

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2015 年 5 月 5 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 审计报告.....	12
§7 年度财务报表.....	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	16
§8 投资组合报告.....	36
8.1 期末基金资产组合情况.....	36
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
8.12 投资组合报告附注.....	54
§9 基金份额持有人信息.....	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	55
§10 开放式基金份额变动.....	55
§11 重大事件揭示.....	56
§12 备查文件目录.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 500ETF
场内简称	中证 500
基金主代码	512500
交易代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	316,008,794 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 5 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为“中证 500 指数”。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033

法定代表人	杨明辉	王洪章
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-112,694,712.19
本期利润	-270,682,030.94
加权平均基金份额本期利润	-0.5185
本期加权平均净值利润率	-18.23%
本期基金份额净值增长率	-20.61%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-297,584,459.60
期末可供分配基金份额利润	-0.9417
期末基金资产净值	1,146,121,335.95
期末基金份额净值	3.6269
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-20.61%

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

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

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

④本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	23.36%	1.95%	24.40%	2.05%	-1.04%	-0.10%
过去六个月	-15.24%	3.17%	-14.47%	3.23%	-0.77%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-20.61%	3.11%	-10.49%	3.25%	-10.12%	-0.14%

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

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 5 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：①本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效。

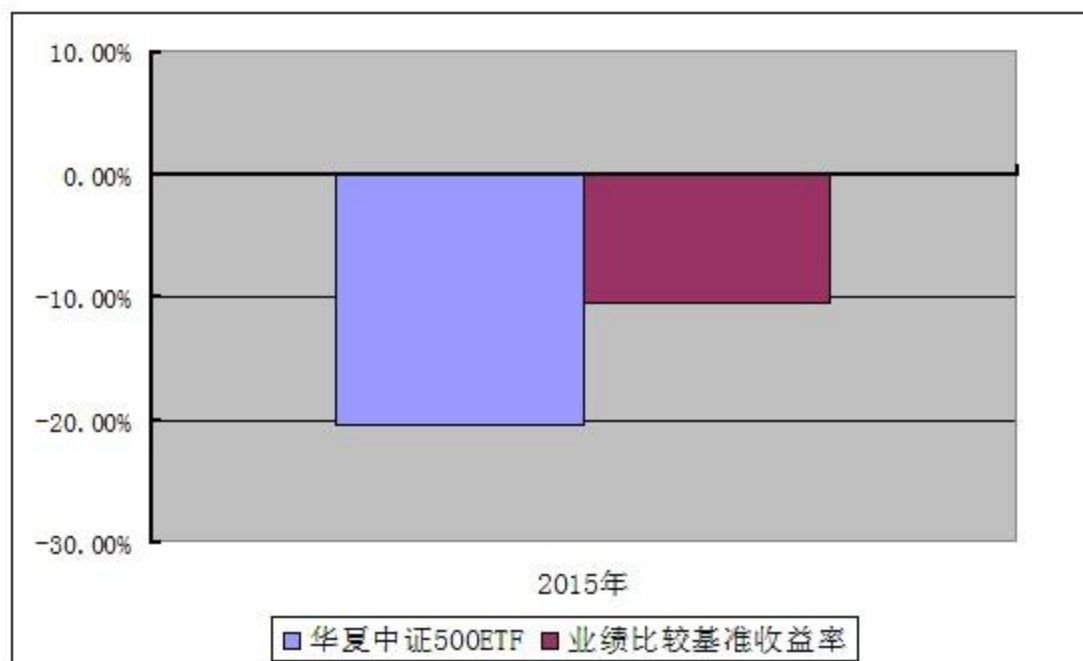
②根据华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

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

的比较

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，截至 2015 年 12 月 31 日，旗下共管理 12 只 ETF 产品，分别为华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏能源 ETF、华夏材料 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF 和华夏沪港通恒生 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

2015 年，在《中国证券报》主办的“第十二届中国基金业金牛奖”评选中，华夏永福养老理财混合荣获“2014 年度开放式混合型金牛基金”；在《上海证券报》主办的第十二届中国“金基金”奖的评选中，华夏永福养老理财混合、华夏沪深 300ETF 获得“金基金”产品奖；在《证券时报》主办的“2014 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏策略混合获得“五年持续回报积极混合型明星基金奖”。

2015 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户的使用便利性和服务体验：（1）全面改版客服热线自助语音服务，新增快速查账、手机绑定等多项功能，为客户提供更便捷的自助查询方式；（2）提前网上查询和自助语音数据更新时间，让客户能更及时地了解交易信息；（3）与苏宁易购、苏宁金融、网易理财等互联网平台合作，为客户购买旗下基金提供更多优惠便捷的交易通道，同时也满足了网上交易客户基金交易以外的消费需求。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方军	本基金的基金经理、数量投资部总监	2015-05-05	-	16 年	硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理、华夏回报证券投资基金基金经理助理、数量投资部副总经理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。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《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深

