

华泰柏瑞中证 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：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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，投资者在做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 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	63
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	63
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.....	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	64
§8 基金份额持有人信息.....	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69

10.8 其他重大事件.....	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
备查文件目录.....	75
11.3 备查文件目录.....	75
11.4 存放地点.....	75
11.5 查阅方式.....	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	274,429,801.00 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 6 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
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。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

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	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-888-0001		95566
传真	021-38601799		010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层		北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层		北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135		100818
法定代表人	贾波		陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§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 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-5,134,996.67
本期利润	-46,067,694.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1902
本期加权平均净值利润率	-15.37%
本期基金份额净值增长率	-15.36%
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	-250,827,298.26
期末可供分配基金份额利润	-0.9140
期末基金资产净值	301,165,831.39
期末基金份额净值	1.0974
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	-44.38%

注：1、上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、对期末可供分配利润，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。

3.2 基金净值表现

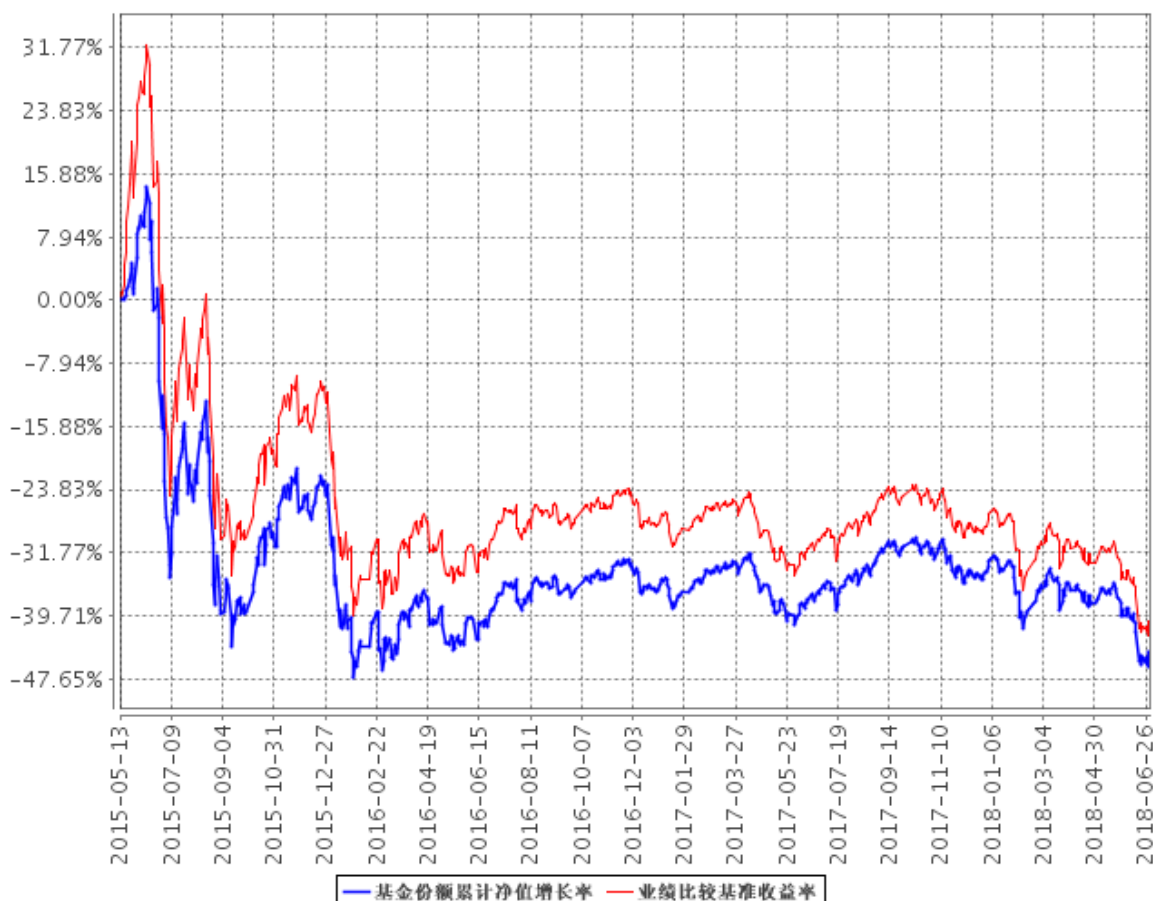
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.82%	1.85%	-9.33%	1.86%	0.51%	-0.01%
过去三个月	-13.60%	1.37%	-14.67%	1.38%	1.07%	-0.01%
过去六个月	-15.36%	1.42%	-16.53%	1.44%	1.17%	-0.02%
过去一年	-12.64%	1.20%	-14.99%	1.22%	2.35%	-0.02%
过去三年	-36.79%	1.89%	-41.41%	1.90%	4.62%	-0.01%

自基金合同生效起至今	-44.38%	1.94%	-40.34%	1.98%	-4.04%	-0.04%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2018 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（四）投资范围中规定的比例，即投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。

3.3 其他指标

注：无。

§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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置

混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金。截至 2018 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 886.17 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		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2015 年 5 月 13 日	-	17 年	17 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起任指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏

					<p>瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

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法》、《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》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年 A 股市场整体表现不佳。今年 1 月中上旬市场迎来了短暂的开门红，以沪深 300 为代表的蓝筹股票表现优异。不过 1 月下旬后，在国内去杠杆以及中美贸易关系持续紧张的背景下，市场开始持续至半年末的大幅调整，期间沪深 300、中证 500 和中证 1000 的调整幅度均达到 20% 左右。尽管市场整体表现不佳，不过期间以食品饮料、医药生物和休闲服务为代表的大消费股票表现出了较好的抗跌性。经过近几个月市场的连续调整，A 股的整体估值水平已经逐渐接近历史低位，截至 6 月底，沪深 300 的市盈率为 11.89 倍，估值已回落至 2016 年年初市场熔断后的水平；中证 500 的市盈率为 22.41 倍，处于 2010 年以来中证 500 指数估值 1% 分位数的低位。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 1.163%，日均绝对跟踪偏离度为 0.022%，期间日跟踪误差为 0.027%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0974 元；本报告期基金份额净值增长率为 -15.36%，业绩比较基准收益率为 -16.53%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年市场表现，我们认为对当前市场过于悲观已无必要。目前中国经济依然向好，在金融去杠杆的大背景下仍表现出较好的韧性，A股市场盈利改善仍在持续，今年一季报全部A股归属于母公司净利润同比增速达到14.86%。股票市场在经历近几个月的持续调整后，估值已经降至历史偏低水平，这为投资者提供较高的安全边际。我们认为，下半年市场有望逐渐企稳，弱市中投资者可重点关注具有稳定业绩增长、估值合理和高分红的大盘蓝筹股票。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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，方可进行收益分配；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的100%。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,165,235.32	3,519,943.15
结算备付金		59,339.08	9,048.65
存出保证金		18,173.13	15,012.80
交易性金融资产	6.4.7.2	296,355,599.30	264,585,100.33
其中：股票投资		296,355,599.30	264,585,100.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,364,301.21	168,934.31
应收利息	6.4.7.5	816.43	528.59
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		301,963,464.47	268,298,567.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		64,429.86	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		124,953.94	113,442.18
应付托管费		24,990.77	22,688.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	87,363.73	75,395.49

