

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金  
2018 年半年度报告  
2018 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	53

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	53
8.3	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 .....	54
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>54</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>54</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8	其他重大事件 .....	57
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1	备查文件目录 .....	58
12.2	存放地点 .....	58
12.3	查阅方式 .....	58

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 500ETF
场内简称	广发 500
基金主代码	510510
交易代码	510510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	1,513,038,319.00 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	2013 年 5 月 24 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证 500 指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	郭明
	联系电话	020-83936666	(010) 66105798
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	(010) 66105799

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-8,343,527.46
本期利润	-259,261,666.31
加权平均基金份额本期利润	-0.2350
本期加权平均净值利润率	-14.22%
本期基金份额净值增长率	-15.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	701,478,289.43
期末可供分配基金份额利润	0.4636
期末基金资产净值	2,214,516,608.43
期末基金份额净值	1.4636
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	46.36%

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

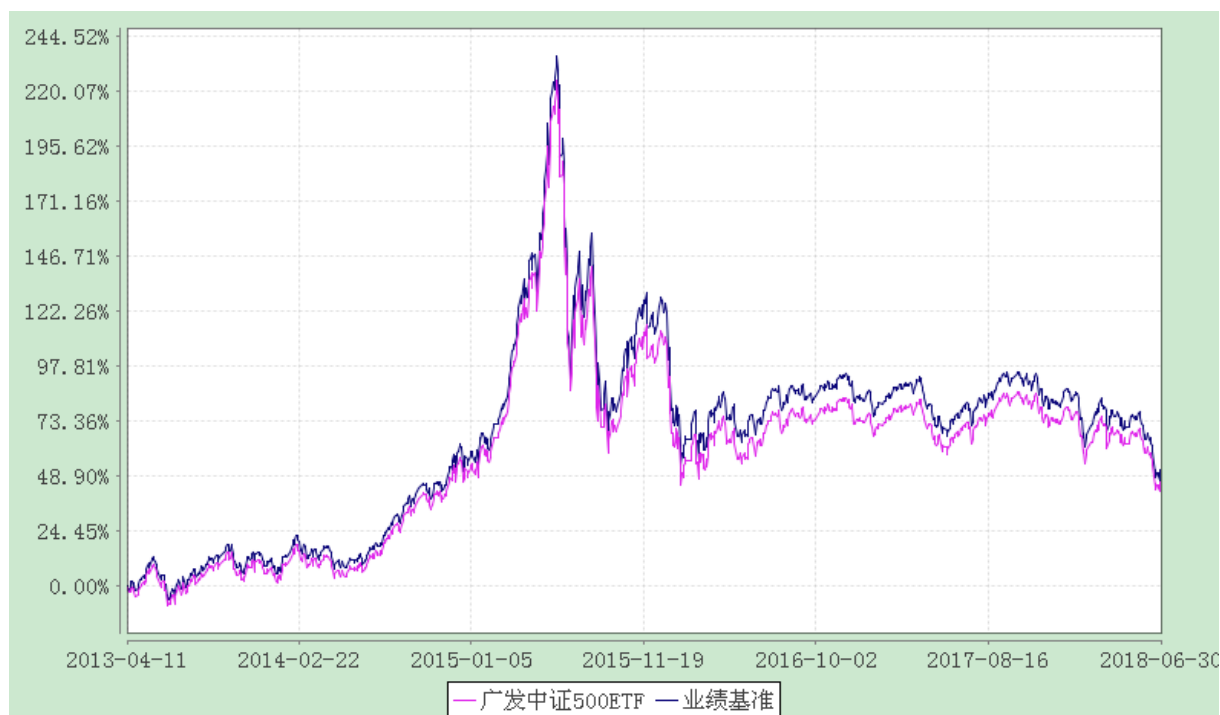
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.93%	1.86%	-9.33%	1.86%	0.40%	0.00%
过去三个月	-13.95%	1.37%	-14.67%	1.38%	0.72%	-0.01%
过去六个月	-15.84%	1.43%	-16.53%	1.44%	0.69%	-0.01%
过去一年	-14.06%	1.20%	-14.99%	1.22%	0.93%	-0.02%
过去三年	-41.47%	1.84%	-41.41%	1.90%	-0.06%	-0.06%
自基金合同生效起至今	46.36%	1.74%	51.80%	1.78%	-5.44%	-0.04%

注：业绩比较基准：中证 500 指数。

#### 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

广发中证 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  
 (2013 年 4 月 11 日至 2018 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 30 个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理；广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理；广发沪深 300ETF 基金	2014-04-01	-	14 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日）。现任广



	<p>的基金经理；                  广发养老指数基金的基金经理；                  广发中小板 300ETF 基金的基金经理；                  广发中小板 300 联接基金的基金经理；                  广发中证环保 ETF 联接基金的基金经理；                  广发军工 ETF 基金的基金经理；                  广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理；                  广发中证环保 ETF 基金的基金经理；                  广发创业板 ETF 基金的基金经理；                  广发创业板 ETF 联接基金的基金经理；                  广发量化稳健混合基金的基金经理；                  广发道琼斯石油指数 (QDII-LOF) 基金的基金经理；                  广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；                  广发美国房地产指数(QDII) 基金的基金经理；                  广发纳斯达克 100 指数 (QDII) 基金的基金经理；                  广发纳指 100ETF 基金</p>				<p>发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理（自 2014 年 4 月 1 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 8 月 20 日起任职）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 18 日起任职）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 1 月 25 日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日起任职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 30 日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 25 日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 25 日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2017 年 5 月 25 日起任职）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 8 月 4 日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2018 年 4 月 26 日起任职）、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金</p>
--	--	--	--	--	---

	的基金经理； 广发全球农业 指数（QDII） 基金的基金经 理；广发全球 医疗保健 （QDII）基金 的基金经理； 广发生物科技 指数（QDII） 基金的基金经 理；指数投资 部总经理助理			基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起 任职）、广发标普全球农业指数证 券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发道琼斯美 国石油开发与生产指数证券投资 基金（QDII-LOF）基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发港 股通恒生综合中型股指数证券投 资基金(LOF)基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发纳斯达 克生物科技指数型发起式证券投 资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发美国房地产指 数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任职）、广发全 球医疗保健指数证券投资基金基 金经理（自 2018 年 8 月 6 日起任 职）。
--	--	--	--	---

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投

资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### （1）投资策略

作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

##### （2）运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是申购、赎回和成份股调整因素，作为 ETF 基金并且目前的规模水平下，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-15.84%，同期业绩基准收益率为-16.53%，较好地跟踪了指数。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，受金融去杠杆、信用债违约以及中美贸易战升级的持续不利影响，整体市场预期较为悲观，主流指数均呈现较大幅度的下挫，但同时也释放了一定的市场风险，目前很多行业估值均已

处于历史低位，而随着流动性的逐步改善和市场环境的逐步消化，市场对于风险应对或许存在一定的过度反应。结合目前的估值水平，A 股市场进入了相对值得配置的阶段，投资者应关注未来的 A 股投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

### 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，本基金托管人在对广发中证 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 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，广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	58,215,484.02	24,153,641.83
结算备付金		9,422,473.37	4,712,394.92
存出保证金		5,683,704.43	3,275,476.69
交易性金融资产	6.4.7.2	2,151,174,111.04	1,404,995,785.18
其中：股票投资		2,151,174,111.04	1,404,870,191.16
基金投资		-	-
债券投资		-	125,594.02
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,493,081.98	14,711,486.47
应收利息	6.4.7.5	17,574.48	5,708.58
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,226,006,429.32	1,451,854,493.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,287,044.16	11,940,440.68
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		742,880.29	588,541.47
应付托管费		148,576.07	117,708.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,693,065.25	1,393,653.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	6,618,255.12	2,978,624.57
负债合计		11,489,820.89	17,018,968.77
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,513,038,319.00	825,038,319.00
未分配利润	6.4.7.10	701,478,289.43	609,797,205.90
所有者权益合计		2,214,516,608.43	1,434,835,524.90
负债和所有者权益总计		2,226,006,429.32	1,451,854,493.67

