

华商中证 500 指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 26 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 2014 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
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	55
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	55
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	56
§11 备查文件目录.....	57
11.1 备查文件目录	57
11.2 存放地点	57
11.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	华商中证 500 指数分级		
场内简称	华商 500		
基金主代码	166301		
交易代码	166301		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 9 月 6 日		
基金管理人	华商基金管理有限公司		
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	13,998,335.04 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-09-25		
下属分级基金的基金简称	华商中证 500 指数分级	华商 500A	华商 500B
下属分级基金的交易代码	166301	150110	150111
报告期末下属分级基金份额总额	12,869,919.04 份	451,366.00 份	677,050.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用完全复制的被动型指数化投资方法，通过严格的投资纪律约束和数量化风险手段，力争将本基金的净值增长率与标的指数之间的日均跟踪误差偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制 4%以内，获得与标的指数收益相类似的回报。		
投资策略	本基金采用完全复制法，以中证 500 指数作为标的指数，按照成份股在指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，严格控制与目标指数的偏离风险，以拟合、跟踪标的指数的收益表现，并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整，获得与标的指数收益相似的回报。		
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品；同时本基金为指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。		
下属三级基金的风险收益特征	华商中证 500 指数分级份额具有风险较高、收益较高的特征。	华商中证 500A 类份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	华商中证 500B 类份额具有高风险、高预期收益的特征。

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		华商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周亚红	赵会军
	联系电话	010-58573600	010-66105799
	电子邮箱	zhouyh@hsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007008880	95588
传真		010-58573520	010-66105798
注册地址		北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100035	100140
法定代表人		李晓安	姜建清

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、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,123,948.69
本期利润	1,388,333.46
加权平均基金份额本期利润	0.0678
本期加权平均净值利润率	6.07%
本期基金份额净值增长率	0.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,728,128.07
期末可供分配基金份额利润	0.1235
期末基金资产净值	15,726,463.11

期末基金份额净值	1.123
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	12.30%

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余额的孰低数。

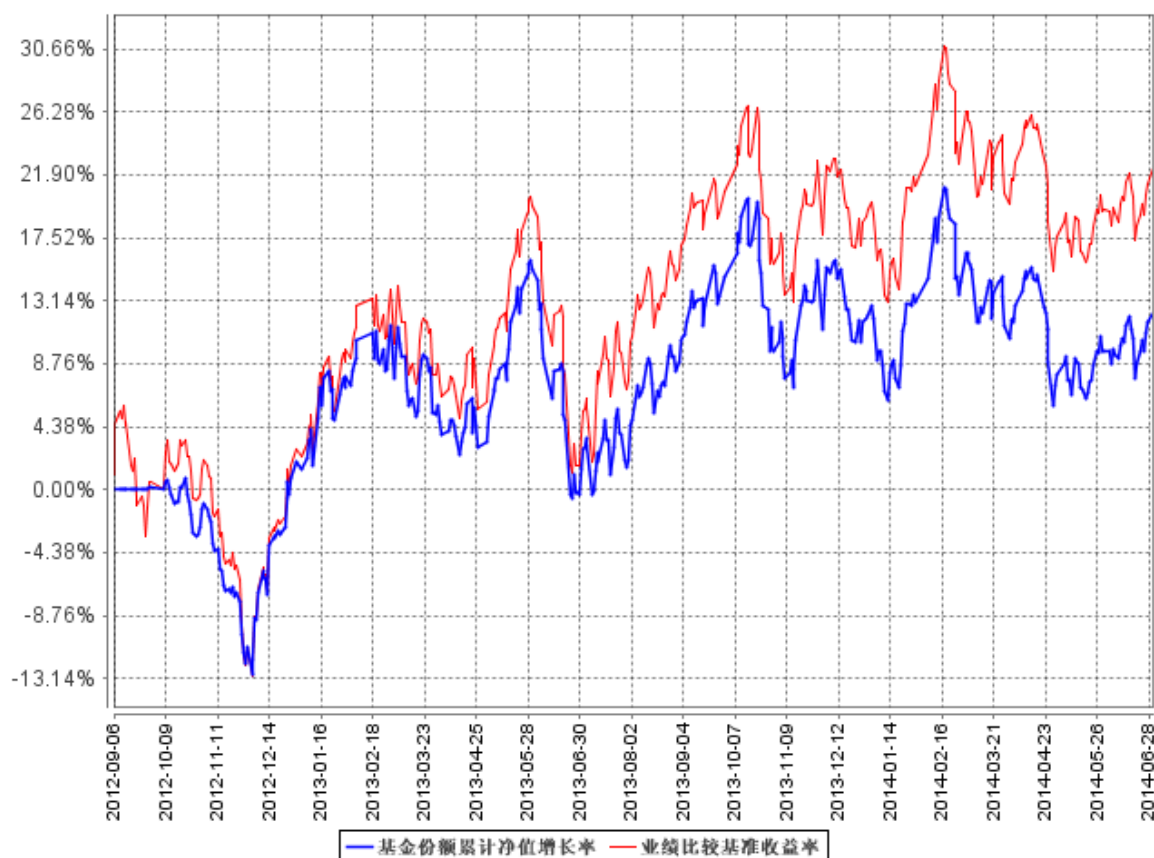
3.2 基金净值表现

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	2.37%	0.90%	2.38%	0.93%	-0.01%	-0.03%
过去三个月	1.63%	0.96%	2.11%	1.01%	-0.48%	-0.05%
过去六个月	0.09%	1.10%	2.43%	1.19%	-2.34%	-0.09%
过去一年	12.64%	1.17%	20.27%	1.26%	-7.63%	-0.09%
自基金合同生效起至今	12.30%	1.17%	22.36%	1.33%	-10.06%	-0.16%

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本基金合同生效日为 2012 年 9 月 6 日。

②根据《华商中证 500 指数分级股票型基金基金合同》的规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：投资股票组合的比例占基金资产的 85%–95%，其中投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%–3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其他金融工具的投资比例符合法律规则和监管机构的规定。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

华商基金管理有限公司由华龙证券有限责任公司、中国华电集团财务有限公司、济钢集团有限公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字【2005】160 号文批准设立，于 2005 年 12 月 20 日成立，注册资本为 1 亿元人民币。

华商基金管理有限公司自 2012 年 9 月 6 日华商中证 500 指数分级证券投资基金正式成立之日起，成为该基金的管理人。目前本公司旗下管理十九只基金产品，分别为华商领先企业混合型证券投资基金（基金代码：630001）、华商盛世成长股票型证券投资基金（基金代码：630002）、华商收益增强债券型证券投资基金（基金代码：A 类 630003，B 类 630103）、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：630005）、华商产业升级股票型证券投资基金（基金代码：630006）、华商稳健双利债券型证券投资基金（基金代码：A 类 630007，B 类 630107）、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：630008）、华商稳定增利债券型证券投资基金（基金代码：A 类 630009，C 类 630109）、华商价值精选股票型证券投资基金（基金代码：630010）、华商主题精选股票型证券投资基金（基金代码：630011）、华商中证 500 指数分级证券投资基金（基金代码：母基金：166301，A 类 150110，B 类 150111）、华商现金增利货币市场基金（基金代码：A 类 630012，B 类 630112）、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金（基金代码：630016）、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：630015）、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：000279）、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：000390）、华商双债丰利债券型证券投资基金（基金代码：A 类 000463，c 类 000481）、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金（基金代码：000541）、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：000609）。

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		
路阳	基金经理	2013 年 12 月 30 日	2014 年 6 月 10 日	7	男，金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格。2006 年 12 月至 2007 年 7 月，就职于中软融鑫计算机系统工程公司，任模型研发工程师；2007 年 7 月至 2007 年 10 月，就职于大众国际资信评估公

