	22,765	305,961.60	0.23
136	600787	中储股份	38,667	305,855.97	0.23
137	600572	康恩贝	44,190	305,794.80	0.23
138	300146	汤臣倍健	22,136	304,148.64	0.23
139	002399	海普瑞	15,000	303,450.00	0.23
140	000598	兴蓉环境	53,898	302,906.76	0.23

141	300058	蓝色光标	38,697	302,610.54	0.23
142	002439	启明星辰	16,255	302,343.00	0.23
143	000960	锡业股份	22,164	301,652.04	0.23
144	600874	创业环保	15,370	300,790.90	0.23
145	002601	龙鳞佰利	18,347	300,523.86	0.23
146	000825	太钢不锈	68,544	298,166.40	0.23
147	300159	新研股份	22,470	297,502.80	0.23
148	002408	齐翔腾达	26,723	296,090.84	0.23
149	600478	科力远	34,267	295,038.87	0.23
150	002400	省广股份	36,728	294,925.84	0.23
151	600017	日照港	64,872	291,924.00	0.22
152	000685	中山公用	26,638	291,686.10	0.22
153	000513	丽珠集团	4,272	290,923.20	0.22
154	002354	天神娱乐	13,528	290,852.00	0.22
155	600125	铁龙物流	32,178	288,314.88	0.22
156	000089	深圳机场	30,822	288,185.70	0.22
157	600064	南京高科	19,062	287,836.20	0.22
158	000078	海王生物	47,729	287,805.87	0.22
159	603077	和邦生物	56,510	287,635.90	0.22
160	600348	阳泉煤业	42,346	287,105.88	0.22
161	002013	中航机电	27,648	285,603.84	0.22
162	000729	燕京啤酒	42,434	285,156.48	0.22
163	000979	中弘股份	108,114	283,258.68	0.22
164	600565	迪马股份	51,212	282,178.12	0.22
165	002127	南极电商	23,169	279,881.52	0.21
166	000926	福星股份	22,847	278,733.40	0.21
167	600198	大唐电信	21,739	277,607.03	0.21
168	300122	智飞生物	14,519	277,458.09	0.21
169	002051	中工国际	13,355	276,849.15	0.21
170	600597	光明乳业	21,664	276,216.00	0.21
171	600410	华胜天成	31,122	275,740.92	0.21
172	601717	郑煤机	35,347	275,353.13	0.21
173	000697	炼石有色	13,443	275,178.21	0.21
174	000988	华工科技	18,818	274,554.62	0.21
175	002431	棕榈股份	24,873	274,100.46	0.21
176	600416	湘电股份	19,996	273,945.20	0.21
177	000690	宝新能源	45,733	273,483.34	0.21
178	002373	千方科技	20,014	272,990.96	0.21
179	002701	奥瑞金	42,563	271,977.57	0.21
180	002640	跨境通	12,781	271,596.25	0.21
181	603766	隆鑫通用	37,152	270,466.56	0.21
182	600687	刚泰控股	20,972	270,119.36	0.21
183	600200	江苏吴中	20,345	268,554.00	0.21
184	002390	信邦制药	30,740	267,745.40	0.21

185	000806	银河生物	19,825	267,637.50	0.21
186	600582	天地科技	58,246	267,349.14	0.20
187	002221	东华能源	24,432	266,553.12	0.20
188	002512	达华智能	16,479	266,135.85	0.20
189	002048	宁波华翔	12,752	266,006.72	0.20
190	600039	四川路桥	63,701	264,996.16	0.20
191	601929	吉视传媒	76,559	264,894.14	0.20
192	000600	建投能源	21,517	264,013.59	0.20
193	300253	卫宁健康	33,657	262,861.17	0.20
194	601928	凤凰传媒	26,832	261,880.32	0.20
195	600466	蓝光发展	30,093	259,702.59	0.20
196	600282	南钢股份	69,703	258,598.13	0.20
197	601689	拓普集团	7,714	258,341.86	0.20
198	000012	南玻 A	27,669	258,151.77	0.20
199	002635	安洁科技	7,124	258,031.28	0.20
200	600751	天海投资	45,280	257,643.20	0.20
201	002191	劲嘉股份	27,512	257,512.32	0.20
202	600086	东方金钰	23,746	256,694.26	0.20
203	603000	人民网	19,485	256,617.45	0.20
204	000592	平潭发展	46,478	256,558.56	0.20
205	300026	红日药业	54,395	256,200.45	0.20
206	002665	首航节能	35,571	256,111.20	0.20
207	002028	思源电气	16,060	255,996.40	0.20
208	000667	美好置业	76,926	254,625.06	0.20
209	002603	以岭药业	14,574	254,462.04	0.19
210	000816	智慧农业	34,181	254,306.64	0.19
211	600380	健康元	27,960	253,876.80	0.19
212	300166	东方国信	18,875	253,491.25	0.19
213	600557	康缘药业	15,252	253,335.72	0.19
214	002444	巨星科技	16,243	253,065.94	0.19
215	300001	特锐德	15,046	252,170.96	0.19
216	002477	雏鹰农牧	56,581	250,653.83	0.19
217	000006	深振业 A	28,439	250,547.59	0.19
218	000732	泰禾集团	15,013	250,416.84	0.19
219	600151	航天机电	30,318	249,517.14	0.19
220	000758	中色股份	35,536	249,107.36	0.19
221	000975	银泰资源	19,559	247,030.17	0.19
222	000031	中粮地产	32,720	246,381.60	0.19
223	002122	天马股份	23,869	245,850.70	0.19
224	002672	东江环保	14,549	245,732.61	0.19
225	600648	外高桥	13,200	244,464.00	0.19
226	600316	洪都航空	15,209	244,408.63	0.19
227	600366	宁波韵升	13,813	243,661.32	0.19
228	600169	太原重工	63,106	243,589.16	0.19

229	600694	大商股份	6,247	243,445.59	0.19
230	600611	大众交通	44,026	243,023.52	0.19
231	000860	顺鑫农业	12,129	242,701.29	0.19
232	000158	常山股份	15,273	241,313.40	0.18
233	603444	吉比特	851	241,113.83	0.18
234	600759	洲际油气	39,778	241,054.68	0.18
235	600270	外运发展	12,734	241,054.62	0.18
236	000027	深圳能源	35,694	240,220.62	0.18
237	600835	上海机电	11,353	240,002.42	0.18
238	002250	联化科技	16,741	239,396.30	0.18
239	600267	海正药业	20,408	238,365.44	0.18
240	600563	法拉电子	4,809	237,612.69	0.18
241	300287	飞利信	25,841	237,220.38	0.18
242	300274	阳光电源	21,300	236,217.00	0.18
243	002261	拓维信息	20,150	235,956.50	0.18
244	600108	亚盛集团	54,731	235,890.61	0.18
245	000877	天山股份	18,561	235,167.87	0.18
246	600187	国中水务	46,555	235,102.75	0.18
247	300116	坚瑞沃能	21,787	234,210.25	0.18
248	002468	申通快递	9,217	234,203.97	0.18
249	600645	中源协和	10,874	233,029.82	0.18
250	601678	滨化股份	33,452	232,491.40	0.18
251	002308	威创股份	17,796	232,237.80	0.18
252	002266	浙富控股	47,531	231,951.28	0.18
253	002517	恺英网络	6,584	231,690.96	0.18
254	600993	马应龙	10,625	231,412.50	0.18
255	600729	重庆百货	8,608	231,038.72	0.18
256	000727	华东科技	81,604	230,939.32	0.18
257	600848	上海临港	10,698	230,648.88	0.18
258	002353	杰瑞股份	14,484	229,136.88	0.18
259	000939	凯迪生态	44,860	228,786.00	0.18
260	600098	广州发展	28,829	228,037.39	0.17
261	002002	鸿达兴业	29,115	227,970.45	0.17
262	000563	陕国投 A	44,072	227,852.24	0.17
263	600765	中航重机	16,483	227,135.74	0.17
264	600545	新疆城建	18,858	225,541.68	0.17
265	600750	江中药业	6,379	221,670.25	0.17
266	600422	昆药集团	19,458	220,653.72	0.17
267	600073	上海梅林	23,097	220,576.35	0.17
268	002396	星网锐捷	11,395	220,493.25	0.17
269	000712	锦龙股份	13,451	220,192.87	0.17
270	600300	维维股份	41,226	220,146.84	0.17
271	300257	开山股份	10,354	218,262.32	0.17
272	002358	森源电气	12,811	218,043.22	0.17