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4636 元，基金份额总额 1,513,038,319.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-251,167,582.92</b>	<b>-8,281,159.96</b>
1.利息收入		257,198.60	177,457.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	257,192.38	177,369.82
债券利息收入		6.22	87.88
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）		-10,413,693.39	-8,698,248.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,109,359.96	-17,698,655.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,915.49	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-691,740.58	688,920.00
股利收益	6.4.7.15	12,377,491.66	8,311,486.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-250,918,138.85	-424,952.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,907,050.72	664,582.96
<b>减：二、费用</b>		<b>8,094,083.39</b>	<b>5,834,630.39</b>
1. 管理人报酬		4,509,845.28	3,695,487.73
2. 托管费		901,969.07	739,097.58
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,189,556.95	959,683.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,343.30	-
7. 其他费用	6.4.7.19	489,368.79	440,361.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-259,261,666.31</b>	<b>-14,115,790.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-259,261,666.31</b>	<b>-14,115,790.35</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	825,038,319.00	609,797,205.90	1,434,835,524.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-259,261,666.31	-259,261,666.31
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）	688,000,000.00	350,942,749.84	1,038,942,749.84
其中：1.基金申购款	1,048,000,000.00	597,733,091.26	1,645,733,091.26
2.基金赎回款	-360,000,000.00	-246,790,341.42	-606,790,341.42
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）	1,513,038,319.00	701,478,289.43	2,214,516,608.43
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	791,038,319.00	574,091,146.08	1,365,129,465.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,115,790.35	-14,115,790.35
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）	204,000,000.00	139,523,545.22	343,523,545.22
其中：1.基金申购款	416,000,000.00	290,334,905.13	706,334,905.13
2.基金赎回款	-212,000,000.00	-150,811,359.91	-362,811,359.91
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）	995,038,319.00	699,498,900.95	1,694,537,219.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦 刚，会计机构负责人：张晓章



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2013]165 号《关于核准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2013 年 4 月 11 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,并于 2013 年 4 月 11 日获确认。

本基金募集期为 2013 年 3 月 18 日至 2013 年 3 月 29 日,本基金为交易型开放式,存续期限不定,募集期间净认购金额为人民币 425,036,920.00 元,有效认购户数为 3,122 户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,399.00 元,折合基金份额 1,399.00 份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。基金合同于 2013 年 4 月 11 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 425,038,319.00 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括:标的指数成份股、备选成份股。可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

本基金的财务报表于 2018 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[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]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所

得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	58,215,484.02
定期存款	-
其他存款	-
合计	58,215,484.02

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,430,807,674.44	2,151,174,111.04	-279,633,563.40
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	2,430,807,674.44	2,151,174,111.04	-279,633,563.40

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	25,940,000.00	-	-	-

其中：股指期货投资	25,940,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,940,000.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，本基金本报告期末具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1807	IC1807	25.00	25,940,000.00	-2,490,560.00
总额合计		-	25,940,000.00	-2,490,560.00
减：可抵销期货暂收款		-	-	-2,490,560.00
股指期货投资净额		-	-	-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,693.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	95.67
应收结算备付金利息	1,785.77
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	-
合计	17,574.48

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,693,065.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,693,065.25

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	218,190.07
应付替代款	6,134,135.63
可退替代款	123,170.29
应付指数使用费	142,759.13
合计	6,618,255.12

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	825,038,319.00	825,038,319.00
本期申购	1,048,000,000.00	1,048,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-360,000,000.00	-360,000,000.00
本期末	1,513,038,319.00	1,513,038,319.00

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,093,031,797.53	-483,234,591.63	609,797,205.90
本期利润	-8,343,527.46	-250,918,138.85	-259,261,666.31
本期基金份额交易产生的变动数	910,382,961.47	-559,440,211.63	350,942,749.84
其中：基金申购款	1,386,525,956.62	-788,792,865.36	597,733,091.26
基金赎回款	-476,142,995.15	229,352,653.73	-246,790,341.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,995,071,231.54	-1,293,592,942.11	701,478,289.43

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	220,192.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,345.61
结算备付金利息收入	35,654.63
其他	-
合计	257,192.38

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,605,492.89
股票投资收益——赎回差价收入	-5,503,867.07
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-22,109,359.96

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	479,535,043.67
减：卖出股票成本总额	496,140,536.56
买卖股票差价收入	-16,605,492.89

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	606,790,341.42
减：现金支付赎回款总额	341,058,560.42
减：赎回股票成本总额	271,235,648.07
赎回差价收入	-5,503,867.07

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	131,246.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	121,300.00
减：应收利息总额	31.11
买卖债券差价收入	9,915.49

### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-691,740.58

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,377,491.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,377,491.66

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-248,004,598.71
——股票投资	-248,000,304.69
——债券投资	-4,294.02
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-2,918,120.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-2,918,120.00
4.其他	4,579.86
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-250,918,138.85

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
替代损益	9,907,050.72
其他	-
合计	9,907,050.72

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

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,174,764.06
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	14,792.89
合计	2,189,556.95

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	588.00
上市费	29,752.78
指数使用费	270,590.72
合计	489,368.79

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	本基金的联接基金
广发期货有限公司	基金管理人母公司的全资子公司

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易



**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	0.00	0.00%	154,747,313.61	17.84%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-

**6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
广发证券股份有限公司	144,117.78	26.63%	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**6.4.10.2 关联方报酬**

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,509,845.28	3,695,487.73
其中：支付销售机构的客户维护费	10,553.56	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	901,969.07	739,097.58

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。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 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
广发中证 500 交 易型开放式指数 证券投资基金联 接基金	1,192,190,277.00	78.79%	783,363,770.00	94.95%
广发证券股份有 限公司	500,800.00	0.03%	-	-

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公 司	58,215,484.0 2	220,192.14	37,829,769.3 3	112,179.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
60310 5	芯能 科技	2018-0 6-29	2018-0 7-09	新股 流通 受限	4.83	4.83	3,410. 00	16,470 .30	16,470 .30	-
60370 6	东方 环宇	2018-0 6-29	2018-0 7-09	新股 流通 受限	13.09	13.09	1,765. 00	23,103 .85	23,103 .85	-

60369 3	江苏 新能	2018-0 6-25	2018-0 7-03	新股 流通 受限	9.00	9.00	5,384. 00	48,456 .00	48,456 .00	-
60113 8	工业 富联	2018-0 5-28	2019-0 6-08	新股 流通 受限	13.77	16.40	152,33 1.00	2,097, 597.87	2,498, 228.40	-

注：截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
00069 3	*ST 华 泽	2018-05 -02	重大事 项停牌	3.31	-	-	109,768.00	2,234,069.65	363,332.08	-
00200 5	德豪润 达	2018-01 -02	重大事 项停牌	4.36	2018-0 7-02	3.92	353,956.00	2,115,352.01	1,543,248.16	-
00066 9	金鸿控 股	2018-05 -18	重大事 项停牌	7.25	2018-0 8-06	6.53	232,419.00	2,455,020.63	1,685,037.75	-
60068 7	刚泰控 股	2018-06 -11	重大事 项停牌	9.09	2018-0 8-20	8.18	195,740.00	2,542,600.11	1,779,276.60	-
00201 1	盾安环 境	2018-05 -02	重大事 项停牌	6.40	-	-	281,943.00	2,592,838.70	1,804,435.20	-
00058 7	金洲慈 航	2018-06 -15	重大事 项停牌	4.96	2018-0 7-02	4.46	386,208.00	2,925,990.68	1,915,591.68	-
60033 5	国机汽 车	2018-04 -03	重大事 项停牌	10.43	-	-	184,528.00	2,091,610.94	1,924,627.04	-
60075 9	洲际油 气	2018-03 -27	重大事 项停牌	3.94	-	-	501,770.00	3,270,765.68	1,976,973.80	-
00269 9	美盛文 化	2018-02 -05	重大事 项停牌	18.76	2018-0 7-02	16.88	108,720.00	1,996,403.13	2,039,587.20	-
00042 6	兴业矿 业	2018-06 -19	重大事 项停牌	7.21	-	-	294,082.00	2,691,282.18	2,120,331.22	-
60075 0	江中药 业	2018-05 -02	重大事 项停牌	17.75	2018-0 8-01	16.12	126,695.00	2,611,491.92	2,248,836.25	-
60008 6	东方金 钰	2018-01 -19	重大事 项停牌	10.04	-	-	227,455.00	2,417,943.59	2,283,648.20	-
00243 7	誉衡药 业	2018-06 -11	重大事 项停牌	6.20	2018-0 8-13	5.57	381,927.00	2,971,853.70	2,367,947.40	-
00242 6	胜利精 密	2018-06 -19	重大事 项停牌	3.60	2018-0 7-03	3.26	673,700.00	2,730,776.00	2,425,320.00	-
00214	新光圆	2018-01	重大事	14.76	-	-	175,716.00	2,171,784.75	2,593,568.16	-