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	495,894.78	420,897.20
负债合计		797,633.08	632,423.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	551,993,129.65	415,216,683.82
未分配利润	6.4.7.10	-250,827,298.26	-147,550,539.32
所有者权益合计		301,165,831.39	267,666,144.50
负债和所有者权益总计		301,963,464.47	268,298,567.83

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0974 元，基金份额总额 274,429,801.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 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 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
一、收入		-44,668,122.60	4,457,848.25
1.利息收入		20,851.88	13,570.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,848.84	13,561.84
债券利息收入		3.04	8.47
资产支持证券利息收入		0.00	0.00
买入返售金融资产收入		0.00	0.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,116,636.27	-12,685,327.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,218,021.25	-14,369,785.66
基金投资收益		0.00	0.00
债券投资收益	6.4.7.13	591.46	1,915.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	0.00	0.00
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	0.00	0.00
股利收益	6.4.7.16	2,100,793.52	1,682,543.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-40,932,698.15	17,030,449.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填		0.00	0.00

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	360,359.94	99,155.76
减：二、费用		1,399,572.22	1,463,039.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	741,714.44	782,375.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	148,342.89	156,475.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	0.00	0.00
4. 交易费用	6.4.7.19	199,446.16	195,113.01
5. 利息支出		0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出		0.00	0.00
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	310,068.73	329,076.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-46,067,694.82	2,994,808.87
减：所得税费用		0.00	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-46,067,694.82	2,994,808.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 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）	415,216,683.82	-147,550,539.32	267,666,144.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-46,067,694.82	-46,067,694.82
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）	136,776,445.83	-57,209,064.12	79,567,381.71
其中：1. 基金申购款	164,936,302.33	-67,288,795.24	97,647,507.09
2. 基金赎回款	-28,159,856.50	10,079,731.12	-18,080,125.38
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）	551,993,129.65	-250,827,298.26	301,165,831.39
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）	535,901,783.09	-195,610,327.72	340,291,455.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,994,808.87	2,994,808.87
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）	-52,296,876.35	17,430,660.63	-34,866,215.72
其中：1. 基金申购款	36,205,529.79	-13,846,539.80	22,358,989.99
2. 基金赎回款	-88,502,406.14	31,277,200.43	-57,225,205.71
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）	-	-6,394,315.13	-6,394,315.13
五、期末所有者权益（基金净值）	483,604,906.74	-181,579,173.35	302,025,733.39

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：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 赵景云 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]508 号《关于核准华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中

《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 873,771,921.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,140.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 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，本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.49716235，并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意，本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资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%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 8 月 25 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金

会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利

息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c)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。

(d)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。

(e)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	4,165,235.32
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,165,235.32

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	391,915,100.76	296,355,599.30	-95,559,501.46
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	391,915,100.76	296,355,599.30	-95,559,501.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	781.63
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	26.70
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	8.10
合计	816.43

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	87,363.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	87,363.73

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	258,271.27
可退替代款	106,718.80
应付替代款	130,904.71
合计	495,894.78

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	206,429,801.00	415,216,683.82
本期申购	82,000,000.00	164,936,302.33
本期赎回(以“-”号填列)	-14,000,000.00	-28,159,856.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	274,429,801.00	551,993,129.65

注：1. 投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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	-68,918,848.33	-78,631,690.99	-147,550,539.32
本期利润	-5,134,996.67	-40,932,698.15	-46,067,694.82
本期基金份额交易产生的变动数	-23,349,938.83	-33,859,125.29	-57,209,064.12
其中：基金申购款	-28,115,116.93	-39,173,678.31	-67,288,795.24
基金赎回款	4,765,178.10	5,314,553.02	10,079,731.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-97,403,783.83	-153,423,514.43	-250,827,298.26

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	19,463.73
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	1,251.26
其他	133.85
合计	20,848.84

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	-4,854,891.25
股票投资收益——赎回差价收入	-1,363,130.00
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-6,218,021.25

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	50,534,594.33
减：卖出股票成本总额	55,389,485.58
买卖股票差价收入	-4,854,891.25

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	18,080,125.38
减：现金支付赎回款总额	9,980,828.38
减：赎回股票成本总额	9,462,427.00
赎回差价收入	-1,363,130.00

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	591.46
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	591.46

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,594.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,000.00

减：应收利息总额	3.04
买卖债券差价收入	591.46

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,100,793.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,100,793.52

6.4.7.17 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	-40,932,698.15
——股票投资	-40,932,698.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-40,932,698.15

6.4.7.18 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	-
替代损益	360,359.94
合计	360,359.94

6.4.7.19 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	199,446.16
银行间市场交易费用	-

合计	199,446.16
----	------------

6.4.7.20 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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	1,797.46
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	310,068.73

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至报告日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

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

注：本报告期本基金及上年度可比期间与关联方未进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	741,714.44	782,375.12
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如

下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ H为每日应支付的管理人报酬 E为前一日的基金资产净值
基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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	148,342.89	156,475.08

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ H为每日应支付的托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

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

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的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

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2018年6月30日		2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国银行股份有限公司—华泰柏瑞中证500交易型开	142,829,928.00	52.0461%	102,805,231.00	49.8015%

放式指数证券				
--------	--	--	--	--

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
中国银行	4,165,235.32	19,463.73	4,420,239.34	12,601.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1

注：本报告期内本基金未实行利润分配。

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
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大资产重组	6.00	-	-	177,992	837,936.25	1,067,952.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大资产重组	2.02	2018年8月16日	1.83	516,980	1,119,211.56	1,044,299.60	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	231,276	1,462,339.46	994,486.80	-
002408	齐翔腾达	2018年6月21日	重大资产重组	12.28	-	-	72,367	711,699.97	888,666.76	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项	19.58	2018年8月21日	17.62	41,900	958,676.93	820,402.00	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大资产	19.99	2018年7月2日	17.99	38,373	1,021,377.06	767,076.27	-

			重组							
300146	汤臣倍健	2018年4月9日	重大资产重组	16.60	2018年7月31日	16.50	46,000	533,499.36	763,600.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大资产重组	12.89	2018年7月9日	11.60	52,624	1,115,460.82	678,323.36	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大资产重组	9.49	-	-	69,544	890,365.54	659,972.56	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项	11.55	-	-	52,611	1,054,940.28	607,657.05	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项	3.60	2018年7月3日	3.26	168,700	707,944.50	607,320.00	-
600158	中体产业	2018年3月27日	重大资产重组	11.64	2018年7月16日	11.61	51,570	1,202,665.12	600,274.80	-
002051	中工国际	2018年4月9日	重大资产重组	15.27	-	-	39,254	646,686.94	599,408.58	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大资产	5.37	-	-	109,050	861,180.56	585,598.50	-