273	600639	浦东金桥	11,963	216,769.56	0.17
274	002375	亚厦股份	24,233	215,916.03	0.17
275	601016	节能风电	58,483	215,217.44	0.16
276	000061	农产品	23,754	215,211.24	0.16
277	002022	科华生物	12,385	215,127.45	0.16
278	002670	国盛金控	13,497	214,602.30	0.16
279	002268	卫士通	12,689	213,428.98	0.16
280	000519	中兵红箭	16,936	213,393.60	0.16
281	000501	鄂武商 A	11,538	212,991.48	0.16
282	000830	鲁西化工	30,822	212,671.80	0.16
283	601311	骆驼股份	14,997	212,357.52	0.16
284	300199	翰宇药业	13,824	212,060.16	0.16
285	603188	亚邦股份	12,155	211,983.20	0.16
286	002544	杰赛科技	9,295	211,926.00	0.16
287	002440	闰土股份	13,859	211,488.34	0.16
288	002281	光迅科技	9,495	210,978.90	0.16
289	600284	浦东建设	19,540	209,468.80	0.16
290	600259	广晟有色	5,364	209,410.56	0.16
291	002589	瑞康医药	13,565	208,901.00	0.16
292	002489	浙江永强	32,707	208,670.66	0.16
293	002657	中科金财	7,186	208,322.14	0.16
294	000703	恒逸石化	14,619	208,174.56	0.16
295	002155	湖南黄金	21,670	207,381.90	0.16
296	600651	飞乐音响	24,420	206,837.40	0.16
297	600770	综艺股份	27,508	206,310.00	0.16
298	002368	太极股份	7,441	206,041.29	0.16
299	600496	精工钢构	42,550	205,516.50	0.16
300	000528	柳工	23,688	204,664.32	0.16
301	002342	巨力索具	20,227	203,685.89	0.16
302	600587	新华医疗	11,442	203,438.76	0.16
303	002709	天赐材料	4,924	202,721.08	0.16
304	000612	焦作万方	25,152	202,473.60	0.16
305	300273	和佳股份	16,605	201,916.80	0.15
306	600216	浙江医药	20,352	201,688.32	0.15
307	000090	天健集团	18,088	200,776.80	0.15
308	600536	中国软件	10,451	200,241.16	0.15
309	002503	搜于特	28,280	198,808.40	0.15
310	002285	世联行	24,600	197,292.00	0.15
311	000937	冀中能源	31,879	195,099.48	0.15
312	600458	时代新材	17,002	194,672.90	0.15
313	600171	上海贝岭	19,003	193,260.51	0.15
314	002437	誉衡药业	26,446	192,526.88	0.15
315	000049	德赛电池	3,709	192,163.29	0.15
316	002325	洪涛股份	26,274	191,800.20	0.15

317	000587	金洲慈航	12,775	190,347.50	0.15
318	000021	深科技	22,151	190,055.58	0.15
319	300376	易事特	20,867	189,263.69	0.14
320	000810	创维数字	15,564	188,791.32	0.14
321	000543	皖能电力	32,352	188,612.16	0.14
322	600428	中远海特	30,252	188,167.44	0.14
323	600058	五矿发展	15,156	188,085.96	0.14
324	002011	盾安环境	16,567	188,035.45	0.14
325	002249	大洋电机	28,533	187,747.14	0.14
326	002018	华信国际	27,408	187,744.80	0.14
327	000669	金鸿能源	10,354	187,718.02	0.14
328	000829	天音控股	17,326	187,120.80	0.14
329	603883	老百姓	3,825	186,086.25	0.14
330	002056	横店东磁	24,727	185,452.50	0.14
331	000766	通化金马	11,602	185,399.96	0.14
332	000777	中核科技	9,237	184,370.52	0.14
333	000636	风华高科	21,502	182,982.02	0.14
334	002317	众生药业	14,716	182,772.72	0.14
335	000897	津滨发展	38,880	182,736.00	0.14
336	002242	九阳股份	9,246	181,868.82	0.14
337	600329	中新药业	10,022	181,498.42	0.14
338	000099	中信海直	16,110	181,398.60	0.14
339	600517	置信电气	23,853	180,567.21	0.14
340	601233	桐昆股份	12,992	180,069.12	0.14
341	600894	广日股份	15,199	179,956.16	0.14
342	603888	新华网	5,533	179,213.87	0.14
343	603556	海兴电力	4,082	179,158.98	0.14
344	000572	海马汽车	34,622	178,995.74	0.14
345	000762	西藏矿业	12,605	178,612.85	0.14
346	600736	苏州高新	25,196	178,135.72	0.14
347	601777	力帆股份	22,112	177,780.48	0.14
348	600338	西藏珠峰	4,656	176,881.44	0.14
349	000848	承德露露	17,695	176,596.10	0.14
350	600859	王府井	10,931	176,535.65	0.14
351	600805	悦达投资	23,945	175,995.75	0.13
352	600586	金晶科技	35,923	175,663.47	0.13
353	000062	深圳华强	6,621	175,655.13	0.13
354	600880	博瑞传播	26,897	175,637.41	0.13
355	600790	轻纺城	25,765	175,459.65	0.13
356	600289	亿阳信通	16,033	175,401.02	0.13
357	000596	古井贡酒	3,441	175,318.95	0.13
358	603816	顾家家居	2,978	175,046.84	0.13
359	603369	今世缘	13,228	174,609.60	0.13
360	002123	梦网荣信	15,553	172,793.83	0.13

361	002106	莱宝高科	17,044	172,655.72	0.13
362	600220	江苏阳光	50,166	172,069.38	0.13
363	002479	富春环保	14,446	171,907.40	0.13
364	002276	万马股份	17,006	171,590.54	0.13
365	600720	祁连山	21,863	171,187.29	0.13
366	002254	泰和新材	12,870	171,171.00	0.13
367	600773	西藏城投	15,462	171,164.34	0.13
368	600395	盘江股份	23,293	170,737.69	0.13
369	300010	立思辰	13,153	170,331.35	0.13
370	603355	莱克电气	2,898	170,315.46	0.13
371	002064	华峰氨纶	35,273	170,015.86	0.13
372	603377	东方时尚	4,495	168,967.05	0.13
373	002482	广田集团	18,696	168,077.04	0.13
374	002428	云南锗业	15,737	168,071.16	0.13
375	002707	众信旅游	12,776	167,748.88	0.13
376	002073	软控股份	19,729	167,301.92	0.13
377	601886	江河集团	16,302	167,095.50	0.13
378	002332	仙琚制药	19,304	166,014.40	0.13
379	600006	东风汽车	28,206	165,005.10	0.13
380	600460	士兰微	27,161	164,867.27	0.13
381	002681	奋达科技	13,082	164,702.38	0.13
382	000652	泰达股份	31,072	164,681.60	0.13
383	600801	华新水泥	17,166	163,591.98	0.13
384	000680	山推股份	29,829	162,568.05	0.12
385	000620	新华联	22,821	162,257.31	0.12
386	600053	九鼎投资	4,637	162,109.52	0.12
387	000969	安泰科技	18,545	161,897.85	0.12
388	600596	新安股份	19,153	161,842.85	0.12
389	000541	佛山照明	17,711	161,347.21	0.12
390	603198	迎驾贡酒	8,472	161,222.16	0.12
391	600280	中央商场	20,228	160,408.04	0.12
392	002463	沪电股份	35,212	160,214.60	0.12
393	000726	鲁泰 A	13,504	160,157.44	0.12
394	600757	长江传媒	21,368	159,618.96	0.12
395	600059	古越龙山	17,122	158,378.50	0.12
396	002690	美亚光电	8,224	157,736.32	0.12
397	600869	智慧能源	23,425	157,650.25	0.12
398	600628	新世界	13,639	157,530.45	0.12
399	001696	宗申动力	20,728	156,910.96	0.12
400	600141	兴发集团	12,608	155,960.96	0.12
401	300297	蓝盾股份	14,192	155,402.40	0.12
402	600580	卧龙电气	22,680	154,677.60	0.12
403	600754	锦江股份	5,695	154,334.50	0.12
404	300043	星辉娱乐	18,762	154,036.02	0.12