7	成	-18	项停牌							
600751	海航科技	2018-01-12	重大事项停牌	6.49	-	-	416,600.00	3,297,430.39	2,703,734.00	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项停牌	3.31	-	-	838,538.00	3,787,096.53	2,775,560.78	-
600848	上海临港	2018-06-15	重大事项停牌	21.67	-	-	128,155.00	2,867,134.42	2,777,118.85	-
002512	达华智能	2018-06-19	重大事项停牌	9.70	-	-	288,900.00	4,108,437.48	2,802,330.00	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大事项停牌	4.99	2018-07-02	4.74	586,744.00	3,051,776.43	2,927,852.56	-
600122	宏图高科	2018-06-19	重大事项停牌	7.40	-	-	396,411.00	4,228,063.17	2,933,441.40	-
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项停牌	6.71	-	-	472,048.00	4,231,161.49	3,167,442.08	-
002573	清新环境	2018-06-19	重大事项停牌	11.55	-	-	281,148.00	5,053,411.61	3,247,259.40	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	-	-	607,020.00	4,621,740.04	3,259,697.40	-
002665	首航节能	2018-05-29	重大事项停牌	5.80	-	-	568,929.00	4,281,757.38	3,299,788.20	-
600158	中体产业	2018-03-27	重大事项停牌	11.64	2018-07-16	11.61	305,288.00	4,615,960.54	3,553,552.32	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	-	-	395,326.00	4,635,052.88	3,751,643.74	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项停牌	12.89	2018-07-09	11.60	296,566.00	4,051,079.51	3,822,735.74	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项停牌	15.27	-	-	271,949.00	4,928,688.89	4,152,661.23	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项停牌	16.60	2018-07-31	16.50	283,054.00	3,682,580.66	4,698,696.40	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大事项停牌	12.28	-	-	387,237.00	4,202,565.82	4,755,270.36	-
002359	北讯集团	2018-05-21	重大事项停牌	19.58	-	-	246,290.00	5,873,034.81	4,822,358.20	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项停牌	19.99	2018-07-02	17.99	245,214.00	6,430,787.68	4,901,827.86	-
600811	东方集团	2018-05-30	重大事项停牌	4.30	-	-	1,226,877.00	6,004,334.59	5,275,571.10	-
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大事项停牌	2.02	2018-08-16	1.83	2,918,116.00	6,214,273.10	5,894,594.32	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	1,114,700.00	5,732,207.60	6,688,200.00	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总裁负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

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，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	125,594.02
未评级	-	-
合计	-	125,594.02

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	58,215,484.02	-	-	-	58,215,484.02
结算备付金	9,422,473.37	-	-	-	9,422,473.37
存出保证金	5,683,704.43	-	-	-	5,683,704.43
交易性金融资产	-	-	-	2,151,174,111.04	2,151,174,111.04
应收证券清算款	-	-	-	1,493,081.98	1,493,081.98
应收利息	-	-	-	17,574.48	17,574.48
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	73,321,661.82	-	-	2,152,684,767.50	2,226,006,429.32
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,287,044.16	1,287,044.16
应付管理人报酬	-	-	-	742,880.29	742,880.29
应付托管费	-	-	-	148,576.07	148,576.07
应付交易费用	-	-	-	2,693,065.25	2,693,065.25
其他负债	-	-	-	6,618,255.12	6,618,255.12
负债总计	-	-	-	11,489,820.89	11,489,820.89
利率敏感度缺口	73,321,661.82	-	-	2,141,194,946.61	2,214,516,608.43
上年度末 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	24,153,641.83	-	-	-	24,153,641.83
结算备付金	4,712,394.92	-	-	-	4,712,394.92
存出保证金	3,275,476.69	-	-	-	3,275,476.69
交易性金融资产	125,594.02	-	-	1,404,870,191.16	1,404,995,785.89



					18
应收证券清算款	-	-	-	14,711,486.47	14,711,486.47
应收利息	-	-	-	5,708.58	5,708.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,267,107.46	-	-	1,419,587,386.21	1,451,854,493.67
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,940,440.68	11,940,440.68
应付管理人报酬	-	-	-	588,541.47	588,541.47
应付托管费	-	-	-	117,708.31	117,708.31
应付交易费用	-	-	-	1,393,653.74	1,393,653.74
其他负债	-	-	-	2,978,624.57	2,978,624.57
负债总计	-	-	-	17,018,968.77	17,018,968.77
利率敏感度缺口	32,267,107.46	-	-	1,402,568,417.44	1,434,835,524.90

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，上年度末持有的债券占基金资产净值较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,151,174,111.04	97.14	1,404,870,191.16	97.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	125,594.02	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>2,151,174,111.04</b>	<b>97.14</b>	<b>1,404,995,785.18</b>	<b>97.92</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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	上年度末
		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	110,725,830.42	69,566,030.88
	业绩比较基准下降 5%	-110,725,830.42	-69,566,030.88

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,037,304,755.81 元，属于第二层级的余额为 111,371,126.83 元，属于第三层级的余额为 2,498,228.40 元（2017 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 1,294,892,881.79 元，属于第二层级的余额为 110,102,903.39 元，无属于第三层级的金额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层级的余额为人民币 2,498,228.40 元；新增购入属于第三层级的金额为人民币 2,097,597.87 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 400,630.53 元（均为权益工具产生），除上述变动外，该层级金融资产无其他变动。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,151,174,111.04	96.64
	其中：股票	2,151,174,111.04	96.64
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	67,637,957.39	3.04
8	其他各项资产	7,194,360.89	0.32
9	合计	2,226,006,429.32	100.00

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

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

A	农、林、牧、渔业	22,934,667.08	1.04
B	采矿业	66,804,695.62	3.02
C	制造业	1,279,680,647.47	57.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,717,564.66	3.06
E	建筑业	34,158,973.58	1.54
F	批发和零售业	113,116,380.48	5.11
G	交通运输、仓储和邮政业	75,590,843.65	3.41
H	住宿和餐饮业	11,763,781.04	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	187,456,182.47	8.46
J	金融业	52,124,450.51	2.35
K	房地产业	113,671,054.22	5.13
L	租赁和商务服务业	40,324,276.49	1.82
M	科学研究和技术服务业	3,773,631.06	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	15,105,951.78	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,494,470.40	0.07
Q	卫生和社会工作	3,284,167.60	0.15
R	文化、体育和娱乐业	44,659,751.57	2.02
S	综合	17,507,280.50	0.79
	合计	2,151,168,770.18	97.14

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000661	长春高新	81,576	18,574,855.20	0.84
2	603019	中科曙光	276,000	12,660,120.00	0.57