300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值选取排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。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而进行相应调整。

2015 年，国际方面，美国经济继续复苏，美联储加息 0.25 个百分点；欧洲经济则在其宽松政策下维持稳定。国内方面，工业增速仍然较弱，投资和消费均未出现明显恢复，出口依然低迷并面临日益不确定的国际环境。在此背景下，政府一方面继续通过改革推进结构调整，另一方面通过积极的财政政策确保经济平稳运行，更进一步系统性地提出通过加强“供给侧改革”引导经济持续健康发展。货币政策方面，央行降息降准，放开存款利率上限，继续深化利率市场化改革。人民币对美元贬值明显，而人民币将于明年正式纳入国际货币基金组织（IMF）特别提款权货币篮子将加速其国际化进程。

市场方面，年初以来，因政府推出一系列措施持续提振市场信心，A 股市场出现了一波较大幅度的上涨行情。但在 6 月中旬以后，受监管机构大力整顿两融及场外配资等影响，市场出现深幅快速调整，跌幅明显。其后，受政府多种稳定市场措施影响，A 股表现为较大幅度的震荡；8 月中旬至 8 月底，受汇改及境外市场大幅调整与继续整顿两融、配资等业务的影响，市场又出现深幅而快速的调整；随后，政府加大了稳定市场措施的力度，市场出现窄幅震荡，进入修复及自我调节阶段。中证 500 指数本报告期上涨 43.12%，总体表现好于市场平均水平。

基金投资运作方面，报告期内，本基金严格按照基金合同要求，完成组合的建仓工作，在指数权重及成份股变动时，努力降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合至目标结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 3.6269 元，本报告期份额净值增长率为-20.61%，同期业绩比较基准增长率为-10.49%。本基金本报告期跟踪偏离度为-10.12%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，国际方面，美国经济将继续维持稳定，欧洲经济可能持续回暖，需重点关注美元后续加息及其对经济的影响。国内方面，政府将全力推进“供给侧改革”，预计在削减过剩产能、降低企业成本、消化房地产库存、扩大有效供给等方面有较大动作。财政政策可能更为积极，货币政策也将维持宽松。总体上，经济仍面临较大挑战，市场方面也依然存在较多不确定性。前期调整中，中证 500 指数成份股下跌幅度较大，如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，中证 500 指数在反弹行情中或将有相对较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司制定了员工行为规范、员工行为准则，修订了员工投资行为管理制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；加强事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、基金交易、市场销售，后台运作等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种

进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、法律监察工作负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权。当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2016)第 21750 号

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华夏中证 500ETF 基金”）的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华夏中证 500ETF 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。

选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述华夏中证 500ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏中证 500ETF 基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 许康玮 洪磊

上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2016 年 3 月 7 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	24,962,045.28
结算备付金		41,424,174.24
存出保证金		15,126,165.65
交易性金融资产	7.4.7.2	1,070,992,413.56
其中：股票投资		1,070,992,413.56
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-

贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		3,232,295.65
应收利息	7.4.7.5	35,951.33
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,155,773,045.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		6,623,411.53
应付赎回款		-
应付管理人报酬		569,435.13
应付托管费		113,887.02
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	155,862.12
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	2,189,113.96
负债合计		9,651,709.76
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	1,443,705,795.55
未分配利润	7.4.7.10	-297,584,459.60
所有者权益合计		1,146,121,335.95
负债和所有者权益总计		1,155,773,045.71

注：①报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.6269 元，基金份额总额 316,008,794 份。

②本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，本报告期自 2015 年 5 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日） 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-262,405,351.82
1.利息收入		1,335,084.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,335,084.70
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）		-106,090,444.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-117,530,209.47
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	5,451,280.00
股利收益	7.4.7.17	5,988,485.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-157,987,318.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	337,326.54
减：二、费用		8,276,679.12
1.管理人报酬		4,801,501.19
2.托管费		960,300.24
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.20	2,023,634.38
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.21	491,243.31

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-270,682,030.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-270,682,030.94

注：本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，本报告期自 2015 年 5 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,134,473,505.00	-	2,134,473,505.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-270,682,030.94	-270,682,030.94
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）	-690,767,709.45	-26,902,428.66	-717,670,138.11
其中：1.基金申购款	920,959,900.11	-167,642,347.65	753,317,552.46
2.基金赎回款	-1,611,727,609.56	140,739,918.99	-1,470,987,690.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,443,705,795.55	-297,584,459.60	1,146,121,335.95