405	601001	大同煤业	29,191	153,252.75	0.12
406	000426	兴业矿业	16,908	152,510.16	0.12
407	600481	双良节能	28,563	151,669.53	0.12
408	002063	远光软件	14,554	151,652.68	0.12
409	600292	远达环保	13,818	148,958.04	0.11
410	000616	海航投资	34,486	148,289.80	0.11
411	000552	靖远煤电	41,296	147,426.72	0.11
412	600195	中牧股份	7,596	147,286.44	0.11
413	002663	普邦股份	27,069	146,984.67	0.11
414	002120	韵达股份	2,844	146,750.40	0.11
415	601002	晋亿实业	16,791	145,242.15	0.11
416	600537	亿晶光电	29,024	144,539.52	0.11
417	600971	恒源煤电	17,641	143,421.33	0.11
418	300147	香雪制药	13,953	143,297.31	0.11
419	002727	一心堂	7,787	143,280.80	0.11
420	600862	中航高科	14,778	143,198.82	0.11
421	600640	号百控股	8,427	142,416.30	0.11
422	002041	登海种业	10,647	141,072.75	0.11
423	002190	成飞集成	5,260	140,968.00	0.11
424	300039	上海凯宝	19,356	140,718.12	0.11
425	002269	美邦服饰	37,726	140,717.98	0.11
426	600748	上实发展	19,503	140,421.60	0.11
427	002005	德豪润达	29,423	140,347.71	0.11
428	600743	华远地产	33,035	139,407.70	0.11
429	002345	潮宏基	12,802	139,157.74	0.11
430	300202	聚龙股份	8,370	138,272.40	0.11
431	002277	友阿股份	21,339	137,636.55	0.11
432	000417	合肥百货	16,519	136,281.75	0.10
433	300032	金龙机电	9,768	136,263.60	0.10
434	600184	光电股份	7,199	135,053.24	0.10
435	600826	兰生股份	7,437	134,609.70	0.10
436	002588	史丹利	17,412	133,898.28	0.10
437	600251	冠农股份	16,626	132,509.22	0.10
438	000681	视觉中国	8,453	132,373.98	0.10
439	002233	塔牌集团	10,843	131,959.31	0.10
440	002371	北方华创	5,514	131,894.88	0.10
441	002147	新光圆成	8,486	131,872.44	0.10
442	600996	贵广网络	11,010	131,789.70	0.10
443	603169	兰石重装	10,831	131,596.65	0.10
444	600335	国机汽车	10,876	130,076.96	0.10
445	002344	海宁皮城	15,424	128,327.68	0.10
446	600831	广电网络	12,762	126,981.90	0.10
447	002309	中利集团	9,603	120,133.53	0.09
448	002699	美盛文化	8,307	114,636.60	0.09

449	600776	东方通信	16,874	114,405.72	0.09
450	603005	晶方科技	4,054	113,471.46	0.09
451	600551	时代出版	7,158	113,024.82	0.09
452	603698	航天工程	4,415	111,258.00	0.09
453	603868	飞科电器	1,771	109,518.64	0.08
454	002551	尚荣医疗	6,710	108,232.30	0.08
455	002392	北京利尔	18,100	107,333.00	0.08
456	603001	奥康国际	5,695	107,009.05	0.08
457	002093	国脉科技	12,150	106,920.00	0.08
458	603568	伟明环保	4,894	105,808.28	0.08
459	002118	紫鑫药业	15,397	105,161.51	0.08
460	002414	高德红外	5,649	103,376.70	0.08
461	603567	珍宝岛	6,024	101,383.92	0.08
462	002416	爱施德	9,340	100,778.60	0.08
463	603328	依顿电子	7,053	99,799.95	0.08
464	000536	华映科技	16,663	96,812.03	0.07
465	002251	步步高	7,750	96,022.50	0.07
466	600936	广西广电	11,758	94,887.06	0.07
467	603528	多伦科技	6,589	94,683.93	0.07
468	002646	青青稞酒	5,407	94,406.22	0.07
469	600126	杭钢股份	13,693	93,933.98	0.07
470	603806	福斯特	2,905	92,989.05	0.07
471	000517	荣安地产	19,152	89,056.80	0.07
472	603228	景旺电子	1,808	87,236.00	0.07
473	600618	氯碱化工	7,947	84,873.96	0.07
474	603515	欧普照明	2,323	83,906.76	0.06
475	601020	华钰矿业	3,767	82,987.01	0.06
476	603866	桃李面包	2,298	81,762.84	0.06
477	000025	特力A	1,577	81,593.98	0.06
478	002807	江阴银行	6,478	81,169.34	0.06
479	600468	百利电气	11,777	76,550.50	0.06
480	002315	焦点科技	2,836	70,729.84	0.05
481	603658	安图生物	1,565	67,451.50	0.05
482	002194	武汉凡谷	6,838	60,516.30	0.05
483	603877	太平鸟	2,088	58,443.12	0.04
484	601811	新华文轩	3,691	57,431.96	0.04
485	600917	重庆燃气	6,070	57,240.10	0.04
486	603569	长久物流	1,635	54,658.05	0.04
487	002818	富森美	1,368	53,994.96	0.04
488	002815	崇达技术	1,578	52,137.12	0.04
489	603025	大豪科技	1,815	47,916.00	0.04
490	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.04
491	000761	本钢板材	9,044	47,300.12	0.04
492	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03

493	600643	爱建集团	2,373	35,547.54	0.03
494	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
495	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
496	002168	深圳惠程	1,346	22,868.54	0.02
497	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
498	300088	长信科技	1,420	22,365.00	0.02
499	600673	东阳光科	2,970	21,651.30	0.02
500	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
501	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
502	600655	豫园商城	1,641	18,576.12	0.01
503	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
504	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
505	300134	大富科技	726	16,959.36	0.01
506	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
507	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
508	002025	航天电器	547	13,647.65	0.01
509	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
510	002642	荣之联	515	12,905.90	0.01
511	600277	亿利洁能	1,363	10,672.29	0.01
512	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
513	300291	华录百纳	530	10,610.60	0.01
514	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
515	002505	大康农业	2,684	9,394.00	0.01
516	002128	露天煤业	1,066	9,274.20	0.01
517	000693	*ST 华泽	700	8,750.00	0.01
518	600657	信达地产	1,343	7,735.68	0.01
519	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
520	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01

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	002092	中泰化学	3,358,526.00	46.58
2	000661	长春高新	3,332,183.30	46.21
3	600166	福田汽车	3,115,045.09	43.20
4	000050	深天马 A	3,102,563.00	43.03
5	600161	天坛生物	3,007,544.20	41.71
6	002491	通鼎互联	3,006,117.13	41.69

7	002273	水晶光电	3,004,923.00	41.67
8	300244	迪安诊断	2,969,265.96	41.18
9	600699	均胜电子	2,958,411.20	41.03
10	002078	太阳纸业	2,958,382.00	41.03
11	002244	滨江集团	2,948,476.32	40.89
12	000078	海王生物	2,944,447.96	40.84
13	600664	哈药股份	2,919,651.93	40.49
14	601699	潞安环能	2,874,749.44	39.87
15	600307	酒钢宏兴	2,869,879.00	39.80
16	600516	方大炭素	2,849,304.00	39.52
17	000959	首钢股份	2,841,033.60	39.40
18	600094	大名城	2,834,815.16	39.31
19	000528	柳 工	2,822,954.00	39.15
20	600200	江苏吴中	2,815,154.00	39.04
21	300273	和佳股份	2,812,700.00	39.01
22	600536	中国软件	2,800,983.70	38.85
23	002431	棕榈股份	2,774,050.00	38.47
24	600282	南钢股份	2,773,117.82	38.46
25	002589	瑞康医药	2,764,124.00	38.33
26	600267	海正药业	2,756,371.04	38.23
27	600300	维维股份	2,747,097.04	38.10
28	002106	莱宝高科	2,745,375.00	38.07
29	300043	星辉娱乐	2,726,522.89	37.81
30	000090	天健集团	2,725,290.89	37.80
31	000062	深圳华强	2,713,977.24	37.64
32	603198	迎驾贡酒	2,675,312.26	37.10
33	002498	汉缆股份	2,664,960.00	36.96
34	600220	江苏阳光	2,663,925.39	36.94
35	601233	桐昆股份	2,655,525.50	36.83
36	600628	新世界	2,645,297.00	36.69
37	603883	老百姓	2,642,861.28	36.65
38	000861	海印股份	2,634,637.53	36.54
39	600687	刚泰控股	2,554,247.00	35.42
40	600864	哈投股份	2,521,896.81	34.98
41	000761	本钢板材	2,494,947.54	34.60
42	002670	国盛金控	2,329,717.47	32.31
43	002665	首航节能	2,321,987.00	32.20
44	600270	外运发展	2,293,477.36	31.81
45	000961	中南建设	2,250,070.00	31.21
46	600872	中炬高新	2,084,698.00	28.91
47	601717	郑煤机	1,959,450.51	27.17
48	002408	齐翔腾达	1,952,948.00	27.08
49	002512	达华智能	1,941,713.56	26.93
50	002118	紫鑫药业	1,920,283.86	26.63

