

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

金

2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 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：二〇一八年三月三十日

§ 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 2018 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9	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	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	审计报告	17
6.1	审计意见	17
6.2	形成审计意见的基础	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7	年度财务报表	19
7.1	资产负债表	19
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	46
8.1	期末基金资产组合情况	46
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3	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	48
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6	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	84
8.7	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	84
8.8	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	84
8.9	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	84
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	84
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12	投资组合报告附注	84
§ 9	基金份额持有人信息	85
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2	期末上市基金前十名持有人	85
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
9.4	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	86
§ 10	开放式基金份额变动	86
§ 11	重大事件揭示	86
11.1	基金份额持有人大会决议	86
11.2	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	87
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4	基金投资策略的改变	87
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	87
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	87
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	87
11.8	其他重大事件	89
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	89
12.1	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	89
§ 13	备查文件目录	90
13.1	备查文件目录	90
13.2	存放地点	90
13.3	查阅方式	90

§ 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	6,632,005.00 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 负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年	2015 年 8 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,694,072.62	-890,270.34	21,516,402.48
本期利润	-1,611,861.64	-2,240,942.11	22,467,589.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1431	-1.8129	0.5237
本期加权平均净值利润率	-2.28%	-27.97%	17.40%
本期基金份额净值增长率	-1.11%	-15.89%	20.47%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	86,153.54	94,462.68	2,253,140.58
期末可供分配基金份额利润	0.0130	0.0861	1.3281
期末基金资产净值	43,125,946.36	7,210,522.51	13,263,023.94
期末基金份额净值	6.5027	6.5759	7.8178
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	0.20%	1.33%	20.47%

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.本基金合同于 2015 年 8 月 27 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

5.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
过去三个月	-4.76%	0.89%	-5.34%	0.98%	0.58%	-0.09%
过去六个月	5.24%	0.90%	1.84%	0.96%	3.40%	-0.06%
过去一年	-1.11%	0.90%	-0.20%	0.93%	-0.91%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	0.20%	1.48%	0.20%	1.69%	0.00%	-0.21%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

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

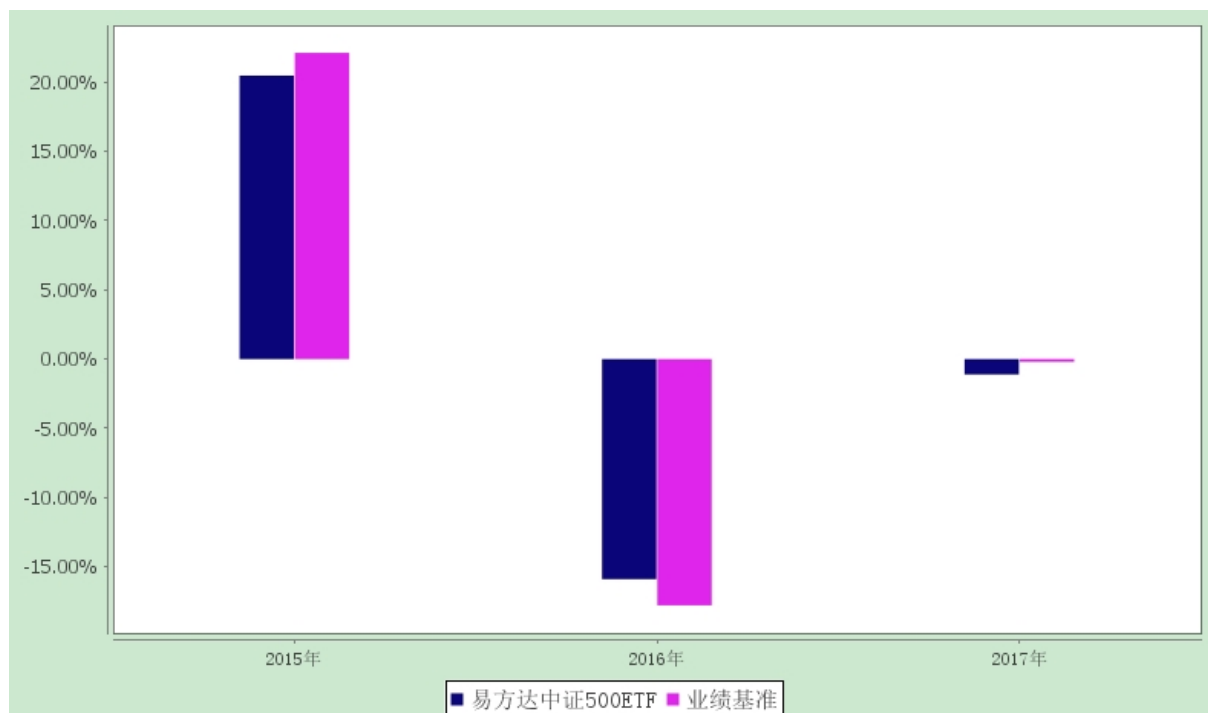
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 8 月 27 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 0.20%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 8 月 27 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至 2017 年 12 月 31 日，易方达旗下管理的各类资产规模总计 12338 亿元，其中公募基金规模 6077 亿元；服务各类客户总数 6703 万户，公募基金累计分红 931 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（自 2016 年 05 月 26 日至 2017 年 07 月 06 日）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理（自 2013 年 11 月 29 日至 2017 年 07 月 06 日）、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、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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	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。

	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联接基金的基金经理、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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申

购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2017 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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 36 次，其中 33 次为旗下指数及量化组合因

投资策略需要和其他组合发生反向交易, 3 次为不同基金经理管理的组合间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。

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, 全球经济回暖拉动外需持续向好的背景下, 2017 年中国宏观经济延续了 2016 年以来的企稳态势, 经济韧性增强。全年 GDP 增速达 6.9%, 较 2016 年提高 0.2 个百分点; 其中社会消费品零售总额增长 10.2%, 较 2016 年回落 0.2 个百分点, 固定资产投资增长 7.2%, 较 2016 年回落 0.9 个百分点, 工业增加值增长 6.6%, 较 2016 年回升 0.6 个百分点, 出口额增长 7.9%, 较 2016 年大幅回升 15.6 个百分点。防范金融风险 and 去杠杆主导了 2017 年央行的货币政策基调, 叠加美联储加息和缩表的影响, 全年宏观流动性整体维持偏紧格局。本年度人民币兑美元汇率稳中有升扭转了过去三年以来的走低趋势, 截至年末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均回落至 6.5 附近。资本市场方面, A 股市场震荡走高, 最终上证综指以上涨 6.56% 收官。在风格方面, 大小盘分化明显, 个股表现之间“二八”分化特征显著, 本年度上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 25.08%、21.78%, 而创业板综指、中证 500 指数分别下跌 15.32%、0.20%; 行业方面, 保险、食品饮料、家用电器、钢铁、有色金属、电子、银行等板块涨幅居前, 纺织服装、传媒、国防军工等板块跌幅较大。

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 6.5027 元, 本报告期份额净值增长率为 -1.11%, 同期业绩比较基准收益率为 -0.20%, 日跟踪偏离度的均值为 0.07%, 年化跟踪误差为 2.842%, 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依然是影响未来 A 股市场最值得关注的因素。从经济增长的角度来看, 在外需稳健、资本开支周期复苏具有惯性、消费增长有韧性等因素支持下, 预计 2018 年中国经济增长仍将保持稳健回升态势。从金融监管政策传递的信号来看, 金融去杠杆将更依赖监管规则升级而非持续紧缩流动性, 对未来流动性的预期无需过度悲观。从海外市场来看, 全球主要经济体“紧货

币，宽财政”的政策组合对经济增长仍有一定的支持力度，美国税改落地有望进一步提振美国乃至全球的需求。全球主要经济体复苏的共振以及温和的再通胀均有利于股票类资产。如果当前中国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 股市场整体估值水平仍偏低、上市公司整体盈利继续好转、流动性可能“有惊无险”的背景下，未来 A 股市场的机会仍将大于风险。从长期来看改革与创新仍然值得期待，中国新老经济的结构转换仍在深化中，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点。各项改革进程，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，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，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

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成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等新法规的实施和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投

资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，认真贯彻落实流动性风险管理规定的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 有计划、有重点地对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。

(6) 督促落实投资者适当性管理新规，推动投资者适当性管理制度、相关销售流程规范及系统的修订、更新，持续检讨完善客户投诉处理机制流程，切实保障投资者合法权益。

(7) 深入贯彻落实“风险为本”的监管要求，加强洗钱风险评估和监测防控，围绕“三号令”的落实进一步完善反洗钱可疑交易监测和配套工作机制，探索建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理体系，同时不断夯实反洗钱工作基础，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

(8) 紧跟法规监管要求、市场变化和业务发展，不断优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、规范。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

截至 2017 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、中国证券投资基金业协会相关指引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，公司首席运营官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，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 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。

4.9 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 24 日，2017 年 11 月 3 日至 2017 年 11 月 7 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，2017 年 12 月 5 日至本报告期末，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。

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。

§ 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，对易方达中证 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对易方达中证 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，对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年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 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21283 号

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括

沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

薛竞 周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	967,040.64	383,686.88
结算备付金		103,377.59	833.73
存出保证金		50,251.40	309.31
交易性金融资产	7.4.7.2	42,259,807.49	6,900,709.25
其中：股票投资		42,259,807.49	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,753.65	-
应收利息	7.4.7.5	270.14	77.10
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		43,382,500.91	7,285,616.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		13,310.72	3,098.00
应付托管费		2,662.14	619.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	581.69	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	7.4.7.8	240,000.00	70,000.00
负债合计		256,554.55	75,093.76
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	43,039,792.82	7,116,059.83
未分配利润	7.4.7.10	86,153.54	94,462.68
所有者权益合计		43,125,946.36	7,210,522.51
负债和所有者权益总计		43,382,500.91	7,285,616.27

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 6.5027 元，基金份额总额 6,632,005.00

份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-342,873.60	-1,897,564.93
1.利息收入		26,511.51	5,236.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	26,503.02	5,234.36
债券利息收入		8.49	1.79
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）		-839,083.27	-544,773.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,949,300.66	-593,563.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,594.46	1,964.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,104,622.93	46,825.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	82,210.98	-1,350,671.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	387,487.18	-7,355.85
减：二、费用		1,268,988.04	343,377.18
1. 管理人报酬		349,054.69	40,248.46

2. 托管费		69,810.87	8,049.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	397,750.34	14,730.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	452,372.14	280,349.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,611,861.64	-2,240,942.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,611,861.64	-2,240,942.11

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	-	-1,611,861.64	-1,611,861.64
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）	35,923,732.99	1,603,552.50	37,527,285.49
其中：1.基金申购款	223,994,900.71	-2,105,845.22	221,889,055.49
2.基金赎回款	-188,071,167.72	3,709,397.72	-184,361,770.00

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）	43,039,792.82	86,153.54	43,125,946.36
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-2,240,942.11	-2,240,942.11
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	94,462.68	7,210,522.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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。本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购赎回对价现金替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；
- (3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；
- (4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的

指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 15 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 15 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中

央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2017）6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 15 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	967,040.64	383,686.88
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	967,040.64	383,686.88

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,577,080.80	42,259,807.49	-317,273.31
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	42,577,080.80	42,259,807.49	-317,273.31
项目	上年度末		

		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,300,193.54	6,900,709.25	-399,484.29
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		7,300,193.54	6,900,709.25	-399,484.29

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	200.14	76.70
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	47.40	0.20
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	22.60	0.20
合计	270.14	77.10

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	581.69	1,376.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	581.69	1,376.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	190,000.00	20,000.00
其他应付款	50,000.00	50,000.00
应付替代款	-	-
合计	240,000.00	70,000.00

7.4.7.9 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 12 月 31 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	34,515,466.00	223,994,900.71
本期赎回（以“-”号填列）	-28,979,976.00	-188,071,167.72

本期末	6,632,005.00	43,039,792.82
-----	--------------	---------------

7.4.7.10 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	-1,694,072.62	82,210.98	-1,611,861.64
本期基金份额交易产生的变动数	19,323,887.91	-17,720,335.41	1,603,552.50
其中：基金申购款	95,994,905.03	-98,100,750.25	-2,105,845.22
基金赎回款	-76,671,017.12	80,380,414.84	3,709,397.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,877,702.97	-20,791,549.43	86,153.54

7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	18,156.30	4,530.51
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	7,627.38	139.18
其他	719.34	564.67
合计	26,503.02	5,234.36

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

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 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,949,300.66	-254,441.87
股票投资收益——赎回差价收入	-	-339,121.99

股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,949,300.66	-593,563.86

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出股票成交总额	332,655,862.14	7,134,100.64
减：卖出股票成本总额	334,605,162.80	7,388,542.51
买卖股票差价收入	-1,949,300.66	-254,441.87

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
赎回基金份额对价总额	-	3,677,808.22
减：现金支付赎回款总额	-	1,846,757.22
减：赎回股票成本总额	-	2,170,172.99
赎回差价收入	-	-339,121.99

7.4.7.13 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12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	49,802.95	13,666.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	44,199.71	11,700.00
减：应收利息总额	8.78	1.79
买卖债券差价收入	5,594.46	1,964.49

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日

股票投资产生的股利收益	1,104,622.93	46,825.91
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,104,622.93	46,825.91

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	82,210.98	-1,350,671.77
——股票投资	82,210.98	-1,350,671.77
——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	82,210.98	-1,350,671.77