					司，任分析师；2007 年 10 月至 2009 年 9 月，就职于民生证券有限公司，任合规监测及金融工程师；2009 年 9 月加入华商基金管理有限公司，从事量化研究及产品设计工作；2013 年 2 月 28 日至 2013 年 12 月 30 日，担任华商中证 500 指数分级证券投资基金的基金经理助理。
费鹏	基金经理	2014 年 6 月 10 日	-	8	男，房地产金融学博士，具有基金从业资格。2003 年 11 月至 2004 年 8 月，就职于中国国际金融有限公司，任研究部经理；2007 年 5 月至 2009 年 3 月，就职于美国 W&L Asset Management, Inc，任资本市场策略部分分析师；2009 年 5 月至 2011 年 7 月，就职于中国对外经济贸易信托有限公司，任证券投资部总经理；2011 年 8 月，加入华商基金管理有限公司，2011 年 9 月起至 2013 年 8 月 5 日担任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2013 年 4 月 9 日起至今担任华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014 年 6 月 5 日起至今担任华商新量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：① “任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于

不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

2014 年上半年市场呈现震荡格局，代表新兴产业和中小市值的创业板指数和中证 500 指数获得了正收益，而代表传统产业和大市值的沪深 300 指数却依然下跌，继续延续了 2013 年以来的结构性行情。然而超额收益和波动性都在减小，创业板指和中证 500 上半年的振幅为 27.64%和 16.82%，沪深 300 低至 10.90%，创近年来的新低。本基金在一季度遭遇大额赎回，影响了基金的正常操作，带来了一定的跟踪误差，随着二季度规模的减少，基金的固定费用对基金跟踪误差带来了更大的影响。在二季度末期，我们采取了积极的措施，获得了不错的效果。本基金的操作将继续严格按照指数基金的管理流程及方法，力争将跟踪误差控制在合同约定范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.123 元，份额累计净值为 1.123 元，本报告期内本基金份额净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准的收益率为 2.43%，本基金份额净值增长率低于同期业绩比较基准的收益率 2.34 个百分点。自本基金合同成立至本报告期末，本基金份额净

值增长率为 12.30%，同期业绩比较基准收益率为 22.36%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 10.06 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在当前的经济形势下，预计 2014 年下半年市场仍会维持震荡格局。中证 500 指数的成份股大多具有良好的成长性和盈利能力，市值水平适中，估值水平合理，具备长期的投资价值。本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，获得与标的指数收益相似的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列 6.4 报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性，公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人，委员包括投资总监、基金运营部经理、基金会计主管、研究发展部经理（若负责人认为必要，可适当增减委员会委员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人，成员包括监察稽核部和基金事务相关人员（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人，成员包括监察稽核部和基金事务相关人员（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

在严格遵循公平、合理原则下，公司制订了健全、有效的估值政策流程：

1. 基金运营部基金会计应实时监控股票停牌情况，对于连续 5 个交易日不存在活跃市场的股票及时提示研究发展部并发出预警；
2. 由研究发展部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值，若确定用估值方法计算公允价值，则在参考证券业协会的意见或第三方意见后确定估值方法，并确定估值所用的行业指数和指数日收益率；
3. 由估值委员会计算该投资品种的公允价值，并将计算结果提交风险内控小组；
4. 风险内控小组审核该投资品种估值方法的适用性和公允性，出具审核意见并提交公司管理层；
5. 公司管理层审批后，该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性，风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行审核，并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下，公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形，已确定的估值政策和程序应当持续适用。

风险内控小组和估值委员会应互相协助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及适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议，风险内控小组审核并提交公司管理层，待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时，应由风险内控小组对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时，风险内控小组应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未进行利润分配。

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

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

本报告期内，华商中证 500 指数分级证券投资基金的管理人——华商基金管理有限公司在华商中证 500 指数分级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，华商中证 500 指数分级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

本托管人依法对华商基金管理有限公司编制和披露的华商中证 500 指数分级证券投资基金 2014 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：华商中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	981,126.80	13,049,805.06
结算备付金		-	-
存出保证金		15,818.36	40,660.64
交易性金融资产	6.4.7.2	14,927,726.20	46,675,788.00
其中：股票投资		14,927,726.20	46,675,788.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	202.86	2,664.99
应收股利		-	-
应收申购款		297.15	831.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	55,757.58	-
资产总计		15,980,928.95	59,769,750.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 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		-	8,119,335.31
应付赎回款		13,437.77	-
应付管理人报酬		12,747.09	39,183.80
应付托管费		2,804.37	8,620.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,822.66	15,156.35
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	218,653.95	90,000.00
负债合计		254,465.84	8,272,295.91
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,998,335.04	45,907,706.83
未分配利润	6.4.7.10	1,728,128.07	5,589,747.40
所有者权益合计		15,726,463.11	51,497,454.23
负债和所有者权益总计		15,980,928.95	59,769,750.14

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.123 元，基金份额总额 13,998,335.04 份。

其中下属华商中证 500 份额 12,869,919.04 份，华商中证 500A 类份额 451,366.00 份，华商中证 500B 类份额 677,050.00 份，下属华商中证 500 份额净值 1.123 元，华商中证 500A 类份额净值 1.114 元，华商中证 500B 类份额净值 1.130 元。

6.2 利润表

会计主体：华商中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		1,902,370.19	521,630.93
1.利息收入		13,015.94	25,863.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,015.94	25,863.90
债券利息收入		-	-
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）		4,584,599.83	5,582,809.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,496,650.16	5,287,201.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	87,949.67	295,607.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,735,615.23	-5,155,604.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	40,369.65	68,562.67

列)			
减：二、费用		514,036.73	713,016.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	117,291.08	263,962.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,804.07	58,071.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	96,671.62	119,817.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	274,269.96	271,164.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,388,333.46	-191,385.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,388,333.46	-191,385.39

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	45,907,706.83	5,589,747.40	51,497,454.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,388,333.46	1,388,333.46
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）	-31,909,371.79	-5,249,952.79	-37,159,324.58
其中：1.基金申购款	991,389.24	99,667.63	1,091,056.87
2.基金赎回款	-32,900,761.03	-5,349,620.42	-38,250,381.45
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）	13,998,335.04	1,728,128.07	15,726,463.11
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	59,990,696.86	1,143,566.66	61,134,263.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-191,385.39	-191,385.39
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）	-9,458,683.71	-1,080,033.66	-10,538,717.37
其中：1.基金申购款	41,156,414.08	3,154,557.73	44,310,971.81
2.基金赎回款	-50,615,097.79	-4,234,591.39	-54,849,689.18
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）	50,532,013.15	-127,852.39	50,404,160.76

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：

_____ 王锋	_____ 程蕾	_____ 程蕾
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

华商中证 500 指数分级证券投资基金(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[2012]244 号《关于核准华商中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由华商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 344,468,319.49 元，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(2012)第 348 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 344,520,333.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,014.14 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《华商中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金分级运作期为三年，分级运作期内基金份额包括华商中证 500 指数分级证券投资基金之基础份额(简称“华商中证 500 份额”)、华商中证 500 指数分级证券投资基金 A 类份额(简称“华商中证 500A 份额”)与华商中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额(简称“华商中证 500B 份额”)。其中，华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额的基

金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。本基金发售结束后，投资者场外认购的全部份额将确认为华商中证 500 份额；投资者场内认购的全部将按 4:6 的比率自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额。两类基金份额的基金资产合并运作。华商中证 500 份额只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。华商中证 500A 份额与华商中证 500B 份额同时在深圳证券交易所上市和交易，但不接受申购和赎回。在华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额的存续期内。本基金净资产优先确保华商中证 500A 份额的本金及约定收益；本基金在优先确保华商中证 500A 份额的本金及约定收益后，将剩余净资产分配予华商中证 500B 份额。本基金基金合同生效满三年后，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称为华商中证 500 指数证券投资基金（LOF）。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2012]320 号文审核同意，本基金华商中证 500A 份额 83,325,734.00 份，华商中证 500B 份额 124,988,602.00 份，于 2012 年 9 月 26 日在深交所挂牌交易。未上市交易的华商中证 500 份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后，选择将华商中证 500 份额分拆为华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额后即可上市流通。