			重组							
002665	首航节能	2018年5月29日	重大资产重组	5.80	-	-	100,014	953,720.58	580,081.20	-
600122	宏图高科	2018年6月26日	重大资产重组	7.40	-	-	74,077	1,041,473.14	548,169.80	-
600848	上海临港	2018年6月15日	重大资产重组	21.67	-	-	24,400	521,022.80	528,748.00	-
600751	海航科技	2018年1月12日	重大资产重组	6.49	-	-	80,770	707,061.17	524,197.30	-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项	6.71	-	-	78,049	803,605.28	523,708.79	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大资产重组	4.99	2018年7月2日	4.74	103,870	763,354.74	518,311.30	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项	3.31	-	-	151,388	824,147.26	501,094.28	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项	9.70	-	-	51,000	846,058.84	494,700.00	-

002147	新光圆成	2018年1月18日	重大资产重组	14.76	-	-	32,200	394,844.35	475,272.00	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事件	7.21	-	-	61,093	497,383.39	440,480.53	-
600086	东方金钰	2018年1月19日	重大资产重组	10.04	-	-	42,392	624,716.84	425,615.68	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大资产重组	6.20	2018年8月13日	5.57	65,851	664,090.81	408,276.20	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	重大事件	4.96	2018年7月2日	4.46	72,556	755,681.55	359,877.76	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	重大资产重组	3.94	-	-	89,271	813,635.58	351,727.74	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重大资产重组	17.75	2018年8月1日	16.12	19,365	493,183.37	343,728.75	-
000008	神州高铁	2018年6月8日	重大事件	4.96	2018年8月7日	4.46	67,400	366,585.00	334,304.00	-
002699	美盛	2018年	重大	18.76	2018年	16.88	17,690	359,194.80	331,864.40	-

	文化	2月5日	资产重组		7月2日					
600687	刚泰控股	2018年6月11日	重要事项未公告	9.09	2018年8月20日	8.18	35,658	524,599.34	324,131.22	-
600335	国机汽车	2018年4月2日	重大资产重组	10.43	-	-	30,718	456,542.64	320,388.74	-
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大资产重组	4.36	2018年7月2日	3.92	65,615	670,349.31	286,081.40	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大资产重组	6.40	-	-	42,413	568,160.16	271,443.20	-
000669	金鸿控股	2018年5月18日	重大资产重组	7.25	2018年8月6日	6.53	36,960	604,479.55	267,960.00	-

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，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余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，

或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

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个月以内	1-3个月	3个月- 1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,165,235.32	-	-	-	-	-	4,165,235.32
结算备付金	59,339.08	-	-	-	-	-	59,339.08
存出保证金	18,173.13	-	-	-	-	-	18,173.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	296,356,075.96	296,356,075.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,299,871.35	1,299,871.35
应收利息	-	-	-	-	-	816.43	816.43
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,242,747.53	-	-	-	-	297,656,763.74	301,899,511.27
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,953.94	124,953.94
应付托管费	-	-	-	-	-	24,990.77	24,990.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	87,363.73	87,363.73
其他负债	-	-	-	-	-	496,371.44	496,371.44
负债总计	-	-	-	-	-	733,679.88	733,679.88

利率敏感度缺口	4,242,747.53	-	-	-	-	-296,923,083.86	301,165,831.39
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,519,943.15	-	-	-	-	-	3,519,943.15
结算备付金	9,048.65	-	-	-	-	-	9,048.65
存出保证金	15,012.80	-	-	-	-	-	15,012.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-264,585,100.33	264,585,100.33
应收证券清算款	-	-	-	-	-	168,934.31	168,934.31
应收利息	-	-	-	-	-	528.59	528.59
资产总计	3,544,004.60	-	-	-	-	-264,754,563.23	268,298,567.83
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	113,442.18	113,442.18
应付托管费	-	-	-	-	-	22,688.46	22,688.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	75,395.49	75,395.49
其他负债	-	-	-	-	-	420,897.20	420,897.20
负债总计	-	-	-	-	-	632,423.33	632,423.33
利率敏感度缺口	3,544,004.60	-	-	-	-	-264,122,139.90	267,666,144.50

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，

对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	296,355,599.30	98.40	264,585,100.33	98.85
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	296,355,599.30	98.40	264,585,100.33	98.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数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：人民币万元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%		1,558.14
中证 500 指数下降 5%		-1,558.14	-1,377.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§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	296,355,599.30	98.14
	其中：股票	296,355,599.30	98.14
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	4,224,574.40	1.40
8	其他各项资产	1,383,290.77	0.46
9	合计	301,963,464.47	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,122,804.82	1.04
B	采矿业	9,320,977.52	3.09
C	制造业	175,194,057.49	58.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,415,531.12	3.13
E	建筑业	4,858,200.37	1.61
F	批发和零售业	15,933,447.83	5.29
G	交通运输、仓储和邮政业	10,411,173.73	3.46
H	住宿和餐饮业	1,598,146.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服	25,768,449.13	8.56

	务业		
J	金融业	7,349,213.20	2.44
K	房地产业	15,892,370.28	5.28
L	租赁和商务服务业	5,463,596.25	1.81
M	科学研究和技术服务业	491,611.50	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	2,396,732.06	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	198,055.00	0.07
Q	卫生和社会工作	444,776.97	0.15
R	文化、体育和娱乐业	6,097,341.37	2.02
S	综合	2,398,638.00	0.80
	合计	296,355,122.64	98.40

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	11,565	2,633,350.50	0.87
2	603019	中科曙光	38,037	1,744,757.19	0.58
3	600521	华海药业	63,428	1,692,893.32	0.56
4	600201	生物股份	98,836	1,689,107.24	0.56
5	600426	华鲁恒升	95,501	1,679,862.59	0.56
6	002049	紫光国微	36,000	1,588,320.00	0.53
7	002410	广联达	56,422	1,564,582.06	0.52
8	603589	口子窖	25,352	1,557,880.40	0.52
9	000977	浪潮信息	65,261	1,556,474.85	0.52
10	600298	安琪酵母	41,550	1,482,504.00	0.49
11	000830	鲁西化工	86,033	1,469,443.64	0.49
12	000703	恒逸石化	96,980	1,443,062.40	0.48
13	600256	广汇能源	340,238	1,391,573.42	0.46
14	600584	长电科技	80,199	1,358,571.06	0.45