3	600201	生物股份	709,105	12,118,604.45	0.55
4	600521	华海药业	452,370	12,073,755.30	0.55
5	600426	华鲁恒升	683,927	12,030,275.93	0.54
6	002410	广联达	429,941	11,922,263.93	0.54
7	002049	紫光国微	258,200	11,391,784.00	0.51
8	603589	口子窖	182,434	11,210,569.30	0.51
9	000977	浪潮信息	467,021	11,138,450.85	0.50
10	000830	鲁西化工	628,079	10,727,589.32	0.48
11	600298	安琪酵母	297,758	10,624,005.44	0.48
12	000703	恒逸石化	703,080	10,461,830.40	0.47
13	600256	广汇能源	2,434,174	9,955,771.66	0.45
14	002340	格林美	1,644,940	9,951,887.00	0.45
15	600584	长电科技	577,374	9,780,715.56	0.44
16	000418	小天鹅 A	138,500	9,604,975.00	0.43
17	600872	中炬高新	342,633	9,593,724.00	0.43
18	600673	东阳光科	922,485	9,529,270.05	0.43
19	601233	桐昆股份	550,363	9,477,250.86	0.43
20	002038	双鹭药业	247,946	9,419,468.54	0.43
21	600600	青岛啤酒	212,420	9,310,368.60	0.42
22	002179	中航光电	238,371	9,296,469.00	0.42
23	002078	太阳纸业	958,850	9,291,256.50	0.42
24	600760	中航沈飞	257,400	9,276,696.00	0.42
25	600879	航天电子	1,312,625	9,227,753.75	0.42
26	000860	顺鑫农业	240,503	9,018,862.50	0.41
27	002129	中环股份	1,129,911	8,847,203.13	0.40
28	002589	瑞康医药	636,077	8,676,090.28	0.39
29	600315	上海家化	218,598	8,663,038.74	0.39
30	600525	长园集团	818,183	8,648,194.31	0.39
31	300253	卫宁健康	692,529	8,580,434.31	0.39
32	600642	申能股份	1,644,208	8,253,924.16	0.37
33	600004	白云机场	627,510	8,214,105.90	0.37
34	600885	宏发股份	273,720	8,189,702.40	0.37
35	600258	首旅酒店	300,040	8,152,086.80	0.37
36	600392	盛和资源	494,602	8,027,390.46	0.36
37	002465	海格通信	986,272	7,919,764.16	0.36
38	600325	华发股份	1,023,129	7,908,787.17	0.36
39	000656	金科股份	1,644,927	7,895,649.60	0.36
40	000581	威孚高科	354,773	7,844,031.03	0.35
41	300383	光环新网	581,500	7,797,915.00	0.35
42	000066	中国长城	1,092,360	7,766,679.60	0.35
43	000513	丽珠集团	176,184	7,743,286.80	0.35
44	002268	卫士通	354,340	7,735,242.20	0.35
45	002092	中泰化学	800,441	7,716,251.24	0.35
46	600079	人福医药	575,515	7,608,308.30	0.34

47	600884	杉杉股份	344,044	7,603,372.40	0.34
48	000690	宝新能源	1,064,569	7,409,400.24	0.33
49	601168	西部矿业	1,155,837	7,258,656.36	0.33
50	002223	鱼跃医疗	370,181	7,214,827.69	0.33
51	002127	南极电商	756,150	7,100,248.50	0.32
52	000039	中集集团	534,300	7,095,504.00	0.32
53	002176	江特电机	727,600	7,072,272.00	0.32
54	600138	中青旅	354,137	7,057,950.41	0.32
55	300315	掌趣科技	1,684,000	7,039,120.00	0.32
56	000488	晨鸣纸业	544,714	7,037,704.88	0.32
57	000636	风华高科	442,299	7,023,708.12	0.32
58	002195	二三四五	1,629,040	6,972,291.20	0.31
59	600528	中铁工业	680,000	6,949,600.00	0.31
60	603369	今世缘	302,356	6,902,787.48	0.31
61	600260	凯乐科技	256,789	6,892,216.76	0.31
62	000997	新大陆	437,098	6,884,293.50	0.31
63	002439	启明星辰	324,375	6,883,237.50	0.31
64	600718	东软集团	524,201	6,846,065.06	0.31
65	002013	中航机电	888,480	6,725,793.60	0.30
66	002110	三钢闽光	418,600	6,710,158.00	0.30
67	002384	东山精密	279,456	6,706,944.00	0.30
68	000825	太钢不锈	1,114,700	6,688,200.00	0.30
69	300418	昆仑万维	353,200	6,668,416.00	0.30
70	300166	东方国信	450,933	6,642,243.09	0.30
71	000999	华润三九	238,458	6,636,286.14	0.30
72	600062	华润双鹤	268,335	6,587,624.25	0.30
73	002019	亿帆医药	372,200	6,569,330.00	0.30
74	300088	长信科技	1,128,300	6,544,140.00	0.30
75	000887	中鼎股份	453,400	6,533,494.00	0.30
76	600967	内蒙一机	510,515	6,503,961.10	0.29
77	600808	马钢股份	1,810,567	6,499,935.53	0.29
78	000009	中国宝安	1,322,944	6,482,425.60	0.29
79	000750	国海证券	1,804,286	6,441,301.02	0.29
80	600643	爱建集团	684,497	6,434,271.80	0.29
81	600839	四川长虹	2,226,497	6,367,781.42	0.29
82	000596	古井贡酒	71,642	6,360,376.76	0.29
83	600060	海信电器	474,600	6,354,894.00	0.29
84	000681	视觉中国	216,744	6,220,552.80	0.28
85	000960	锡业股份	514,260	6,176,262.60	0.28
86	000778	新兴铸管	1,442,950	6,175,826.00	0.28
87	000975	银泰资源	607,315	6,158,174.10	0.28
88	000930	中粮生化	592,853	6,106,385.90	0.28
89	600160	巨化股份	827,497	6,057,278.04	0.27
90	300182	捷成股份	797,050	6,041,639.00	0.27

91	600143	金发科技	1,147,980	5,992,455.60	0.27
92	002183	怡亚通	896,400	5,961,060.00	0.27
93	002371	北方华创	119,735	5,947,237.45	0.27
94	000732	泰禾集团	304,780	5,927,971.00	0.27
95	600388	龙净环保	462,305	5,908,257.90	0.27
96	600056	中国医药	323,023	5,901,630.21	0.27
97	600022	山东钢铁	2,918,116	5,894,594.32	0.27
98	600183	生益科技	643,150	5,891,254.00	0.27
99	600282	南钢股份	1,327,200	5,866,224.00	0.26
100	000729	燕京啤酒	871,266	5,863,620.18	0.26
101	002221	东华能源	598,550	5,847,833.50	0.26
102	600410	华胜天成	668,097	5,845,848.75	0.26
103	600460	士兰微	476,004	5,807,248.80	0.26
104	603816	顾家家居	78,700	5,785,237.00	0.26
105	002373	千方科技	442,945	5,780,432.25	0.26
106	600572	康恩贝	803,097	5,758,205.49	0.26
107	002506	协鑫集成	1,229,203	5,752,670.04	0.26
108	600655	豫园股份	606,362	5,730,120.90	0.26
109	600166	福田汽车	2,822,400	5,729,472.00	0.26
110	002640	跨境通	375,331	5,637,471.62	0.25
111	600380	健康元	475,139	5,635,148.54	0.25
112	600755	厦门国贸	768,016	5,598,836.64	0.25
113	601098	中南传媒	442,700	5,595,728.00	0.25
114	603077	和邦生物	3,222,724	5,575,312.52	0.25
115	300274	阳光电源	617,702	5,540,786.94	0.25
116	600094	大名城	959,569	5,527,117.44	0.25
117	600895	张江高科	479,500	5,514,250.00	0.25
118	002273	水晶光电	427,385	5,500,444.95	0.25
119	000686	东北证券	856,530	5,490,357.30	0.25
120	002407	多氟多	391,600	5,490,232.00	0.25
121	603899	晨光文具	171,230	5,426,278.70	0.25
122	000988	华工科技	373,425	5,395,991.25	0.24
123	002028	思源电气	320,471	5,380,708.09	0.24
124	002174	游族网络	270,200	5,376,980.00	0.24
125	600266	北京城建	571,036	5,367,738.40	0.24
126	002030	达安基因	347,743	5,362,197.06	0.24
127	600409	三友化工	622,649	5,361,007.89	0.24
128	600291	西水股份	396,220	5,293,499.20	0.24
129	600811	东方集团	1,226,877	5,275,571.10	0.24
130	600161	天坛生物	272,489	5,272,662.15	0.24
131	600499	科达洁能	761,770	5,225,742.20	0.24
132	300010	立思辰	426,157	5,216,161.68	0.24
133	600348	阳泉煤业	726,814	5,196,720.10	0.23
134	600418	江淮汽车	798,096	5,195,604.96	0.23