注：本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，本报告期自 2015 年 5 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨明辉	_____ 汪贵华	_____ 汪贵华
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获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]113 号《关于准予华夏中证 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》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 2,134,343,230 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,134,473,505 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,275 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2015 年 5 月 22 日为基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2015 年 5 月 22 日中证 500 指数收盘值的两千万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 2,134,473,505 份，本次基金份额折算比例为 0.21889230，折算后基金份额总额为 467,208,794 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、国债期货、权证、货币市场工具、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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

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

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

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括

交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。赎回转出股票投资收益/(损失)于赎回当日按转出股票以当日市场交易收盘价计算的市值与其成本的差额确认。

当本基金申购或赎回对价中包含可以现金替代或退补现金替代时,在本基金补足或卖出被替代股票(或采取强制退款)之前,该股票估值日与申购日或赎回日估值的差额确认为“公允价值变动收益/(损失)”。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

2、在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21

号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，于 2015 年 3 月 20 日起按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。

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

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	24,962,045.28
定期存款	-
其他存款	-
合计	24,962,045.28

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,229,335,452.31	1,070,992,413.56	-158,343,038.75
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	1,229,335,452.31	1,070,992,413.56	-158,343,038.75

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	73,990,000.00	-	-	-
其中：股指期货	73,990,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	73,990,000.00	-	-	-

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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1601	中证 500 股指期货 IC1601 合约	50	73,990,000.00	355,720.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理。
公允价值变动总额合计					355,720.00
股指期货投资本期收益					5,451,280.00
股指期货投资本期公允价值变动					355,720.00

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,632.99
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	27,155.87

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	162.47
合计	35,951.33

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	155,862.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	155,862.12

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
可退替代款	1,009,677.70
应退替代款	961,337.79
预提费用	120,000.00
应付指数使用费	98,098.47
合计	2,189,113.96

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,134,473,505.00	2,134,473,505.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2015 年 5 月 22 日基金拆分/ 份额折算前	2,134,473,505.00	2,134,473,505.00

基金拆分/份额折算调整	-1,667,264,711.00	-
本期申购	201,586,620.00	920,959,900.11
本期赎回（以“-”号填列）	-352,786,620.00	-1,611,727,609.56
本期末	316,008,794.00	1,443,705,795.55

注：本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,134,343,230.00 元。根据《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金的认购资金在募集期间产生的利息 130,275.00 元在本基金合同生效后，折算为 130,275.00 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-112,694,712.19	-157,987,318.75	-270,682,030.94
本期基金份额交易产生的变动数	538,995.57	-27,441,424.23	-26,902,428.66
其中：基金申购款	-9,151,402.16	-158,490,945.49	-167,642,347.65
基金赎回款	9,690,397.73	131,049,521.26	140,739,918.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-112,155,716.62	-185,428,742.98	-297,584,459.60

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,018,135.94
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	310,779.68
其他	6,169.08
合计	1,335,084.70

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
股票投资收益--买卖股票差	-66,679,319.19

价收入	
股票投资收益--赎回差价收入	-50,850,890.28
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-117,530,209.47

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,128,555,369.39
减：卖出股票成本总额	1,195,234,688.58
买卖股票差价收入	-66,679,319.19

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,363,334,367.76
减：现金支付赎回款总额	773,237,554.76
减：赎回股票成本总额	640,947,703.28
赎回差价收入	-50,850,890.28

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	5,451,280.00
合计	5,451,280.00

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,988,485.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,988,485.16

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-158,343,038.75
——股票投资	-158,343,038.75
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	355,720.00
——权证投资	-
——股指期货	355,720.00
3.其他	-
合计	-157,987,318.75

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	161,479.98
替代损益	-452,472.28
其他	628,318.84
合计	337,326.54

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,023,634.38
银行间市场交易费用	-
合计	2,023,634.38

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00
信息披露费	50,000.00
指数使用费	288,090.05
上市费	65,000.00
银行费用	17,393.26
其他	760.00
合计	491,243.31

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、场外销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人

中信证券股份有限公司 ("中信证券")	基金管理人的股东、场内申购赎回代办券商
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 ("华夏中证 500ETF 联接")	该基金是本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,801,501.19

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	960,300.24

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 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
中信证券	65.00	0.00%
华夏中证 500ETF 联接	227,997,423.00	72.15%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	24,962,045.28	1,018,135.94