本基金分级运作期内不进行定期折算。分级运作期内本基金在以下两种情况下将进行份额折算，即：当华商中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.500 元；当华商中证 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元。当华商中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.500 元后，本基金将分别对华商中证 500 份额、华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额的比例为 4:6，份额折算后华商中证 500 份额、华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。当华商中证 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元后，本基金即可分别对华商中证 500 份额、华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额的比例为 4:6，份额折算后华商中证 500 份额、华商中证 500A 份额和华商中证 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪中证 500 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票组合的比例占基金资产的 85%-95%，其中

投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	981,126.80
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	981,126.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,798,606.42	14,927,726.20	1,129,119.78
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	13,798,606.42	14,927,726.20	1,129,119.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	195.76
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.10
合计	202.86

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	55,757.58
合计	55,757.58

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,822.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,822.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	50.64
预提费用	168,603.31
应付指数使用费	50,000.00
合计	218,653.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,907,706.83	45,907,706.83
本期申购	991,389.24	991,389.24
本期赎回(以“-”号填列)	-32,900,761.03	-32,900,761.03
本期末	13,998,335.04	13,998,335.04

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	9,272,439.63	-3,682,692.23	5,589,747.40
本期利润	4,123,948.69	-2,735,615.23	1,388,333.46
本期基金份额交易产生的变动数	-8,067,812.81	2,817,860.02	-5,249,952.79
其中：基金申购款	305,881.65	-206,214.02	99,667.63
基金赎回款	-8,373,694.46	3,024,074.04	-5,349,620.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,328,575.51	-3,600,447.44	1,728,128.07

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,529.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,052.63
结算备付金利息收入	214.46
其他	219.00
合计	13,015.94

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	42,838,429.78
减：卖出股票成本总额	38,341,779.62
买卖股票差价收入	4,496,650.16

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未发生债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未有衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	87,949.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	87,949.67

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,735,615.23
——股票投资	-2,735,615.23
——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	-
合计	-2,735,615.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,369.65
合计	40,369.65

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	96,671.62
银行间市场交易费用	-
合计	96,671.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
上市年费	4,242.42
指数使用费	100,000.00
银行费用	1,424.23

合计	274,269.96
----	------------

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

本基金本报告期内无其他或有事项的说明。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无资产负债表日后事项的说明。

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
华商基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华龙证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行交易。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	117,291.08	263,962.53
其中：支付销售机构的客户维护费	5,474.80	14,230.47

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,804.07	58,071.74

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	华商中证 500 指数分级	华商 500A	华商 500B
基金合同生效日（2012 年 9 月 6 日）持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
期初持有的基金份额	4,770,038.17	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00	0.00
期末持有的基金份额	4,770,038.17	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	37.0600%	0.0000%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	华商中证 500 指数分级	华商 500A	华商 500B
基金合同生效日（2012 年 9 月 6 日）持有的基金份额	0.00	0.00	0.00

期初持有的基金份额	4,770,038.17	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00	0.00
期末持有的基金份额	4,770,038.17	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.0200%	0.0000%	0.0000%

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

华商中证 500 指数分级				
关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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
华龙证券有限责任公司	4,774,594.08	37.1000%	4,774,594.08	10.0300%

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	981,126.80	11,529.85	8,223,560.90	23,356.41

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，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002167	东方锆业	2014 年 1 月 2 日	重大事项停牌	11.39	2014 年 7 月 1 日	11.10	8,732	96,785.81	99,457.48	-
002252	上海莱士	2014 年 6 月 13 日	重大事项停牌	63.30	-	-	1,246	35,683.82	78,871.80	-
600418	江淮汽车	2014 年 4 月 14 日	重大事项停牌	10.20	2014 年 7 月 11 日	11.22	6,216	48,128.98	63,403.20	-
600757	长江传媒	2014 年 6 月 17 日	重大事项停牌	8.85	-	-	7,122	57,692.68	63,029.70	-
002340	格林美	2014 年 6 月 26 日	重大事项停牌	11.19	2014 年 7 月 24 日	11.77	3,695	36,376.78	41,347.05	-
000762	西藏矿业	2014 年 4 月 29 日	重大事项停牌	10.54	2014 年 7 月 28 日	11.59	3,493	42,253.64	36,816.22	-
600490	鹏欣资源	2014 年 4 月 1 日	重大事项停牌	6.11	2014 年 7 月 15 日	6.11	5,107	33,010.62	31,203.77	-
002638	勤上光电	2014 年 6 月 10 日	重大事项停牌	14.87	2014 年 7 月 15 日	14.75	1,915	25,295.93	28,476.05	-
600685	广船国际	2014 年 4 月 8 日	重大事项停牌	17.13	-	-	1,518	17,965.46	26,003.34	-
600582	天地科技	2014 年 6 月 26 日	重大事项停牌	7.97	-	-	3,200	25,376.00	25,504.00	-
000612	焦作万方	2014 年 4 月 3 日	重大事项停牌	6.08	2014 年 8 月 18 日	6.69	4,029	21,796.47	24,496.32	-
002306	湘鄂情	2014 年 6 月 23 日	重大事项停牌	5.57	2014 年 7 月 29 日	6.13	3,866	16,099.26	21,533.62	-
600260	凯乐科技	2014 年 6 月 9 日	重大事项停牌	6.59	-	-	3,115	23,977.44	20,527.85	-
000683	远兴能源	2014 年 6 月 25 日	重大事项停牌	3.56	2014 年 7 月 2 日	3.85	5,686	24,903.15	20,242.16	-
600864	哈投股份	2014 年 4 月 11 日	重大事项停牌	8.68	2014 年 7 月 15 日	8.30	2,267	19,746.77	19,677.56	-
000852	江钻股份	2014 年 5 月 28 日	重大事项停牌	15.80	-	-	1,108	16,457.65	17,506.40	-
002635	安洁科技	2014 年 6 月 30 日	重大事项停牌	31.99	2014 年 8 月 5 日	35.19	482	22,560.49	15,419.18	-
601777	力帆股份	2014 年 6 月 24 日	重大事项停牌	6.39	2014 年 7 月 8 日	6.70	2,199	13,608.00	14,051.61	-
600850	华东电脑	2014 年 4 月 4 日	重大事项停牌	19.56	2014 年 7 月 11 日	21.52	666	14,237.09	13,026.96	-

注：本基金截至 2014 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品；同时本基金为指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。从本基金所分离的两类基

金份额来看，华商中证 500A 类份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华商中证 500B 类份额具有高风险、高预期收益的特征。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运用完全复制的被动型指数化投资方法，将跟踪误差的管理作为本基金主要的风险控制手段之一，通过严格的投资纪律约束和数量化风险手段，力争将本基金的净值增长率与标的指数之间的日均跟踪误差偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，获得与标的指数收益相似的回报。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1) 第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理小组、投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的研究、分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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

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工商银行，与该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 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2013 年 12 月 31 日：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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	981,126.80	-	-	-	981,126.80
存出保证金	15,818.36	-	-	-	15,818.36
交易性金融资产	-	-	-	14,927,726.20	14,927,726.20
应收利息	-	-	-	202.86	202.86
应收申购款	-	-	-	297.15	297.15
其他资产	-	-	-	55,757.58	55,757.58
资产总计	996,945.16	-	-	14,983,983.79	15,980,928.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,437.77	13,437.77
应付管理人报酬	-	-	-	12,747.09	12,747.09
应付托管费	-	-	-	2,804.37	2,804.37
应付交易费用	-	-	-	6,822.66	6,822.66
其他负债	-	-	-	218,653.95	218,653.95
负债总计	-	-	-	254,465.84	254,465.84
利率敏感度缺口	996,945.16	-	-	14,729,517.95	15,726,463.11
上年度末 2013 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	13,049,805.06	-	-	-	13,049,805.06
存出保证金	40,660.64	-	-	-	40,660.64
交易性金融资产	-	-	-	46,675,788.00	46,675,788.00
应收利息	-	-	-	2,664.99	2,664.99
应收申购款	-	-	-	831.45	831.45
资产总计	13,090,465.70	-	-	46,679,284.44	59,769,750.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,119,335.31	8,119,335.31