135	600511	国药股份	191,797	5,168,929.15	0.23
136	002670	国盛金控	479,459	5,163,773.43	0.23
137	000528	柳工	480,954	5,151,017.34	0.23
138	600267	海正药业	353,394	5,138,348.76	0.23
139	002491	通鼎互联	463,800	5,134,266.00	0.23
140	600787	中储股份	662,977	5,131,441.98	0.23
141	000401	冀东水泥	577,300	5,120,651.00	0.23
142	603885	吉祥航空	331,640	5,110,572.40	0.23
143	600875	东方电气	689,616	5,110,054.56	0.23
144	002399	海普瑞	230,200	5,096,628.00	0.23
145	002603	以岭药业	363,697	5,084,484.06	0.23
146	600240	华业资本	687,571	5,039,895.43	0.23
147	002440	闰土股份	429,675	5,022,900.75	0.23
148	600827	百联股份	489,712	4,995,062.40	0.23
149	002244	滨江集团	959,236	4,988,027.20	0.23
150	300287	飞利信	693,700	4,987,703.00	0.23
151	002281	光迅科技	235,224	4,986,748.80	0.23
152	000878	云南铜业	521,100	4,971,294.00	0.22
153	002353	杰瑞股份	304,543	4,948,823.75	0.22
154	600978	宜华生活	721,019	4,924,559.77	0.22
155	000807	云铝股份	948,700	4,914,266.00	0.22
156	000970	中科三环	524,700	4,905,945.00	0.22
157	300266	兴源环境	245,214	4,901,827.86	0.22
158	600729	重庆百货	147,002	4,843,715.90	0.22
159	002359	北讯集团	246,290	4,822,358.20	0.22
160	000089	深圳机场	627,600	4,801,140.00	0.22
161	000547	航天发展	613,089	4,788,225.09	0.22
162	002408	齐翔腾达	387,237	4,755,270.36	0.21
163	002563	森马服饰	332,200	4,750,460.00	0.21
164	600649	城投控股	774,806	4,741,812.72	0.21
165	300058	蓝色光标	831,578	4,739,994.60	0.21
166	000078	海王生物	980,385	4,715,651.85	0.21
167	300146	汤臣倍健	283,054	4,698,696.40	0.21
168	002299	圣农发展	303,300	4,698,117.00	0.21
169	600125	铁龙物流	558,790	4,677,072.30	0.21
170	002517	恺英网络	649,594	4,670,580.86	0.21
171	600737	中粮糖业	619,300	4,669,522.00	0.21
172	300133	华策影视	436,509	4,648,820.85	0.21
173	601872	招商轮船	1,286,600	4,644,626.00	0.21
174	600270	外运发展	220,805	4,628,072.80	0.21
175	601966	玲珑轮胎	293,371	4,626,460.67	0.21
176	603883	老百姓	55,600	4,623,696.00	0.21
177	600179	安通控股	450,594	4,564,517.22	0.21
178	000813	德展健康	552,170	4,549,880.80	0.21



179	002583	海能达	541,346	4,520,239.10	0.20
180	000028	国药一致	90,523	4,517,097.70	0.20
181	000598	兴蓉环境	1,110,100	4,507,006.00	0.20
182	002280	联络互动	787,150	4,502,498.00	0.20
183	600216	浙江医药	352,499	4,501,412.23	0.20
184	600466	蓝光发展	723,960	4,488,552.00	0.20
185	603658	安图生物	54,247	4,473,207.62	0.20
186	002004	华邦健康	880,100	4,470,908.00	0.20
187	002366	台海核电	313,474	4,470,139.24	0.20
188	002368	太极股份	152,522	4,433,814.54	0.20
189	600801	华新水泥	293,629	4,413,243.87	0.20
190	000553	沙隆达 A	279,100	4,412,571.00	0.20
191	300055	万邦达	383,700	4,408,713.00	0.20
192	002152	广电运通	749,201	4,405,301.88	0.20
193	600435	北方导航	539,188	4,399,774.08	0.20
194	600037	歌华有线	424,774	4,383,667.68	0.20
195	600277	亿利洁能	834,911	4,374,933.64	0.20
196	600500	中化国际	638,100	4,351,842.00	0.20
197	600575	皖江物流	1,170,500	4,342,555.00	0.20
198	600635	大众公用	1,165,611	4,336,072.92	0.20
199	000685	中山公用	542,212	4,321,429.64	0.20
200	002131	利欧股份	2,054,367	4,314,170.70	0.19
201	002600	领益智造	829,600	4,305,624.00	0.19
202	300115	长盈精密	329,581	4,274,665.57	0.19
203	002745	木林森	240,200	4,273,158.00	0.19
204	300113	顺网科技	245,200	4,268,932.00	0.19
205	600970	中材国际	639,055	4,268,887.40	0.19
206	002358	森源电气	283,036	4,259,691.80	0.19
207	601179	中国西电	1,236,501	4,228,833.42	0.19
208	601000	唐山港	1,785,312	4,195,483.20	0.19
209	002051	中工国际	271,949	4,152,661.23	0.19
210	000979	中弘股份	4,106,137	4,147,198.37	0.19
211	300199	翰宇药业	289,739	4,137,472.92	0.19
212	600648	外高桥	225,483	4,121,829.24	0.19
213	600859	王府井	193,178	4,108,896.06	0.19
214	300026	红日药业	1,122,143	4,095,821.95	0.18
215	002191	劲嘉股份	545,048	4,071,508.56	0.18
216	600563	法拉电子	81,758	4,046,203.42	0.18
217	601678	滨化股份	654,171	4,042,776.78	0.18
218	002709	天赐材料	103,689	3,996,174.06	0.18
219	600021	上海电力	592,215	3,991,529.10	0.18
220	002701	奥瑞金	729,858	3,985,024.68	0.18
221	600863	内蒙华电	1,752,364	3,977,866.28	0.18
222	600171	上海贝岭	342,572	3,966,983.76	0.18

223	600307	酒钢宏兴	1,885,676	3,959,919.60	0.18
224	600598	北大荒	431,800	3,955,288.00	0.18
225	601128	常熟银行	683,800	3,911,336.00	0.18
226	002285	世联行	621,446	3,896,466.42	0.18
227	002690	美亚光电	163,000	3,885,920.00	0.18
228	000848	承德露露	363,973	3,854,474.07	0.17
229	300159	新研股份	543,586	3,848,588.88	0.17
230	600717	天津港	508,300	3,827,499.00	0.17
231	600064	南京高科	521,103	3,824,896.02	0.17
232	000566	海南海药	296,566	3,822,735.74	0.17
233	000031	中粮地产	658,618	3,806,812.04	0.17
234	002672	东江环保	289,710	3,792,303.90	0.17
235	002390	信邦制药	516,875	3,783,525.00	0.17
236	600823	世茂股份	904,460	3,780,642.80	0.17
237	600503	华丽家族	966,000	3,777,060.00	0.17
238	600835	上海机电	200,229	3,776,318.94	0.17
239	600645	中源协和	195,931	3,773,631.06	0.17
240	300324	旋极信息	395,326	3,751,643.74	0.17
241	000758	中色股份	831,878	3,743,451.00	0.17
242	000738	航发控制	278,711	3,715,217.63	0.17
243	600536	中国软件	171,166	3,702,320.58	0.17
244	000156	华数传媒	383,907	3,700,863.48	0.17
245	600664	哈药股份	930,855	3,695,494.35	0.17
246	600614	鹏起科技	644,764	3,681,602.44	0.17
247	600582	天地科技	1,001,871	3,676,866.57	0.17
248	002266	浙富控股	978,519	3,669,446.25	0.17
249	002831	裕同科技	73,200	3,660,000.00	0.17
250	600881	亚泰集团	978,520	3,649,879.60	0.16
251	600597	光明乳业	369,096	3,642,977.52	0.16
252	000027	深圳能源	736,120	3,636,432.80	0.16
253	002317	众生药业	343,930	3,635,340.10	0.16
254	600120	浙江东方	267,849	3,629,353.95	0.16
255	601880	大连港	1,862,706	3,613,649.64	0.16
256	600754	锦江股份	97,719	3,611,694.24	0.16
257	002505	大康农业	1,685,918	3,607,864.52	0.16
258	600039	四川路桥	1,091,801	3,581,107.28	0.16
259	002056	横店东磁	509,456	3,571,286.56	0.16
260	002444	巨星科技	324,010	3,567,350.10	0.16
261	002128	露天煤业	393,724	3,567,139.44	0.16
262	600017	日照港	1,111,127	3,566,717.67	0.16
263	002180	纳思达	129,519	3,556,591.74	0.16
264	600158	中体产业	305,288	3,553,552.32	0.16
265	300002	神州泰岳	839,858	3,502,207.86	0.16
266	600026	中远海能	824,367	3,495,316.08	0.16