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	34.88	2016-03-10	31.39	232,500	7,434,211.17	8,109,600.00	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项	44.08	-	-	173,200	5,519,465.40	7,634,656.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	22.33	2016-01-21	20.10	305,200	5,702,466.05	6,815,116.00	-
600122	宏图高科	2015-12-25	重大事项	19.42	-	-	264,176	4,450,027.70	5,130,297.92	-
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项	21.54	2016-03-10	19.39	236,100	4,314,256.97	5,085,594.00	-
600654	中安消	2015-12-14	重大事项	28.84	-	-	158,400	4,643,843.16	4,568,256.00	-
600584	长电科技	2015-11-30	重大事项	22.02	-	-	190,533	4,559,219.81	4,195,536.66	-
002219	恒康医疗	2015-07-08	重大事项	14.90	-	-	251,032	4,000,941.14	3,740,376.80	-
002049	同方国芯	2015-12-11	重大事项	60.15	2016-03-11	54.14	58,900	3,185,941.10	3,542,835.00	-
600200	江苏吴中	2015-11-26	重大事项	27.89	2016-03-16	25.10	126,800	3,122,552.91	3,536,452.00	-
002340	格林美	2015-12-29	重大事项	15.20	2016-01-06	14.35	217,570	3,410,522.46	3,307,064.00	-
300088	长信科技	2015-12-14	重大事项	14.03	2016-02-29	12.63	232,666	3,355,319.04	3,264,303.98	-
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项	13.00	2016-02-22	11.70	243,700	2,432,298.04	3,168,100.00	-
600219	南山铝业	2015-09-29	重大事项	6.58	2016-01-25	7.00	427,700	4,661,755.81	2,814,266.00	-
002143	印纪传媒	2015-12-09	重大事项	40.55	2016-01-05	36.50	67,970	2,384,340.78	2,756,183.50	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	15.80	-	-	171,900	3,365,411.00	2,716,020.00	-
600851	海欣股份	2015-12-21	重大事项	14.70	2016-01-19	13.23	183,900	2,563,040.20	2,703,330.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项	12.22	-	-	205,700	4,136,210.93	2,513,654.00	-
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项	42.69	2016-01-18	38.42	57,000	2,435,210.23	2,433,330.00	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项	17.40	-	-	138,410	3,413,399.06	2,408,334.00	-
000028	国药一致	2015-10-21	重大事项	66.15	-	-	35,658	2,782,247.41	2,358,776.70	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项	16.72	2016-02-22	15.05	140,800	2,466,775.00	2,354,176.00	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项	31.25	2016-03-10	29.00	63,100	2,461,926.96	1,971,875.00	-
600759	洲际油气	2015-09-21	重大事项	7.85	-	-	231,580	3,077,933.32	1,817,903.00	-
600859	王府井	2015-12-21	重大事项	27.22	2016-01-04	27.22	66,200	1,998,060.87	1,801,964.00	-
601717	郑煤机	2015-12-18	重大事项	7.52	-	-	237,500	2,414,791.68	1,786,000.00	-

600572	康恩贝	2015-12-29	重大事项	13.36	2016-01-04	13.18	133,670	2,410,829.77	1,785,831.20	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项	22.68	2016-01-11	20.41	77,500	1,504,068.12	1,757,700.00	-
601000	唐山港	2015-10-29	重大事项	8.25	2016-02-17	7.98	202,700	2,683,075.25	1,672,275.00	-
002698	博实股份	2015-12-28	重大事项	29.33	2016-01-05	26.40	55,310	2,058,717.13	1,622,242.30	-
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大事项	7.06	2016-03-21	7.77	217,800	1,589,571.59	1,537,668.00	-
600645	中源协和	2015-12-30	重大事项	65.01	2016-01-04	63.90	22,700	1,319,376.16	1,475,727.00	-
601678	滨化股份	2015-12-31	重大事项	8.02	2016-01-05	7.22	180,700	1,634,379.30	1,449,214.00	-
600282	南钢股份	2015-12-30	重大事项	3.17	2016-01-12	3.24	416,100	1,340,565.69	1,319,037.00	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事项	89.53	2016-02-15	80.58	14,600	1,481,060.92	1,307,138.00	-
600729	重庆百货	2015-07-24	重大事项	32.39	2016-01-04	29.90	38,600	1,405,230.48	1,250,254.00	-
600120	浙江东方	2015-10-12	重大事项	19.86	-	-	59,300	2,089,798.95	1,177,698.00	-
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大事项	7.50	2016-01-18	8.25	154,600	3,278,795.98	1,159,500.00	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事项	17.21	2016-01-19	15.49	56,300	1,023,874.37	968,923.00	-
002371	七星电子	2015-10-08	重大事项	19.28	2016-01-11	21.21	43,650	1,787,191.29	841,572.00	-
600864	哈投股份	2015-10-09	重大事项	10.88	2016-01-14	11.97	68,500	1,446,895.17	745,280.00	-
600429	三元股份	2015-09-21	重大事项	7.29	2016-01-27	7.49	91,800	1,005,062.27	669,222.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律监察部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；