应付管理人报酬	-	-	-	39,183.80	39,183.80
应付托管费	-	-	-	8,620.45	8,620.45
应付交易费用	-	-	-	15,156.35	15,156.35
其他负债	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	-	-	-	8,272,295.91	8,272,295.91
利率敏感度缺口	13,090,465.70	-	-	38,406,988.53	51,497,454.23

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2013 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，以中证 500 指数作为标的指数，按照成份股在指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，严格控制与目标指数的偏离风险，以拟合、跟踪标的指数的收益表现，并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整，获得与标的指数收益相似的回报。同时，本基金还将依据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况等变化，对股票组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与标的指数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。本基金投资于股票组合的比例占基金资产的 85%-95%，其中投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	14,927,726.20	94.92	46,675,788.00	90.64
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	14,927,726.20	94.92	46,675,788.00	90.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	672,078.77	1,952,525.98
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-672,078.77	-1,952,525.98

§ 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	14,927,726.20	93.41
	其中：股票	14,927,726.20	93.41
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	981,126.80	6.14
7	其他各项资产	72,075.95	0.45

8	合计	15,980,928.95	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	290,775.26	1.85
B	采矿业	394,125.23	2.51
C	制造业	9,071,394.22	57.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	299,736.50	1.91
E	建筑业	399,538.73	2.54
F	批发和零售业	1,004,678.12	6.39
G	交通运输、仓储和邮政业	465,007.06	2.96
H	住宿和餐饮业	19,560.72	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	700,864.85	4.46
J	金融业	203,180.54	1.29
K	房地产业	1,088,996.12	6.92
L	租赁和商务服务业	260,982.62	1.66
M	科学研究和技术服务业	51,670.50	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	122,283.23	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	221,465.13	1.41
S	综合	84,886.26	0.54
	合计	14,679,145.09	93.34

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	227,047.49	1.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	21,533.62	0.14

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	248,581.11	1.58

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002190	成飞集成	2,285	134,815.00	0.86
2	600517	置信电气	10,195	103,581.20	0.66
3	600511	国药股份	4,286	97,292.20	0.62
4	600570	恒生电子	3,294	96,843.60	0.62
5	600787	中储股份	7,250	94,757.50	0.60
6	600790	轻纺城	10,545	94,694.10	0.60
7	600151	航天机电	12,278	93,803.92	0.60
8	000848	承德露露	4,704	93,468.48	0.59
9	600797	浙大网新	13,638	93,420.30	0.59
10	002073	软控股份	9,602	91,891.14	0.58
11	000513	丽珠集团	1,862	87,942.26	0.56
12	600884	杉杉股份	5,091	87,514.29	0.56
13	600038	哈飞股份	3,124	86,940.92	0.55
14	600426	华鲁恒升	11,913	85,773.60	0.55
15	002161	远望谷	10,981	84,553.70	0.54
16	000028	国药一致	2,114	84,454.30	0.54
17	600503	华丽家族	20,677	84,362.16	0.54
18	002424	贵州百灵	3,373	83,178.18	0.53
19	600580	卧龙电气	10,734	82,329.78	0.52
20	600064	南京高科	7,494	80,560.50	0.51

21	002168	深圳惠程	10,924	80,182.16	0.51
22	002714	牧原股份	1,800	79,290.00	0.50
23	600563	法拉电子	2,374	78,935.50	0.50
24	000090	天健集团	9,973	76,891.83	0.49
25	002179	中航光电	4,379	76,851.45	0.49
26	000636	风华高科	12,309	76,808.16	0.49
27	000021	长城开发	12,972	76,534.80	0.49
28	600300	维维股份	18,790	75,911.60	0.48
29	000099	中信海直	8,439	74,769.54	0.48
30	000777	中核科技	6,415	73,708.35	0.47
31	002122	天马股份	15,506	72,878.20	0.46
32	002091	江苏国泰	4,746	72,661.26	0.46
33	601801	皖新传媒	5,354	71,582.98	0.46
34	000525	红太阳	5,102	71,479.02	0.45
35	002463	沪电股份	21,677	70,016.71	0.45
36	002392	北京利尔	7,553	69,412.07	0.44
37	600587	新华医疗	927	69,107.85	0.44
38	000418	小天鹅 A	6,766	69,080.86	0.44
39	603366	日出东方	5,109	69,022.59	0.44
40	600683	京投银泰	13,555	67,368.35	0.43
41	600557	康缘药业	2,327	66,784.90	0.42
42	000559	万向钱潮	6,372	65,504.16	0.42
43	600879	航天电子	5,543	65,296.54	0.42
44	000998	隆平高科	2,324	63,863.52	0.41
45	600312	平高电气	4,549	63,413.06	0.40
46	600418	江淮汽车	6,216	63,403.20	0.40
47	600757	长江传媒	7,122	63,029.70	0.40
48	002022	科华生物	2,625	60,506.25	0.38
49	601099	太平洋	9,400	59,878.00	0.38
50	600201	金宇集团	1,900	59,128.00	0.38
51	600872	中炬高新	5,310	56,657.70	0.36
52	000977	浪潮信息	1,599	56,252.82	0.36
53	600398	海澜之家	5,900	54,280.00	0.35
54	600967	北方创业	4,300	53,965.00	0.34
55	002005	德豪润达	6,436	53,869.32	0.34
56	002405	四维图新	3,227	53,632.74	0.34
57	002250	联化科技	3,717	52,781.40	0.34
58	000511	烯碳新材	7,698	51,884.52	0.33
59	600645	中源协和	1,862	51,670.50	0.33

60	002152	广电运通	2,988	50,915.52	0.32
61	600525	长园集团	4,574	50,496.96	0.32
62	002063	远光软件	2,463	50,368.35	0.32
63	600584	长电科技	5,687	50,216.21	0.32
64	600522	中天科技	3,757	49,179.13	0.31
65	600759	正和股份	4,809	49,147.98	0.31
66	600138	中青旅	2,251	49,026.78	0.31
67	600694	大商股份	1,900	48,507.00	0.31
68	600770	综艺股份	5,199	48,142.74	0.31
69	600643	爱建股份	5,158	47,402.02	0.30
70	002440	闰土股份	2,556	47,286.00	0.30
71	600675	中华企业	9,626	46,686.10	0.30
72	600601	方正科技	14,631	46,672.89	0.30
73	600881	亚泰集团	12,630	46,478.40	0.30
74	600811	东方集团	8,800	45,672.00	0.29
75	600654	飞乐股份	5,033	45,548.65	0.29
76	002219	恒康医疗	2,054	45,146.92	0.29
77	600037	歌华有线	4,241	44,615.32	0.28
78	000712	锦龙股份	2,986	44,580.98	0.28
79	600175	美都控股	7,700	44,275.00	0.28
80	600820	隧道股份	9,083	44,052.55	0.28
81	000897	津滨发展	8,624	43,206.24	0.27
82	600200	江苏吴中	4,157	43,191.23	0.27
83	600747	大连控股	6,832	42,426.72	0.27
84	002153	石基信息	824	42,271.20	0.27
85	600158	中体产业	4,499	42,200.62	0.27
86	002048	宁波华翔	2,826	42,107.40	0.27
87	600635	大众公用	8,771	42,013.09	0.27
88	600805	XD 悦达投	4,537	41,695.03	0.27
89	002092	中泰化学	6,732	41,603.76	0.26
90	002340	格林美	3,695	41,347.05	0.26
91	000997	新大陆	2,381	41,334.16	0.26
92	600410	华胜天成	3,445	40,961.05	0.26
93	002004	华邦颖泰	2,180	40,548.00	0.26
94	600110	中科英华	7,668	40,257.00	0.26
95	000550	江铃汽车	1,384	40,108.32	0.26
96	002266	浙富控股	5,629	39,909.61	0.25
97	002437	誉衡药业	774	39,861.00	0.25
98	002701	奥瑞金	1,970	39,734.90	0.25