267	603766	隆鑫通用	641,468	3,483,171.24	0.16
268	002155	湖南黄金	508,472	3,477,948.48	0.16
269	002242	九阳股份	196,516	3,476,368.04	0.16
270	300001	特锐德	305,504	3,470,525.44	0.16
271	002250	联化科技	391,722	3,454,988.04	0.16
272	300308	中际旭创	57,383	3,445,275.32	0.16
273	002400	省广集团	1,065,785	3,442,485.55	0.16
274	000012	南玻 A	695,333	3,441,898.35	0.16
275	600623	华谊集团	344,200	3,435,116.00	0.16
276	000006	深振业 A	584,618	3,425,861.48	0.15
277	600594	益佰制药	381,906	3,421,877.76	0.15
278	002332	仙琚制药	389,723	3,410,076.25	0.15
279	000718	苏宁环球	925,260	3,395,704.20	0.15
280	000926	福星股份	471,650	3,391,163.50	0.15
281	601200	上海环境	213,652	3,382,111.16	0.15
282	002839	张家港行	554,100	3,374,469.00	0.15
283	600936	广西广电	708,400	3,371,984.00	0.15
284	002233	塔牌集团	293,831	3,361,426.64	0.15
285	000667	美好置业	1,574,465	3,353,610.45	0.15
286	601138	工业富联	198,015	3,340,641.36	0.15
287	002916	深南电路	52,500	3,334,275.00	0.15
288	002212	南洋股份	279,799	3,326,810.11	0.15
289	600908	无锡银行	563,800	3,320,782.00	0.15
290	603515	欧普照明	70,930	3,315,268.20	0.15
291	600557	康缘药业	267,754	3,306,761.90	0.15
292	002665	首航节能	568,929	3,299,788.20	0.15
293	000519	中兵红箭	422,982	3,286,570.14	0.15
294	300244	迪安诊断	172,760	3,284,167.60	0.15
295	600329	中新药业	172,547	3,278,393.00	0.15
296	300257	开山股份	213,900	3,270,531.00	0.15
297	300197	铁汉生态	607,020	3,259,697.40	0.15
298	002573	清新环境	281,148	3,247,259.40	0.15
299	002354	天神娱乐	350,416	3,244,852.16	0.15
300	000563	陕国投 A	953,305	3,241,237.00	0.15
301	600098	广州发展	497,964	3,211,867.80	0.15
302	600633	浙数文化	384,100	3,203,394.00	0.14
303	600478	科力远	625,192	3,188,479.20	0.14
304	002431	棕榈股份	472,048	3,167,442.08	0.14
305	000727	华东科技	1,681,100	3,160,468.00	0.14
306	002249	大洋电机	731,168	3,151,334.08	0.14
307	601717	郑煤机	538,799	3,130,422.19	0.14
308	600141	兴发集团	268,452	3,127,465.80	0.14
309	600993	马应龙	183,582	3,122,729.82	0.14
310	000021	深科技	454,998	3,103,086.36	0.14

311	300376	易事特	576,700	3,096,879.00	0.14
312	002254	泰和新材	270,347	3,076,548.86	0.14
313	002635	安洁科技	178,345	3,067,534.00	0.14
314	600280	中央商场	351,394	3,064,155.68	0.14
315	600195	中牧股份	156,213	3,038,342.85	0.14
316	000612	焦作万方	576,565	3,026,966.25	0.14
317	002807	江阴银行	538,173	3,024,532.26	0.14
318	002064	华峰氨纶	727,144	3,003,104.72	0.14
319	002002	鸿达兴业	647,512	2,985,030.32	0.13
320	600580	卧龙电气	390,300	2,974,086.00	0.13
321	002424	贵州百灵	260,747	2,962,085.92	0.13
322	002707	众信旅游	308,100	2,957,760.00	0.13
323	002022	科华生物	248,636	2,946,336.60	0.13
324	601311	骆驼股份	256,839	2,945,943.33	0.13
325	300297	蓝盾股份	363,100	2,944,741.00	0.13
326	600694	大商股份	90,330	2,936,628.30	0.13
327	600122	宏图高科	396,411	2,933,441.40	0.13
328	000939	*ST 凯迪	586,744	2,927,852.56	0.13
329	000543	皖能电力	663,910	2,927,843.10	0.13
330	000400	许继电气	374,737	2,926,695.97	0.13
331	002544	杰赛科技	212,587	2,910,316.03	0.13
332	000501	鄂武商 A	235,433	2,893,471.57	0.13
333	601016	节能风电	1,007,500	2,891,525.00	0.13
334	002048	宁波华翔	234,460	2,890,891.80	0.13
335	600416	湘电股份	400,553	2,879,976.07	0.13
336	000766	通化金马	242,157	2,876,825.16	0.13
337	002308	威创股份	345,698	2,869,293.40	0.13
338	002434	万里扬	325,616	2,858,908.48	0.13
339	603000	人民网	339,297	2,816,165.10	0.13
340	002512	达华智能	288,900	2,802,330.00	0.13
341	601928	凤凰传媒	460,334	2,798,830.72	0.13
342	002277	友阿股份	607,064	2,798,565.04	0.13
343	000712	锦龙股份	279,200	2,786,416.00	0.13
344	600770	综艺股份	471,651	2,782,740.90	0.13
345	600848	上海临港	128,155	2,777,118.85	0.13
346	000158	常山北明	404,180	2,776,716.60	0.13
347	002477	雏鹰农牧	838,538	2,775,560.78	0.13
348	601801	皖新传媒	364,400	2,773,084.00	0.13
349	601608	中信重工	1,065,950	2,771,470.00	0.13
350	600312	平高电气	490,940	2,768,901.60	0.13
351	000592	平潭发展	973,944	2,766,000.96	0.12
352	600545	卓郎智能	348,231	2,764,954.14	0.12
353	000090	天健集团	443,846	2,751,845.20	0.12
354	002463	沪电股份	731,536	2,735,944.64	0.12