51	002315	焦点科技	1,786,659.00	24.78
52	600291	西水股份	1,774,702.78	24.61
53	600428	中远海特	1,768,924.00	24.53
54	600098	广州发展	1,637,512.88	22.71
55	000417	合肥百货	1,605,119.17	22.26
56	002572	索菲亚	1,567,354.00	21.74
57	002503	搜于特	1,484,135.00	20.58
58	300287	飞利信	1,393,832.86	19.33
59	300136	信维通信	1,318,949.22	18.29
60	000400	许继电气	1,303,106.28	18.07
61	002018	华信国际	1,231,194.66	17.07
62	600180	瑞茂通	1,226,596.00	17.01
63	000690	宝新能源	1,216,025.00	16.86
64	600825	新华传媒	1,188,622.22	16.48
65	002460	赣锋锂业	1,182,701.06	16.40
66	300257	开山股份	1,157,776.00	16.06
67	300156	神雾环保	1,097,363.00	15.22
68	600487	亨通光电	1,089,746.00	15.11
69	002064	华峰氨纶	1,045,356.00	14.50
70	600468	百利电气	1,016,431.00	14.10
71	600879	航天电子	1,007,831.00	13.98
72	600201	生物股份	988,784.20	13.71
73	000066	中国长城	969,525.82	13.45
74	601012	隆基股份	948,826.00	13.16
75	600525	长园集团	918,386.00	12.74
76	002405	四维图新	917,323.95	12.72
77	600219	南山铝业	916,489.00	12.71
78	600522	中天科技	890,336.75	12.35
79	600079	人福医药	877,206.00	12.17
80	000656	金科股份	875,324.00	12.14
81	002271	东方雨虹	871,686.95	12.09
82	600584	长电科技	856,292.00	11.88
83	002508	老板电器	854,579.90	11.85
84	600176	中国巨石	821,230.00	11.39
85	002340	格林美	815,962.00	11.32
86	300296	利亚德	813,368.00	11.28
87	300115	长盈精密	780,353.72	10.82
88	600315	上海家化	776,283.99	10.77
89	000998	隆平高科	774,298.11	10.74
90	300113	顺网科技	774,112.57	10.74
91	002422	科伦药业	770,641.38	10.69
92	002573	清新环境	767,431.21	10.64
93	600266	北京城建	757,457.82	10.50
94	600642	申能股份	756,821.26	10.50

95	000786	北新建材	734,124.00	10.18
96	000547	航天发展	727,072.35	10.08
97	600436	片仔癀	723,963.00	10.04
98	600528	中铁工业	710,886.00	9.86
99	000401	冀东水泥	702,338.00	9.74
100	002249	大洋电机	691,362.04	9.59
101	600325	华发股份	678,668.00	9.41
102	600435	北方导航	676,947.00	9.39
103	002371	北方华创	673,744.00	9.34
104	601168	西部矿业	669,946.00	9.29
105	000930	中粮生化	664,760.36	9.22
106	002407	多氟多	664,279.90	9.21
107	600521	华海药业	657,663.98	9.12
108	601000	唐山港	652,718.80	9.05
109	000028	国药一致	646,808.00	8.97
110	000970	中科三环	644,049.00	8.93
111	002311	海大集团	643,073.62	8.92
112	600056	中国医药	639,508.00	8.87
113	600682	南京新百	638,463.25	8.85
114	600022	山东钢铁	637,211.00	8.84
115	002004	华邦健康	632,375.07	8.77
116	000997	新大陆	631,044.96	8.75
117	000778	新兴铸管	628,138.00	8.71
118	000581	威孚高科	621,928.00	8.63
119	000999	华润三九	619,196.49	8.59
120	300055	万邦达	616,704.00	8.55
121	002410	广联达	612,653.00	8.50
122	300026	红日药业	611,121.00	8.48
123	002366	台海核电	606,308.00	8.41
124	002217	合力泰	605,992.34	8.40
125	603799	华友钴业	604,755.00	8.39
126	300159	新研股份	603,755.50	8.37
127	600978	宜华生活	601,414.00	8.34
128	002176	江特电机	597,823.00	8.29
129	600138	中青旅	597,675.00	8.29
130	002701	奥瑞金	596,548.01	8.27
131	002038	双鹭药业	593,452.00	8.23
132	601010	文峰股份	591,401.00	8.20
133	000598	兴蓉环境	586,285.00	8.13
134	000878	云南铜业	584,583.00	8.11
135	600426	华鲁恒升	583,556.00	8.09
136	002439	启明星辰	573,924.32	7.96
137	002050	三花智控	573,852.00	7.96
138	600717	天津港	572,196.00	7.94

139	600839	四川长虹	571,536.00	7.93
140	002179	中航光电	571,325.24	7.92
141	600614	鹏起科技	570,785.00	7.92
142	000039	中集集团	570,570.82	7.91
143	600388	龙净环保	570,061.00	7.91
144	000418	小天鹅 A	567,216.81	7.87
145	600240	华业资本	564,533.00	7.83
146	002030	达安基因	562,512.18	7.80
147	600122	宏图高科	561,313.00	7.78
148	600600	青岛啤酒	560,849.00	7.78
149	600635	大众公用	560,118.00	7.77
150	002223	鱼跃医疗	559,628.00	7.76
151	000825	太钢不锈	555,375.00	7.70
152	300324	旋极信息	554,327.00	7.69
153	600500	中化国际	549,389.00	7.62
154	002051	中工国际	540,805.00	7.50
155	000488	晨鸣纸业	540,073.00	7.49
156	600594	益佰制药	539,284.00	7.48
157	000566	海南海药	539,049.00	7.48
158	600503	华丽家族	537,517.00	7.45
159	000012	南玻 A	531,456.69	7.37
160	300202	聚龙股份	530,167.07	7.35
161	600801	华新水泥	528,217.00	7.33
162	002384	东山精密	527,316.00	7.31
163	002354	天神娱乐	526,171.56	7.30
164	300266	兴源环境	525,113.00	7.28
165	300253	卫宁健康	524,680.00	7.28
166	603589	口子窖	524,415.00	7.27
167	000089	深圳机场	518,205.00	7.19
168	600755	厦门国贸	517,098.00	7.17
169	600881	亚泰集团	515,684.00	7.15
170	002019	亿帆医药	513,934.00	7.13
171	300002	神州泰岳	511,466.00	7.09
172	000877	天山股份	510,761.00	7.08
173	600158	中体产业	510,669.96	7.08
174	002602	世纪华通	510,527.50	7.08
175	600418	江淮汽车	509,974.00	7.07
176	002001	新和成	509,050.45	7.06
177	603019	中科曙光	508,180.00	7.05
178	600511	国药股份	506,031.00	7.02
179	600967	内蒙一机	505,915.00	7.02
180	600160	巨化股份	505,830.00	7.02
181	000758	中色股份	498,123.00	6.91
182	000988	华工科技	497,971.00	6.91