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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合 Beta 值等指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的

价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,070,992,413.56	93.44
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
合计	1,070,992,413.56	93.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为中证 500 指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	2、假定中证 500 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。	
	3、Beta 系数是根据组合在报表日各类持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。	
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 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	55,953,643.62
	-5%	-55,953,643.62

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确

定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 1,070,992,413.56 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。

7.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

7.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,070,992,413.56	92.66
	其中：股票	1,070,992,413.56	92.66
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	66,386,219.52	5.74
7	其他各项资产	18,394,412.63	1.59
8	合计	1,155,773,045.71	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 期末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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,233,398.69	1.85
B	采矿业	32,992,436.10	2.88
C	制造业	646,554,861.87	56.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,787,752.80	2.77
E	建筑业	28,129,104.15	2.45
F	批发和零售业	62,168,701.91	5.42
G	交通运输、仓储和邮政业	29,120,498.36	2.54
H	住宿和餐饮业	2,345,324.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,953,331.48	6.10
J	金融业	9,185,632.00	0.80
K	房地产业	73,271,370.09	6.39
L	租赁和商务服务业	21,139,247.59	1.84
M	科学研究和技术服务业	2,916,923.40	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	7,815,544.10	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,767,692.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	14,460,781.33	1.26
S	综合	15,149,813.69	1.32
	合计	1,070,992,413.56	93.44

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000748	长城信息	232,500	8,109,600.00	0.71
2	002018	华信国际	173,200	7,634,656.00	0.67
3	600978	宜华木业	305,200	6,815,116.00	0.59
4	000566	海南海药	149,100	5,794,026.00	0.51
5	002439	启明星辰	173,433	5,549,856.00	0.48
6	002466	天齐锂业	39,200	5,517,400.00	0.48
7	002400	省广股份	216,310	5,440,196.50	0.47
8	002405	四维图新	137,519	5,335,737.20	0.47
9	600503	华丽家族	384,000	5,260,800.00	0.46

10	600482	风帆股份	110,600	5,203,730.00	0.45
11	600201	生物股份	140,010	5,176,169.70	0.45
12	600160	巨化股份	219,800	5,158,706.00	0.45
13	600122	宏图高科	264,176	5,130,297.92	0.45
14	000066	长城电脑	236,100	5,085,594.00	0.44
15	600635	大众公用	497,300	4,903,378.00	0.43
16	600079	人福医药	217,594	4,843,642.44	0.42
17	002030	达安基因	116,160	4,783,468.80	0.42
18	000012	南 玻 A	342,700	4,575,045.00	0.40
19	600654	中安消	158,400	4,568,256.00	0.40
20	600410	华胜天成	168,901	4,477,565.51	0.39
21	600074	保千里	270,100	4,448,547.00	0.39
22	600388	龙净环保	256,100	4,425,408.00	0.39
23	600158	中体产业	165,800	4,324,064.00	0.38
24	601168	西部矿业	572,000	4,227,080.00	0.37
25	600584	长电科技	190,533	4,195,536.66	0.37
26	002276	万马股份	138,300	4,162,830.00	0.36
27	002701	奥瑞金	147,225	4,160,578.50	0.36
28	000997	新 大 陆	163,600	4,142,352.00	0.36
29	002085	万丰奥威	128,660	4,140,278.80	0.36
30	000887	中鼎股份	174,300	4,113,480.00	0.36
31	000998	隆平高科	170,500	4,049,375.00	0.35
32	300182	捷成股份	168,600	4,046,400.00	0.35
33	601929	吉视传媒	650,700	4,021,326.00	0.35
34	002191	劲嘉股份	261,600	4,018,176.00	0.35
35	600655	豫园商城	246,400	3,981,824.00	0.35
36	300257	开山股份	128,700	3,970,395.00	0.35
37	002004	华邦健康	278,600	3,942,190.00	0.34
38	600499	科达洁能	173,200	3,919,516.00	0.34
39	600816	安信信托	170,450	3,881,146.50	0.34
40	600516	方大炭素	310,000	3,878,100.00	0.34
41	002657	中科金财	47,400	3,791,526.00	0.33
42	600694	大商股份	72,506	3,743,484.78	0.33
43	002219	恒康医疗	251,032	3,740,376.80	0.33
44	600664	哈药股份	310,800	3,707,844.00	0.32
45	600498	烽火通信	129,840	3,701,738.40	0.32
46	002573	清新环境	163,000	3,657,720.00	0.32