7.4.7.17 其他收入

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	276,542.67	-
基金申购费收入	110,944.51	-
替代损益收入	-	-7,355.85
其他	-	-
合计	387,487.18	-7,355.85

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。

7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	397,750.34	14,730.05
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	-	-
合计	397,750.34	14,730.05

7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	30,000.00	20,000.00
信息披露费	160,000.00	-
银行汇划费	2,372.14	349.00
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	-	-
合计	452,372.14	280,349.00

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9关联方关系

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
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申赎代办券商
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	349,054.69	40,248.46
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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	69,810.87	8,049.67

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		2016年1月1日至2016年12月31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	967,040.64	18,156.30	383,686.88	4,530.51

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
000006	深振业 A	2017-09-11	重大事项停牌	9.85	2018-03-08	8.87	11,239	96,188.90	110,704.15	-
000031	中粮地产	2017-07-24	重大事项停牌	8.00	-	-	32,720	279,420.83	261,760.00	-
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项停牌	11.40	-	-	5,700	72,415.00	64,980.00	-
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大事项停牌	13.79	2018-01-15	15.17	3,186	58,620.36	43,934.94	-
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项停牌	10.83	-	-	11,099	140,714.46	120,202.17	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项停牌	12.89	-	-	3,853	51,014.29	49,665.17	-
000592	平潭发展	2017-08-09	重大事项停牌	5.75	2018-01-29	5.70	44,678	255,525.49	256,898.50	-
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	2018-03-21	11.88	700	12,897.87	8,750.00	-
000766	通化金马	2017-11-24	重大事项停牌	13.60	-	-	1,902	32,882.58	25,867.20	-
000806	银河生物	2017-07-18	重大事项停牌	10.76	2018-01-18	10.01	19,825	226,776.32	213,317.00	-
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项停牌	10.89	2018-01-10	11.98	7,547	91,757.17	82,186.83	-
000930	中粮生化	2017-10-24	重大事项停牌	13.34	-	-	10,687	131,421.69	142,564.58	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大事项停牌	4.99	-	-	7,460	41,642.62	37,225.40	-
000979	中弘股份	2017-09-07	重大事项停牌	1.94	2018-02-14	1.75	59,460	110,436.01	115,352.40	-
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项停牌	6.73	2018-03-14	7.30	6,937	55,893.92	46,686.01	-
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项停牌	8.49	-	-	7,169	70,088.01	60,864.81	-
002168	深圳惠程	2017-12-19	重大事项停牌	13.76	-	-	1,346	14,466.45	18,520.96	-

002344	海宁皮城	2017-11-01	重大事项 停牌	7.93	2018-01-31	7.44	5,724	54,388.51	45,391.32	-
002345	潮宏基	2017-12-20	重大事项 停牌	10.75	-	-	4,502	49,134.32	48,396.50	-
002358	森源电气	2017-12-07	重大事项 停牌	14.86	2018-03-07	15.05	1,811	33,734.99	26,911.46	-
002366	台海核电	2017-12-06	重大事项 停牌	26.45	-	-	2,462	58,512.32	65,119.90	-
002512	达华智能	2017-12-06	重大事项 停牌	18.07	2018-03-06	16.26	2,579	39,324.88	46,602.53	-
002745	木林森	2017-12-28	重大事项 停牌	45.50	2018-01-05	46.50	2,100	97,914.00	95,550.00	-
300010	立思辰	2017-11-17	重大事项 停牌	11.17	2018-02-22	10.05	2,053	29,856.82	22,932.01	-
300032	金龙机电	2017-11-27	重大事项 停牌	13.89	-	-	1,568	21,553.31	21,779.52	-
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大事项 停牌	7.62	-	-	9,687	83,302.81	73,814.94	-
300134	大富科技	2017-12-18	重大事项 停牌	16.45	2018-03-19	14.81	3,826	71,529.36	62,937.70	-
300156	神雾环保	2017-07-17	重大事项 停牌	24.16	2018-01-17	21.74	18,326	593,780.18	442,756.16	-
300159	新研股份	2017-11-23	重大事项 停牌	10.40	2018-03-22	9.36	3,570	52,555.31	37,128.00	-
300383	光环新网	2017-11-07	重大事项 停牌	13.19	2018-03-19	14.51	9,662	121,950.01	127,441.78	-
600187	国中水务	2017-11-09	重大事项 停牌	4.68	2018-03-20	4.21	6,255	35,515.30	29,273.40	-
600525	长园集团	2017-12-25	重大事项 停牌	15.79	2018-01-10	17.30	13,151	201,366.04	207,654.29	-
600614	鹏起科技	2017-12-26	重大事项 停牌	10.16	-	-	10,607	122,836.47	107,767.12	-
600645	中源协和	2017-10-09	重大事项 停牌	28.40	2018-01-19	25.56	3,674	79,752.98	104,341.60	-
600664	哈药股份	2017-09-28	重大事项 停牌	5.81	2018-02-27	6.00	18,087	132,559.01	105,085.47	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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 12 月 31 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%)。

7.4.13.2.1 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12月31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。

7.4.13.2.2 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12月31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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	967,040.64	-	-	-	967,040.64
结算备付金	103,377.59	-	-	-	103,377.59
存出保证金	50,251.40	-	-	-	50,251.40
交易性金融资产	-	-	-	42,259,807.49	42,259,807.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,753.65	1,753.65
应收利息	-	-	-	270.14	270.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,120,669.63	-	-	42,261,831.28	43,382,500.91
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	-	-	-	13,310.72	13,310.72
应付托管费	-	-	-	2,662.14	2,662.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	581.69	581.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	-	-	-	256,554.55	256,554.55
利率敏感度缺口	1,120,669.63	-	-	42,005,276.73	43,125,946.36
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2016 年 12 月 31 日					
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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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币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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	42,259,807.49	97.99	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	42,259,807.49	97.99	6,900,709.25	95.70

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,097,549.72	342,941.31

	2.业绩比较基准下降 5%	-2,097,549.72	-342,941.31
--	---------------	---------------	-------------

7.4.14 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 12 月 31 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 38,929,443.67 元，属于第二层次的余额为 3,330,363.82 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 12 月 31 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[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、国家税务总局颁布的财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	42,259,807.49	97.41
	其中：股票	42,259,807.49	97.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,070,418.23	2.47
8	其他各项资产	52,275.19	0.12
9	合计	43,382,500.91	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	870,036.66	2.02
B	采矿业	1,175,763.63	2.73
C	制造业	25,039,152.52	58.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,248,133.87	2.89
E	建筑业	954,704.05	2.21
F	批发和零售业	2,295,479.89	5.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,358,068.80	3.15
H	住宿和餐饮业	51,502.55	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,450,381.87	8.00
J	金融业	782,892.35	1.82
K	房地产业	2,694,629.40	6.25
L	租赁和商务服务业	709,926.99	1.65
M	科学研究和技术服务业	104,341.60	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	467,379.54	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	51,774.10	0.12
Q	卫生和社会工作	78,725.46	0.18
R	文化、体育和娱乐业	554,979.41	1.29
S	综合	371,934.80	0.86
	合计	42,259,807.49	97.99

8.3 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	300156	神雾环保	18,326	442,756.16	1.03
2	600516	方大炭素	10,681	308,467.28	0.72
3	600201	生物股份	9,003	285,755.22	0.66
4	600176	中国巨石	17,485	284,830.65	0.66
5	002405	四维图新	10,265	270,893.35	0.63

6	000661	长春高新	1,442	263,886.00	0.61
7	000031	中粮地产	32,720	261,760.00	0.61
8	000592	平潭发展	44,678	256,898.50	0.60
9	002422	科伦药业	8,635	215,011.50	0.50
10	000806	银河生物	19,825	213,317.00	0.49
11	002271	东方雨虹	5,275	210,789.00	0.49
12	002001	新和成	5,471	208,226.26	0.48
13	600525	长园集团	13,151	207,654.29	0.48
14	600584	长电科技	9,535	203,381.55	0.47
15	000786	北新建材	8,946	201,285.00	0.47
16	000998	隆平高科	7,555	194,314.60	0.45
17	002340	格林美	26,548	190,880.12	0.44
18	300274	阳光电源	10,100	189,577.00	0.44
19	600438	通威股份	15,500	187,705.00	0.44
20	600521	华海药业	6,220	187,346.40	0.43
21	603019	中科曙光	4,558	183,413.92	0.43
22	600426	华鲁恒升	11,269	179,402.48	0.42
23	002049	紫光国芯	3,700	177,563.00	0.41
24	600315	上海家化	4,692	173,087.88	0.40
25	000039	中集集团	7,567	172,905.95	0.40
26	002092	中泰化学	12,882	171,459.42	0.40
27	600079	人福医药	9,502	169,515.68	0.39
28	300266	兴源环境	6,272	169,344.00	0.39
29	000050	深天马 A	8,356	164,696.76	0.38
30	000830	鲁西化工	10,222	162,734.24	0.38
31	600298	安琪酵母	4,973	162,716.56	0.38
32	002583	海能达	8,706	161,148.06	0.37
33	600642	申能股份	27,172	159,227.92	0.37
34	600256	广汇能源	31,200	157,872.00	0.37
35	002179	中航光电	3,999	157,480.62	0.37
36	002050	三花智控	8,512	156,110.08	0.36
37	601168	西部矿业	19,000	155,800.00	0.36
38	000009	中国宝安	21,400	154,722.00	0.36
39	600291	西水股份	6,577	154,691.04	0.36
40	000418	小天鹅 A	2,267	153,815.95	0.36
41	002384	东山精密	5,398	153,627.08	0.36
42	002410	广联达	7,815	153,174.00	0.36
43	600392	盛和资源	8,058	153,102.00	0.36
44	000977	浪潮信息	7,700	153,076.00	0.35
45	600004	白云机场	10,300	151,410.00	0.35
46	000513	丽珠集团	2,254	149,778.30	0.35
47	000488	晨鸣纸业	8,924	148,763.08	0.34
48	600879	航天电子	18,912	148,270.08	0.34
49	002311	海大集团	6,316	147,794.40	0.34

50	600388	龙净环保	8,533	147,620.90	0.34
51	002573	清新环境	6,438	146,335.74	0.34
52	601233	桐昆股份	6,492	146,005.08	0.34
53	300055	万邦达	6,912	145,359.36	0.34
54	002078	太阳纸业	15,479	143,645.12	0.33
55	300088	长信科技	18,340	143,602.20	0.33
56	000930	中粮生化	10,687	142,564.58	0.33
57	603589	口子窖	3,065	141,143.25	0.33
58	600022	山东钢铁	65,306	139,754.84	0.32
59	600499	科达洁能	12,588	139,600.92	0.32
60	600600	青岛啤酒	3,538	139,149.54	0.32
61	000690	宝新能源	17,333	138,664.00	0.32
62	600872	中炬高新	5,552	137,467.52	0.32
63	601699	潞安环能	11,939	135,865.82	0.32
64	600811	东方集团	29,607	135,600.06	0.31
65	600875	东方电气	12,000	134,760.00	0.31
66	000887	中鼎股份	7,400	134,458.00	0.31
67	002019	亿帆医药	6,043	134,456.75	0.31
68	600056	中国医药	5,336	132,813.04	0.31
69	002176	江特电机	11,726	132,738.32	0.31
70	600885	宏发股份	3,200	132,384.00	0.31
71	002407	多氟多	6,462	131,954.04	0.31
72	000656	金科股份	26,545	131,397.75	0.30
73	600166	福田汽车	46,470	130,580.70	0.30
74	002517	恺英网络	5,768	128,107.28	0.30
75	000066	中国长城	17,554	127,968.66	0.30
76	600839	四川长虹	36,721	127,789.08	0.30
77	000997	新大陆	7,123	127,715.39	0.30
78	600718	东软集团	8,700	127,542.00	0.30
79	300383	光环新网	9,662	127,441.78	0.30
80	002038	双鹭药业	4,115	127,441.55	0.30
81	600643	爱建集团	11,473	127,120.84	0.29
82	600183	生益科技	7,302	126,032.52	0.29
83	600755	厦门国贸	12,444	125,684.40	0.29
84	600418	江淮汽车	13,222	125,080.12	0.29
85	002439	启明星辰	5,355	125,039.25	0.29
86	002273	水晶光电	5,299	125,003.41	0.29
87	600260	凯乐科技	4,280	124,590.80	0.29
88	600325	华发股份	16,914	124,487.04	0.29
89	002359	北讯集团	5,500	124,025.00	0.29
90	600266	北京城建	9,397	123,476.58	0.29
91	002244	滨江集团	15,522	123,399.90	0.29
92	000970	中科三环	8,540	122,805.20	0.28
93	600808	马钢股份	29,685	122,599.05	0.28