99	000988	华工科技	4,158	39,043.62	0.25
100	600432	吉恩镍业	2,700	38,988.00	0.25
101	002191	劲嘉股份	2,916	38,782.80	0.25
102	600978	宜华木业	7,907	38,586.16	0.25
103	002049	同方国芯	1,618	38,427.50	0.24
104	600422	昆明制药	1,819	38,217.19	0.24
105	600478	科力远	1,678	38,023.48	0.24
106	600261	阳光照明	3,798	37,524.24	0.24
107	600572	康恩贝	2,698	37,421.26	0.24
108	600765	中航重机	3,111	37,332.00	0.24
109	000939	凯迪电力	5,030	37,222.00	0.24
110	000762	西藏矿业	3,493	36,816.22	0.23
111	600139	西部资源	2,647	36,528.60	0.23
112	600651	飞乐音响	4,926	36,452.40	0.23
113	000788	北大医药	2,383	36,173.94	0.23
114	000735	罗牛山	5,867	35,906.04	0.23
115	600500	中化国际	5,554	35,767.76	0.23
116	600366	宁波韵升	2,400	35,616.00	0.23
117	600320	振华重工	11,072	35,319.68	0.22
118	600183	生益科技	5,691	35,056.56	0.22
119	600198	大唐电信	2,352	35,044.80	0.22
120	000541	佛山照明	3,515	35,009.40	0.22
121	000887	中鼎股份	3,614	34,911.24	0.22
122	600521	华海药业	3,140	34,697.00	0.22
123	600284	浦东建设	3,674	34,572.34	0.22
124	002155	辰州矿业	4,600	34,408.00	0.22
125	002223	鱼跃医疗	1,417	34,362.25	0.22
126	600112	天成控股	2,668	34,203.76	0.22
127	600776	东方通信	2,549	34,029.15	0.22
128	600351	亚宝药业	3,690	33,948.00	0.22
129	600835	上海机电	2,150	33,497.00	0.21
130	002271	东方雨虹	1,344	33,398.40	0.21
131	600596	新安股份	3,621	33,132.15	0.21
132	000049	德赛电池	820	32,939.40	0.21
133	002309	中利科技	1,894	32,936.66	0.21
134	000690	宝新能源	8,056	32,868.48	0.21
135	002396	星网锐捷	1,170	32,748.30	0.21
136	600169	太原重工	11,300	32,092.00	0.20
137	002273	水晶光电	1,751	32,043.30	0.20

138	000829	天音控股	3,787	32,038.02	0.20
139	600699	均胜电子	1,272	31,965.36	0.20
140	002690	美亚光电	901	31,778.27	0.20
141	000969	安泰科技	3,450	31,740.00	0.20
142	002428	云南锗业	2,612	31,683.56	0.20
143	600611	大众交通	4,818	31,654.26	0.20
144	600161	天坛生物	1,718	31,576.84	0.20
145	002573	国电清新	1,775	31,204.50	0.20
146	600490	鹏欣资源	5,107	31,203.77	0.20
147	600387	海越股份	2,059	31,049.72	0.20
148	601519	大智慧	5,247	30,799.89	0.20
149	600673	东阳光科	2,512	30,772.00	0.20
150	002368	太极股份	914	30,609.86	0.19
151	000671	阳光城	3,479	30,580.41	0.19
152	600704	物产中大	3,688	30,536.64	0.19
153	600816	安信信托	2,118	30,499.20	0.19
154	600435	北方导航	2,481	30,392.25	0.19
155	000616	亿城投资	9,534	30,318.12	0.19
156	600122	宏图高科	6,087	30,313.26	0.19
157	000528	柳工	5,200	30,264.00	0.19
158	600755	厦门国贸	6,210	30,118.50	0.19
159	000422	湖北宜化	5,985	29,984.85	0.19
160	600545	新疆城建	3,603	29,544.60	0.19
161	000809	铁岭新城	2,483	29,473.21	0.19
162	002317	众生药业	1,474	29,435.78	0.19
163	000759	中百集团	3,631	29,411.10	0.19
164	600125	铁龙物流	6,091	29,358.62	0.19
165	600171	上海贝岭	3,593	29,318.88	0.19
166	002477	雏鹰农牧	3,101	29,180.41	0.19
167	600270	外运发展	2,414	29,161.12	0.19
168	002181	粤传媒	1,845	29,151.00	0.19
169	600509	天富热电	3,610	29,132.70	0.19
170	600160	巨化股份	6,000	29,040.00	0.18
171	000006	深振业A	6,299	28,849.42	0.18
172	000566	海南海药	2,640	28,723.20	0.18
173	600056	中国医药	2,699	28,690.37	0.18
174	000078	海王生物	3,846	28,498.86	0.18
175	600761	安徽合力	2,878	28,319.52	0.18
176	002595	豪迈科技	600	28,290.00	0.18

177	600220	江苏阳光	9,510	28,244.70	0.18
178	002414	高德红外	1,541	28,030.79	0.18
179	002050	三花股份	2,576	27,975.36	0.18
180	600536	中国软件	1,300	27,950.00	0.18
181	002052	同洲电子	3,100	27,869.00	0.18
182	002508	老板电器	985	27,845.95	0.18
183	600067	冠城大通	5,555	27,830.55	0.18
184	600240	华业地产	5,696	27,796.48	0.18
185	600289	亿阳信通	3,047	27,270.65	0.17
186	000415	渤海租赁	3,548	27,248.64	0.17
187	600825	新华传媒	3,482	27,194.42	0.17
188	600416	湘电股份	2,839	27,169.23	0.17
189	600325	XD 华发股	4,357	27,056.97	0.17
190	600409	三友化工	6,167	26,949.79	0.17
191	600458	时代新材	3,036	26,777.52	0.17
192	601717	郑煤机	5,500	26,730.00	0.17
193	600812	华北制药	5,435	26,685.85	0.17
194	000510	金路集团	4,060	26,674.20	0.17
195	000652	泰达股份	6,885	26,644.95	0.17
196	002056	横店东磁	1,369	26,640.74	0.17
197	600187	国中水务	5,800	26,564.00	0.17
198	600017	日照港	10,251	26,550.09	0.17
199	002249	大洋电机	1,909	26,535.10	0.17
200	002431	棕榈园林	1,483	26,397.40	0.17
201	000726	鲁 泰 A	2,996	26,334.84	0.17
202	000088	盐 田 港	5,178	26,304.24	0.17
203	600059	古越龙山	3,300	26,301.00	0.17
204	000933	神火股份	7,600	26,296.00	0.17
205	002018	华星化工	3,100	26,288.00	0.17
206	000786	北新建材	1,916	26,287.52	0.17
207	000540	中天城投	5,149	26,259.90	0.17
208	600266	北京城建	3,500	26,145.00	0.17
209	002041	登海种业	938	26,113.92	0.17
210	000823	超声电子	2,147	26,043.11	0.17
211	600685	广船国际	1,518	26,003.34	0.17
212	600292	中电远达	1,364	25,970.56	0.17
213	600720	祁连山	4,139	25,951.53	0.17
214	000488	晨鸣纸业	5,936	25,880.96	0.16
215	000697	炼石有色	1,865	25,792.95	0.16