47	600525	长园集团	192,465	3,624,115.95	0.32
48	002308	威创股份	147,010	3,623,796.50	0.32
49	002161	远 望 谷	162,401	3,621,542.30	0.32
50	601012	隆基股份	264,400	3,609,060.00	0.31
51	300085	银之杰	64,400	3,599,960.00	0.31
52	600643	爱建集团	244,630	3,583,829.50	0.31
53	000970	中科三环	255,204	3,580,512.12	0.31
54	000050	深天马 A	168,300	3,569,643.00	0.31
55	000078	海王生物	148,762	3,564,337.52	0.31
56	002049	同方国芯	58,900	3,542,835.00	0.31
57	300253	卫宁软件	84,559	3,541,330.92	0.31
58	600376	首开股份	283,200	3,540,000.00	0.31
59	600200	江苏吴中	126,800	3,536,452.00	0.31
60	600770	综艺股份	193,300	3,531,591.00	0.31
61	600312	平高电气	180,400	3,517,800.00	0.31
62	600478	科力远	159,180	3,489,225.60	0.30
63	300122	智飞生物	95,900	3,488,842.00	0.30
64	600487	亨通光电	218,600	3,484,484.00	0.30
65	000718	苏宁环球	263,317	3,473,151.23	0.30
66	002489	浙江永强	319,458	3,462,924.72	0.30
67	600594	益佰制药	162,700	3,449,240.00	0.30
68	600436	片仔癀	50,025	3,441,219.75	0.30
69	600094	大名城	323,900	3,439,818.00	0.30
70	600881	亚泰集团	474,800	3,437,552.00	0.30
71	600108	亚盛集团	467,200	3,429,248.00	0.30
72	600522	中天科技	149,200	3,416,680.00	0.30
73	300147	香雪制药	135,790	3,396,107.90	0.30
74	300072	三聚环保	99,260	3,371,862.20	0.29
75	000031	中粮地产	239,400	3,363,570.00	0.29
76	300055	万邦达	153,300	3,328,143.00	0.29
77	000661	长春高新	27,600	3,324,420.00	0.29
78	600601	方正科技	537,500	3,321,750.00	0.29
79	600500	中化国际	258,500	3,311,385.00	0.29
80	002340	格林美	217,570	3,307,064.00	0.29
81	600497	驰宏锌锗	299,100	3,302,064.00	0.29
82	300088	长信科技	232,666	3,264,303.98	0.28
83	000988	华工科技	153,100	3,242,658.00	0.28

84	600143	金发科技	376,333	3,236,463.80	0.28
85	000592	平潭发展	160,660	3,209,986.80	0.28
86	600435	北方导航	111,400	3,197,180.00	0.28
87	002022	科华生物	109,510	3,186,741.00	0.28
88	600240	华业资本	211,100	3,177,055.00	0.28
89	300291	华录百纳	89,200	3,175,520.00	0.28
90	000547	航天发展	166,670	3,175,063.50	0.28
91	000973	佛塑科技	243,700	3,168,100.00	0.28
92	600521	华海药业	122,301	3,105,222.39	0.27
93	001696	宗申动力	223,900	3,094,298.00	0.27
94	600138	中青旅	132,499	3,088,551.69	0.27
95	600673	东阳光科	301,243	3,069,666.17	0.27
96	002325	洪涛股份	194,675	3,042,770.25	0.27
97	002358	森源电气	164,700	3,038,715.00	0.27
98	002223	鱼跃医疗	78,961	3,036,050.45	0.26
99	002266	浙富控股	371,613	3,024,929.82	0.26
100	600316	洪都航空	129,200	3,015,528.00	0.26
101	300267	尔康制药	89,678	3,013,180.80	0.26
102	300199	翰宇药业	121,800	2,999,934.00	0.26
103	600797	浙大网新	207,200	2,979,536.00	0.26
104	002498	汉缆股份	399,900	2,975,256.00	0.26
105	002665	首航节能	97,500	2,973,750.00	0.26
106	000671	阳光城	328,465	2,966,038.95	0.26
107	600597	光明乳业	185,900	2,959,528.00	0.26
108	600879	航天电子	164,600	2,941,402.00	0.26
109	300026	红日药业	138,300	2,918,130.00	0.25
110	000690	宝新能源	297,330	2,907,887.40	0.25
111	002250	联化科技	153,205	2,890,978.35	0.25
112	002217	合力泰	169,500	2,873,025.00	0.25
113	600171	上海贝岭	135,200	2,864,888.00	0.25
114	002001	新和成	163,900	2,858,416.00	0.25
115	600811	东方集团	329,100	2,856,588.00	0.25
116	002179	中航光电	74,960	2,845,481.60	0.25
117	002595	豪迈科技	125,399	2,845,303.31	0.25
118	002714	牧原股份	60,200	2,833,614.00	0.25
119	000930	中粮生化	191,600	2,831,848.00	0.25
120	000541	佛山照明	169,444	2,829,714.80	0.25