15	002340	格林美	224,466	1,358,019.30	0.45
16	002038	双鹭药业	34,909	1,326,192.91	0.44
17	601233	桐昆股份	76,974	1,325,492.28	0.44
18	600879	航天电子	182,778	1,284,929.34	0.43
19	600872	中炬高新	45,593	1,276,604.00	0.42
20	600760	中航沈飞	35,400	1,275,816.00	0.42
21	600600	青岛啤酒	29,100	1,275,453.00	0.42
22	600673	东阳光科	123,470	1,275,445.10	0.42
23	002078	太阳纸业	131,196	1,271,289.24	0.42
24	002179	中航光电	32,506	1,267,734.00	0.42
25	000418	小天鹅 A	18,228	1,264,111.80	0.42
26	000860	顺鑫农业	33,200	1,245,000.00	0.41
27	002129	中环股份	155,300	1,215,999.00	0.40
28	002589	瑞康医药	88,345	1,205,025.80	0.40
29	300253	卫宁健康	95,421	1,182,266.19	0.39
30	600525	长园集团	109,918	1,161,833.26	0.39
31	600642	申能股份	229,963	1,154,414.26	0.38
32	300383	光环新网	84,940	1,139,045.40	0.38
33	600004	白云机场	85,800	1,123,122.00	0.37
34	600315	上海家化	28,215	1,118,160.45	0.37
35	600885	宏发股份	37,360	1,117,811.20	0.37
36	600258	首旅酒店	41,000	1,113,970.00	0.37
37	600325	华发股份	142,302	1,099,994.46	0.37
38	000581	威孚高科	49,528	1,095,064.08	0.36
39	002465	海格通信	135,900	1,091,277.00	0.36
40	002268	卫士通	49,640	1,083,641.20	0.36
41	600392	盛和资源	66,670	1,082,054.10	0.36
42	000656	金科股份	224,364	1,076,947.20	0.36
43	000825	太钢不锈	177,992	1,067,952.00	0.35
44	000066	中国长城	148,734	1,057,498.74	0.35
45	600079	人福医药	79,856	1,055,696.32	0.35
46	002092	中泰化学	108,424	1,045,207.36	0.35
47	600022	山东钢铁	516,980	1,044,299.60	0.35
48	000513	丽珠集团	23,614	1,037,835.30	0.34
49	600884	杉杉股份	46,921	1,036,954.10	0.34
50	601168	西部矿业	160,608	1,008,618.24	0.33
51	000690	宝新能源	144,757	1,007,508.72	0.33
52	600811	东方集团	231,276	994,486.80	0.33
53	002223	鱼跃医疗	50,823	990,540.27	0.33

54	000039	中集集团	74,119	984,300.32	0.33
55	600138	中青旅	49,033	977,227.69	0.32
56	300315	掌趣科技	231,900	969,342.00	0.32
57	600260	凯乐科技	35,978	965,649.52	0.32
58	000488	晨鸣纸业	74,608	963,935.36	0.32
59	002127	南极电商	102,500	962,475.00	0.32
60	603369	今世缘	42,100	961,143.00	0.32
61	600528	中铁工业	93,400	954,548.00	0.32
62	002195	二三四五	221,885	949,667.80	0.32
63	002439	启明星辰	44,637	947,197.14	0.31
64	600718	东软集团	72,200	942,932.00	0.31
65	002176	江特电机	96,700	939,924.00	0.31
66	000636	风华高科	58,574	930,155.12	0.31
67	002110	三钢闽光	57,600	923,328.00	0.31
68	002013	中航机电	121,546	920,103.22	0.31
69	300418	昆仑万维	48,700	919,456.00	0.31
70	000997	新大陆	58,378	919,453.50	0.31
71	300166	东方国信	62,299	917,664.27	0.30
72	600062	华润双鹤	36,805	903,562.75	0.30
73	600967	内蒙一机	70,900	903,266.00	0.30
74	000887	中鼎股份	62,635	902,570.35	0.30
75	600808	马钢股份	250,835	900,497.65	0.30
76	002019	亿帆医药	50,983	899,849.95	0.30
77	600643	爱建集团	95,547	898,141.80	0.30
78	300088	长信科技	154,535	896,303.00	0.30
79	002408	齐翔腾达	72,367	888,666.76	0.30
80	000999	华润三九	31,862	886,719.46	0.29
81	600060	海信电器	66,182	886,176.98	0.29
82	000009	中国宝安	180,705	885,454.50	0.29
83	000750	国海证券	248,000	885,360.00	0.29
84	600839	四川长虹	307,680	879,964.80	0.29
85	000596	古井贡酒	9,888	877,856.64	0.29
86	002384	东山精密	36,305	871,320.00	0.29
87	000778	新兴铸管	201,589	862,800.92	0.29
88	000975	银泰资源	83,296	844,621.44	0.28
89	000681	视觉中国	29,324	841,598.80	0.28
90	600160	巨化股份	114,292	836,617.44	0.28
91	600143	金发科技	160,201	836,249.22	0.28
92	002183	怡亚通	124,728	829,441.20	0.28

93	000960	锡业股份	68,500	822,685.00	0.27
94	300182	捷成股份	108,393	821,618.94	0.27
95	002359	北讯集团	41,900	820,402.00	0.27
96	600282	南钢股份	185,268	818,884.56	0.27
97	600183	生益科技	89,312	818,097.92	0.27
98	000732	泰禾集团	41,843	813,846.35	0.27
99	600410	华胜天成	92,872	812,630.00	0.27
100	002221	东华能源	83,144	812,316.88	0.27
101	000930	中粮生化	78,811	811,753.30	0.27
102	600388	龙净环保	63,247	808,296.66	0.27
103	002373	千方科技	61,898	807,768.90	0.27
104	600460	士兰微	65,984	805,004.80	0.27
105	603816	顾家家居	10,900	801,259.00	0.27
106	600056	中国医药	43,795	800,134.65	0.27
107	000729	燕京啤酒	118,817	799,638.41	0.27
108	002506	协鑫集成	170,074	795,946.32	0.26
109	600655	豫园股份	83,603	790,048.35	0.26
110	600166	福田汽车	388,702	789,065.06	0.26
111	600380	健康元	66,326	786,626.36	0.26
112	600572	康恩贝	109,442	784,699.14	0.26
113	002640	跨境通	52,200	784,044.00	0.26
114	603077	和邦生物	445,960	771,510.80	0.26
115	600755	厦门国贸	105,515	769,204.35	0.26
116	300266	兴源环境	38,373	767,076.27	0.25
117	300146	汤臣倍健	46,000	763,600.00	0.25
118	600094	大名城	131,700	758,592.00	0.25
119	601098	中南传媒	60,000	758,400.00	0.25
120	000686	东北证券	118,300	758,303.00	0.25
121	002407	多氟多	54,000	757,080.00	0.25
122	002371	北方华创	15,126	751,308.42	0.25
123	600895	张江高科	65,100	748,650.00	0.25
124	600266	北京城建	79,268	745,119.20	0.25
125	002174	游族网络	37,400	744,260.00	0.25
126	002028	思源电气	44,261	743,142.19	0.25
127	300274	阳光电源	82,787	742,599.39	0.25
128	603899	晨光文具	23,400	741,546.00	0.25
129	600409	三友化工	85,697	737,851.17	0.24
130	000988	华工科技	50,968	736,487.60	0.24
131	600875	东方电气	99,300	735,813.00	0.24