183	000667	美好置业	497,608.00	6.90
184	000600	建投能源	494,433.00	6.86
185	002477	雏鹰农牧	492,131.00	6.83
186	000975	银泰资源	491,852.00	6.82
187	600198	大唐电信	491,310.00	6.81
188	600312	平高电气	490,802.00	6.81
189	002191	劲嘉股份	490,638.00	6.80
190	000960	锡业股份	488,989.00	6.78
191	300383	光环新网	486,383.00	6.75
192	600970	中材国际	485,673.00	6.74
193	600298	安琪酵母	485,549.00	6.73
194	000926	福星股份	484,188.00	6.72
195	600863	内蒙华电	482,667.00	6.69
196	002221	东华能源	478,266.00	6.63
197	002048	宁波华翔	478,169.38	6.63
198	600811	东方集团	476,089.00	6.60
199	000939	凯迪生态	474,799.00	6.58
200	002353	杰瑞股份	474,403.80	6.58
201	600633	浙数文化	474,206.00	6.58
202	600787	中储股份	473,664.00	6.57
203	600808	马钢股份	471,066.00	6.53
204	002373	千方科技	470,736.30	6.53
205	002583	海能达	470,252.00	6.52
206	002595	豪迈科技	469,544.00	6.51
207	002266	浙富控股	468,021.52	6.49
208	600260	凯乐科技	466,531.00	6.47
209	300122	智飞生物	464,379.38	6.44
210	300058	蓝色光标	462,921.29	6.42
211	000592	平潭发展	462,499.00	6.41
212	000685	中山公用	461,975.00	6.41
213	601880	大连港	460,153.00	6.38
214	600026	中远海能	452,766.00	6.28
215	000031	中粮地产	450,432.00	6.25
216	600392	盛和资源	450,121.00	6.24
217	600751	天海投资	446,800.00	6.20
218	000563	陕国投 A	446,580.00	6.19
219	600565	迪马股份	445,259.00	6.18
220	600884	杉杉股份	444,901.00	6.17
221	002672	东江环保	444,701.00	6.17
222	002013	中航机电	441,810.68	6.13
223	002375	亚厦股份	441,744.24	6.13
224	000727	华东科技	439,804.00	6.10
225	002028	思源电气	439,451.82	6.09
226	600416	湘电股份	438,863.00	6.09

227	600499	科达洁能	436,779.00	6.06
228	000513	丽珠集团	436,000.00	6.05
229	600497	驰宏锌锗	435,852.00	6.04
230	600478	科力远	432,726.38	6.00
231	002022	科华生物	431,708.00	5.99
232	002002	鸿达兴业	431,192.18	5.98
233	600064	南京高科	429,035.00	5.95
234	600409	三友化工	426,285.00	5.91
235	002127	南极电商	422,559.00	5.86
236	002261	拓维信息	422,446.55	5.86
237	603568	伟明环保	421,426.00	5.84
238	600125	铁龙物流	421,188.00	5.84
239	600039	四川路桥	420,682.00	5.83
240	000729	燕京啤酒	419,853.00	5.82
241	002444	巨星科技	418,192.00	5.80
242	002390	信邦制药	416,525.00	5.78
243	002601	龙蟠佰利	416,298.50	5.77
244	600566	济川药业	415,729.00	5.77
245	600120	浙江东方	413,773.00	5.74
246	002268	卫士通	413,623.98	5.74
247	002489	浙江永强	413,496.00	5.73
248	600062	华润双鹤	412,787.00	5.72
249	600809	山西汾酒	412,376.00	5.72
250	002603	以岭药业	411,503.00	5.71
251	000612	焦作万方	411,388.00	5.71
252	600316	洪都航空	411,097.00	5.70
253	600572	康恩贝	410,846.00	5.70
254	603766	隆鑫通用	410,528.43	5.69
255	600410	华胜天成	410,445.80	5.69
256	601929	吉视传媒	410,019.00	5.69
257	600183	生益科技	409,130.19	5.67
258	000860	顺鑫农业	408,381.00	5.66
259	002635	安洁科技	406,422.00	5.64
260	000519	中兵红箭	405,223.84	5.62
261	002400	省广股份	402,362.00	5.58
262	600759	洲际油气	398,846.00	5.53
263	600143	金发科技	397,370.00	5.51
264	300001	特锐德	396,009.00	5.49
265	600348	阳泉煤业	395,348.52	5.48
266	002342	巨力索具	395,084.00	5.48
267	000006	深振业 A	394,587.00	5.47
268	000979	中弘股份	393,311.00	5.45
269	000697	炼石有色	392,863.48	5.45
270	000937	冀中能源	389,240.00	5.40

271	300166	东方国信	389,083.98	5.40
272	002250	联化科技	387,934.00	5.38
273	000897	津滨发展	386,445.00	5.36
274	600017	日照港	385,492.00	5.35
275	002155	湖南黄金	385,167.00	5.34
276	300146	汤臣倍健	383,525.00	5.32
277	000777	中核科技	382,105.77	5.30
278	002308	威创股份	382,037.00	5.30
279	002640	跨境通	381,654.50	5.29
280	600597	光明乳业	378,209.00	5.25
281	601231	环旭电子	374,123.50	5.19
282	600601	方正科技	374,054.00	5.19
283	000816	智慧农业	372,492.00	5.17
284	600765	中航重机	371,469.00	5.15
285	600108	亚盛集团	371,170.00	5.15
286	300199	翰宇药业	371,129.00	5.15
287	002657	中科金财	369,070.00	5.12
288	600187	国中水务	367,147.89	5.09
289	603077	和邦生物	367,064.00	5.09
290	000652	泰达股份	366,777.00	5.09
291	000732	泰禾集团	366,275.00	5.08
292	600611	大众交通	365,607.00	5.07
293	000543	皖能电力	364,651.00	5.06
294	600169	太原重工	364,140.00	5.05
295	002437	誉衡药业	363,965.00	5.05
296	002440	闰土股份	363,696.03	5.04
297	000703	恒逸石化	362,301.00	5.02
298	000027	深圳能源	362,071.74	5.02
299	002281	光迅科技	361,967.36	5.02
300	002285	世联行	358,792.00	4.98
301	002276	万马股份	358,664.98	4.97
302	600466	蓝光发展	356,951.00	4.95
303	000830	鲁西化工	355,964.00	4.94
304	600575	皖江物流	354,202.45	4.91
305	000810	创维数字	353,536.00	4.90
306	600380	健康元	353,229.43	4.90
307	000848	承德露露	352,211.40	4.88
308	000572	海马汽车	347,697.00	4.82
309	600835	上海机电	345,658.00	4.79
310	002396	星网锐捷	343,847.00	4.77
311	300274	阳光电源	343,626.00	4.77
312	600545	新疆城建	343,146.00	4.76
313	600694	大商股份	342,416.50	4.75
314	603444	吉比特	341,721.00	4.74

315	601689	拓普集团	340,512.00	4.72
316	002468	申通快递	338,798.00	4.70
317	002544	杰赛科技	336,022.00	4.66
318	002517	恺英网络	335,451.00	4.65
319	002368	太极股份	334,022.00	4.63
320	002317	众生药业	333,008.60	4.62
321	000680	山推股份	332,938.00	4.62
322	601928	凤凰传媒	331,247.00	4.59
323	600086	东方金钰	330,909.00	4.59
324	603000	人民网	330,525.00	4.58
325	000158	常山股份	330,491.00	4.58
326	600993	马应龙	330,166.23	4.58
327	600366	宁波韵升	329,670.00	4.57
328	600851	海欣股份	328,520.00	4.56
329	000021	深科技	328,300.00	4.55
330	600557	康缘药业	328,221.00	4.55
331	600750	江中药业	327,986.81	4.55
332	000049	德赛电池	325,186.00	4.51
333	000541	佛山照明	322,786.00	4.48
334	002707	众信旅游	321,415.00	4.46
335	000762	西藏矿业	321,282.00	4.46
336	000501	鄂武商 A	320,898.40	4.45
337	600216	浙江医药	320,786.00	4.45
338	601311	骆驼股份	320,145.00	4.44
339	600422	昆药集团	318,865.00	4.42
340	300116	坚瑞沃能	318,371.00	4.42
341	000620	新华联	317,367.81	4.40
342	600651	飞乐音响	315,425.00	4.37
343	600582	天地科技	314,972.00	4.37
344	000806	银河生物	314,877.00	4.37
345	600284	浦东建设	314,772.00	4.37
346	600458	时代新材	312,642.00	4.34
347	002123	梦网荣信	311,717.47	4.32
348	000726	鲁泰 A	311,366.92	4.32
349	600587	新华医疗	311,291.00	4.32
350	300010	立思辰	311,251.00	4.32
351	002428	云南锗业	310,843.00	4.31
352	600770	综艺股份	310,636.48	4.31
353	600073	上海梅林	310,243.00	4.30
354	002073	软控股份	310,019.00	4.30
355	603188	亚邦股份	305,568.00	4.24
356	000829	天音控股	305,437.87	4.24
357	000587	金洲慈航	305,419.00	4.24
358	600563	法拉电子	304,971.00	4.23