121	600611	大众交通	183,600	2,818,260.00	0.25
122	600219	南山铝业	427,700	2,814,266.00	0.25
123	600418	江淮汽车	192,400	2,807,116.00	0.24
124	000650	仁和药业	265,288	2,804,094.16	0.24
125	601311	骆驼股份	128,300	2,800,789.00	0.24
126	002508	老板电器	62,154	2,793,822.30	0.24
127	000511	烯碳新材	238,412	2,791,804.52	0.24
128	300274	阳光电源	101,600	2,785,872.00	0.24
129	300244	迪安诊断	39,800	2,767,692.00	0.24
130	002143	印纪传媒	67,970	2,756,183.50	0.24
131	600884	杉杉股份	70,200	2,754,648.00	0.24
132	000616	海航投资	350,118	2,751,927.48	0.24
133	600176	中国巨石	107,900	2,741,739.00	0.24
134	300043	互动娱乐	171,900	2,716,020.00	0.24
135	000939	凯迪生态	188,483	2,714,155.20	0.24
136	600851	海欣股份	183,900	2,703,330.00	0.24
137	600198	大唐电信	109,200	2,693,964.00	0.24
138	000006	深振业 A	233,200	2,684,132.00	0.23
139	600755	厦门国贸	284,900	2,655,268.00	0.23
140	600026	中海发展	285,500	2,638,020.00	0.23
141	600325	华发股份	161,200	2,627,560.00	0.23
142	600064	南京高科	138,000	2,615,100.00	0.23
143	300273	和佳股份	125,100	2,614,590.00	0.23
144	600511	国药股份	68,700	2,605,104.00	0.23
145	000732	泰禾集团	106,300	2,604,350.00	0.23
146	002013	中航机电	114,550	2,595,703.00	0.23
147	002444	巨星科技	124,800	2,583,360.00	0.23
148	600422	昆药集团	64,600	2,572,372.00	0.22
149	600289	亿阳信通	130,500	2,570,850.00	0.22
150	000681	视觉中国	67,425	2,562,824.25	0.22
151	002344	海宁皮城	166,600	2,555,644.00	0.22
152	600320	振华重工	427,430	2,551,757.10	0.22
153	600536	中国软件	70,400	2,540,032.00	0.22
154	002073	软控股份	150,000	2,535,000.00	0.22
155	002428	云南锗业	124,700	2,528,916.00	0.22
156	603766	隆鑫通用	106,500	2,527,245.00	0.22
157	002273	水晶光电	62,200	2,525,320.00	0.22

158	000829	天音控股	205,700	2,513,654.00	0.22
159	000543	皖能电力	293,420	2,485,267.40	0.22
160	600704	物产中大	140,500	2,475,610.00	0.22
161	002603	以岭药业	136,500	2,474,745.00	0.22
162	600175	美都能源	341,129	2,466,362.67	0.22
163	002299	圣农发展	112,071	2,464,441.29	0.22
164	600017	日照港	376,100	2,459,694.00	0.21
165	000762	西藏矿业	93,100	2,448,530.00	0.21
166	600835	上海机电	80,700	2,446,017.00	0.21
167	002568	百润股份	57,000	2,433,330.00	0.21
168	002063	远光软件	115,105	2,433,319.70	0.21
169	600433	冠豪高新	211,600	2,424,936.00	0.21
170	600169	太原重工	422,050	2,422,567.00	0.21
171	300115	长盈精密	72,100	2,420,397.00	0.21
172	600183	生益科技	244,600	2,419,094.00	0.21
173	002048	宁波华翔	138,410	2,408,334.00	0.21
174	600270	外运发展	88,700	2,400,222.00	0.21
175	002180	艾派克	51,687	2,385,355.05	0.21
176	000926	福星股份	140,200	2,360,968.00	0.21
177	000028	国药一致	35,658	2,358,776.70	0.21
178	600787	中储股份	234,600	2,355,384.00	0.21
179	002011	盾安环境	140,800	2,354,176.00	0.21
180	000021	深科技	195,200	2,354,112.00	0.21
181	002368	太极股份	34,986	2,347,560.60	0.20
182	600754	锦江股份	45,700	2,345,324.00	0.20
183	002285	世联行	144,180	2,340,041.40	0.20
184	002051	中工国际	92,100	2,332,893.00	0.20
185	000587	金叶珠宝	109,300	2,322,625.00	0.20
186	600348	阳泉煤业	358,800	2,317,848.00	0.20
187	000667	美好集团	457,000	2,266,720.00	0.20
188	600557	康缘药业	89,949	2,250,523.98	0.20
189	600067	冠城大通	256,100	2,238,314.00	0.20
190	002311	海大集团	159,900	2,233,803.00	0.19
191	600161	天坛生物	63,901	2,232,061.93	0.19
192	002437	誉衡药业	73,000	2,208,250.00	0.19
193	002505	大康牧业	260,000	2,207,400.00	0.19
194	002642	荣之联	37,800	2,188,242.00	0.19