94	000581	威孚高科	5,051	121,224.00	0.28
95	600138	中青旅	5,799	121,025.13	0.28
96	600787	中储股份	10,967	120,637.00	0.28
97	000547	航天发展	11,099	120,202.17	0.28
98	000878	云南铜业	8,463	120,089.97	0.28
99	002223	鱼跃医疗	6,028	118,148.80	0.27
100	600060	海信电器	7,800	117,156.00	0.27
101	002670	国盛金控	5,997	116,641.65	0.27
102	600673	东阳光科	17,170	115,897.50	0.27
103	000979	中弘股份	59,460	115,352.40	0.27
104	600460	士兰微	7,461	115,123.23	0.27
105	002195	二三四五	19,700	115,048.00	0.27
106	002285	世联行	10,200	113,730.00	0.26
107	000825	太钢不锈	22,644	112,314.24	0.26
108	600160	巨化股份	10,564	112,295.32	0.26
109	002408	齐翔腾达	8,823	111,875.64	0.26
110	600094	大名城	15,907	111,189.93	0.26
111	000006	深振业 A	11,239	110,704.15	0.26
112	002640	跨境通	5,781	110,648.34	0.26
113	600435	北方导航	8,971	110,612.43	0.26
114	300197	铁汉生态	9,100	110,565.00	0.26
115	000960	锡业股份	8,364	110,404.80	0.26
116	300146	汤臣倍健	7,336	110,186.72	0.26
117	300182	捷成股份	12,700	109,347.00	0.25
118	600978	宜华生活	11,881	108,592.34	0.25
119	600062	华润双鹤	4,383	108,479.25	0.25
120	600884	杉杉股份	5,582	108,179.16	0.25
121	300115	长盈精密	5,384	108,056.88	0.25
122	000999	华润三九	3,967	107,902.40	0.25
123	600655	豫园股份	10,041	107,840.34	0.25
124	600614	鹏起科技	10,607	107,767.12	0.25
125	601000	唐山港	22,704	106,935.84	0.25
126	000981	银亿股份	12,100	106,843.00	0.25
127	600143	金发科技	16,261	106,834.77	0.25
128	600179	安通控股	4,300	106,425.00	0.25
129	000807	云铝股份	10,400	106,392.00	0.25
130	000703	恒逸石化	4,919	106,102.83	0.25
131	600282	南钢股份	21,903	106,010.52	0.25
132	600664	哈药股份	18,087	105,085.47	0.24
133	600346	恒力股份	8,500	104,805.00	0.24
134	600503	华丽家族	15,992	104,747.60	0.24
135	600645	中源协和	3,674	104,341.60	0.24
136	002183	怡亚通	14,800	104,340.00	0.24
137	002013	中航机电	9,648	104,101.92	0.24

138	600970	中材国际	10,516	104,003.24	0.24
139	000778	新兴铸管	19,897	103,862.34	0.24
140	601231	环旭电子	6,570	103,608.90	0.24
141	002051	中工国际	5,555	102,378.65	0.24
142	002589	瑞康医药	7,565	101,749.25	0.24
143	002048	宁波华翔	4,252	101,197.60	0.23
144	002221	东华能源	8,232	100,512.72	0.23
145	000732	泰禾集团	5,013	100,360.26	0.23
146	000988	华工科技	6,018	99,778.44	0.23
147	002127	南极电商	8,169	99,580.11	0.23
148	600125	铁龙物流	9,178	99,305.96	0.23
149	600409	三友化工	10,273	98,518.07	0.23
150	600240	华业资本	11,345	97,340.10	0.23
151	000598	兴蓉环境	17,898	97,186.14	0.23
152	002373	千方科技	6,614	96,895.10	0.22
153	002268	卫士通	4,189	96,430.78	0.22
154	002745	木林森	2,100	95,550.00	0.22
155	002030	达安基因	5,135	95,408.30	0.22
156	002491	通鼎互联	7,565	95,319.00	0.22
157	000028	国药一致	1,582	95,315.50	0.22
158	600161	天坛生物	3,287	94,632.73	0.22
159	000729	燕京啤酒	14,034	94,589.16	0.22
160	600566	济川药业	2,473	94,344.95	0.22
161	002281	光迅科技	3,195	93,933.00	0.22
162	000078	海王生物	15,829	93,391.10	0.22
163	600597	光明乳业	6,164	93,384.60	0.22
164	600410	华胜天成	8,822	92,807.44	0.22
165	300166	东方国信	7,375	92,556.25	0.21
166	002400	省广股份	17,328	92,358.24	0.21
167	600635	大众公用	19,299	92,249.22	0.21
168	002440	闰土股份	4,659	91,735.71	0.21
169	600037	歌华有线	7,000	90,930.00	0.21
170	000685	中山公用	8,838	90,589.50	0.21
171	002152	广电运通	12,100	90,024.00	0.21
172	600122	宏图高科	9,208	89,225.52	0.21
173	600307	酒钢宏兴	31,141	89,063.26	0.21
174	000089	深圳机场	10,222	88,931.40	0.21
175	000012	南玻 A	10,519	88,885.55	0.21
176	600572	康恩贝	12,490	88,304.30	0.20
177	600500	中化国际	10,430	88,237.80	0.20
178	600717	天津港	8,410	88,220.90	0.20
179	600348	阳泉煤业	11,946	88,161.48	0.20
180	002056	横店东磁	8,227	88,028.90	0.20
181	600380	健康元	7,860	87,953.40	0.20

182	600267	海正药业	5,808	87,933.12	0.20
183	600171	上海贝岭	5,403	87,906.81	0.20
184	601200	上海环境	3,500	87,290.00	0.20
185	002431	棕榈股份	10,373	87,133.20	0.20
186	002131	利欧股份	33,465	87,009.00	0.20
187	000975	银泰资源	6,459	86,292.24	0.20
188	600511	国药股份	3,101	86,207.80	0.20
189	601880	大连港	30,838	86,038.02	0.20
190	300324	旋极信息	5,879	86,009.77	0.20
191	600863	内蒙华电	28,894	85,815.18	0.20
192	000636	风华高科	7,202	85,559.76	0.20
193	600881	亚泰集团	16,185	85,456.80	0.20
194	300058	蓝色光标	15,397	84,991.44	0.20
195	002028	思源电气	5,360	84,956.00	0.20
196	002506	协鑫集成	19,800	84,546.00	0.20
197	002665	首航节能	12,671	84,388.86	0.20
198	300002	神州泰岳	13,715	83,935.80	0.19
199	600120	浙江东方	3,409	83,895.49	0.19
200	002280	联络互动	10,900	83,494.00	0.19
201	002477	雏鹰农牧	18,781	83,387.64	0.19
202	600026	中远海能	13,620	83,354.40	0.19
203	002249	大洋电机	11,833	82,476.01	0.19
204	002191	劲嘉股份	8,912	82,436.00	0.19
205	600416	湘电股份	6,596	82,384.04	0.19
206	000926	福星股份	7,547	82,186.83	0.19
207	600967	内蒙一机	6,775	81,638.75	0.19
208	000596	古井贡酒	1,241	81,496.47	0.19
209	600737	中粮糖业	10,200	81,090.00	0.19
210	002354	天神娱乐	4,728	80,848.80	0.19
211	000400	许继电气	6,091	80,340.29	0.19
212	600633	浙数文化	5,266	80,043.20	0.19
213	600936	广西广电	11,658	79,973.88	0.19
214	600835	上海机电	3,253	79,698.50	0.18
215	600466	蓝光发展	8,493	79,409.55	0.18
216	002371	北方华创	1,914	79,316.16	0.18
217	002709	天赐材料	1,724	79,286.76	0.18
218	002635	安洁科技	3,024	78,896.16	0.18
219	300244	迪安诊断	3,333	78,725.46	0.18
220	600751	天海投资	12,880	78,696.80	0.18
221	600216	浙江医药	5,852	78,650.88	0.18
222	600575	皖江物流	19,400	78,570.00	0.18
223	000612	焦作万方	8,352	78,508.80	0.18
224	603369	今世缘	5,028	77,984.28	0.18
225	000667	美好置业	25,526	77,599.04	0.18

226	600064	南京高科	5,462	77,505.78	0.18
227	002505	大康农业	27,284	77,486.56	0.18
228	000860	顺鑫农业	4,029	77,397.09	0.18
229	300133	华策影视	7,100	76,964.00	0.18
230	300199	翰宇药业	4,724	76,906.72	0.18
231	300026	红日药业	17,995	76,658.70	0.18
232	600598	北大荒	7,100	76,538.00	0.18
233	300113	顺网科技	4,177	76,397.33	0.18
234	000758	中色股份	11,836	76,105.48	0.18
235	600151	航天机电	10,018	76,036.62	0.18
236	002353	杰瑞股份	5,784	75,886.08	0.18
237	002603	以岭药业	4,874	75,839.44	0.18
238	600478	科力远	10,267	75,770.46	0.18
239	000712	锦龙股份	4,451	75,577.98	0.18
240	300253	卫宁健康	11,157	74,863.47	0.17
241	300287	飞利信	10,041	74,403.81	0.17
242	600823	世茂股份	15,000	74,100.00	0.17
243	603766	隆鑫通用	10,552	74,075.04	0.17
244	002444	巨星科技	5,343	73,893.69	0.17
245	300116	坚瑞沃能	9,687	73,814.94	0.17
246	002701	奥瑞金	11,763	73,518.75	0.17
247	002807	江阴银行	8,878	73,509.84	0.17
248	600039	四川路桥	18,001	73,264.07	0.17
249	002128	露天煤业	6,566	72,751.28	0.17
250	600908	无锡银行	9,200	72,404.00	0.17
251	002390	信邦制药	8,540	72,163.00	0.17
252	000027	深圳能源	11,894	72,077.64	0.17
253	002299	圣农发展	5,000	72,000.00	0.17
254	600086	东方金钰	6,746	71,844.90	0.17
255	600563	法拉电子	1,409	71,591.29	0.17
256	000021	深科技	7,351	71,525.23	0.17
257	600017	日照港	18,372	71,283.36	0.17
258	002147	新光圆成	5,502	71,195.88	0.17
259	002002	鸿达兴业	10,315	70,554.60	0.16
260	600648	外高桥	3,800	70,300.00	0.16
261	603077	和邦生物	35,122	70,244.00	0.16
262	300376	易事特	9,267	70,151.19	0.16
263	002155	湖南黄金	7,170	69,549.00	0.16
264	600158	中体产业	6,745	69,338.60	0.16
265	000681	视觉中国	3,553	69,283.50	0.16
266	600848	上海临港	3,098	69,085.40	0.16
267	300001	特锐德	5,046	69,079.74	0.16
268	600801	华新水泥	4,866	68,756.58	0.16
269	002032	苏泊尔	1,700	68,646.00	0.16

270	600366	宁波韵升	3,913	68,555.76	0.16
271	002266	浙富控股	15,731	68,115.23	0.16
272	601678	滨化股份	8,352	67,818.24	0.16
273	600312	平高电气	6,766	67,592.34	0.16
274	002672	东江环保	4,149	67,421.25	0.16
275	000528	柳工	7,888	67,284.64	0.16
276	002308	威创股份	5,496	67,051.20	0.16
277	000762	西藏矿业	4,205	66,018.50	0.15
278	600317	营口港	19,300	65,427.00	0.15
279	000718	苏宁环球	15,100	65,383.00	0.15
280	000563	陕国投 A	15,372	65,331.00	0.15
281	002366	台海核电	2,462	65,119.90	0.15
282	000877	天山股份	6,261	65,114.40	0.15
283	000156	华数传媒	5,700	64,980.00	0.15
284	002489	浙江永强	10,807	64,950.07	0.15
285	002368	太极股份	2,541	64,465.17	0.15
286	002018	华信国际	9,108	64,393.56	0.15
287	600594	益佰制药	6,300	64,386.00	0.15
288	000727	华东科技	27,004	64,269.52	0.15
289	600393	粤泰股份	10,100	64,034.00	0.15
290	600859	王府井	3,131	63,872.40	0.15
291	600108	亚盛集团	15,531	63,832.41	0.15
292	600651	飞乐音响	6,920	63,318.00	0.15
293	002428	云南锗业	5,237	63,210.59	0.15
294	300134	大富科技	3,826	62,937.70	0.15
295	600729	重庆百货	2,508	62,850.48	0.15
296	600270	外运发展	3,634	62,795.52	0.15
297	002463	沪电股份	11,712	62,424.96	0.14
298	600694	大商股份	1,847	62,299.31	0.14
299	002251	步步高	3,450	62,272.50	0.14
300	600545	卓郎智能	5,658	62,124.84	0.14
301	600169	太原重工	17,906	61,954.76	0.14
302	600993	马应龙	3,025	61,952.00	0.14
303	601928	凤凰传媒	7,632	61,895.52	0.14
304	600611	大众交通	12,426	61,881.48	0.14
305	000937	冀中能源	10,579	61,569.78	0.14
306	600259	广晟有色	1,564	61,449.56	0.14
307	000501	鄂武商 A	3,838	61,254.48	0.14
308	600316	洪都航空	4,309	61,015.44	0.14
309	002122	天马股份	7,169	60,864.81	0.14
310	603000	人民网	5,585	60,485.55	0.14
311	002375	亚厦股份	8,033	60,408.16	0.14
312	000090	天健集团	5,988	60,119.52	0.14
313	002663	普邦股份	10,769	59,767.95	0.14