132	002273	水晶光电	56,484	726,949.08	0.24
133	600499	科达洁能	105,472	723,537.92	0.24
134	600291	西水股份	54,000	721,440.00	0.24
135	002030	达安基因	46,768	721,162.56	0.24
136	600787	中储股份	92,717	717,629.58	0.24
137	300010	立思辰	58,500	716,040.00	0.24
138	600267	海正药业	49,053	713,230.62	0.24
139	002603	以岭药业	50,924	711,917.52	0.24
140	002670	国盛金控	66,085	711,735.45	0.24
141	000528	柳工	66,388	711,015.48	0.24
142	600348	阳泉煤业	99,318	710,123.70	0.24
143	600418	江淮汽车	108,871	708,750.21	0.24
144	002491	通鼎互联	63,934	707,749.38	0.24
145	600161	天坛生物	36,491	706,100.85	0.23
146	000401	冀东水泥	79,568	705,768.16	0.23
147	603885	吉祥航空	45,100	694,991.00	0.23
148	600240	华业资本	94,738	694,429.54	0.23
149	300287	飞利信	96,500	693,835.00	0.23
150	600511	国药股份	25,695	692,480.25	0.23
151	002399	海普瑞	31,200	690,768.00	0.23
152	600827	百联股份	67,400	687,480.00	0.23
153	002281	光迅科技	32,345	685,714.00	0.23
154	600729	重庆百货	20,774	684,503.30	0.23
155	000807	云铝股份	131,800	682,724.00	0.23
156	002244	滨江集团	131,091	681,673.20	0.23
157	000878	云南铜业	71,396	681,117.84	0.23
158	002440	闰土股份	58,063	678,756.47	0.23
159	000566	海南海药	52,624	678,323.36	0.23
160	600978	宜华生活	99,104	676,880.32	0.22
161	000970	中科三环	71,544	668,936.40	0.22
162	300324	旋极信息	69,544	659,972.56	0.22
163	000089	深圳机场	86,010	657,976.50	0.22
164	002353	杰瑞股份	40,338	655,492.50	0.22
165	002517	恺英网络	90,651	651,780.69	0.22
166	600649	城投控股	106,400	651,168.00	0.22
167	600125	铁龙物流	77,163	645,854.31	0.21
168	002299	圣农发展	41,684	645,685.16	0.21
169	600737	中粮糖业	85,600	645,424.00	0.21
170	000078	海王生物	133,784	643,501.04	0.21

171	002563	森马服饰	45,000	643,500.00	0.21
172	601872	招商轮船	178,200	643,302.00	0.21
173	000547	航天发展	81,654	637,717.74	0.21
174	600179	安通控股	62,820	636,366.60	0.21
175	601966	玲珑轮胎	40,300	635,531.00	0.21
176	600270	外运发展	30,258	634,207.68	0.21
177	002583	海能达	75,500	630,425.00	0.21
178	000028	国药一致	12,619	629,688.10	0.21
179	300133	华策影视	59,000	628,350.00	0.21
180	002280	联络互动	109,800	628,056.00	0.21
181	300058	蓝色光标	110,132	627,752.40	0.21
182	600216	浙江医药	49,057	626,457.89	0.21
183	603883	老百姓	7,525	625,779.00	0.21
184	002745	木林森	35,100	624,429.00	0.21
185	000813	德展健康	75,600	622,944.00	0.21
186	002366	台海核电	43,590	621,593.40	0.21
187	002368	太极股份	21,291	618,929.37	0.21
188	300113	顺网科技	35,359	615,600.19	0.20
189	600435	北方导航	75,345	614,815.20	0.20
190	000598	兴蓉环境	150,753	612,057.18	0.20
191	603658	安图生物	7,406	610,698.76	0.20
192	002004	华邦健康	120,023	609,716.84	0.20
193	600466	蓝光发展	98,280	609,336.00	0.20
194	600635	大众公用	163,476	608,130.72	0.20
195	002573	清新环境	52,611	607,657.05	0.20
196	002426	胜利精密	168,700	607,320.00	0.20
197	000553	沙隆达 A	38,400	607,104.00	0.20
198	600575	皖江物流	163,541	606,737.11	0.20
199	600277	亿利洁能	114,911	602,133.64	0.20
200	600801	华新水泥	39,975	600,824.25	0.20
201	600037	歌华有线	58,200	600,624.00	0.20
202	600158	中体产业	51,570	600,274.80	0.20
203	002051	中工国际	39,254	599,408.58	0.20
204	002152	广电运通	101,862	598,948.56	0.20
205	600500	中化国际	86,959	593,060.38	0.20
206	002131	利欧股份	282,384	593,006.40	0.20
207	601179	中国西电	172,700	590,634.00	0.20
208	002600	领益智造	113,800	590,622.00	0.20
209	600970	中材国际	88,237	589,423.16	0.20

210	300055	万邦达	51,240	588,747.60	0.20
211	300197	铁汉生态	109,050	585,598.50	0.19
212	002665	首航节能	100,014	580,081.20	0.19
213	000685	中山公用	72,720	579,578.40	0.19
214	002358	森源电气	38,451	578,687.55	0.19
215	300750	宁德时代	8,016	576,831.36	0.19
216	601000	唐山港	242,475	569,816.25	0.19
217	600563	法拉电子	11,478	568,046.22	0.19
218	002191	劲嘉股份	75,809	566,293.23	0.19
219	300115	长盈精密	43,579	565,219.63	0.19
220	601678	滨化股份	91,146	563,282.28	0.19
221	300199	翰宇药业	39,413	562,817.64	0.19
222	300026	红日药业	152,999	558,446.35	0.19
223	600859	王府井	26,190	557,061.30	0.18
224	600307	酒钢宏兴	263,336	553,005.60	0.18
225	600863	内蒙华电	243,500	552,745.00	0.18
226	600648	外高桥	30,200	552,056.00	0.18
227	002690	美亚光电	23,100	550,704.00	0.18
228	000979	中弘股份	544,687	550,133.87	0.18
229	600122	宏图高科	74,077	548,169.80	0.18
230	600021	上海电力	81,000	545,940.00	0.18
231	600536	中国软件	25,091	542,718.33	0.18
232	002701	奥瑞金	99,176	541,500.96	0.18
233	002709	天赐材料	14,000	539,560.00	0.18
234	600598	北大荒	58,800	538,608.00	0.18
235	002285	世联行	85,753	537,671.31	0.18
236	601128	常熟银行	93,600	535,392.00	0.18
237	000031	中粮地产	91,727	530,182.06	0.18
238	002672	东江环保	40,426	529,176.34	0.18
239	600848	上海临港	24,400	528,748.00	0.18
240	600717	天津港	70,149	528,221.97	0.18
241	600823	世茂股份	125,900	526,262.00	0.17
242	000848	承德露露	49,677	526,079.43	0.17
243	600503	华丽家族	134,530	526,012.30	0.17
244	600064	南京高科	71,418	524,208.12	0.17
245	600751	天海投资	80,770	524,197.30	0.17
246	002431	棕榈股份	78,049	523,708.79	0.17
247	000758	中色股份	115,707	520,681.50	0.17
248	300159	新研股份	73,500	520,380.00	0.17