216	600481	双良节能	2,633	25,724.41	0.16
217	600851	海欣股份	3,936	25,544.64	0.16
218	600582	天地科技	3,200	25,504.00	0.16
219	601718	际华集团	10,284	25,298.64	0.16
220	002064	华峰氨纶	2,953	25,277.68	0.16
221	600086	东方金钰	1,409	25,164.74	0.16
222	002069	獐子岛	1,800	25,164.00	0.16
223	600894	广日股份	2,278	25,126.34	0.16
224	000877	天山股份	4,106	25,087.66	0.16
225	002672	东江环保	912	24,924.96	0.16
226	002183	怡亚通	3,222	24,906.06	0.16
227	000926	福星股份	3,798	24,762.96	0.16
228	002444	巨星科技	2,606	24,757.00	0.16
229	600329	中新药业	1,595	24,706.55	0.16
230	600460	士兰微	4,156	24,603.52	0.16
231	600640	号百控股	1,427	24,601.48	0.16
232	000816	江淮动力	5,674	24,511.68	0.16
233	000612	焦作万方	4,029	24,496.32	0.16
234	002029	七匹狼	3,022	24,417.76	0.16
235	601311	骆驼股份	2,271	24,345.12	0.15
236	000572	海马汽车	6,577	24,334.90	0.15
237	000982	中银绒业	3,342	24,229.50	0.15
238	002118	紫鑫药业	1,709	24,182.35	0.15
239	600575	芜湖港	6,493	24,153.96	0.15
240	601369	陕鼓动力	4,300	24,123.00	0.15
241	600132	重庆啤酒	1,613	24,065.96	0.15
242	000830	鲁西化工	6,835	24,059.20	0.15
243	600073	上海梅林	3,290	23,918.30	0.15
244	000050	深天马 A	1,913	23,912.50	0.15
245	000973	佛塑科技	4,514	23,833.92	0.15
246	601000	唐山港	5,413	23,708.94	0.15
247	600859	王府井	1,500	23,700.00	0.15
248	000919	金陵药业	1,679	23,371.68	0.15
249	600885	宏发股份	1,063	23,354.11	0.15
250	002262	恩华药业	1,048	23,276.08	0.15
251	000667	美好集团	13,590	23,238.90	0.15
252	002028	思源电气	2,461	23,133.40	0.15
253	000587	金叶珠宝	2,228	23,126.64	0.15
254	002311	海大集团	2,100	23,121.00	0.15

255	000975	银泰资源	2,894	23,065.18	0.15
256	600874	创业环保	2,899	23,047.05	0.15
257	000669	金鸿能源	1,340	23,021.20	0.15
258	000543	皖能电力	3,477	22,948.20	0.15
259	002648	卫星石化	1,599	22,881.69	0.15
260	000979	中弘股份	7,691	22,842.27	0.15
261	600120	浙江东方	2,021	22,837.30	0.15
262	000886	海南高速	5,273	22,832.09	0.15
263	600482	风帆股份	2,125	22,737.50	0.14
264	600141	兴发集团	2,307	22,631.67	0.14
265	600636	三爱富	1,782	22,506.66	0.14
266	600551	时代出版	1,348	22,471.16	0.14
267	002325	洪涛股份	2,727	22,361.40	0.14
268	600401	海润光伏	2,799	22,336.02	0.14
269	002011	盾安环境	2,811	22,291.23	0.14
270	002663	普邦园林	1,863	22,281.48	0.14
271	600528	中铁二局	4,800	22,224.00	0.14
272	000518	四环生物	6,863	22,030.23	0.14
273	600628	新世界	2,836	22,007.36	0.14
274	000900	现代投资	4,721	21,763.81	0.14
275	601002	晋亿实业	2,584	21,705.60	0.14
276	600251	冠农股份	1,448	21,647.60	0.14
277	600004	白云机场	3,066	21,584.64	0.14
278	600748	上实发展	2,888	21,457.84	0.14
279	600612	老凤祥	845	21,386.95	0.14
280	600311	荣华实业	4,436	21,381.52	0.14
281	000860	顺鑫农业	1,521	21,354.84	0.14
282	002277	友阿股份	2,246	21,337.00	0.14
283	600456	宝钛股份	1,434	21,280.56	0.14
284	002013	中航机电	1,432	21,207.92	0.13
285	600729	重庆百货	1,083	21,161.82	0.13
286	600740	山西焦化	4,050	21,141.00	0.13
287	000685	中山公用	2,076	21,112.92	0.13
288	000921	海信科龙	2,396	20,845.20	0.13
289	600993	马应龙	1,326	20,831.46	0.13
290	002408	齐翔腾达	1,494	20,826.36	0.13
291	000563	陕国投 A	3,238	20,820.34	0.13
292	600566	洪城股份	901	20,813.10	0.13
293	600826	兰生股份	1,402	20,777.64	0.13

294	600380	健康元	4,121	20,769.84	0.13
295	001696	宗申动力	4,579	20,742.87	0.13
296	002384	东山精密	2,047	20,695.17	0.13
297	002025	航天电器	1,319	20,695.11	0.13
298	600438	通威股份	2,178	20,669.22	0.13
299	600260	凯乐科技	3,115	20,527.85	0.13
300	600831	广电网络	2,629	20,322.17	0.13
301	002123	荣信股份	2,636	20,218.12	0.13
302	600322	天房发展	5,896	20,164.32	0.13
303	002285	世联行	2,509	20,097.09	0.13
304	002254	泰和新材	2,375	20,068.75	0.13
305	002140	东华科技	1,189	20,010.87	0.13
306	002698	博实股份	801	19,960.92	0.13
307	600487	亨通光电	1,379	19,830.02	0.13
308	002083	孚日股份	4,842	19,803.78	0.13
309	600970	中材国际	2,900	19,778.00	0.13
310	000501	鄂武商 A	1,690	19,773.00	0.13
311	002242	九阳股份	2,000	19,760.00	0.13
312	000031	中粮地产	6,045	19,706.70	0.13
313	600864	哈投股份	2,267	19,677.56	0.13
314	002276	万马股份	3,101	19,567.31	0.12
315	600389	江山股份	600	19,566.00	0.12
316	600754	锦江股份	1,192	19,560.72	0.12
317	000850	华茂股份	3,774	19,473.84	0.12
318	600586	金晶科技	6,638	19,382.96	0.12
319	002237	恒邦股份	1,517	19,372.09	0.12
320	002216	三全食品	1,072	19,349.60	0.12
321	002345	潮宏基	1,126	19,277.12	0.12
322	600298	安琪酵母	1,318	19,216.44	0.12
323	002461	珠江啤酒	1,360	19,203.20	0.12
324	600823	世茂股份	2,237	19,103.98	0.12
325	000930	中粮生化	5,143	19,080.53	0.12
326	000426	兴业矿业	1,989	19,014.84	0.12
327	000931	中关村	3,598	18,925.48	0.12
328	000627	天茂集团	7,218	18,911.16	0.12
329	000680	山推股份	6,616	18,855.60	0.12
330	002371	七星电子	939	18,836.34	0.12
331	600702	沱牌舍得	1,798	18,825.06	0.12
332	000650	仁和药业	3,962	18,819.50	0.12

333	000417	合肥百货	3,639	18,813.63	0.12
334	600750	江中药业	1,199	18,788.33	0.12
335	601886	江河创建	3,000	18,750.00	0.12
336	600021	上海电力	4,279	18,699.23	0.12
337	000066	长城电脑	4,411	18,614.42	0.12
338	002308	威创股份	2,785	18,603.80	0.12
339	002646	青青稞酒	1,199	18,572.51	0.12
340	600180	瑞茂通	1,756	18,525.80	0.12
341	600844	丹化科技	3,118	18,489.74	0.12
342	600983	合肥三洋	1,420	18,431.60	0.12
343	600199	金种子酒	2,593	18,176.93	0.12
344	603766	隆鑫通用	2,056	18,175.04	0.12
345	600176	中国玻纤	2,326	18,049.76	0.11
346	600392	盛和资源	1,003	18,033.94	0.11
347	002275	桂林三金	1,180	17,912.40	0.11
348	600997	开滦股份	4,100	17,876.00	0.11
349	600496	精工钢构	2,737	17,872.61	0.11
350	600639	浦东金桥	1,750	17,815.00	0.11
351	002393	力生制药	608	17,747.52	0.11
352	601880	大连港	6,726	17,689.38	0.11
353	600971	恒源煤电	3,300	17,622.00	0.11
354	601515	东风股份	1,482	17,606.16	0.11
355	600335	国机汽车	1,119	17,579.49	0.11
356	000852	江钻股份	1,108	17,506.40	0.11
357	002221	东华能源	1,563	17,489.97	0.11
358	601101	昊华能源	3,100	17,453.00	0.11
359	002358	森源电气	700	17,402.00	0.11
360	000732	泰禾集团	2,034	17,370.36	0.11
361	600425	青松建化	3,676	17,313.96	0.11
362	601608	中信重工	5,479	17,149.27	0.11
363	600439	瑞贝卡	4,401	17,075.88	0.11
364	002281	光迅科技	496	17,057.44	0.11
365	600429	三元股份	2,359	17,055.57	0.11
366	600026	中海发展	4,216	17,032.64	0.11
367	002203	海亮股份	1,547	17,032.47	0.11
368	600858	银座股份	2,426	17,006.26	0.11
369	002342	巨力索具	3,144	16,914.72	0.11
370	002128	露天煤业	2,600	16,900.00	0.11
371	600039	四川路桥	3,019	16,846.02	0.11