314	600770	综艺股份	7,808	59,340.80	0.14
315	600141	兴发集团	3,508	59,285.20	0.14
316	000587	金洲慈航	8,450	59,150.00	0.14
317	601717	郑煤机	8,947	58,871.26	0.14
318	002250	联化科技	5,541	58,845.42	0.14
319	600557	康缘药业	4,352	58,664.96	0.14
320	002277	友阿股份	9,939	58,341.93	0.14
321	603883	老百姓	925	58,265.75	0.14
322	600565	迪马股份	14,512	58,048.00	0.13
323	600098	广州发展	8,129	57,472.03	0.13
324	600582	天地科技	12,346	57,408.90	0.13
325	002106	莱宝高科	5,644	57,399.48	0.13
326	603188	亚邦股份	3,455	57,318.45	0.13
327	002064	华峰氨纶	11,673	57,197.70	0.13
328	601311	骆驼股份	4,297	56,935.25	0.13
329	600874	创业环保	4,370	56,853.70	0.13
330	002437	誉衡药业	8,246	56,814.94	0.13
331	002434	万里扬	5,400	56,700.00	0.13
332	002233	塔牌集团	4,743	56,489.13	0.13
333	600338	西藏珠峰	1,356	56,477.40	0.13
334	600765	中航重机	4,683	56,289.66	0.13
335	300297	蓝盾股份	5,892	56,209.68	0.13
336	000848	承德露露	5,895	55,766.70	0.13
337	000600	建投能源	7,217	55,643.07	0.13
338	002022	科华生物	4,085	55,596.85	0.13
339	000519	中兵红箭	5,636	55,514.60	0.13
340	000426	兴业矿业	5,608	55,126.64	0.13
341	601689	拓普集团	2,214	54,774.36	0.13
342	000969	安泰科技	6,145	54,629.05	0.13
343	601016	节能风电	16,583	54,558.07	0.13
344	002657	中科金财	2,386	54,448.52	0.13
345	600587	新华医疗	3,242	54,433.18	0.13
346	000541	佛山照明	5,911	54,381.20	0.13
347	000543	皖能电力	10,752	53,975.04	0.13
348	600073	上海梅林	6,597	53,567.64	0.12
349	002276	万马股份	6,206	53,495.72	0.12
350	002242	九阳股份	3,146	53,387.62	0.12
351	002123	梦网集团	5,153	53,333.55	0.12
352	600155	宝硕股份	5,200	53,196.00	0.12
353	000158	常山北明	6,655	52,840.70	0.12
354	600687	刚泰控股	4,472	52,814.32	0.12
355	000572	海马汽车	11,522	52,770.76	0.12
356	600058	五矿发展	4,356	52,620.48	0.12
357	600971	恒源煤电	5,041	52,577.63	0.12

358	600277	亿利洁能	8,163	52,569.72	0.12
359	002690	美亚光电	2,724	52,491.48	0.12
360	603515	欧普照明	1,223	52,393.32	0.12
361	002332	仙琚制药	6,404	52,320.68	0.12
362	002073	软控股份	6,529	52,232.00	0.12
363	002317	众生药业	4,116	52,190.88	0.12
364	000062	深圳华强	2,221	52,171.29	0.12
365	600289	ST 信通	5,233	52,016.02	0.12
366	002503	搜于特	9,380	51,965.20	0.12
367	600580	卧龙电气	6,480	51,904.80	0.12
368	000049	德赛电池	1,309	51,823.31	0.12
369	603816	顾家家居	878	51,775.66	0.12
370	603377	东方时尚	1,295	51,774.10	0.12
371	000061	农产品	6,754	51,735.64	0.12
372	002063	远光软件	4,854	51,598.02	0.12
373	600284	浦东建设	5,540	51,522.00	0.12
374	600754	锦江股份	1,595	51,502.55	0.12
375	002261	拓维信息	6,650	51,471.00	0.12
376	601002	晋亿实业	4,791	51,407.43	0.12
377	600300	维维股份	11,726	51,242.62	0.12
378	600773	西藏城投	4,362	50,948.16	0.12
379	600422	昆药集团	5,558	50,855.70	0.12
380	002699	美盛文化	2,807	50,834.77	0.12
381	601001	大同煤业	8,391	50,765.55	0.12
382	600869	智慧能源	8,825	50,655.50	0.12
383	000669	金鸿控股	3,454	50,601.10	0.12
384	000829	天音控股	5,326	50,597.00	0.12
385	000680	山推股份	9,929	50,538.61	0.12
386	002681	奋达科技	4,482	50,019.12	0.12
387	002642	荣之联	3,815	50,014.65	0.12
388	600578	京能电力	13,500	49,950.00	0.12
389	300202	聚龙股份	2,770	49,721.50	0.12
390	002254	泰和新材	4,270	49,702.80	0.12
391	002482	广田集团	6,196	49,691.92	0.12
392	000566	海南海药	3,853	49,665.17	0.12
393	300273	和佳股份	5,405	48,969.30	0.11
394	600536	中国软件	2,951	48,839.05	0.11
395	002544	杰赛科技	3,095	48,684.35	0.11
396	002345	潮宏基	4,502	48,396.50	0.11
397	600458	时代新材	4,802	48,356.14	0.11
398	300257	开山股份	3,454	48,356.00	0.11
399	600759	洲际油气	11,278	48,044.28	0.11
400	600428	中远海特	8,552	47,976.72	0.11
401	600750	江中药业	1,879	47,876.92	0.11

402	600623	华谊集团	5,600	47,768.00	0.11
403	300039	上海凯宝	7,456	47,420.16	0.11
404	601777	力帆股份	6,512	47,277.12	0.11
405	002479	富春环保	4,846	47,054.66	0.11
406	600335	国机汽车	4,176	46,938.24	0.11
407	300291	华录百纳	4,130	46,875.50	0.11
408	600006	东风汽车	8,006	46,835.10	0.11
409	000777	中核科技	3,137	46,741.30	0.11
410	002004	华邦健康	6,937	46,686.01	0.11
411	002512	达华智能	2,579	46,602.53	0.11
412	603444	吉比特	251	46,166.43	0.11
413	603658	安图生物	865	46,035.30	0.11
414	002005	德豪润达	10,523	45,880.28	0.11
415	002041	登海种业	3,547	45,578.95	0.11
416	002707	众信旅游	4,176	45,476.64	0.11
417	002344	海宁皮城	5,724	45,391.32	0.11
418	000652	泰达股份	10,272	45,299.52	0.11
419	600395	盘江股份	6,593	45,293.91	0.11
420	600059	古越龙山	4,822	45,278.58	0.10
421	600280	中央商场	5,728	45,079.36	0.10
422	002011	盾安环境	5,467	43,954.68	0.10
423	000401	冀东水泥	3,186	43,934.94	0.10
424	603328	依顿电子	3,053	43,810.55	0.10
425	600517	置信电气	6,753	43,691.91	0.10
426	000897	津滨发展	12,880	43,534.40	0.10
427	603198	迎驾贡酒	2,472	43,482.48	0.10
428	600329	中新药业	2,922	43,450.14	0.10
429	600639	浦东金桥	2,563	43,442.85	0.10
430	600195	中牧股份	2,196	43,283.16	0.10
431	603868	飞科电器	571	43,253.25	0.10
432	001696	宗申动力	6,828	43,152.96	0.10
433	000990	诚志股份	2,500	43,150.00	0.10
434	603556	海兴电力	1,182	43,024.80	0.10
435	600657	信达地产	7,643	42,647.94	0.10
436	600757	长江传媒	6,068	42,172.60	0.10
437	300147	香雪制药	4,653	41,737.41	0.10
438	002269	美邦服饰	12,526	41,210.54	0.10
439	600880	博瑞传播	7,697	40,563.19	0.09
440	600862	中航高科	4,178	40,443.04	0.09
441	002342	巨力索具	6,727	40,294.73	0.09
442	600894	广日股份	4,299	40,195.65	0.09
443	000552	靖远煤电	11,396	40,113.92	0.09
444	600628	新世界	3,939	40,059.63	0.09
445	603355	莱克电气	798	39,325.44	0.09

446	002588	史丹利	5,812	38,882.28	0.09
447	000099	中信海直	4,310	38,876.20	0.09
448	000662	天夏智慧	2,600	38,662.00	0.09
449	603888	新华网	1,633	38,620.45	0.09
450	600184	光电股份	2,099	38,453.68	0.09
451	002093	国脉科技	4,050	38,434.50	0.09
452	002118	紫鑫药业	5,097	38,329.44	0.09
453	300043	星辉娱乐	6,262	38,323.44	0.09
454	601127	小康股份	1,900	38,209.00	0.09
455	002190	成飞集成	1,760	38,086.40	0.09
456	000939	凯迪生态	7,460	37,225.40	0.09
457	300159	新研股份	3,570	37,128.00	0.09
458	000816	智慧农业	11,281	36,212.01	0.08
459	002392	北京利尔	7,100	35,784.00	0.08
460	002325	洪涛股份	7,474	35,650.98	0.08
461	600640	号百控股	2,427	35,482.74	0.08
462	600748	上实发展	5,503	35,274.23	0.08
463	600292	远达环保	3,918	35,066.10	0.08
464	600776	东方通信	4,774	34,516.02	0.08
465	600743	华远地产	9,335	34,166.10	0.08
466	002414	高德红外	1,949	32,762.69	0.08
467	600481	双良节能	8,063	32,332.63	0.07
468	600053	九鼎投资	1,337	31,940.93	0.07
469	002551	尚荣医疗	3,373	30,896.68	0.07
470	600996	贵广网络	3,110	30,789.00	0.07
471	601020	华钰矿业	1,467	30,102.84	0.07
472	002416	爱施德	3,140	29,735.80	0.07
473	603568	伟明环保	1,394	29,343.70	0.07
474	600187	国中水务	6,255	29,273.40	0.07
475	603225	新凤鸣	800	28,640.00	0.07
476	000761	本钢板材	5,444	28,308.80	0.07
477	600826	兰生股份	2,137	28,144.29	0.07
478	000536	华映科技	5,563	27,481.22	0.06
479	603806	福斯特	805	27,450.50	0.06
480	603228	景旺电子	508	27,315.16	0.06
481	002358	森源电气	1,811	26,911.46	0.06
482	600126	杭钢股份	3,893	26,744.91	0.06
483	000987	越秀金控	2,700	26,595.00	0.06
484	603169	兰石重装	3,131	26,269.09	0.06
485	000766	通化金马	1,902	25,867.20	0.06
486	600618	氯碱化工	2,247	24,335.01	0.06
487	603001	奥康国际	1,595	23,079.65	0.05
488	300010	立思辰	2,053	22,932.01	0.05
489	000025	特力 A	577	22,220.27	0.05

490	603528	多伦科技	2,489	21,977.87	0.05
491	300032	金龙机电	1,568	21,779.52	0.05
492	601811	新华文轩	1,591	21,367.13	0.05
493	600917	重庆燃气	1,770	19,717.80	0.05
494	601969	海南矿业	2,200	19,470.00	0.05
495	002168	深圳惠程	1,346	18,520.96	0.04
496	002815	崇达技术	578	18,241.68	0.04
497	601128	常熟银行	2,500	17,825.00	0.04
498	603877	太平鸟	588	15,940.68	0.04
499	603569	长久物流	635	15,360.65	0.04
500	603025	大豪科技	515	15,151.30	0.04
501	600939	重庆建工	2,000	14,840.00	0.03
502	002818	富森美	468	14,185.08	0.03
503	000693	*ST 华泽	700	8,750.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000661	长春高新	3,475,683.30	48.20
2	002092	中泰化学	3,456,072.00	47.93
3	000050	深天马 A	3,196,204.00	44.33
4	600166	福田汽车	3,186,922.09	44.20
5	002273	水晶光电	3,078,699.00	42.70
6	002491	通鼎互联	3,056,495.13	42.39
7	600161	天坛生物	3,052,787.20	42.34
8	002078	太阳纸业	3,032,091.00	42.05
9	600516	方大炭素	3,032,031.00	42.05
10	300244	迪安诊断	3,014,086.96	41.80
11	002244	滨江集团	3,011,999.32	41.77
12	000078	海王生物	2,997,500.96	41.57
13	600699	均胜电子	2,961,649.20	41.07
14	601699	潞安环能	2,936,520.44	40.73
15	600664	哈药股份	2,921,995.93	40.52
16	600307	酒钢宏兴	2,919,603.00	40.49
17	600094	大名城	2,910,568.16	40.37
18	000528	柳工	2,857,734.00	39.63
19	000959	首钢股份	2,841,033.60	39.40
20	300273	和佳股份	2,840,707.00	39.40
21	002589	瑞康医药	2,837,542.00	39.35

22	600282	南钢股份	2,835,907.82	39.33
23	002431	棕榈股份	2,829,827.00	39.25
24	600536	中国软件	2,828,448.70	39.23
25	600200	江苏吴中	2,816,635.00	39.06
26	600267	海正药业	2,800,409.04	38.84
27	002106	莱宝高科	2,776,680.00	38.51
28	600300	维维股份	2,776,127.04	38.50
29	601233	桐昆股份	2,758,474.50	38.26
30	000090	天健集团	2,757,693.89	38.25
31	300043	星辉娱乐	2,748,861.89	38.12
32	000062	深圳华强	2,745,550.24	38.08
33	603198	迎驾贡酒	2,697,614.26	37.41
34	603883	老百姓	2,672,756.28	37.07
35	600628	新世界	2,668,772.00	37.01
36	600220	江苏阳光	2,664,984.39	36.96
37	002498	汉缆股份	2,664,960.00	36.96
38	000861	海印股份	2,634,637.53	36.54
39	600687	刚泰控股	2,586,203.00	35.87
40	600864	哈投股份	2,521,896.81	34.98
41	000761	本钢板材	2,516,551.54	34.90
42	002670	国盛金控	2,407,054.47	33.38
43	002665	首航节能	2,372,115.00	32.90
44	600270	外运发展	2,327,011.36	32.27
45	000961	中南建设	2,250,070.00	31.21
46	600872	中炬高新	2,156,135.00	29.90
47	002408	齐翔腾达	2,016,819.00	27.97
48	601717	郑煤机	1,991,180.51	27.61
49	002512	达华智能	1,943,525.56	26.95
50	002118	紫鑫药业	1,942,456.86	26.94
51	600291	西水股份	1,859,274.78	25.79
52	600428	中远海特	1,796,741.00	24.92
53	002315	焦点科技	1,786,659.00	24.78
54	600098	广州发展	1,668,050.88	23.13
55	000417	合肥百货	1,606,869.17	22.29
56	002572	索菲亚	1,571,034.00	21.79
57	002503	搜于特	1,514,374.00	21.00
58	300287	飞利信	1,443,030.86	20.01
59	000400	许继电气	1,348,608.28	18.70
60	002460	赣锋锂业	1,337,594.06	18.55
61	300136	信维通信	1,327,293.22	18.41
62	000690	宝新能源	1,298,789.00	18.01
63	002018	华信国际	1,266,033.66	17.56
64	600180	瑞茂通	1,226,596.00	17.01
65	600825	新华传媒	1,188,622.22	16.48