249	000939	凯迪生态	103,870	518,311.30	0.17
250	600835	上海机电	27,290	514,689.40	0.17
251	000738	航发控制	38,600	514,538.00	0.17
252	600171	上海贝岭	44,403	514,186.74	0.17
253	002390	信邦制药	70,056	512,809.92	0.17
254	600582	天地科技	139,170	510,753.90	0.17
255	600597	光明乳业	51,682	510,101.34	0.17
256	002317	众生药业	48,165	509,104.05	0.17
257	600664	哈药股份	128,214	509,009.58	0.17
258	600881	亚泰集团	135,957	507,119.61	0.17
259	601880	大连港	260,730	505,816.20	0.17
260	002831	裕同科技	10,100	505,000.00	0.17
261	002477	雏鹰农牧	151,388	501,094.28	0.17
262	600614	鹏起科技	87,754	501,075.34	0.17
263	002128	露天煤业	54,996	498,263.76	0.17
264	002266	浙富控股	132,610	497,287.50	0.17
265	600017	日照港	154,879	497,161.59	0.17
266	002512	达华智能	51,000	494,700.00	0.16
267	600039	四川路桥	150,711	494,332.08	0.16
268	000027	深圳能源	99,901	493,510.94	0.16
269	600645	中源协和	25,525	491,611.50	0.16
270	600026	中远海能	115,234	488,592.16	0.16
271	002505	大康农业	228,211	488,371.54	0.16
272	300308	中际旭创	8,100	486,324.00	0.16
273	002056	横店东磁	69,113	484,482.13	0.16
274	600754	锦江股份	13,100	484,176.00	0.16
275	603766	隆鑫通用	89,155	484,111.65	0.16
276	600120	浙江东方	35,668	483,301.40	0.16
277	002180	纳思达	17,600	483,296.00	0.16
278	002155	湖南黄金	70,619	483,033.96	0.16
279	002250	联化科技	54,487	480,575.34	0.16
280	300002	神州泰岳	115,202	480,392.34	0.16
281	600594	益佰制药	53,385	478,329.60	0.16
282	002147	新光圆成	32,200	475,272.00	0.16
283	002444	巨星科技	43,033	473,793.33	0.16
284	000718	苏宁环球	128,100	470,127.00	0.16
285	300001	特锐德	41,300	469,168.00	0.16
286	600623	华谊集团	46,994	469,000.12	0.16
287	002400	省广集团	144,801	467,707.23	0.16

288	000926	福星股份	64,983	467,227.77	0.16
289	603515	欧普照明	9,987	466,792.38	0.15
290	000006	深振业 A	79,649	466,743.14	0.15
291	002332	仙琚制药	53,138	464,957.50	0.15
292	002839	张家港行	76,200	464,058.00	0.15
293	002916	深南电路	7,300	463,623.00	0.15
294	000012	南玻 A	93,380	462,231.00	0.15
295	601200	上海环境	29,100	460,653.00	0.15
296	002212	南洋股份	38,700	460,143.00	0.15
297	600908	无锡银行	77,977	459,284.53	0.15
298	002242	九阳股份	25,911	458,365.59	0.15
299	000667	美好置业	214,650	457,204.50	0.15
300	600633	浙数文化	54,733	456,473.22	0.15
301	000519	中兵红箭	58,748	456,471.96	0.15
302	600329	中新药业	23,900	454,100.00	0.15
303	600936	广西广电	95,200	453,152.00	0.15
304	600557	康缘药业	36,552	451,417.20	0.15
305	002233	塔牌集团	39,109	447,406.96	0.15
306	300244	迪安诊断	23,397	444,776.97	0.15
307	000563	陕国投 A	130,577	443,961.80	0.15
308	600098	广州发展	68,400	441,180.00	0.15
309	000426	兴业矿业	61,093	440,480.53	0.15
310	300257	开山股份	28,760	439,740.40	0.15
311	002354	天神娱乐	46,900	434,294.00	0.14
312	601717	郑煤机	74,700	434,007.00	0.14
313	600993	马应龙	25,491	433,601.91	0.14
314	000727	华东科技	228,887	430,307.56	0.14
315	002635	安洁科技	24,997	429,948.40	0.14
316	600195	中牧股份	21,942	426,771.90	0.14
317	600086	东方金钰	42,392	425,615.68	0.14
318	000021	深科技	62,233	424,429.06	0.14
319	600280	中央商场	48,642	424,158.24	0.14
320	600478	科力远	82,711	421,826.10	0.14
321	600141	兴发集团	35,811	417,198.15	0.14
322	002022	科华生物	34,999	414,738.15	0.14
323	300376	易事特	77,000	413,490.00	0.14
324	000612	焦作万方	78,698	413,164.50	0.14
325	601311	骆驼股份	35,968	412,552.96	0.14
326	002254	泰和新材	36,238	412,388.44	0.14

327	002437	誉衡药业	65,851	408,276.20	0.14
328	002249	大洋电机	94,192	405,967.52	0.13
329	002424	贵州百灵	35,700	405,552.00	0.13
330	002807	江阴银行	72,041	404,870.42	0.13
331	600694	大商股份	12,425	403,936.75	0.13
332	600580	卧龙电气	53,010	403,936.20	0.13
333	000543	皖能电力	90,668	399,845.88	0.13
334	000400	许继电气	51,103	399,114.43	0.13
335	300297	蓝盾股份	49,100	398,201.00	0.13
336	601928	凤凰传媒	64,900	394,592.00	0.13
337	002064	华峰氨纶	95,358	393,828.54	0.13
338	002434	万里扬	44,700	392,466.00	0.13
339	000156	华数传媒	40,700	392,348.00	0.13
340	601016	节能风电	136,700	392,329.00	0.13
341	002002	鸿达兴业	84,908	391,425.88	0.13
342	600770	综艺股份	65,775	388,072.50	0.13
343	000501	鄂武商 A	31,410	386,028.90	0.13
344	600312	平高电气	68,437	385,984.68	0.13
345	002707	众信旅游	39,900	383,040.00	0.13
346	601801	皖新传媒	50,300	382,783.00	0.13
347	600416	湘电股份	53,018	381,199.42	0.13
348	002048	宁波华翔	30,901	381,009.33	0.13
349	601608	中信重工	146,100	379,860.00	0.13
350	600108	亚盛集团	131,354	379,613.06	0.13
351	000158	常山北明	55,180	379,086.60	0.13
352	000712	锦龙股份	37,868	377,922.64	0.13
353	002544	杰赛科技	27,600	377,844.00	0.13
354	600545	卓郎智能	47,545	377,507.30	0.13
355	000090	天健集团	60,739	376,581.80	0.13
356	600777	新潮能源	171,900	376,461.00	0.13
357	002308	威创股份	45,286	375,873.80	0.12
358	600259	广晟有色	12,796	374,666.88	0.12
359	603000	人民网	45,070	374,081.00	0.12
360	000592	平潭发展	130,088	369,449.92	0.12
361	002277	友阿股份	80,043	368,998.23	0.12
362	002503	搜于特	105,284	368,494.00	0.12
363	000937	冀中能源	89,436	367,581.96	0.12
364	600611	大众交通	92,271	367,238.58	0.12
365	600073	上海梅林	55,201	366,534.64	0.12