359	000616	海航投资	304,895.00	4.23
360	002482	广田集团	304,573.00	4.22
361	002463	沪电股份	304,228.00	4.22
362	600171	上海贝岭	303,869.00	4.21
363	002479	富春环保	303,631.00	4.21
364	601016	节能风电	303,509.00	4.21
365	001696	宗申动力	302,186.00	4.19
366	000596	古井贡酒	301,905.00	4.19
367	000636	风华高科	300,046.00	4.16
368	002242	九阳股份	300,033.00	4.16
369	600848	上海临港	299,280.24	4.15
370	600067	冠城大通	298,563.00	4.14
371	600729	重庆百货	298,141.00	4.13
372	600517	置信电气	297,679.00	4.13
373	000766	通化金马	297,352.00	4.12
374	601678	滨化股份	293,743.00	4.07
375	600058	五矿发展	293,706.50	4.07
376	002056	横店东磁	293,682.00	4.07
377	600639	浦东金桥	293,541.00	4.07
378	600151	航天机电	292,903.00	4.06
379	000712	锦龙股份	292,827.95	4.06
380	002399	海普瑞	291,462.41	4.04
381	002269	美邦服饰	291,050.00	4.04
382	600874	创业环保	289,940.00	4.02
383	002325	洪涛股份	287,355.00	3.99
384	600053	九鼎投资	286,199.00	3.97
385	600894	广日股份	285,811.00	3.96
386	002663	普邦股份	284,813.32	3.95
387	600259	广晟有色	284,197.00	3.94
388	600645	中源协和	283,665.00	3.93
389	002005	德豪润达	281,590.00	3.91
390	002277	友阿股份	280,578.00	3.89
391	002581	未名医药	280,058.00	3.88
392	002063	远光软件	277,440.00	3.85
393	002332	仙琚制药	276,725.00	3.84
394	000552	靖远煤电	275,602.98	3.82
395	002011	盾安环境	275,166.21	3.82
396	600736	苏州高新	274,816.00	3.81
397	000969	安泰科技	274,702.00	3.81
398	002709	天赐材料	274,586.98	3.81
399	000061	农产品	274,556.18	3.81
400	300147	香雪制药	272,458.00	3.78
401	600880	博瑞传播	272,436.00	3.78
402	002727	一心堂	272,163.00	3.77

403	002254	泰和新材	272,090.00	3.77
404	600496	精工钢构	272,054.00	3.77
405	002681	奋达科技	271,629.00	3.77
406	002344	海宁皮城	269,662.00	3.74
407	002358	森源电气	269,353.00	3.74
408	600175	美都能源	269,095.00	3.73
409	600805	悦达投资	266,763.37	3.70
410	000669	金鸿能源	266,096.00	3.69
411	600720	祁连山	265,201.00	3.68
412	002690	美亚光电	264,707.26	3.67
413	600537	亿晶光电	264,262.00	3.66
414	300297	蓝盾股份	264,120.20	3.66
415	600329	中新药业	261,441.00	3.63
416	300376	易事特	257,409.00	3.57
417	601886	江河集团	253,804.00	3.52
418	601777	力帆股份	252,229.00	3.50
419	600826	兰生股份	249,380.00	3.46
420	000426	兴业矿业	248,904.00	3.45
421	000973	佛塑科技	248,840.00	3.45
422	600580	卧龙电气	248,834.00	3.45
423	002190	成飞集成	248,445.47	3.45
424	600006	东风汽车	248,226.00	3.44
425	600773	西藏城投	247,710.00	3.44
426	600586	金晶科技	247,355.00	3.43
427	600823	世茂股份	246,353.90	3.42
428	601002	晋亿实业	245,369.00	3.40
429	603556	海兴电力	244,973.00	3.40
430	603888	新华网	243,707.00	3.38
431	002161	远望谷	243,660.00	3.38
432	600869	智慧能源	243,350.00	3.37
433	000681	视觉中国	242,801.68	3.37
434	300039	上海凯宝	241,233.00	3.35
435	600648	外高桥	240,984.00	3.34
436	603369	今世缘	240,725.00	3.34
437	002041	登海种业	240,189.00	3.33
438	600790	轻纺城	239,156.00	3.32
439	600059	古越龙山	238,601.00	3.31
440	002588	史丹利	237,621.00	3.30
441	600757	长江传媒	236,690.00	3.28
442	600596	新安股份	233,156.00	3.23
443	002122	天马股份	232,761.00	3.23
444	600280	中央商场	232,265.00	3.22
445	002233	塔牌集团	232,142.00	3.22
446	600862	中航高科	229,710.00	3.19

447	600395	盘江股份	228,451.00	3.17
448	600338	西藏珠峰	228,412.61	3.17
449	601001	大同煤业	227,812.00	3.16
450	603355	莱克电气	227,056.00	3.15
451	002345	潮宏基	226,685.00	3.14
452	600141	兴发集团	226,156.99	3.14
453	601801	皖新传媒	220,819.00	3.06
454	600743	华远地产	219,599.00	3.05
455	300032	金龙机电	218,965.74	3.04
456	600292	远达环保	216,842.00	3.01
457	600195	中牧股份	216,155.00	3.00
458	000869	张裕 A	215,847.00	2.99
459	600748	上实发展	211,470.00	2.93
460	603377	东方时尚	210,662.00	2.92
461	603816	顾家家居	210,573.48	2.92
462	600640	号百控股	210,377.00	2.92
463	600433	冠豪高新	206,580.00	2.86
464	600289	亿阳信通	206,191.37	2.86
465	002309	中利集团	203,789.00	2.83
466	600859	王府井	203,573.00	2.82
467	600831	广电网络	201,670.00	2.80
468	600335	国机汽车	200,048.00	2.77
469	000931	中关村	199,663.85	2.77
470	600184	光电股份	199,233.60	2.76
471	603528	多伦科技	196,530.00	2.73
472	002120	韵达股份	196,508.00	2.73
473	600754	锦江股份	196,224.00	2.72
474	600481	双良节能	195,758.00	2.71
475	002147	新光圆成	194,991.00	2.70
476	600850	华东电脑	192,841.60	2.67
477	002029	七匹狼	192,623.00	2.67
478	002327	富安娜	190,934.00	2.65
479	600112	*ST 天成	190,809.00	2.65
480	002414	高德红外	190,426.00	2.64
481	000099	中信海直	189,591.89	2.63
482	600351	亚宝药业	188,730.00	2.62
483	002699	美盛文化	187,219.00	2.60
484	600971	恒源煤电	185,948.00	2.58
485	002093	国脉科技	184,899.00	2.56
486	002551	尚荣医疗	182,914.00	2.54
487	600460	士兰微	177,456.34	2.46
488	603806	福斯特	176,412.00	2.45
489	600251	冠农股份	175,313.00	2.43
490	603005	晶方科技	174,178.00	2.42

491	000517	荣安地产	174,127.00	2.41
492	600996	贵广网络	173,350.00	2.40
493	002416	爱施德	172,049.00	2.39
494	600776	东方通信	171,223.00	2.37
495	002392	北京利尔	169,201.00	2.35
496	002646	青青稞酒	166,571.00	2.31
497	603698	航天工程	165,518.00	2.30
498	603001	奥康国际	162,076.66	2.25
499	603328	依顿电子	161,266.00	2.24
500	002698	博实股份	161,256.05	2.24
501	603169	兰石重装	160,278.00	2.22
502	002251	步步高	155,666.00	2.16
503	000919	金陵药业	154,577.00	2.14
504	601908	京运通	150,735.86	2.09
505	600425	*ST 青松	150,112.00	2.08
506	000631	顺发恒业	147,088.00	2.04
507	603567	珍宝岛	146,841.00	2.04