372	000962	东方钽业	1,763	16,819.02	0.11
373	600537	亿晶光电	1,619	16,708.08	0.11
374	000693	华泽钴镍	700	16,576.00	0.11
375	600239	云南城投	3,842	16,559.02	0.11
376	000799	酒鬼酒	1,516	16,539.56	0.11
377	600428	中远航运	5,634	16,507.62	0.10
378	600736	苏州高新	4,231	16,458.59	0.10
379	601678	滨化股份	2,199	16,448.52	0.10
380	600479	千金药业	1,422	16,395.66	0.10
381	002482	广田股份	1,365	16,339.05	0.10
382	600830	香溢融通	2,119	16,316.30	0.10
383	002332	仙琚制药	2,048	16,302.08	0.10
384	002574	明牌珠宝	639	16,288.11	0.10
385	002480	新筑股份	2,239	16,098.41	0.10
386	600616	金枫酒业	2,058	16,052.40	0.10
387	600088	中视传媒	1,104	16,030.08	0.10
388	600467	好当家	2,921	15,919.45	0.10
389	600006	东风汽车	5,332	15,889.36	0.10
390	601965	中国汽研	1,281	15,845.97	0.10
391	000030	富奥股份	2,441	15,744.45	0.10
392	002588	史丹利	761	15,600.50	0.10
393	002635	安洁科技	482	15,419.18	0.10
394	002251	步步高	1,194	15,378.72	0.10
395	002447	壹桥苗业	1,248	15,337.92	0.10
396	002204	大连重工	1,200	15,312.00	0.10
397	002244	滨江集团	2,700	15,309.00	0.10
398	601616	广电电气	4,277	15,268.89	0.10
399	002093	国脉科技	2,306	15,242.66	0.10
400	600508	上海能源	1,927	15,184.76	0.10
401	600803	威远生化	1,300	15,184.00	0.10
402	600773	西藏城投	1,535	15,181.15	0.10
403	000703	恒逸石化	2,300	15,157.00	0.10
404	002479	富春环保	1,967	15,145.90	0.10
405	002293	罗莱家纺	748	15,034.80	0.10
406	600614	鼎立股份	1,489	14,949.56	0.10
407	600195	中牧股份	1,146	14,909.46	0.09
408	002557	洽洽食品	898	14,888.84	0.09
409	600337	美克股份	2,587	14,849.38	0.09
410	601126	XD 四方股	1,043	14,810.60	0.09

411	600078	澄星股份	2,650	14,787.00	0.09
412	600963	岳阳林纸	4,867	14,649.67	0.09
413	002078	太阳纸业	4,599	14,486.85	0.09
414	002572	索菲亚	881	14,483.64	0.09
415	002233	塔牌集团	2,385	14,453.10	0.09
416	002194	武汉凡谷	1,111	14,165.25	0.09
417	000506	中润资源	3,662	14,135.32	0.09
418	601777	力帆股份	2,199	14,051.61	0.09
419	002601	佰利联	759	14,041.50	0.09
420	600449	宁夏建材	1,913	14,003.16	0.09
421	600888	新疆众和	2,564	13,999.44	0.09
422	600815	厦工股份	3,835	13,997.75	0.09
423	600488	天药股份	3,202	13,864.66	0.09
424	000655	金岭矿业	1,984	13,630.08	0.09
425	002154	报喜鸟	2,335	13,519.65	0.09
426	600723	首商股份	2,194	13,471.16	0.09
427	601011	宝泰隆	1,031	13,413.31	0.09
428	002315	焦点科技	313	13,352.58	0.08
429	000596	古井贡酒	700	13,349.00	0.08
430	600197	伊力特	1,469	13,279.76	0.08
431	600780	通宝能源	3,057	13,175.67	0.08
432	000951	中国重汽	1,118	13,158.86	0.08
433	603077	和邦股份	1,011	13,143.00	0.08
434	600737	XD 中粮屯	2,735	13,073.30	0.08
435	600850	华东电脑	666	13,026.96	0.08
436	600801	华新水泥	1,943	12,959.81	0.08
437	600657	信达地产	4,064	12,882.88	0.08
438	002327	富安娜	1,137	12,654.81	0.08
439	600491	龙元建设	3,790	12,469.10	0.08
440	002489	浙江永强	1,193	12,431.06	0.08
441	002267	陕天然气	1,355	12,330.50	0.08
442	601908	京运通	1,719	12,256.47	0.08
443	600333	长春燃气	1,765	12,196.15	0.08
444	601566	九牧王	1,156	12,184.24	0.08
445	002075	沙钢股份	3,152	12,135.20	0.08
446	601339	百隆东方	1,499	12,126.91	0.08
447	600468	百利电气	1,216	12,111.36	0.08
448	002490	山东墨龙	1,417	12,044.50	0.08
449	000620	新华联	2,130	11,949.30	0.08

450	002678	珠江钢琴	1,274	11,911.90	0.08
451	600162	香江控股	2,559	11,873.76	0.08
452	000688	建新矿业	2,274	11,847.54	0.08
453	601233	桐昆股份	1,927	11,812.51	0.08
454	601388	怡球资源	1,093	11,793.47	0.07
455	601636	旗滨集团	1,631	11,677.96	0.07
456	000552	靖远煤电	1,437	11,668.44	0.07
457	601100	恒立油缸	1,259	11,658.34	0.07
458	601999	出版传媒	1,468	11,641.24	0.07
459	002305	南国置业	1,919	11,609.95	0.07
460	600280	中央商场	1,148	11,583.32	0.07
461	000409	山东地矿	1,260	11,466.00	0.07
462	000927	一汽夏利	3,190	11,388.30	0.07
463	600724	宁波富达	2,890	11,386.60	0.07
464	000861	海印股份	1,184	11,354.56	0.07
465	002430	杭氧股份	1,663	11,325.03	0.07
466	002226	江南化工	1,066	11,310.26	0.07
467	600507	方大特钢	3,535	11,170.60	0.07
468	600618	氯碱化工	1,499	11,137.57	0.07
469	601208	东材科技	1,641	11,076.75	0.07
470	600510	黑牡丹	2,121	11,029.20	0.07
471	603001	奥康国际	801	11,013.75	0.07
472	002032	苏泊尔	800	10,952.00	0.07
473	000987	广州友谊	1,196	10,895.56	0.07
474	600094	大名城	1,750	10,885.00	0.07
475	600869	远东电缆	1,319	10,749.85	0.07
476	600054	黄山旅游	840	10,710.00	0.07
477	002238	天威视讯	854	10,700.62	0.07
478	000780	平庄能源	2,704	10,653.76	0.07
479	600268	国电南自	2,100	10,416.00	0.07
480	601010	文峰股份	1,478	10,316.44	0.07
481	002498	汉缆股份	1,430	10,267.40	0.07
482	603555	贵人鸟	800	10,184.00	0.06
483	002419	天虹商场	1,066	10,127.00	0.06
484	600743	华远地产	3,634	10,102.52	0.06
485	002378	章源钨业	570	10,020.60	0.06
486	002320	海峡股份	1,135	10,010.70	0.06
487	002662	京威股份	1,199	9,627.97	0.06
488	000719	大地传媒	803	9,515.55	0.06