66	300257	开山股份	1,184,811.00	16.43
67	600201	生物股份	1,136,567.20	15.76
68	600879	航天电子	1,102,948.00	15.30
69	300156	神雾环保	1,097,363.00	15.22
70	600487	亨通光电	1,095,464.00	15.19
71	002405	四维图新	1,089,665.95	15.11
72	002064	华峰氨纶	1,078,342.00	14.96
73	000066	中国长城	1,038,869.82	14.41
74	600525	长园集团	1,037,593.00	14.39
75	600468	百利电气	1,016,431.00	14.10
76	601012	隆基股份	988,641.00	13.71
77	002271	东方雨虹	972,507.95	13.49
78	600079	人福医药	970,058.00	13.45
79	600584	长电科技	969,718.00	13.45
80	600176	中国巨石	955,690.00	13.25
81	000656	金科股份	942,482.00	13.07
82	600219	南山铝业	921,650.00	12.78
83	002340	格林美	916,592.00	12.71
84	600522	中天科技	890,336.75	12.35
85	002422	科伦药业	889,018.38	12.33
86	000998	隆平高科	883,501.11	12.25
87	600315	上海家化	857,305.99	11.89
88	300115	长盈精密	854,637.72	11.85
89	002508	老板电器	854,579.90	11.85
90	600642	申能股份	842,506.26	11.68
91	002573	清新环境	842,310.21	11.68
92	000786	北新建材	836,036.00	11.59
93	600266	北京城建	831,698.82	11.53
94	300113	顺网科技	820,699.57	11.38
95	300296	利亚德	817,182.00	11.33
96	600643	爱建集团	765,155.00	10.61
97	601168	西部矿业	751,100.00	10.42
98	600521	华海药业	750,908.98	10.41
99	600325	华发股份	744,709.00	10.33
100	002249	大洋电机	743,236.04	10.31
101	600435	北方导航	741,311.00	10.28
102	002407	多氟多	739,133.90	10.25
103	000547	航天发展	730,687.35	10.13
104	600436	片仔癀	723,963.00	10.04
105	600022	山东钢铁	716,368.00	9.94
106	002311	海大集团	715,952.62	9.93
107	600528	中铁工业	713,834.00	9.90
108	002371	北方华创	713,690.00	9.90
109	600056	中国医药	712,815.10	9.89

110	002410	广联达	711,847.00	9.87
111	601000	唐山港	711,724.80	9.87
112	000970	中科三环	709,287.00	9.84
113	300055	万邦达	708,706.00	9.83
114	000997	新大陆	707,735.96	9.82
115	000401	冀东水泥	704,099.00	9.76
116	000028	国药一致	692,002.00	9.60
117	000778	新兴铸管	688,653.00	9.55
118	000581	威孚高科	685,653.00	9.51
119	000999	华润三九	675,925.49	9.37
120	002176	江特电机	672,518.00	9.33
121	600426	华鲁恒升	669,809.00	9.29
122	000930	中粮生化	668,558.36	9.27
123	002038	双鹭药业	665,627.00	9.23
124	600978	宜华生活	661,003.00	9.17
125	600138	中青旅	658,712.00	9.14
126	002050	三花智控	658,707.00	9.14
127	000039	中集集团	657,174.82	9.11
128	300026	红日药业	656,267.00	9.10
129	002179	中航光电	654,174.24	9.07
130	000418	小天鹅 A	648,811.81	9.00
131	002439	启明星辰	646,244.32	8.96
132	600388	龙净环保	644,675.00	8.94
133	000878	云南铜业	643,637.00	8.93
134	600839	四川长虹	642,799.00	8.91
135	000598	兴蓉环境	639,113.00	8.86
136	600682	南京新百	638,463.25	8.85
137	002004	华邦健康	636,081.07	8.82
138	600614	鹏起科技	634,919.00	8.81
139	002223	鱼跃医疗	634,324.00	8.80
140	002701	奥瑞金	633,628.01	8.79
141	600600	青岛啤酒	631,465.00	8.76
142	603019	中科曙光	629,731.00	8.73
143	300266	兴源环境	628,618.00	8.72
144	002384	东山精密	625,819.00	8.68
145	600717	天津港	620,389.00	8.60
146	600240	华业资本	619,527.00	8.59
147	000488	晨鸣纸业	619,139.00	8.59
148	002001	新和成	617,339.45	8.56
149	000825	太钢不锈	615,924.00	8.54
150	002030	达安基因	615,298.18	8.53
151	603799	华友钴业	613,729.00	8.51
152	600635	大众公用	610,671.00	8.47
153	600122	宏图高科	609,754.00	8.46

154	002217	合力泰	609,382.34	8.45
155	002366	台海核电	609,285.00	8.45
156	002051	中工国际	607,598.00	8.43
157	300159	新研股份	606,231.50	8.41
158	300324	旋极信息	604,064.00	8.38
159	603589	口子窖	601,283.00	8.34
160	600500	中化国际	599,304.00	8.31
161	600503	华丽家族	596,577.00	8.27
162	600418	江淮汽车	594,958.00	8.25
163	601010	文峰股份	591,401.00	8.20
164	600298	安琪酵母	588,235.00	8.16
165	600755	厦门国贸	585,573.00	8.12
166	002019	亿帆医药	584,618.00	8.11
167	000012	南玻 A	579,511.69	8.04
168	600594	益佰制药	578,366.00	8.02
169	002354	天神娱乐	576,332.56	7.99
170	002583	海能达	575,601.00	7.98
171	600811	东方集团	575,245.00	7.98
172	600160	巨化股份	574,623.00	7.97
173	300253	卫宁健康	569,048.00	7.89
174	000089	深圳机场	565,911.00	7.85
175	600801	华新水泥	564,404.00	7.83
176	600881	亚泰集团	563,130.00	7.81
177	000960	锡业股份	562,475.00	7.80
178	300002	神州泰岳	560,313.00	7.77
179	300202	聚龙股份	554,768.07	7.69
180	000988	华工科技	551,075.00	7.64
181	600967	内蒙一机	550,506.00	7.63
182	600158	中体产业	550,321.96	7.63
183	600511	国药股份	549,784.00	7.62
184	000877	天山股份	548,685.00	7.61
185	600787	中储股份	542,131.00	7.52
186	002477	雏鹰农牧	542,045.00	7.52
187	000566	海南海药	541,651.00	7.51
188	000975	银泰资源	540,833.00	7.50
189	000667	美好置业	540,566.00	7.50
190	000758	中色股份	539,614.00	7.48
191	600808	马钢股份	539,340.00	7.48
192	002221	东华能源	535,577.00	7.43
193	600970	中材国际	534,875.00	7.42
194	002191	劲嘉股份	534,588.00	7.41
195	600260	凯乐科技	533,643.00	7.40
196	000926	福星股份	532,628.00	7.39
197	002048	宁波华翔	531,940.38	7.38

198	000513	丽珠集团	529,906.00	7.35
199	600863	内蒙华电	528,682.00	7.33
200	000600	建投能源	527,928.00	7.32
201	600312	平高电气	527,674.00	7.32
202	300058	蓝色光标	526,101.29	7.30
203	600392	盛和资源	521,611.00	7.23
204	002353	杰瑞股份	520,530.80	7.22
205	002373	千方科技	519,070.30	7.20
206	600633	浙数文化	515,799.00	7.15
207	000685	中山公用	511,270.00	7.09
208	600499	科达洁能	511,167.00	7.09
209	002602	世纪华通	510,527.50	7.08
210	601880	大连港	508,851.00	7.06
211	002266	浙富控股	506,392.52	7.02
212	002013	中航机电	503,013.68	6.98
213	600884	杉杉股份	501,912.00	6.96
214	600026	中远海能	498,163.00	6.91
215	300088	长信科技	493,074.00	6.84
216	600198	大唐电信	492,816.00	6.83
217	600751	天海投资	492,674.00	6.83
218	600416	湘电股份	492,021.00	6.82
219	300383	光环新网	489,357.00	6.79
220	002028	思源电气	489,080.82	6.78
221	000563	陕国投 A	484,320.91	6.72
222	600409	三友化工	483,205.00	6.70
223	002127	南极电商	482,810.00	6.70
224	002672	东江环保	479,255.00	6.65
225	600565	迪马股份	477,817.00	6.63
226	000939	凯迪生态	476,895.00	6.61
227	600478	科力远	476,846.38	6.61
228	000727	华东科技	476,467.00	6.61
229	002375	亚厦股份	476,438.24	6.61
230	600125	铁龙物流	474,222.00	6.58
231	600064	南京高科	472,776.00	6.56
232	002002	鸿达兴业	472,269.18	6.55
233	002268	卫士通	471,332.98	6.54
234	002400	省广股份	470,875.00	6.53
235	002595	豪迈科技	469,544.00	6.51
236	600183	生益科技	469,482.19	6.51
237	000729	燕京啤酒	468,743.00	6.50
238	600062	华润双鹤	468,402.00	6.50
239	300122	智飞生物	466,892.38	6.48
240	600566	济川药业	465,524.00	6.46
241	002022	科华生物	464,543.00	6.44

242	300274	阳光电源	463,491.00	6.43
243	002444	巨星科技	462,650.00	6.42
244	000592	平潭发展	462,499.00	6.41
245	600120	浙江东方	461,867.00	6.41
246	600039	四川路桥	460,897.00	6.39
247	600572	康恩贝	460,074.00	6.38
248	600410	华胜天成	458,409.80	6.36
249	002635	安洁科技	458,166.00	6.35
250	002640	跨境通	458,162.50	6.35
251	002390	信邦制药	456,425.00	6.33
252	002261	拓维信息	456,204.55	6.33
253	000612	焦作万方	453,574.00	6.29
254	002603	以岭药业	453,339.00	6.29
255	600143	金发科技	451,582.00	6.26
256	000031	中粮地产	450,432.00	6.25
257	603766	隆鑫通用	450,058.43	6.24
258	000860	顺鑫农业	449,424.00	6.23
259	002489	浙江永强	449,090.00	6.23
260	300166	东方国信	448,726.98	6.22
261	600316	洪都航空	446,626.00	6.19
262	000830	鲁西化工	444,609.00	6.17
263	002285	世联行	441,526.00	6.12
264	600348	阳泉煤业	441,367.52	6.12
265	300146	汤臣倍健	439,552.00	6.10
266	603568	伟明环保	437,919.00	6.07
267	000519	中兵红箭	436,746.84	6.06
268	600497	驰宏锌锗	435,852.00	6.04
269	002517	恺英网络	434,629.00	6.03
270	300001	特锐德	434,495.00	6.03
271	600575	皖江物流	433,520.45	6.01
272	601231	环旭电子	427,950.50	5.94
273	600597	光明乳业	426,159.00	5.91
274	600017	日照港	425,689.00	5.90
275	600759	洲际油气	424,957.00	5.89
276	000937	冀中能源	423,131.00	5.87
277	002250	联化科技	422,115.00	5.85
278	002155	湖南黄金	421,584.00	5.85
279	002308	威创股份	419,676.00	5.82
280	002342	巨力索具	419,275.00	5.81
281	002601	龙麟佰利	418,179.50	5.80
282	600809	山西汾酒	416,982.00	5.78
283	002281	光迅科技	416,223.04	5.77
284	300199	翰宇药业	413,682.00	5.74
285	601929	吉视传媒	411,789.00	5.71