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600161	天坛生物	2,951,100.04	40.93
2	000661	长春高新	2,904,681.86	40.28
3	002092	中泰化学	2,762,143.11	38.31
4	000090	天健集团	2,708,688.40	37.57
5	002244	滨江集团	2,666,662.89	36.98
6	600516	方大炭素	2,641,197.73	36.63
7	002078	太阳纸业	2,591,496.56	35.94
8	002498	汉缆股份	2,588,657.95	35.90
9	603198	迎驾贡酒	2,584,336.90	35.84
10	002491	通鼎互联	2,561,621.31	35.53
11	000050	深天马 A	2,557,259.14	35.47
12	002589	瑞康医药	2,549,525.70	35.36
13	000078	海王生物	2,543,806.33	35.28
14	300244	迪安诊断	2,532,390.62	35.12
15	600166	福田汽车	2,521,783.10	34.97
16	000861	海印股份	2,500,056.63	34.67
17	000959	首钢股份	2,490,898.62	34.55
18	600094	大名城	2,485,631.74	34.47
19	600267	海正药业	2,479,842.11	34.39
20	002273	水晶光电	2,477,931.87	34.37

21	002431	棕榈股份	2,476,031.33	34.34
22	600628	新世界	2,463,429.64	34.16
23	000062	深圳华强	2,447,987.94	33.95
24	600699	均胜电子	2,398,716.58	33.27
25	600282	南钢股份	2,397,667.24	33.25
26	000528	柳 工	2,388,096.93	33.12
27	600200	江苏吴中	2,387,633.10	33.11
28	600536	中国软件	2,386,796.69	33.10
29	600864	哈投股份	2,375,324.31	32.94
30	603883	老百姓	2,372,365.84	32.90
31	600220	江苏阳光	2,354,409.98	32.65
32	300043	星辉娱乐	2,353,568.27	32.64
33	002106	莱宝高科	2,279,182.91	31.61
34	300273	和佳股份	2,278,605.78	31.60
35	600307	酒钢宏兴	2,275,673.81	31.56
36	600687	刚泰控股	2,272,269.03	31.51
37	601233	桐昆股份	2,257,687.02	31.31
38	601699	潞安环能	2,233,189.10	30.97
39	000761	本钢板材	2,218,007.04	30.76
40	600300	维维股份	2,133,361.19	29.59
41	000961	中南建设	2,098,791.25	29.11
42	002670	国盛金控	2,091,988.82	29.01
43	600664	哈药股份	2,011,931.73	27.90
44	600872	中炬高新	1,943,014.83	26.95
45	600270	外运发展	1,931,689.05	26.79
46	002665	首航节能	1,928,457.67	26.75
47	002118	紫鑫药业	1,707,240.48	23.68
48	002512	达华智能	1,706,596.53	23.67
49	002408	齐翔腾达	1,654,661.37	22.95
50	002315	焦点科技	1,591,776.87	22.08
51	601717	郑煤机	1,458,920.44	20.23
52	000417	合肥百货	1,458,193.84	20.22
53	600428	中远海特	1,423,391.06	19.74
54	002503	搜于特	1,378,490.33	19.12
55	600291	西水股份	1,356,751.73	18.82
56	600098	广州发展	1,314,284.16	18.23
57	600180	瑞茂通	1,163,928.14	16.14
58	002572	索菲亚	1,113,758.73	15.45
59	600825	新华传媒	1,111,567.03	15.42
60	300287	飞利信	1,008,088.83	13.98
61	000400	许继电气	986,299.80	13.68
62	002508	老板电器	935,467.73	12.97
63	600522	中天科技	911,524.13	12.64
64	002018	华信国际	896,626.97	12.43

65	300257	开山股份	866,397.87	12.02
66	002064	华峰氨纶	821,752.90	11.40
67	600468	百利电气	795,153.96	11.03
68	000690	宝新能源	746,684.63	10.36
69	600436	片仔癀	744,369.79	10.32
70	600682	南京新百	699,429.97	9.70
71	002460	赣锋锂业	602,902.19	8.36
72	300136	信维通信	565,435.99	7.84
73	601010	文峰股份	546,973.45	7.59
74	002602	世纪华通	526,246.28	7.30
75	300156	神雾环保	517,801.95	7.18
76	600879	航天电子	510,515.51	7.08
77	002271	东方雨虹	474,497.95	6.58
78	002371	北方华创	470,977.71	6.53
79	002249	大洋电机	456,839.93	6.34
80	300113	顺网科技	455,884.94	6.32
81	002405	四维图新	441,936.81	6.13
82	002595	豪迈科技	437,560.57	6.07
83	600497	驰宏锌锗	435,943.40	6.05
84	000066	中国长城	435,830.71	6.04
85	002340	格林美	380,875.28	5.28
86	002422	科伦药业	375,176.72	5.20
87	300202	聚龙股份	359,873.10	4.99
88	600601	方正科技	356,451.58	4.94
89	000786	北新建材	355,955.19	4.94
90	002311	海大集团	355,405.44	4.93
91	002573	清新环境	349,957.53	4.85
92	600801	华新水泥	341,820.04	4.74
93	603568	伟明环保	335,579.26	4.65
94	000401	冀东水泥	327,506.93	4.54
95	300026	红日药业	323,275.03	4.48
96	600487	亨通光电	321,048.29	4.45
97	300115	长盈精密	319,947.74	4.44
98	300296	利亚德	319,449.79	4.43
99	000999	华润三九	316,085.47	4.38
100	000998	隆平高科	313,763.20	4.35
101	000970	中科三环	313,168.30	4.34
102	002410	广联达	313,139.27	4.34
103	002004	华邦健康	311,881.52	4.33
104	000028	国药一致	306,544.67	4.25
105	300055	万邦达	306,027.46	4.24
106	000547	航天发展	302,180.27	4.19
107	600201	生物股份	301,711.50	4.18
108	600067	冠城大通	294,986.72	4.09

109	002050	三花智控	294,609.93	4.09
110	002038	双鹭药业	293,469.25	4.07
111	000418	小天鹅 A	290,235.94	4.03
112	600575	皖江物流	289,693.97	4.02
113	300159	新研股份	288,862.67	4.01
114	000930	中粮生化	284,346.27	3.94
115	601012	隆基股份	283,707.29	3.93
116	000581	威孚高科	278,020.30	3.86
117	000997	新大陆	277,943.20	3.85
118	000878	云南铜业	276,915.68	3.84
119	002030	达安基因	275,871.68	3.83
120	600525	长园集团	274,556.04	3.81
121	000598	兴蓉环境	274,007.37	3.80
122	600219	南山铝业	272,908.36	3.78
123	002217	合力泰	272,034.77	3.77
124	002384	东山精密	271,861.60	3.77
125	002439	启明星辰	270,783.50	3.76
126	600079	人福医药	269,702.21	3.74
127	600851	海欣股份	267,153.19	3.71
128	002176	江特电机	266,131.31	3.69
129	000600	建投能源	260,024.92	3.61
130	002581	未名医药	257,623.60	3.57
131	002701	奥瑞金	256,269.62	3.55
132	000825	太钢不锈	255,833.95	3.55
133	600175	美都能源	255,662.90	3.55
134	600584	长电科技	253,354.32	3.51
135	000089	深圳机场	250,070.38	3.47
136	002366	台海核电	249,692.42	3.46
137	000973	佛塑科技	249,203.22	3.46
138	000877	天山股份	248,762.11	3.45
139	000566	海南海药	246,261.94	3.42
140	002407	多氟多	245,390.27	3.40
141	002179	中航光电	244,145.58	3.39
142	000988	华工科技	240,433.42	3.33
143	002223	鱼跃医疗	239,032.30	3.32
144	300253	卫宁健康	238,698.53	3.31
145	600823	世茂股份	238,240.44	3.30
146	002354	天神娱乐	237,614.22	3.30
147	000012	南玻 A	235,951.89	3.27
148	600315	上海家化	235,855.21	3.27
149	000960	锡业股份	234,850.78	3.26
150	600176	中国巨石	233,732.03	3.24
151	002191	劲嘉股份	232,579.53	3.23
152	000488	晨鸣纸业	230,774.40	3.20