489	000631	顺发恒业	2,090	9,446.80	0.06
490	600397	安源煤业	2,639	8,946.21	0.06
491	600184	光电股份	418	8,819.80	0.06
492	002503	搜于特	1,036	8,495.20	0.05
493	002225	濮耐股份	1,585	8,384.65	0.05
494	002612	朗姿股份	399	8,011.92	0.05
495	000603	盛达矿业	673	7,948.13	0.05
496	002705	新宝股份	500	7,470.00	0.05
497	002534	杭锅股份	533	7,147.53	0.05
498	000935	四川双马	1,334	6,950.14	0.04

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002167	东方锆业	8,732	99,457.48	0.63
2	002252	上海莱士	1,246	78,871.80	0.50
3	002638	勤上光电	1,915	28,476.05	0.18
4	002306	湘鄂情	3,866	21,533.62	0.14
5	000683	远兴能源	5,686	20,242.16	0.13

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	002400	省广股份	223,805.55	0.43
2	600587	新华医疗	220,567.44	0.43
3	600881	亚泰集团	202,540.00	0.39
4	600320	振华重工	156,477.00	0.30
5	600300	维维股份	151,925.92	0.30
6	000422	湖北宜化	142,290.10	0.28
7	002092	中泰化学	134,268.00	0.26
8	002153	石基信息	131,383.10	0.26
9	600125	铁龙物流	131,108.00	0.25
10	002266	浙富控股	119,264.00	0.23

11	000788	北大医药	114,366.00	0.22
12	600812	华北制药	111,375.00	0.22
13	601718	际华集团	110,010.00	0.21
14	000977	浪潮信息	106,674.00	0.21
15	600199	金种子酒	102,621.00	0.20
16	600640	号百控股	101,312.00	0.20
17	000413	东旭光电	99,536.00	0.19
18	000049	德赛电池	99,442.00	0.19
19	000921	海信科龙	98,566.00	0.19
20	000969	安泰科技	94,490.80	0.18

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

7.4.2 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	002230	科大讯飞	342,027.70	0.66
2	000503	海虹控股	336,994.60	0.65
3	600499	科达洁能	319,563.96	0.62
4	002008	大族激光	317,630.08	0.62
5	000400	许继电气	290,590.80	0.56
6	000793	华闻传媒	289,007.33	0.56
7	002465	海格通信	286,262.81	0.56
8	000661	长春高新	280,194.00	0.54
9	600388	龙净环保	279,689.80	0.54
10	601929	吉视传媒	272,781.65	0.53
11	600594	益佰制药	257,788.70	0.50
12	002410	广联达	233,462.45	0.45
13	600880	博瑞传播	231,712.46	0.45
14	000917	电广传媒	217,406.94	0.42
15	600867	通化东宝	214,797.43	0.42
16	600570	恒生电子	211,913.25	0.41
17	600557	康缘药业	199,248.31	0.39
18	000598	兴蓉投资	194,576.86	0.38
19	002400	省广股份	188,963.44	0.37
20	600872	中炬高新	184,419.45	0.36

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相

关交易费用。

7.4.3 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	9,329,333.05
卖出股票收入（成交）总额	42,838,429.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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投资。

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 恒生电子 2014 年 1 月 2 日公告称，日前董事会办公室收到本公司控股子公司杭州数米基金销售有限公司的报告，称其收到浙江证监局【2013】13 号行政监管措施决定书。因违反《证券投资基金销售管理办法》相关规定，数米公司被责令限期改正。

本公司对该证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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	15,818.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	202.86
5	应收申购款	297.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	55,757.58
8	其他	-
9	合计	72,075.95

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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002167	东方锆业	99,457.48	0.63	重大事项停牌
2	002252	上海莱士	78,871.80	0.50	重大事项停牌
3	002638	勤上光电	28,476.05	0.18	重大事项停牌
4	002306	湘鄂情	21,533.62	0.14	重大事项停牌
5	000683	远兴能源	20,242.16	0.13	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
华商中证 500 指数分级	130	98,999.38	9,544,632.25	74.16%	3,325,286.79	25.84%
华商 500A	228	1,979.68	1.00	0.00%	451,365.00	100.00%
华商 500B	246	2,752.24	2.00	0.00%	677,048.00	100.00%
合计	604	23,176.05	9,544,635.25	68.18%	4,453,699.79	31.82%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华商 500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黎明	40,004.00	8.86%
2	赵金才	39,200.00	8.68%
3	陈炜嵘	33,500.00	7.42%
4	姚莉君	31,708.00	7.02%
5	冯月琼	23,602.00	5.23%
6	王立建	21,606.00	4.79%
7	周继玺	20,191.00	4.47%

8	陈培坤	20,004.00	4.43%
9	王进莲	20,002.00	4.43%
10	郑朝琴	20,002.00	4.43%

华商 500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	林胜蓝	70,000.00	10.34%
2	杜胜利	60,012.00	8.86%
3	赵金才	58,800.00	8.68%
4	吴凤英	42,000.00	6.20%
5	冯月琼	35,402.00	5.23%
6	张采	32,505.00	4.80%
7	陈培坤	30,007.00	4.43%
8	韩志慧	30,005.00	4.43%
9	王进莲	30,002.00	4.43%
10	余乐	30,002.00	4.43%
11	郑朝琴	30,002.00	4.43%
12	熊志强	30,002.00	4.43%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华商中证 500 指数分级	60,123.14	0.4672%
	华商 500A	—	—
	华商 500B	—	—
	合计	60,123.14	0.4295%

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	份额级别	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	华商中证 500 指数分级	0~10
	华商 500A	—
	华商 500B	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华商中证 500 指数分级	0
	华商 500A	0
	华商 500B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华商中证 500 指数分级	华商 500A	华商 500B
基金合同生效日（2012 年 9 月 6 日）基金份额总额	136,205,997.63	83,325,734.00	124,988,602.00
本报告期期初基金份额总额	44,254,220.83	661,394.00	992,092.00
本报告期基金总申购份额	991,389.24	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	32,900,761.03	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	525,070.00	-210,028.00	-315,042.00
本报告期期末基金份额总额	12,869,919.04	451,366.00	677,050.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人 2014 年 2 月 24 日发布公告，经华商基金管理有限公司研究决定，陆涛先生、田明圣先生、梁永强先生担任公司副总经理职务。上述变更事项，由华商基金管理有限公司第三届董事会第二次会议审议通过，并经中国证券投资基金业协会中基协高备函【2014】4、5、6 号文核准批复。

本报告期内，因本基金托管人工商银行股份有限公司工作需要，周月秋同志不再担任本基金托管人资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本基金托管人资产托管部总经理部分业务授权职责。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日（2012 年 9 月 6 日）起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员未发生受监管部门稽查或处罚的情形。

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	
光大证券	2	52,152,534.77	100.00%	47,479.81	100.00%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

注：选择专用席位的标准和程序：

（1）选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

（2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，

基金管理人留存监察稽核部备案。

（3）本基金本期撤销日信证券交易单元一个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	华商中证 500 指数分级证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 1 月 2 日
2	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 1 月 17 日
3	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 1 月 14 日
4	华商中证 500 指数分级证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 1 月 20 日
5	华商基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 2 月 24 日
6	华商基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 2 月 27 日
7	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 3 月 11 日
8	华商中证 500 指数分级证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 3 月 26 日
9	华商中证 500 指数分级证券投资基金 2013 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 3 月 26 日
10	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 4 月 1 日
11	华商中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2014 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 4 月 18 日
12	华商中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）（2014 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 4 月 18 日
13	华商中证 500 指数分级证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 4 月 22 日
14	华商基金管理有限公司关于华商中证 500 基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 6 月 11 日
15	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 6 月 16 日
16	华商基金管理有限公司关于旗下基金转换业务申购费补差计算方式的调整公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华商中证 500 指数分级证券投资基金设立的文件；
- 2、《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《华商中证 500 指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内华商中证 500 指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

华商基金管理有限公司

2014 年 8 月 26 日