286	000897	津滨发展	411,749.00	5.71
287	002440	闰土股份	411,537.03	5.71
288	000703	恒逸石化	411,147.00	5.70
289	000732	泰禾集团	410,800.00	5.70
290	603077	和邦生物	406,436.00	5.64
291	000777	中核科技	406,089.77	5.63
292	600108	亚盛集团	405,998.00	5.63
293	600765	中航重机	402,937.00	5.59
294	000027	深圳能源	402,580.74	5.58
295	600380	健康元	401,141.43	5.56
296	002657	中科金财	400,038.00	5.55
297	600611	大众交通	399,847.00	5.55
298	600169	太原重工	398,773.00	5.53
299	000006	深振业 A	397,329.00	5.51
300	600466	蓝光发展	396,461.00	5.50
301	000697	炼石有色	395,529.48	5.49
302	000979	中弘股份	395,456.00	5.48
303	000543	皖能电力	394,922.00	5.48
304	000816	智慧农业	394,858.00	5.48
305	600835	上海机电	393,843.00	5.46
306	002437	誉衡药业	393,462.00	5.46
307	000652	泰达股份	392,974.00	5.45
308	002276	万马股份	390,088.98	5.41
309	600694	大商股份	382,463.50	5.30
310	000848	承德露露	381,105.40	5.29
311	000572	海马汽车	377,161.00	5.23
312	600601	方正科技	374,054.00	5.19
313	600545	卓郎智能	373,920.00	5.19
314	002368	太极股份	371,376.00	5.15
315	601689	拓普集团	369,293.00	5.12
316	600086	东方金钰	368,982.00	5.12
317	600187	国中水务	368,590.89	5.11
318	300116	坚瑞沃能	368,490.00	5.11
319	000021	深科技	367,856.00	5.10
320	603000	人民网	366,207.00	5.08
321	601928	凤凰传媒	365,493.00	5.07
322	600993	马应龙	364,793.23	5.06
323	002544	杰赛科技	364,731.00	5.06
324	603444	吉比特	364,374.00	5.05
325	600366	宁波韵升	363,555.00	5.04
326	000158	常山北明	362,081.00	5.02
327	600216	浙江医药	362,066.00	5.02
328	600557	康缘药业	361,599.00	5.01
329	002317	众生药业	360,666.60	5.00

330	000680	山推股份	359,314.00	4.98
331	000762	西藏矿业	357,128.00	4.95
332	600171	上海贝岭	356,054.00	4.94
333	000501	鄂武商 A	355,726.40	4.93
334	000810	创维数字	354,626.00	4.92
335	000049	德赛电池	354,388.00	4.91
336	600750	江中药业	354,160.81	4.91
337	000541	佛山照明	352,904.00	4.89
338	000596	古井贡酒	352,346.00	4.89
339	601311	骆驼股份	352,065.00	4.88
340	600651	飞乐音响	351,628.00	4.88
341	600422	昆药集团	347,754.00	4.82
342	600770	综艺股份	346,171.48	4.80
343	600582	天地科技	346,028.00	4.80
344	002707	众信旅游	345,250.00	4.79
345	000636	风华高科	344,933.00	4.78
346	600284	浦东建设	344,080.00	4.77
347	002396	星网锐捷	343,847.00	4.77
348	002428	云南锗业	342,642.00	4.75
349	002123	梦网集团	342,013.47	4.74
350	600151	航天机电	341,360.00	4.73
351	002056	横店东磁	340,691.00	4.72
352	600458	时代新材	340,333.00	4.72
353	600073	上海梅林	340,303.00	4.72
354	002463	沪电股份	340,074.00	4.72
355	600587	新华医疗	339,580.00	4.71
356	002073	软控股份	338,896.00	4.70
357	002468	申通快递	338,798.00	4.70
358	600563	法拉电子	338,600.00	4.70
359	603188	亚邦股份	336,742.00	4.67
360	000587	金洲慈航	336,689.00	4.67
361	600848	上海临港	336,184.24	4.66
362	000712	锦龙股份	336,122.95	4.66
363	601016	节能风电	335,992.00	4.66
364	002482	广田集团	331,747.00	4.60
365	000829	天音控股	331,322.87	4.59
366	002479	富春环保	330,836.00	4.59
367	600729	重庆百货	330,575.00	4.58
368	002242	九阳股份	328,986.00	4.56
369	600851	海欣股份	328,520.00	4.56
370	601678	滨化股份	327,530.00	4.54
371	600517	置信电气	324,409.00	4.50
372	002277	友阿股份	322,236.00	4.47
373	001696	宗申动力	322,016.00	4.47

374	600058	五矿发展	321,950.50	4.47
375	600874	创业环保	321,693.00	4.46
376	600823	世茂股份	321,134.90	4.45
377	002663	普邦股份	319,812.32	4.44
378	600259	广晟有色	319,140.00	4.43
379	000620	新华联	318,885.81	4.42
380	600639	浦东金桥	317,807.00	4.41
381	000806	银河生物	314,877.00	4.37
382	002709	天赐材料	313,940.98	4.35
383	000726	鲁泰 A	313,776.92	4.35
384	002269	美邦服饰	313,772.00	4.35
385	300010	立思辰	312,577.00	4.34
386	000969	安泰科技	309,600.00	4.29
387	002005	德豪润达	309,018.00	4.29
388	600894	广日股份	307,835.00	4.27
389	002325	洪涛股份	307,609.00	4.27
390	000616	海航投资	306,245.00	4.25
391	002332	仙琚制药	305,399.00	4.24
392	002063	远光软件	304,769.00	4.23
393	600053	九鼎投资	304,092.00	4.22
394	002681	奋达科技	303,713.00	4.21
395	000061	农产品	300,978.18	4.17
396	300297	蓝盾股份	300,086.20	4.16
397	002011	盾安环境	299,382.21	4.15
398	002254	泰和新材	299,232.00	4.15
399	600067	冠城大通	298,563.00	4.14
400	000766	通化金马	297,352.00	4.12
401	000552	靖远煤电	297,154.98	4.12
402	600880	博瑞传播	296,091.00	4.11
403	300147	香雪制药	295,213.00	4.09
404	000669	金鸿控股	292,889.00	4.06
405	002128	露天煤业	292,310.40	4.05
406	002690	美亚光电	292,000.26	4.05
407	002399	海普瑞	291,462.41	4.04
408	000681	视觉中国	289,433.68	4.01
409	603369	今世缘	288,243.00	4.00
410	300376	易事特	287,339.00	3.98
411	600329	中新药业	287,186.00	3.98
412	600645	中源协和	283,665.00	3.93
413	002581	未名医药	280,058.00	3.88
414	601777	力帆股份	279,455.00	3.88
415	000426	兴业矿业	278,871.00	3.87
416	600648	外高桥	278,331.00	3.86
417	600869	智慧能源	278,135.00	3.86

418	600580	卧龙电气	277,355.00	3.85
419	600736	苏州高新	276,250.00	3.83
420	600773	西藏城投	275,180.00	3.82
421	600006	东风汽车	273,716.00	3.80
422	002727	一心堂	272,163.00	3.77
423	600496	精工钢构	272,054.00	3.77
424	601002	晋亿实业	271,061.00	3.76
425	002122	天马股份	271,015.00	3.76
426	002358	森源电气	270,868.00	3.76
427	002344	海宁皮城	270,498.00	3.75
428	300039	上海凯宝	270,459.00	3.75
429	600175	美都能源	269,095.00	3.73
430	002190	成飞集成	269,059.47	3.73
431	002233	塔牌集团	268,384.00	3.72
432	603888	新华网	268,311.50	3.72
433	600805	悦达投资	267,522.37	3.71
434	603556	海兴电力	266,406.00	3.69
435	600826	兰生股份	266,349.00	3.69
436	600720	祁连山	266,269.00	3.69
437	600537	亿晶光电	264,799.00	3.67
438	600059	古越龙山	263,178.00	3.65
439	002041	登海种业	262,967.00	3.65
440	600280	中央商场	261,796.00	3.63
441	600338	西藏珠峰	260,353.61	3.61
442	002588	史丹利	259,965.00	3.61
443	600757	长江传媒	259,490.00	3.60
444	600141	兴发集团	256,335.99	3.56
445	601886	江河集团	254,910.00	3.54
446	601001	大同煤业	254,700.00	3.53
447	600862	中航高科	253,488.00	3.52
448	002345	潮宏基	252,939.00	3.51
449	600395	盘江股份	252,402.00	3.50
450	600586	金晶科技	248,999.00	3.45
451	000973	佛塑科技	248,840.00	3.45
452	603355	莱克电气	245,438.00	3.40
453	002147	新光圆成	244,409.00	3.39
454	002161	远望谷	243,660.00	3.38
455	600790	轻纺城	239,848.00	3.33
456	600195	中牧股份	238,829.00	3.31
457	600859	王府井	238,637.00	3.31
458	600743	华远地产	238,256.00	3.30
459	600460	士兰微	237,843.34	3.30
460	603377	东方时尚	236,575.00	3.28
461	600292	远达环保	235,017.00	3.26

462	600596	新安股份	234,392.00	3.25
463	603816	顾家家居	233,317.48	3.24
464	600335	国机汽车	232,872.00	3.23
465	600640	号百控股	230,288.00	3.19
466	600748	上实发展	229,672.00	3.19
467	002642	荣之联	225,635.00	3.13
468	600184	光电股份	222,018.60	3.08
469	601801	皖新传媒	220,819.00	3.06
470	600754	锦江股份	220,256.00	3.05
471	300032	金龙机电	218,965.74	3.04
472	002699	美盛文化	215,856.00	2.99
473	000869	张裕 A	215,847.00	2.99
474	600481	双良节能	213,841.00	2.97
475	600971	恒源煤电	213,031.00	2.95
476	603528	多伦科技	212,879.00	2.95
477	000099	中信海直	210,570.89	2.92
478	600289	ST 信通	207,355.37	2.88
479	002414	高德红外	207,148.00	2.87
480	600433	冠豪高新	206,580.00	2.86
481	002093	国脉科技	205,095.00	2.84
482	002309	中利集团	203,789.00	2.83
483	600831	广电网络	202,713.00	2.81
484	002551	尚荣医疗	200,750.00	2.78
485	000931	中关村	199,663.85	2.77
486	002745	木林森	199,176.00	2.76
487	002120	韵达股份	196,508.00	2.73
488	002251	步步高	193,874.00	2.69
489	600850	华东电脑	192,841.60	2.67
490	603328	依顿电子	192,676.00	2.67
491	002029	七匹狼	192,623.00	2.67
492	002392	北京利尔	192,082.00	2.66
493	002327	富安娜	190,934.00	2.65
494	600776	东方通信	190,878.00	2.65
495	600112	*ST 天成	190,809.00	2.65
496	600936	广西广电	190,406.00	2.64
497	603806	福斯特	189,662.00	2.63
498	600996	贵广网络	189,033.00	2.62
499	600351	亚宝药业	188,730.00	2.62
500	002416	爱施德	188,713.00	2.62
501	002049	紫光国芯	185,893.00	2.58
502	002807	江阴银行	180,847.00	2.51
503	600251	冠农股份	176,138.00	2.44
504	603169	兰石重装	174,586.00	2.42
505	000517	荣安地产	174,563.00	2.42

506	603005	晶方科技	174,178.00	2.42
507	603001	奥康国际	173,708.66	2.41
508	600438	通威股份	172,236.22	2.39
509	002646	青青稞酒	168,361.00	2.33
510	603698	航天工程	165,518.00	2.30
511	002698	博实股份	161,256.05	2.24
512	600256	广汇能源	157,457.00	2.18
513	000009	中国宝安	157,099.00	2.18
514	000536	华映科技	156,265.00	2.17
515	000919	金陵药业	154,577.00	2.14
516	601908	京运通	150,735.86	2.09
517	600425	*ST 青松	150,112.00	2.08
518	600657	信达地产	147,206.00	2.04
519	000631	顺发恒业	147,088.00	2.04
520	600004	白云机场	147,037.00	2.04
521	000977	浪潮信息	146,891.00	2.04
522	603567	珍宝岛	146,841.00	2.04
523	603868	飞科电器	146,155.00	2.03
524	603515	欧普照明	146,044.00	2.03

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。

8.4.2 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	600516	方大炭素	3,609,691.73	50.06
2	000661	长春高新	3,425,693.86	47.51
3	002092	中泰化学	3,271,888.11	45.38
4	600161	天坛生物	3,271,006.04	45.36
5	000050	深天马 A	3,034,103.26	42.08
6	600166	福田汽车	2,943,440.12	40.82
7	002244	滨江集团	2,938,797.89	40.76
8	002078	太阳纸业	2,918,967.56	40.48
9	000090	天健集团	2,884,945.40	40.01
10	600699	均胜电子	2,850,226.83	39.53
11	002273	水晶光电	2,812,092.87	39.00
12	002491	通鼎互联	2,808,261.31	38.95
13	000078	海王生物	2,793,615.33	38.74
14	300244	迪安诊断	2,756,999.55	38.24
15	600094	大名城	2,746,462.74	38.09
16	603198	迎驾贡酒	2,729,622.90	37.86