153	000667	美好置业	228,663.78	3.17
154	000939	凯迪生态	226,895.49	3.15
155	000758	中色股份	226,073.09	3.14
156	000975	银泰资源	224,937.28	3.12
157	300324	旋极信息	223,060.58	3.09
158	002477	雏鹰农牧	219,760.90	3.05
159	002373	千方科技	214,689.75	2.98
160	000926	福星股份	214,293.38	2.97
161	000869	张裕 A	212,750.09	2.95
162	002161	远望谷	212,418.70	2.95
163	002051	中工国际	212,034.23	2.94
164	600426	华鲁恒升	211,075.37	2.93
165	002342	巨力索具	210,678.30	2.92
166	601168	西部矿业	210,423.40	2.92
167	600266	北京城建	210,325.74	2.92
168	002261	拓维信息	209,692.61	2.91
169	002635	安洁科技	209,329.85	2.90
170	601801	皖新传媒	208,161.16	2.89
171	300266	兴源环境	207,909.22	2.88
172	002001	新和成	207,771.03	2.88
173	000727	华东科技	207,442.20	2.88
174	002353	杰瑞股份	205,779.69	2.85
175	600056	中国医药	205,717.14	2.85
176	000778	新兴铸管	202,537.37	2.81
177	002375	亚厦股份	202,239.87	2.80
178	600528	中铁工业	200,842.72	2.79
179	002002	鸿达兴业	200,208.18	2.78
180	002019	亿帆医药	199,919.54	2.77
181	601000	唐山港	199,056.20	2.76
182	002266	浙富控股	197,988.70	2.75
183	002640	跨境通	195,962.13	2.72
184	002022	科华生物	195,400.60	2.71
185	000563	陕国投 A	194,942.61	2.70
186	600850	华东电脑	194,648.17	2.70
187	300122	智飞生物	194,633.46	2.70
188	002029	七匹狼	193,864.30	2.69
189	000513	丽珠集团	193,464.56	2.68
190	000592	平潭发展	192,030.96	2.66
191	000931	中关村	190,829.93	2.65
192	002489	浙江永强	190,612.42	2.64
193	600325	华发股份	190,590.28	2.64
194	002048	宁波华翔	189,962.03	2.63
195	000039	中集集团	189,939.36	2.63
196	000612	焦作万方	188,002.80	2.61

197	600521	华海药业	186,723.36	2.59
198	002327	富安娜	186,173.38	2.58
199	000685	中山公用	185,664.60	2.57
200	600433	冠豪高新	184,008.91	2.55
201	600978	宜华生活	182,709.13	2.53
202	000897	津滨发展	182,697.86	2.53
203	300166	东方国信	182,360.46	2.53
204	002281	光迅科技	181,409.22	2.52
205	002221	东华能源	180,730.26	2.51
206	600435	北方导航	180,302.84	2.50
207	002028	思源电气	180,239.54	2.50
208	002672	东江环保	177,581.19	2.46
209	600138	中青旅	177,428.13	2.46
210	000937	冀中能源	176,895.08	2.45
211	000830	鲁西化工	175,863.17	2.44
212	000031	中粮地产	175,729.03	2.44
213	002268	卫士通	174,751.43	2.42
214	000703	恒逸石化	174,656.97	2.42
215	600351	亚宝药业	174,462.41	2.42
216	600717	天津港	174,395.50	2.42
217	002444	巨星科技	173,678.50	2.41
218	000777	中核科技	173,213.44	2.40
219	600022	山东钢铁	172,325.10	2.39
220	002285	世联行	171,882.39	2.38
221	000006	深振业 A	170,720.04	2.37
222	000652	泰达股份	170,520.54	2.36
223	002603	以岭药业	169,798.08	2.35
224	603589	口子窖	169,230.08	2.35
225	000816	智慧农业	168,892.39	2.34
226	600260	凯乐科技	168,886.34	2.34
227	600635	大众公用	168,644.61	2.34
228	000543	皖能电力	168,588.28	2.34
229	600600	青岛啤酒	166,501.72	2.31
230	300002	神州泰岳	163,791.89	2.27
231	000021	深科技	163,491.66	2.27
232	000810	创维数字	163,246.08	2.26
233	002437	誉衡药业	163,168.32	2.26
234	000860	顺鑫农业	163,080.35	2.26
235	002250	联化科技	162,991.17	2.26
236	600511	国药股份	162,311.69	2.25
237	000158	常山股份	161,755.27	2.24
238	300383	光环新网	161,753.96	2.24
239	600642	申能股份	161,495.51	2.24
240	000572	海马汽车	160,679.69	2.23

241	002317	众生药业	160,217.40	2.22
242	000848	承德露露	158,708.27	2.20
243	600500	中化国际	158,479.29	2.20
244	300001	特锐德	158,000.46	2.19
245	600755	厦门国贸	157,274.82	2.18
246	603799	华友钴业	156,414.92	2.17
247	600160	巨化股份	155,941.60	2.16
248	600298	安琪酵母	154,155.59	2.14
249	600122	宏图高科	154,095.30	2.14
250	600240	华业资本	153,560.66	2.13
251	002583	海能达	152,464.11	2.11
252	000680	山推股份	152,371.95	2.11
253	603019	中科曙光	152,174.96	2.11
254	002698	博实股份	151,662.47	2.10
255	600158	中体产业	151,463.57	2.10
256	300274	阳光电源	151,329.90	2.10
257	600503	华丽家族	151,013.77	2.09
258	600633	浙数文化	150,828.13	2.09
259	600418	江淮汽车	150,618.42	2.09
260	600881	亚泰集团	149,923.07	2.08
261	300199	翰宇药业	149,913.25	2.08
262	600594	益佰制药	149,796.54	2.08
263	600970	中材国际	149,530.68	2.07
264	000519	中兵红箭	148,645.09	2.06
265	002308	威创股份	148,464.74	2.06
266	600388	龙净环保	148,458.36	2.06
267	002440	闰土股份	148,167.59	2.05
268	002707	众信旅游	147,682.37	2.05
269	002155	湖南黄金	147,105.42	2.04
270	000620	新华联	147,007.60	2.04
271	600808	马钢股份	146,565.26	2.03
272	000541	佛山照明	146,342.43	2.03
273	300058	蓝色光标	146,107.60	2.03
274	002277	友阿股份	145,481.28	2.02
275	000501	鄂武商 A	144,951.47	2.01
276	600062	华润双鹤	144,891.90	2.01
277	002482	广田集团	144,792.29	2.01
278	600312	平高电气	144,566.09	2.00
279	002544	杰赛科技	144,349.40	2.00
280	000726	鲁泰 A	144,287.79	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	342,266,169.73
卖出股票收入（成交）总额	212,051,243.80

注：“买入股票成本”或“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

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

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	55,582.88
2	应收证券清算款	146,146.00
3	应收股利	-
4	应收利息	791.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	202,520.68

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

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	888,426.30	0.68	重大事项停 牌

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
289	73,102.95	20,416,283.00	96.64%	710,470.00	3.36%

注：已包含场外持有人。

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	邓敏妍	210,000.00	19.15%
2	中国对外经济贸易信托有限公司—申毅量化套利集合资金信托计划	183,254.00	16.71%
3	上海申毅投资股份有限公司—申毅多策略量化套利 7 号	163,656.00	14.93%
4	刘健	63,564.00	5.80%
5	陈思	45,000.00	4.10%
6	吕爱平	45,000.00	4.10%
7	银河期货有限公司—外贸信托·申毅量化套利集合资金信托计划	39,135.00	3.57%
8	谢雪泮	34,100.00	3.11%
9	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	29,100.00	2.65%
10	吴杰	17,800.00	1.62%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

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（2015 年 8 月 27 日）基金份额总额	295,259,000.00
本报告期初基金份额总额	1,096,515.00
本报告期基金总申购份额	31,429,302.00
减：本报告期基金总赎回份额	11,399,064.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	21,126,753.00

注：期末基金总份额包含场外份额 20,030,238 份；总申购份额包含场外总申购份额 31,429,302 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 11,399,064 份。

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

本基金管理人于 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	719,553.69	0.13%	359.81	40.96%	-
国信证券	2	551,777,968.44	99.68%	-	-	-
中信证券	2	1,037,222.58	0.19%	518.70	59.04%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增国海证券股份有限公司一个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能

力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	1,060.00	100.00%	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-09
2	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19
4	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
5	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23

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	1	2017年04月07日~2017年05月01日,2017年05月05日~2017年05月07日	-	6,079,500.00	6,079,500.00	-	-
	2	2017年04月07日~2017年06月30日	-	12,159,001.00	-	12,159,001.00	57.55%
	3	2017年06月07日~2017年06月30日	-	7,111,300.00	-	7,111,300.00	33.66%
个人	1	2017年01月01日~2017年04月04日	295,000.00	-	85,000.00	210,000.00	0.99%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 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和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

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。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日