355	603659	璞泰来	42,800	2,734,492.00	0.12
356	600108	亚盛集团	945,942	2,733,772.38	0.12
357	600777	新潮能源	1,245,600	2,727,864.00	0.12
358	600751	海航科技	416,600	2,703,734.00	0.12
359	600611	大众交通	678,594	2,700,804.12	0.12
360	000937	冀中能源	656,760	2,699,283.60	0.12
361	600259	广晟有色	91,704	2,685,093.12	0.12
362	603198	迎驾贡酒	145,500	2,672,835.00	0.12
363	000062	深圳华强	136,101	2,667,579.60	0.12
364	002509	天广中茂	915,300	2,663,523.00	0.12
365	000980	众泰汽车	373,800	2,657,718.00	0.12
366	002503	搜于特	756,486	2,647,701.00	0.12
367	600317	营口港	1,169,117	2,642,204.42	0.12
368	600073	上海梅林	396,612	2,633,503.68	0.12
369	600422	昆药集团	338,544	2,623,716.00	0.12
370	601689	拓普集团	134,388	2,612,502.72	0.12
371	600366	宁波韵升	427,328	2,606,700.80	0.12
372	002073	软控股份	451,607	2,596,740.25	0.12
373	000877	天山股份	384,448	2,595,024.00	0.12
374	002147	新光圆成	175,716	2,593,568.16	0.12
375	002657	中科金财	163,644	2,592,120.96	0.12
376	600565	迪马股份	876,057	2,584,368.15	0.12
377	603228	景旺电子	51,900	2,565,936.00	0.12
378	600765	中航重机	343,240	2,553,705.60	0.12
379	600869	智慧能源	539,970	2,548,658.40	0.12
380	600169	太原重工	1,084,641	2,538,059.94	0.11
381	600578	京能电力	812,482	2,534,943.84	0.11
382	601001	大同煤业	506,228	2,510,890.88	0.11
383	600874	创业环保	267,516	2,498,599.44	0.11
384	002302	西部建设	231,894	2,497,498.38	0.11
385	600338	西藏珠峰	120,401	2,494,708.72	0.11
386	603188	亚邦股份	243,695	2,485,689.00	0.11
387	600316	洪都航空	265,866	2,477,871.12	0.11
388	000600	建投能源	442,868	2,466,774.76	0.11
389	600151	航天机电	605,645	2,458,918.70	0.11
390	002489	浙江永强	670,777	2,441,628.28	0.11
391	002251	步步高	214,421	2,440,110.98	0.11
392	300156	神雾环保	365,676	2,439,058.92	0.11
393	002428	云南锗业	315,760	2,437,667.20	0.11
394	002815	崇达技术	151,242	2,434,996.20	0.11
395	600395	盘江股份	399,800	2,426,786.00	0.11
396	002426	胜利精密	673,700	2,425,320.00	0.11
397	000762	西藏矿业	251,606	2,422,965.78	0.11
398	000572	海马汽车	706,138	2,422,053.34	0.11

399	002681	奋达科技	276,990	2,398,733.40	0.11
400	000541	佛山照明	398,727	2,388,374.73	0.11
401	002345	潮宏基	277,682	2,388,065.20	0.11
402	002437	誉衡药业	381,927	2,367,947.40	0.11
403	000969	安泰科技	378,262	2,364,137.50	0.11
404	603444	吉比特	18,380	2,348,780.20	0.11
405	002093	国脉科技	304,502	2,347,710.42	0.11
406	000829	天音控股	319,096	2,338,973.68	0.11
407	300039	上海凯宝	402,212	2,332,829.60	0.11
408	000536	华映科技	845,217	2,324,346.75	0.10
409	300273	和佳股份	339,364	2,300,887.92	0.10
410	600300	维维股份	704,907	2,297,996.82	0.10
411	000552	靖远煤电	699,976	2,288,921.52	0.10
412	600086	东方金钰	227,455	2,283,648.20	0.10
413	000061	农产品	422,618	2,282,137.20	0.10
414	002841	视源股份	42,700	2,280,607.00	0.10
415	002375	亚厦股份	426,700	2,278,578.00	0.10
416	600187	国中水务	801,708	2,276,850.72	0.10
417	600155	华创阳安	315,600	2,269,164.00	0.10
418	002482	广田集团	377,855	2,255,794.35	0.10
419	600750	江中药业	126,695	2,248,836.25	0.10
420	002118	紫鑫药业	311,778	2,229,212.70	0.10
421	600393	粤泰股份	614,829	2,225,680.98	0.10
422	002276	万马股份	380,321	2,221,074.64	0.10
423	603556	海兴电力	121,940	2,215,649.80	0.10
424	002642	荣之联	239,750	2,203,302.50	0.10
425	600058	五矿发展	264,684	2,199,524.04	0.10
426	001696	宗申动力	443,589	2,173,586.10	0.10
427	000990	诚志股份	154,700	2,165,800.00	0.10
428	002818	富森美	81,779	2,157,330.02	0.10
429	600971	恒源煤电	301,226	2,150,753.64	0.10
430	603888	新华网	127,350	2,147,121.00	0.10
431	000049	德赛电池	75,646	2,134,730.12	0.10
432	000426	兴业矿业	294,082	2,120,331.22	0.10
433	603568	伟明环保	83,378	2,109,463.40	0.10
434	600757	长江传媒	366,898	2,087,649.62	0.09
435	601777	力帆股份	394,830	2,064,960.90	0.09
436	600773	西藏城投	296,086	2,048,915.12	0.09
437	002699	美盛文化	108,720	2,039,587.20	0.09
438	002414	高德红外	150,986	2,029,251.84	0.09
439	600006	东风汽车	489,935	2,003,834.15	0.09
440	002920	德赛西威	66,831	1,998,246.90	0.09
441	600759	洲际油气	501,770	1,976,973.80	0.09
442	603328	依顿电子	182,124	1,976,045.40	0.09

443	600640	号百控股	193,177	1,964,610.09	0.09
444	002663	普邦股份	660,992	1,963,146.24	0.09
445	600657	信达地产	459,610	1,953,342.50	0.09
446	600335	国机汽车	184,528	1,924,627.04	0.09
447	601127	小康股份	111,306	1,924,480.74	0.09
448	600639	浦东金桥	154,018	1,922,144.64	0.09
449	000587	金洲慈航	386,208	1,915,591.68	0.09
450	002344	海宁皮城	391,682	1,903,574.52	0.09
451	002190	成飞集成	109,900	1,878,191.00	0.08
452	002261	拓维信息	407,087	1,872,600.20	0.08
453	002588	史丹利	359,085	1,860,060.30	0.08
454	600428	中远海特	516,900	1,834,995.00	0.08
455	600458	时代新材	247,406	1,820,908.16	0.08
456	002011	盾安环境	281,943	1,804,435.20	0.08
457	002422	科伦药业	56,023	1,798,338.30	0.08
458	603868	飞科电器	36,961	1,787,803.57	0.08
459	600687	刚泰控股	195,740	1,779,276.60	0.08
460	603056	德邦股份	64,100	1,755,699.00	0.08
461	000806	银河生物	404,700	1,752,351.00	0.08
462	300202	聚龙股份	165,607	1,727,281.01	0.08
463	300291	华录百纳	244,876	1,726,375.80	0.08
464	600748	上实发展	340,449	1,715,862.96	0.08
465	000669	金鸿控股	232,419	1,685,037.75	0.08
466	600651	飞乐音响	427,156	1,665,908.40	0.08
467	300032	金龙机电	296,700	1,664,487.00	0.08
468	600350	山东高速	410,100	1,660,905.00	0.08
469	600939	重庆建工	333,611	1,648,038.34	0.07
470	300116	坚瑞沃能	596,300	1,645,788.00	0.07
471	300134	大富科技	178,918	1,599,526.92	0.07
472	002479	富春环保	282,158	1,594,192.70	0.07
473	002342	巨力索具	420,562	1,593,929.98	0.07
474	600516	方大炭素	65,104	1,587,235.52	0.07
475	603355	莱克电气	52,661	1,582,463.05	0.07
476	000025	特力 A	49,000	1,576,330.00	0.07
477	600184	光电股份	126,801	1,571,064.39	0.07
478	600862	中航高科	253,300	1,557,795.00	0.07
479	600880	博瑞传播	363,300	1,547,658.00	0.07
480	002005	德豪润达	353,956	1,543,248.16	0.07
481	600517	置信电气	415,019	1,535,570.30	0.07
482	300043	星辉娱乐	381,209	1,524,836.00	0.07
483	600481	双良节能	495,948	1,517,600.88	0.07
484	603377	东方时尚	107,904	1,494,470.40	0.07
485	002041	登海种业	218,308	1,488,860.56	0.07
486	600743	华远地产	575,728	1,479,620.96	0.07