366	002509	天广中茂	125,600	365,496.00	0.12
367	000980	众泰汽车	51,400	365,454.00	0.12
368	600317	营口港	161,700	365,442.00	0.12
369	002463	沪电股份	97,318	363,969.32	0.12
370	002657	中科金财	22,900	362,736.00	0.12
371	600565	迪马股份	122,700	361,965.00	0.12
372	000587	金洲慈航	72,556	359,877.76	0.12
373	000877	天山股份	53,019	357,878.25	0.12
374	600169	太原重工	151,482	354,467.88	0.12
375	603228	景旺电子	7,133	352,655.52	0.12
376	600759	洲际油气	89,271	351,727.74	0.12
377	002073	软控股份	61,098	351,313.50	0.12
378	600422	昆药集团	45,225	350,493.75	0.12
379	601001	大同煤业	70,108	347,735.68	0.12
380	600366	宁波韵升	56,846	346,760.60	0.12
381	600874	创业环保	36,822	343,917.48	0.11
382	600750	江中药业	19,365	343,728.75	0.11
383	603198	迎驾贡酒	18,700	343,519.00	0.11
384	600578	京能电力	109,500	341,640.00	0.11
385	002815	崇达技术	21,200	341,320.00	0.11
386	000762	西藏矿业	35,366	340,574.58	0.11
387	300156	神雾环保	51,000	340,170.00	0.11
388	600316	洪都航空	36,453	339,741.96	0.11
389	002302	西部建设	31,500	339,255.00	0.11
390	000062	深圳华强	17,246	338,021.60	0.11
391	600395	盘江股份	55,573	337,328.11	0.11
392	600338	西藏珠峰	16,273	337,176.56	0.11
393	000008	神州高铁	67,400	334,304.00	0.11
394	000572	海马汽车	97,463	334,298.09	0.11
395	002489	浙江永强	91,756	333,991.84	0.11
396	600869	智慧能源	70,596	333,213.12	0.11
397	002699	美盛文化	17,690	331,864.40	0.11
398	000600	建投能源	59,390	330,802.30	0.11
399	601689	拓普集团	17,000	330,480.00	0.11
400	000766	通化金马	27,686	328,909.68	0.11
401	600151	航天机电	80,330	326,139.80	0.11
402	002093	国脉科技	42,276	325,947.96	0.11
403	000541	佛山照明	54,406	325,891.94	0.11
404	600687	刚泰控股	35,658	324,131.22	0.11

405	000829	天音控股	44,154	323,648.82	0.11
406	000969	安泰科技	51,524	322,025.00	0.11
407	002428	云南锗业	41,586	321,043.92	0.11
408	600335	国机汽车	30,718	320,388.74	0.11
409	000536	华映科技	116,397	320,091.75	0.11
410	603659	璞泰来	5,000	319,450.00	0.11
411	002345	潮宏基	37,100	319,060.00	0.11
412	002681	奋达科技	36,740	318,168.40	0.11
413	600300	维维股份	97,446	317,673.96	0.11
414	000552	靖远煤电	96,398	315,221.46	0.10
415	300039	上海凯宝	54,129	313,948.20	0.10
416	002251	步步高	27,530	313,291.40	0.10
417	002482	广田集团	51,895	309,813.15	0.10
418	600155	宝硕股份	43,000	309,170.00	0.10
419	300273	和佳股份	45,486	308,395.08	0.10
420	000061	农产品	57,047	308,053.80	0.10
421	002118	紫鑫药业	42,976	307,278.40	0.10
422	002841	视源股份	5,700	304,437.00	0.10
423	002276	万马股份	52,104	304,287.36	0.10
424	600187	国中水务	106,679	302,968.36	0.10
425	600765	中航重机	40,672	302,599.68	0.10
426	600058	五矿发展	36,332	301,918.92	0.10
427	002375	亚厦股份	56,293	300,604.62	0.10
428	603556	海兴电力	16,520	300,168.40	0.10
429	000990	诚志股份	21,408	299,712.00	0.10
430	600971	恒源煤电	41,900	299,166.00	0.10
431	002818	富森美	11,300	298,094.00	0.10
432	000049	德赛电池	10,532	297,213.04	0.10
433	600393	粤泰股份	81,600	295,392.00	0.10
434	603568	伟明环保	11,650	294,745.00	0.10
435	603188	亚邦股份	28,600	291,720.00	0.10
436	600757	长江传媒	51,232	291,510.08	0.10
437	603444	吉比特	2,277	290,977.83	0.10
438	603888	新华网	17,250	290,835.00	0.10
439	002005	德豪润达	65,615	286,081.40	0.09
440	002414	高德红外	21,283	286,043.52	0.09
441	600773	西藏城投	41,329	285,996.68	0.09
442	001696	宗申动力	57,551	281,999.90	0.09
443	002642	荣之联	30,500	280,295.00	0.09

444	601777	力帆股份	53,222	278,351.06	0.09
445	002920	德赛西威	9,300	278,070.00	0.09
446	600006	东风汽车	67,688	276,843.92	0.09
447	600640	号百控股	26,767	272,220.39	0.09
448	600639	浦东金桥	21,765	271,627.20	0.09
449	002011	盾安环境	42,413	271,443.20	0.09
450	000669	金鸿控股	36,960	267,960.00	0.09
451	002663	普邦股份	89,297	265,212.09	0.09
452	600657	信达地产	62,400	265,200.00	0.09
453	603328	依顿电子	24,331	263,991.35	0.09
454	300134	大富科技	29,176	260,833.44	0.09
455	002261	拓维信息	55,700	256,220.00	0.09
456	601127	小康股份	14,800	255,892.00	0.08
457	600428	中远海特	71,484	253,768.20	0.08
458	600880	博瑞传播	59,313	252,673.38	0.08
459	002588	史丹利	47,737	247,277.66	0.08
460	002190	成飞集成	14,443	246,830.87	0.08
461	603056	德邦股份	9,000	246,510.00	0.08
462	600458	时代新材	33,448	246,177.28	0.08
463	300202	聚龙股份	23,336	243,394.48	0.08
464	300291	华录百纳	34,371	242,315.55	0.08
465	000806	银河生物	55,490	240,271.70	0.08
466	002344	海宁皮城	49,129	238,766.94	0.08
467	600748	上实发展	45,324	228,432.96	0.08
468	600350	山东高速	56,400	228,420.00	0.08
469	300116	坚瑞沃能	81,800	225,768.00	0.07
470	600939	重庆建工	45,500	224,770.00	0.07
471	600651	飞乐音响	57,628	224,749.20	0.07
472	300032	金龙机电	38,700	217,107.00	0.07
473	600862	中航高科	35,200	216,480.00	0.07
474	002342	巨力索具	56,598	214,506.42	0.07
475	002479	富春环保	37,792	213,524.80	0.07
476	603355	莱克电气	7,103	213,445.15	0.07
477	600517	置信电气	56,680	209,716.00	0.07
478	300043	星辉娱乐	51,122	204,488.00	0.07
479	600743	华远地产	79,266	203,713.62	0.07
480	600481	双良节能	66,315	202,923.90	0.07
481	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.07
482	002041	登海种业	29,323	199,982.86	0.07