17	600267	海正药业	2,720,972.11	37.74
18	002589	瑞康医药	2,718,794.70	37.71
19	600282	南钢股份	2,711,296.24	37.60
20	002431	棕榈股份	2,687,898.52	37.28
21	600200	江苏吴中	2,661,067.05	36.91
22	601699	潞安环能	2,610,289.10	36.20
23	600628	新世界	2,604,265.64	36.12
24	000062	深圳华强	2,596,805.67	36.01
25	002498	汉缆股份	2,588,657.95	35.90
26	600307	酒钢宏兴	2,577,950.81	35.75
27	000528	柳 工	2,562,990.93	35.55
28	600536	中国软件	2,556,942.69	35.46
29	603883	老百姓	2,544,716.84	35.29
30	600220	江苏阳光	2,526,070.60	35.03
31	600687	刚泰控股	2,514,266.03	34.87
32	000861	海印股份	2,500,056.63	34.67
33	000959	首钢股份	2,490,898.62	34.55
34	300043	星辉娱乐	2,479,041.27	34.38
35	300273	和佳股份	2,431,625.78	33.72
36	002106	莱宝高科	2,429,290.91	33.69
37	601233	桐昆股份	2,426,313.02	33.65
38	600864	哈投股份	2,375,324.31	32.94
39	600300	维维股份	2,326,777.19	32.27
40	600872	中炬高新	2,319,668.83	32.17
41	002670	国盛金控	2,276,300.82	31.57
42	000761	本钢板材	2,264,035.04	31.40
43	600664	哈药股份	2,221,446.66	30.81
44	002665	首航节能	2,157,925.67	29.93
45	600270	外运发展	2,149,594.05	29.81
46	000961	中南建设	2,098,791.25	29.11
47	002512	达华智能	1,957,096.53	27.14
48	600291	西水股份	1,954,190.73	27.10
49	002408	齐翔腾达	1,930,120.37	26.77
50	002460	赣锋锂业	1,895,024.62	26.28
51	002118	紫鑫药业	1,795,546.48	24.90
52	002572	索菲亚	1,760,343.89	24.41
53	601717	郑煤机	1,704,603.44	23.64
54	002315	焦点科技	1,663,523.39	23.07
55	300136	信维通信	1,610,580.85	22.34
56	600428	中远海特	1,608,158.06	22.30
57	000417	合肥百货	1,600,038.46	22.19
58	002503	搜于特	1,541,375.33	21.38
59	600098	广州发展	1,501,418.16	20.82
60	601012	隆基股份	1,382,055.82	19.17

61	600487	亨通光电	1,319,662.08	18.30
62	000400	许继电气	1,237,618.80	17.16
63	300287	飞利信	1,198,173.83	16.62
64	600180	瑞茂通	1,163,928.14	16.14
65	600825	新华传媒	1,111,567.03	15.42
66	002018	华信国际	1,068,452.97	14.82
67	002405	四维图新	1,059,983.81	14.70
68	300257	开山股份	1,033,403.87	14.33
69	000690	宝新能源	1,026,781.63	14.24
70	600219	南山铝业	1,024,660.33	14.21
71	002064	华峰氨纶	984,076.90	13.65
72	600525	长园集团	982,428.80	13.62
73	600879	航天电子	970,585.51	13.46
74	600201	生物股份	965,543.50	13.39
75	002271	东方雨虹	965,325.95	13.39
76	002508	老板电器	935,467.73	12.97
77	603799	华友钴业	913,623.14	12.67
78	600522	中天科技	911,524.13	12.64
79	600468	百利电气	876,416.03	12.15
80	002340	格林美	870,538.28	12.07
81	600176	中国巨石	825,280.51	11.45
82	000066	中国长城	822,761.71	11.41
83	600584	长电科技	812,348.32	11.27
84	300296	利亚德	808,215.58	11.21
85	600079	人福医药	794,146.21	11.01
86	002422	科伦药业	791,277.72	10.97
87	000998	隆平高科	781,528.20	10.84
88	600315	上海家化	780,138.21	10.82
89	300115	长盈精密	776,713.74	10.77
90	000786	北新建材	774,981.19	10.75
91	600436	片仔癀	744,369.79	10.32
92	000656	金科股份	717,499.19	9.95
93	601168	西部矿业	713,180.40	9.89
94	600682	南京新百	699,429.97	9.70
95	300113	顺网科技	674,857.94	9.36
96	002050	三花智控	673,610.93	9.34
97	600642	申能股份	673,474.51	9.34
98	000970	中科三环	671,341.30	9.31
99	002573	清新环境	670,946.53	9.31
100	600392	盛和资源	667,367.06	9.26
101	002217	合力泰	667,366.05	9.26
102	000997	新大陆	665,036.20	9.22
103	002311	海大集团	656,128.44	9.10
104	600022	山东钢铁	655,213.10	9.09

105	002176	江特电机	648,142.31	8.99
106	600528	中铁工业	640,537.53	8.88
107	600266	北京城建	636,772.31	8.83
108	002249	大洋电机	635,415.93	8.81
109	002410	广联达	634,732.27	8.80
110	600056	中国医药	624,744.14	8.66
111	000401	冀东水泥	624,271.93	8.66
112	600426	华鲁恒升	614,262.37	8.52
113	000999	华润三九	606,878.47	8.42
114	000488	晨鸣纸业	606,842.40	8.42
115	600260	凯乐科技	605,679.34	8.40
116	002366	台海核电	602,780.42	8.36
117	002407	多氟多	600,795.27	8.33
118	000581	威孚高科	599,975.30	8.32
119	600325	华发股份	599,316.28	8.31
120	002371	北方华创	599,288.71	8.31
121	002004	华邦健康	596,006.52	8.27
122	300055	万邦达	594,587.46	8.25
123	002179	中航光电	593,048.58	8.22
124	600435	北方导航	592,617.84	8.22
125	600521	华海药业	590,367.36	8.19
126	000028	国药一致	585,808.67	8.12
127	600809	山西汾酒	585,582.99	8.12
128	002038	双鹭药业	585,531.25	8.12
129	000878	云南铜业	583,651.68	8.09
130	603589	口子窖	583,472.07	8.09
131	601000	唐山港	583,199.20	8.09
132	600808	马钢股份	581,856.26	8.07
133	002384	东山精密	581,238.60	8.06
134	002439	启明星辰	576,745.50	8.00
135	002019	亿帆医药	576,583.54	8.00
136	300122	智飞生物	573,787.72	7.96
137	603019	中科曙光	573,697.96	7.96
138	000418	小天鹅 A	571,476.94	7.93
139	000039	中集集团	564,007.93	7.82
140	600755	厦门国贸	563,062.82	7.81
141	000825	太钢不锈	561,502.95	7.79
142	600978	宜华生活	557,490.13	7.73
143	601010	文峰股份	546,973.45	7.59
144	300266	兴源环境	546,316.22	7.58
145	000778	新兴铸管	544,270.37	7.55
146	600388	龙净环保	541,870.36	7.51
147	600138	中青旅	539,718.52	7.49
148	600839	四川长虹	539,110.38	7.48

149	600643	爱建集团	538,018.40	7.46
150	000598	兴蓉环境	534,550.37	7.41
151	000547	航天发展	533,375.27	7.40
152	300026	红日药业	531,274.03	7.37
153	002001	新 和 成	530,056.03	7.35
154	600801	华新水泥	529,504.04	7.34
155	002030	达安基因	529,229.68	7.34
156	600614	鹏起科技	528,019.17	7.32
157	300159	新研股份	526,498.67	7.30
158	002602	世纪华通	526,246.28	7.30
159	000930	中粮生化	526,212.27	7.30
160	600600	青岛啤酒	518,206.72	7.19
161	300156	神雾环保	517,801.95	7.18
162	000566	海南海药	515,347.94	7.15
163	000960	锡业股份	514,362.78	7.13
164	002701	奥瑞金	513,901.62	7.13
165	000988	华工科技	507,748.42	7.04
166	002223	鱼跃医疗	505,706.30	7.01
167	600503	华丽家族	504,075.77	6.99
168	600717	天津港	501,436.50	6.95
169	600500	中化国际	498,041.29	6.91
170	600884	杉杉股份	488,321.84	6.77
171	600499	科达洁能	488,195.81	6.77
172	300202	聚龙股份	484,680.10	6.72
173	600635	大众公用	483,216.61	6.70
174	600298	安琪酵母	482,048.59	6.69
175	600125	铁龙物流	481,639.00	6.68
176	000089	深圳机场	481,237.38	6.67
177	002354	天神娱乐	475,537.22	6.60
178	000600	建投能源	474,745.92	6.58
179	600240	华业资本	474,280.66	6.58
180	300088	长信科技	468,338.00	6.50
181	000012	南 玻 A	467,637.89	6.49
182	600160	巨化股份	461,929.60	6.41
183	000513	丽珠集团	459,661.56	6.37
184	600409	三友化工	459,506.93	6.37
185	002191	劲嘉股份	459,467.57	6.37
186	000758	中色股份	458,439.09	6.36
187	002601	龙麟佰利	458,224.43	6.35
188	300253	卫宁健康	458,163.23	6.35
189	600198	大唐电信	456,795.44	6.34
190	000975	银泰资源	456,614.28	6.33
191	600787	中储股份	455,330.35	6.31
192	600511	国药股份	455,063.69	6.31

193	600183	生益科技	453,826.66	6.29
194	300324	旋极信息	453,692.58	6.29
195	002583	海能达	453,145.11	6.28
196	600881	亚泰集团	448,890.07	6.23
197	000877	天山股份	448,853.11	6.22
198	002051	中工国际	448,279.23	6.22
199	000926	福星股份	447,651.38	6.21
200	000667	美好置业	447,448.78	6.21
201	600633	浙数文化	446,693.13	6.20
202	600122	宏图高科	446,040.30	6.19
203	000697	炼石有色	444,125.27	6.16
204	600062	华润双鹤	440,937.90	6.12
205	002373	千方科技	440,524.75	6.11
206	600158	中体产业	439,283.57	6.09
207	002477	雏鹰农牧	437,877.90	6.07
208	002595	豪迈科技	437,560.57	6.07
209	002635	安洁科技	437,356.85	6.07
210	601231	环旭电子	436,586.70	6.05
211	600497	驰宏锌锗	435,943.40	6.05
212	000830	鲁西化工	435,866.17	6.04
213	600418	江淮汽车	434,486.42	6.03
214	600967	内蒙一机	430,361.83	5.97
215	600811	东方集团	429,225.83	5.95
216	000685	中山公用	428,470.60	5.94
217	603568	伟明环保	427,092.26	5.92
218	600970	中材国际	426,381.68	5.91
219	002127	南极电商	423,548.80	5.87
220	002221	东华能源	423,484.26	5.87
221	601880	大连港	422,552.51	5.86
222	300002	神州泰岳	421,975.89	5.85
223	002048	宁波华翔	420,502.03	5.83
224	000939	凯迪生态	419,533.49	5.82
225	300166	东方国信	412,611.46	5.72
226	600594	益佰制药	412,495.54	5.72
227	600026	中远海能	411,909.71	5.71
228	600863	内蒙华电	410,810.49	5.70
229	002640	跨境通	410,641.12	5.70
230	300274	阳光电源	408,543.90	5.67
231	600348	阳泉煤业	404,956.54	5.62
232	000727	华东科技	404,847.20	5.61
233	000612	焦作万方	404,498.80	5.61
234	600572	康恩贝	404,489.07	5.61
235	002285	世联行	398,282.39	5.52
236	300146	汤臣倍健	396,705.80	5.50

237	002002	鸿达兴业	396,462.18	5.50
238	002028	思源电气	396,041.54	5.49
239	600478	科力远	395,983.07	5.49
240	002353	杰瑞股份	395,429.69	5.48
241	000563	陕国投 A	394,302.61	5.47
242	300058	蓝色光标	391,598.60	5.43
243	600312	平高电气	391,546.09	5.43
244	600120	浙江东方	390,316.24	5.41
245	002266	浙富控股	389,477.70	5.40
246	002013	中航机电	389,003.39	5.39
247	002444	巨星科技	387,645.50	5.38
248	300383	光环新网	384,230.96	5.33
249	600064	南京高科	382,940.89	5.31
250	600143	金发科技	381,970.83	5.30
251	002375	亚厦股份	380,706.87	5.28
252	002396	星网锐捷	379,407.96	5.26
253	002672	东江环保	378,680.19	5.25
254	002603	以岭药业	378,586.08	5.25
255	600751	天海投资	378,388.65	5.25
256	601929	吉视传媒	376,154.38	5.22
257	600017	日照港	375,318.74	5.21
258	600410	华胜天成	374,136.26	5.19
259	000860	顺鑫农业	373,116.35	5.17
260	002440	闰土股份	370,600.59	5.14
261	002261	拓维信息	370,398.61	5.14
262	002489	浙江永强	370,369.06	5.14
263	002022	科华生物	370,186.60	5.13
264	000703	恒逸石化	367,472.97	5.10
265	002281	光迅科技	367,411.22	5.10
266	600597	光明乳业	367,282.13	5.09
267	002268	卫士通	367,158.03	5.09
268	603766	隆鑫通用	366,998.92	5.09
269	000729	燕京啤酒	366,466.11	5.08
270	000937	冀中能源	365,652.08	5.07
271	601678	滨化股份	365,329.77	5.07
272	300001	特锐德	364,339.46	5.05
273	002342	巨力索具	363,316.30	5.04
274	600566	济川药业	363,158.29	5.04
275	600039	四川路桥	362,787.23	5.03
276	002390	信邦制药	362,746.12	5.03
277	600874	创业环保	361,499.43	5.01
278	002308	威创股份	359,875.74	4.99
279	000816	智慧农业	359,168.39	4.98
280	600601	方正科技	356,451.58	4.94