487	603806	福斯特	65,515	1,441,985.15	0.07
488	600996	贵广网络	193,947	1,439,086.74	0.06
489	600126	杭钢股份	235,811	1,407,791.67	0.06
490	600167	联美控股	139,600	1,396,000.00	0.06
491	603877	太平鸟	41,548	1,384,794.84	0.06
492	600292	远达环保	235,786	1,384,063.82	0.06
493	002405	四维图新	67,347	1,363,776.75	0.06
494	603225	新凤鸣	68,140	1,360,755.80	0.06
495	600053	九鼎投资	78,763	1,352,360.71	0.06
496	002416	爱施德	229,562	1,347,528.94	0.06
497	601019	山东出版	166,974	1,337,461.74	0.06
498	601020	华钰矿业	96,000	1,323,840.00	0.06
499	601969	海南矿业	239,016	1,309,807.68	0.06
500	600176	中国巨石	126,966	1,298,862.18	0.06
501	603169	兰石重装	256,886	1,286,998.86	0.06
502	000987	越秀金控	160,600	1,262,316.00	0.06
503	000761	本钢板材	291,650	1,178,266.00	0.05
504	600618	氯碱化工	137,962	1,174,056.62	0.05
505	002001	新和成	58,829	1,115,397.84	0.05
506	000786	北新建材	57,767	1,070,422.51	0.05
507	002050	三花智控	55,112	1,038,861.20	0.05
508	002271	东方雨虹	58,010	986,750.10	0.04
509	603025	大豪科技	48,680	941,471.20	0.04
510	601811	新华文轩	96,513	938,106.36	0.04
511	000998	隆平高科	48,208	909,202.88	0.04
512	002311	海大集团	40,771	860,268.10	0.04
513	600917	重庆燃气	117,600	800,856.00	0.04
514	000050	深天马 A	55,820	793,760.40	0.04
515	603569	长久物流	53,020	757,125.60	0.03
516	600346	恒力股份	48,800	715,408.00	0.03
517	600566	济川药业	14,815	713,934.85	0.03
518	601699	潞安环能	72,694	673,146.44	0.03
519	600438	通威股份	94,300	650,670.00	0.03
520	000981	银亿股份	78,509	584,892.05	0.03
521	002032	苏泊尔	10,508	541,162.00	0.02
522	601231	环旭电子	40,108	363,779.56	0.02
523	000693	*ST 华泽	109,768	363,332.08	0.02
524	002123	梦网集团	35,600	316,484.00	0.01
525	002063	远光软件	32,026	270,939.96	0.01
526	600587	新华医疗	19,642	267,720.46	0.01
527	600059	古越龙山	30,381	247,605.15	0.01
528	600284	浦东建设	49,462	241,374.56	0.01
529	002269	美邦服饰	82,296	238,658.40	0.01
530	002106	莱宝高科	39,619	228,205.44	0.01



531	000680	山推股份	65,175	224,202.00	0.01
532	300147	香雪制药	31,076	224,057.96	0.01
533	002168	深圳惠程	21,746	223,548.88	0.01
534	002122	*ST 天马	108,473	219,115.46	0.01
535	000652	泰达股份	69,174	215,822.88	0.01
536	000777	中核科技	21,148	197,522.32	0.01
537	000897	津滨发展	86,133	194,660.58	0.01
538	000099	中信海直	28,847	183,466.92	0.01
539	002325	洪涛股份	49,105	181,688.50	0.01
540	601002	晋亿实业	28,909	176,633.99	0.01
541	600826	兰生股份	12,993	176,315.01	0.01
542	600628	新世界	24,202	173,770.36	0.01
543	600894	广日股份	27,974	165,885.82	0.01
544	002392	北京利尔	46,744	158,929.60	0.01
545	000662	天夏智慧	22,992	147,838.56	0.01
546	002551	尚荣医疗	23,131	142,255.65	0.01
547	600776	东方通信	29,178	141,221.52	0.01
548	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
549	603001	奥康国际	10,330	123,030.30	0.01
550	603528	多伦科技	15,200	120,688.00	0.01
551	000816	*ST 慧业	74,109	118,574.40	0.01
552	002018	*ST 华信	77,873	112,915.85	0.01
553	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.01
554	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.00
555	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.00
556	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
557	600289	*ST 信通	25,903	62,685.26	0.00
558	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
559	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
560	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
561	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	10,218,693.34	0.71
2	002129	中环股份	8,841,342.76	0.62
3	000830	鲁西化工	8,619,894.39	0.60

4	002049	紫光国微	8,591,370.93	0.60
5	002465	海格通信	8,394,708.32	0.59
6	000703	恒逸石化	8,336,898.50	0.58
7	002410	广联达	7,943,717.67	0.55
8	600760	中航沈飞	7,685,793.00	0.54
9	002340	格林美	7,407,555.65	0.52
10	300315	掌趣科技	7,374,584.00	0.51
11	002078	太阳纸业	7,319,016.28	0.51
12	000418	小天鹅 A	7,214,167.24	0.50
13	000513	丽珠集团	7,007,905.31	0.49
14	002589	瑞康医药	6,952,760.54	0.48
15	002110	三钢闽光	6,939,731.00	0.48
16	300418	昆仑万维	6,914,295.00	0.48
17	002092	中泰化学	6,899,174.43	0.48
18	000750	国海证券	6,694,312.38	0.47
19	000977	浪潮信息	6,606,488.75	0.46
20	002268	卫士通	6,568,358.31	0.46

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（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，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	14,667,894.02	1.02
2	002405	四维图新	12,535,171.87	0.87
3	000786	北新建材	10,127,602.96	0.71
4	600516	方大炭素	9,847,008.93	0.69
5	002271	东方雨虹	9,569,436.40	0.67
6	002001	新和成	8,883,332.50	0.62
7	600176	中国巨石	8,459,180.00	0.59
8	002050	三花智控	8,123,720.91	0.57
9	000998	隆平高科	7,781,160.10	0.54
10	002311	海大集团	7,607,140.43	0.53
11	000050	深天马 A	7,317,641.00	0.51
12	000981	银亿股份	5,598,748.16	0.39
13	002410	广联达	4,577,357.10	0.32
14	600346	恒力股份	4,429,008.00	0.31
15	600566	济川药业	4,168,644.00	0.29
16	600438	通威股份	4,105,327.00	0.29

17	002032	苏泊尔	4,038,029.60	0.28
18	601699	潞安环能	3,990,374.17	0.28
19	000661	长春高新	3,564,694.40	0.25
20	000830	鲁西化工	3,308,222.97	0.23

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,189,069,763.34
卖出股票收入（成交）总额	479,535,043.67

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1807	IC1807	25.00	25,940,000.00	-2,490,560.00	-
公允价值变动总额合计					-2,490,560.00
股指期货投资本期收益					-691,740.58

股指期货投资本期公允价值变动	-2,918,120.00
----------------	---------------

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情况。

**7.12.2** 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,683,704.43
2	应收证券清算款	1,493,081.98
3	应收股利	-
4	应收利息	17,574.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,194,360.89

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
3,364	449,773.58	1,448,765,645.00	95.75%	64,272,674.00	4.25%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人民人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	110,000,000.00	7.27%
2	中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—008C—CT001 沪	68,220,000.00	4.51%
3	财通证券股份有限公司	42,000,000.00	2.78%
4	中国人民健康保险股份有限公司—传统—普通保险产品	12,214,900.00	0.81%
5	白洞明	11,921,700.00	0.79%
6	国信证券股份有限公司	9,045,200.00	0.60%
7	方正证券股份有限公司	4,117,135.00	0.27%
8	兴全基金—兴业银行—兴全—FOF 投资 1 号特定多客户资产管理计划	3,000,000.00	0.20%
9	中国工商银行股份有限公司—中融量化精选混合型	2,889,500.00	0.19%

	基金中基金 (FOF)		
10	张逸耀	1,945,000.00	0.13%
11	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,192,190,277.00	78.79%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 4 月 11 日) 基金份额总额	425,038,319.00
本报告期期初基金份额总额	825,038,319.00
本报告期基金总申购份额	1,048,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	360,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,513,038,319.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	4	67,928,156.69	4.09%	63,261.86	4.09%	-
光大证券	3	478,132,693.44	28.77%	445,284.43	28.77%	-
申万宏源	6	1,115,869,026.44	67.14%	1,039,215.34	67.14%	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	8	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
方正证券	7	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
中银国际	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中泰证券	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
首创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；



(5) 能积极为公司投资业务的开展, 提供良好的信息交流和客户服务;

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程:

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估, 确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议, 并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	131,246.60	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证 500 交易型开放式指数证	1	20180101-20180630	783,363,770.00	833,065,407.00	424,238,900.00	1,192,190,277.00	78.79%

券 投 资 基 金 联 接 基 金 (LOF)							
产品特有风险							
<p>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及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；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。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照

### 12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日