483	603806	福斯特	9,044	199,058.44	0.07
484	600996	贵广网络	26,700	198,114.00	0.07
485	603377	东方时尚	14,300	198,055.00	0.07
486	600167	联美控股	18,900	189,000.00	0.06
487	600053	九鼎投资	11,000	188,870.00	0.06
488	603225	新凤鸣	9,447	188,656.59	0.06
489	600126	杭钢股份	31,533	188,252.01	0.06
490	600184	光电股份	15,100	187,089.00	0.06
491	600292	远达环保	31,580	185,374.60	0.06
492	601019	山东出版	23,000	184,230.00	0.06
493	601969	海南矿业	32,600	178,648.00	0.06
494	000987	越秀金控	22,706	178,469.16	0.06
495	603169	兰石重装	35,600	178,356.00	0.06
496	002416	爱施德	29,720	174,456.40	0.06
497	601020	华钰矿业	12,600	173,754.00	0.06
498	603868	飞科电器	3,466	167,650.42	0.06
499	000025	特力A	5,025	161,654.25	0.05
500	000761	本钢板材	38,172	154,214.88	0.05
501	600618	氯碱化工	17,756	151,103.56	0.05
502	603877	太平鸟	4,494	149,785.02	0.05
503	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.04
504	601811	新华文轩	12,200	118,584.00	0.04
505	603587	地素时尚	2,442	100,879.02	0.03
506	603025	大豪科技	5,141	99,426.94	0.03
507	603569	长久物流	6,920	98,817.60	0.03
508	600917	重庆燃气	14,253	97,062.93	0.03
509	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.03
510	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
511	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
512	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002129	中环股份	1,318,006.00	0.49
2	002465	海格通信	1,290,493.20	0.48
3	600760	中航沈飞	1,233,972.00	0.46
4	300315	掌趣科技	1,153,320.00	0.43
5	600258	首旅酒店	1,082,864.00	0.40
6	300418	昆仑万维	1,006,210.00	0.38
7	000750	国海证券	979,093.50	0.37
8	600528	中铁工业	975,153.00	0.36
9	000703	恒逸石化	915,299.00	0.34
10	002110	三钢闽光	896,668.00	0.33
11	000686	东北证券	857,649.16	0.32
12	601098	中南传媒	811,224.00	0.30
13	600895	张江高科	788,011.99	0.29
14	002600	领益智造	768,073.26	0.29
15	002174	游族网络	767,044.29	0.29
16	002399	海普瑞	766,934.00	0.29
17	600827	百联股份	757,717.81	0.28
18	000813	德展健康	740,711.00	0.28
19	603885	吉祥航空	738,445.00	0.28
20	603899	晨光文具	727,551.00	0.27

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	2,398,028.63	0.90
2	600516	方大炭素	2,394,461.85	0.89
3	600176	中国巨石	2,090,805.00	0.78
4	002405	四维图新	1,837,259.86	0.69
5	000786	北新建材	1,721,397.63	0.64
6	002271	东方雨虹	1,595,373.34	0.60
7	000998	隆平高科	1,432,757.96	0.54
8	002001	新和成	1,381,238.05	0.52

9	002311	海大集团	1,283,772.75	0.48
10	002050	三花智控	1,280,056.88	0.48
11	600346	恒力股份	1,155,671.96	0.43
12	000050	深天马 A	1,141,956.30	0.43
13	600566	济川药业	1,032,510.33	0.39
14	600438	通威股份	987,331.00	0.37
15	000981	银亿股份	956,635.00	0.36
16	601699	潞安环能	938,091.28	0.35
17	300156	神雾环保	772,498.70	0.29
18	002032	苏泊尔	758,109.00	0.28
19	002168	深圳惠程	674,648.00	0.25
20	601231	环旭电子	570,877.00	0.21

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	99,824,904.70
卖出股票收入（成交）总额	50,534,594.33

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

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	18,173.13
2	应收证券清算款	1,364,301.21
3	应收股利	-
4	应收利息	816.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,383,290.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,335	63,305.61	153,036,687.00	55.77%	121,393,114.00	44.23%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	142,829,928.00	52.05%

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	赵熙逸	38,260,678.00	13.94%
2	方正证券股份有限公司	3,026,381.00	1.10%
3	兰树华	1,712,100.00	0.62%
4	兴业银行股份有限公司企业年金计划—上海浦东发展银行股份有限	1,614,300.00	0.59%
5	上海市邮政公司企业年金计划—中 国建设银行	1,580,600.00	0.58%
6	华西证券—建行—华西证券融诚 2号集合资产管理计划	1,014,143.00	0.37%
7	浙江省交通投资集团有限公司及子 分公司企业年金计划—农行	994,000.00	0.36%
8	陈剑	650,000.00	0.24%
9	上海申通地铁集团有限公司企业年 金计划—上海浦东发展银行股份有 限公司	646,900.00	0.24%
10	宋向岭	602,500.00	0.22%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	206,429,801.00
本报告期基金总申购份额	82,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	274,429,801.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，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

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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金

	数量		成交总额的比 例		总量的比例	备注
长城证券	1	51,550,609.30	34.80%	46,977.68	34.60%	-
中投证券	1	49,473,202.49	33.39%	45,085.71	33.21%	-
国都证券	1	31,622,819.30	21.34%	29,450.71	21.69%	-
民生证券	1	6,819,839.60	4.60%	6,214.86	4.58%	-
国信证券	2	5,710,367.15	3.85%	5,318.38	3.92%	-
海通证券	2	2,608,881.40	1.76%	2,377.47	1.75%	-
西南证券	1	369,459.90	0.25%	344.07	0.25%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、上述交易单元均系本报告期内租用。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	21,594.50	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 1 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 21 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 2 日
3	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 28 日
4	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 28 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 54 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 23 日
6	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年 4 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 1 月 22 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20180101-20180630	139,941,028.00	3,468,900.00	580,000.00	142,829,928.00	52.05%

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债

券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

11.3 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的公告

11.4 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
托管人住所

11.5 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日