281	002468	申通快递	353,052.32	4.90
282	603077	和邦生物	352,621.74	4.89
283	600380	健康元	352,470.37	4.89
284	600565	迪马股份	350,309.47	4.86
285	002400	省广股份	349,964.91	4.85
286	002250	联化科技	347,493.17	4.82
287	300699	光威复材	347,363.28	4.82
288	600316	洪都航空	346,008.82	4.80
289	600466	蓝光发展	344,240.65	4.77
290	600416	湘电股份	342,138.85	4.74
291	000158	常山北明	340,745.27	4.73
292	600563	法拉电子	336,833.94	4.67
293	300199	翰宇药业	336,088.25	4.66
294	002155	湖南黄金	335,014.42	4.65
295	000021	深科技	332,984.66	4.62
296	000897	津滨发展	329,475.86	4.57
297	000732	泰禾集团	328,948.43	4.56
298	000810	创维数字	328,344.36	4.55
299	600366	宁波韵升	326,398.41	4.53
300	000543	皖能电力	322,043.28	4.47
301	002517	恺英网络	321,590.85	4.46
302	600582	天地科技	321,191.28	4.45
303	600108	亚盛集团	321,010.03	4.45
304	600169	太原重工	320,313.62	4.44
305	002437	誉衡药业	318,221.32	4.41
306	000006	深振业 A	317,224.04	4.40
307	600694	大商股份	316,427.20	4.39
308	000501	鄂武商 A	316,418.47	4.39
309	000979	中弘股份	316,311.15	4.39
310	002657	中科金财	316,142.21	4.38
311	600765	中航重机	315,736.55	4.38
312	002317	众生药业	315,163.40	4.37
313	600259	广晟有色	315,149.50	4.37
314	600611	大众交通	314,723.49	4.36
315	000027	深圳能源	314,432.26	4.36
316	603000	人民网	314,127.95	4.36
317	000652	泰达股份	313,622.54	4.35
318	600848	上海临港	311,415.55	4.32
319	600720	祁连山	310,354.65	4.30
320	000572	海马汽车	310,335.69	4.30
321	000519	中兵红箭	309,679.09	4.29
322	600496	精工钢构	308,556.27	4.28
323	000777	中核科技	307,767.44	4.27
324	000049	德赛电池	305,861.11	4.24

325	002368	太极股份	305,859.27	4.24
326	000596	古井贡酒	304,372.57	4.22
327	000680	山推股份	303,973.95	4.22
328	000848	承德露露	303,846.77	4.21
329	002544	杰赛科技	303,314.40	4.21
330	600835	上海机电	303,271.91	4.21
331	000620	新华联	301,821.04	4.19
332	600171	上海贝岭	301,681.49	4.18
333	002056	横店东磁	301,519.93	4.18
334	000587	金洲慈航	301,278.19	4.18
335	000726	鲁 泰 A	300,537.79	4.17
336	600086	东方金钰	298,621.00	4.14
337	000762	西藏矿业	296,091.49	4.11
338	000636	风华高科	295,808.71	4.10
339	600067	冠城大通	294,986.72	4.09
340	600187	国中水务	294,682.35	4.09
341	000712	锦龙股份	294,124.23	4.08
342	600993	马应龙	293,784.93	4.07
343	002428	云南锗业	292,583.83	4.06
344	600729	重庆百货	292,148.31	4.05
345	002482	广田集团	291,518.29	4.04
346	601689	拓普集团	289,865.03	4.02
347	601928	凤凰传媒	289,852.25	4.02
348	600575	皖江物流	289,693.97	4.02
349	000616	海航投资	289,623.55	4.02
350	600639	浦东金桥	288,670.02	4.00
351	603188	亚邦股份	288,063.80	4.00
352	002463	沪电股份	287,928.99	3.99
353	600651	飞乐音响	287,841.25	3.99
354	300116	坚瑞沃能	287,380.29	3.99
355	601311	骆驼股份	286,527.70	3.97
356	600073	上海梅林	284,421.78	3.94
357	000541	佛山照明	284,198.43	3.94
358	600759	洲际油气	283,365.44	3.93
359	002276	万马股份	283,207.57	3.93
360	000829	天音控股	281,796.08	3.91
361	002011	盾安环境	281,785.20	3.91
362	600557	康缘药业	280,655.75	3.89
363	600284	浦东建设	278,736.84	3.87
364	002727	一心堂	278,288.74	3.86
365	600422	昆药集团	278,255.17	3.86
366	002709	天赐材料	277,613.72	3.85
367	002707	众信旅游	277,341.27	3.85
368	002242	九阳股份	276,903.79	3.84

369	600596	新安股份	276,532.30	3.84
370	600545	卓郎智能	276,392.60	3.83
371	601016	节能风电	273,435.80	3.79
372	600216	浙江医药	273,090.56	3.79
373	600770	综艺股份	273,066.89	3.79
374	600151	航天机电	271,955.38	3.77
375	002073	软控股份	271,710.40	3.77
376	600587	新华医疗	271,027.59	3.76
377	600750	江中药业	270,642.29	3.75
378	000552	靖远煤电	267,573.98	3.71
379	600851	海欣股份	267,153.19	3.71
380	000669	金鸿控股	267,086.01	3.70
381	002332	仙琚制药	267,041.58	3.70
382	001696	宗申动力	265,985.28	3.69
383	000426	兴业矿业	265,971.61	3.69
384	600058	五矿发展	265,542.94	3.68
385	002277	友阿股份	263,881.28	3.66
386	002325	洪涛股份	262,910.82	3.65
387	002399	海普瑞	262,407.02	3.64
388	000969	安泰科技	262,225.95	3.64
389	002254	泰和新材	261,830.08	3.63
390	002479	富春环保	261,146.87	3.62
391	300010	立思辰	260,924.64	3.62
392	603369	今世缘	260,903.53	3.62
393	002123	梦网集团	259,956.60	3.61
394	600141	兴发集团	259,762.37	3.60
395	600736	苏州高新	259,193.28	3.59
396	002681	奋达科技	258,961.42	3.59
397	600338	西藏珠峰	258,772.08	3.59
398	002581	未名医药	257,623.60	3.57
399	600175	美都能源	255,662.90	3.55
400	002269	美邦服饰	255,364.31	3.54
401	600586	金晶科技	254,589.81	3.53
402	603444	吉比特	254,150.83	3.52
403	600805	悦达投资	253,915.69	3.52
404	002663	普邦股份	253,567.33	3.52
405	600458	时代新材	249,425.70	3.46
406	000973	佛塑科技	249,203.22	3.46
407	002063	远光软件	249,128.83	3.46
408	600790	轻纺城	247,605.73	3.43
409	601886	江河集团	246,536.67	3.42
410	002005	德豪润达	244,594.54	3.39
411	300147	香雪制药	244,525.78	3.39
412	300297	蓝盾股份	243,122.91	3.37

413	600645	中源协和	240,487.67	3.34
414	600517	置信电气	240,305.45	3.33
415	600823	世茂股份	238,240.44	3.30
416	000061	农产品	237,786.68	3.30
417	600971	恒源煤电	237,424.92	3.29
418	601777	力帆股份	236,270.62	3.28
419	002690	美亚光电	235,334.82	3.26
420	600053	九鼎投资	234,407.17	3.25
421	600894	广日股份	232,870.33	3.23
422	600329	中新药业	232,350.59	3.22
423	600395	盘江股份	230,075.65	3.19
424	000766	通化金马	229,607.67	3.18
425	601001	大同煤业	229,446.42	3.18
426	300376	易事特	227,906.61	3.16
427	600880	博瑞传播	223,900.66	3.11
428	600773	西藏城投	223,754.10	3.10
429	300032	金龙机电	222,519.92	3.09
430	002128	露天煤业	222,278.00	3.08
431	600580	卧龙电气	221,748.26	3.08
432	002233	塔牌集团	221,654.66	3.07
433	600006	东风汽车	221,508.08	3.07
434	300039	上海凯宝	220,963.53	3.06
435	000681	视觉中国	216,247.81	3.00
436	002309	中利集团	215,907.39	2.99
437	600859	王府井	215,756.71	2.99
438	600869	智慧能源	215,643.24	2.99
439	002041	登海种业	214,124.99	2.97
440	002120	韵达股份	213,322.40	2.96
441	002122	天马股份	213,147.00	2.96
442	600059	古越龙山	213,125.55	2.96
443	000869	张裕 A	212,750.09	2.95
444	002161	远望谷	212,418.70	2.95
445	002358	森源电气	211,700.33	2.94
446	600537	亿晶光电	211,047.29	2.93
447	600862	中航高科	210,750.60	2.92
448	600280	中央商场	209,271.87	2.90
449	601002	晋亿实业	208,509.13	2.89
450	601801	皖新传媒	208,161.16	2.89
451	600648	外高桥	208,063.00	2.89
452	002345	潮宏基	207,568.03	2.88
453	600640	号百控股	207,271.38	2.87
454	002190	成飞集成	206,985.21	2.87
455	600757	长江传媒	206,103.18	2.86
456	000592	平潭发展	201,797.96	2.80

457	600460	士兰微	200,714.90	2.78
458	002588	史丹利	200,328.28	2.78
459	002344	海宁皮城	200,188.49	2.78
460	603355	莱克电气	199,793.10	2.77
461	300676	华大基因	199,476.00	2.77
462	603556	海兴电力	197,651.32	2.74
463	603888	新华网	195,909.09	2.72
464	600850	华东电脑	194,648.17	2.70
465	002029	七匹狼	193,864.30	2.69
466	600292	远达环保	192,806.37	2.67
467	600195	中牧股份	191,554.94	2.66
468	000931	中关村	190,829.93	2.65
469	600251	冠农股份	190,785.20	2.65
470	600754	锦江股份	187,863.32	2.61
471	002327	富安娜	186,173.38	2.58
472	603816	顾家家居	185,001.93	2.57
473	600743	华远地产	184,632.83	2.56
474	600831	广电网络	184,123.43	2.55
475	002699	美盛文化	184,045.37	2.55
476	600433	冠豪高新	184,008.91	2.55
477	603377	东方时尚	181,952.04	2.52
478	002147	新光圆成	181,328.84	2.51
479	600748	上实发展	179,579.31	2.49
480	600335	国机汽车	179,058.97	2.48
481	600184	光电股份	177,783.27	2.47
482	000031	中粮地产	175,729.03	2.44
483	600826	兰生股份	175,341.30	2.43
484	600351	亚宝药业	174,462.41	2.42
485	603005	晶方科技	173,058.77	2.40
486	002392	北京利尔	173,018.18	2.40
487	002093	国脉科技	167,674.44	2.33
488	002646	青青稞酒	165,851.90	2.30
489	000517	荣安地产	165,650.79	2.30
490	000099	中信海直	165,598.57	2.30
491	600481	双良节能	164,405.03	2.28
492	002642	荣之联	162,874.00	2.26
493	002551	尚荣医疗	160,168.71	2.22
494	600289	ST 信通	159,912.40	2.22
495	600776	东方通信	158,747.30	2.20
496	002414	高德红外	157,743.90	2.19
497	002416	爱施德	155,258.71	2.15
498	002251	步步高	153,120.28	2.12
499	002698	博实股份	151,662.47	2.10
500	600996	贵广网络	150,719.72	2.09

501	603698	航天工程	149,661.02	2.08
502	603528	多伦科技	149,512.08	2.07
503	603169	兰石重装	147,125.60	2.04

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。

8.4.3 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	369,882,050.06
卖出股票收入（成交）总额	332,655,862.14

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金为指数型基金，神雾环保系标的指数原成份券，由于该股票在成份股调整期间停牌，截至报告期末仍无法正常调出组合以及本基金规模变动，使得该股票权重被动上升至持仓前十名，该股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除神雾环保外，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。

8.12.3 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	50,251.40
2	应收证券清算款	1,753.65
3	应收股利	-
4	应收利息	270.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,275.19

8.12.4 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。

8.12.5 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	300156	神雾环保	442,756.16	1.03	重大事项停牌
2	000031	中粮地产	261,760.00	0.61	重大事项停牌
3	000592	平潭发展	256,898.50	0.60	重大事项停牌
4	000806	银河生物	213,317.00	0.49	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 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
1,205	5,503.74	5,775,662.00	87.09%	856,343.00	12.91%

注：已包含场外持有人。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国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%
2	钱中明	117,300.00	10.70%
3	刘健	63,564.00	5.80%
4	陶成魂	62,400.00	5.69%
5	张琳	57,100.00	5.21%
6	上海申毅投资股份有限公司—申毅多策略量化套利 7 号	56,918.00	5.19%
7	何健斌	53,500.00	4.88%
8	吕爱平	44,900.00	4.09%
9	魏长明	35,500.00	3.24%
10	陈思	28,000.00	2.55%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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%

9.4 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

§ 10 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
本报告期期初基金份额总额	1,096,515.00
本报告期基金总申购份额	34,515,466.00

减：本报告期基金总赎回份额	28,979,976.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,632,005.00

注：期末基金总份额包含场外份额 5,535,490 份；总申购份额包含场外总申购份额 34,515,466 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 28,979,976 份。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 3 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 30,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	2,839,161.79	0.41%	1,419.64	48.45%	-
中信证券	2	3,021,364.71	0.43%	1,510.75	51.55%	-
国信证券	2	695,127,094.33	99.16%	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	22,881.50	45.94%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	26,921.45	54.06%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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
6	易方达基金管理有限公司关于直销中心收款银行账户信息的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-08-04
7	易方达基金管理有限公司关于易方达资产管理有限公司股权结构等事项变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-12-02

		理人网站	
8	易方达基金管理有限公司关于公司旗下证券投资基金执行增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-30

§ 12影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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08月21日	-	12,159,001.00	12,159,001.00	-	-
	3	2017年06月07日~2017年12月31日	-	7,111,300.00	4,661,974.00	2,449,326.00	36.93%
	4	2017年12月18日~2017年12月31日	-	1,543,082.00	-	1,543,082.00	23.27%
	5	2017年12月18日~2017年12月31日	-	1,543,082.00	-	1,543,082.00	23.27%
个人	1	2017年01月01日~2017年04月04日	295,000.00	-	295,000.00	-	-

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

二〇一八年三月三十日