195	600614	鼎立股份	187,300	2,178,299.00	0.19
196	000656	金科股份	411,600	2,173,248.00	0.19
197	002005	德豪润达	214,000	2,169,960.00	0.19
198	600380	健康元	157,000	2,169,740.00	0.19
199	600765	中航重机	110,255	2,165,408.20	0.19
200	600151	航天机电	175,020	2,163,247.20	0.19
201	000685	中山公用	152,590	2,159,148.50	0.19
202	600517	置信电气	169,500	2,145,870.00	0.19
203	000758	中色股份	144,207	2,145,800.16	0.19
204	002244	滨江集团	268,194	2,134,824.24	0.19
205	600580	卧龙电气	138,000	2,127,960.00	0.19
206	002653	海思科	97,107	2,125,672.23	0.19
207	002050	三花股份	199,100	2,120,415.00	0.19
208	600351	亚宝药业	135,452	2,115,760.24	0.18
209	600125	铁龙物流	229,500	2,109,105.00	0.18
210	600805	悦达投资	165,697	2,097,724.02	0.18
211	000513	丽珠集团	36,440	2,092,749.20	0.18
212	600528	中铁二局	145,700	2,087,881.00	0.18
213	600426	华鲁恒升	144,000	2,077,920.00	0.18
214	600587	新华医疗	57,000	2,070,810.00	0.18
215	300202	聚龙股份	63,794	2,053,528.86	0.18
216	600216	浙江医药	166,000	2,053,420.00	0.18
217	600651	飞乐音响	139,000	2,050,250.00	0.18
218	600056	中国医药	123,200	2,048,816.00	0.18
219	600236	桂冠电力	273,400	2,045,032.00	0.18
220	002681	奋达科技	46,680	2,039,916.00	0.18
221	300134	大富科技	67,500	2,031,750.00	0.18
222	002271	东方雨虹	103,900	2,029,167.00	0.18
223	603019	中科曙光	22,100	2,014,857.00	0.18
224	000777	中核科技	64,140	2,013,354.60	0.18
225	600187	国中水务	323,100	2,006,451.00	0.18
226	002414	高德红外	65,500	1,995,785.00	0.17
227	600885	宏发股份	66,700	1,993,663.00	0.17
228	600086	东方金钰	161,100	1,983,141.00	0.17
229	600699	均胜电子	63,100	1,971,875.00	0.17
230	600220	江苏阳光	343,200	1,969,968.00	0.17
231	600058	五矿发展	86,700	1,968,090.00	0.17

232	002354	天神娱乐	20,400	1,957,992.00	0.17
233	600808	马钢股份	621,200	1,956,780.00	0.17
234	002482	广田股份	66,580	1,947,465.00	0.17
235	000488	晨鸣纸业	217,300	1,938,316.00	0.17
236	000979	中弘股份	484,280	1,937,120.00	0.17
237	600267	海正药业	121,056	1,918,737.60	0.17
238	002440	闰土股份	100,400	1,912,620.00	0.17
239	000572	海马汽车	297,800	1,905,920.00	0.17
240	600039	四川路桥	372,300	1,898,730.00	0.17
241	002551	尚荣医疗	57,292	1,888,917.24	0.16
242	000848	承德露露	114,417	1,887,880.50	0.16
243	002092	中泰化学	212,700	1,871,760.00	0.16
244	600628	新世界	103,441	1,871,247.69	0.16
245	600284	浦东建设	136,020	1,862,113.80	0.16
246	600416	湘电股份	89,400	1,853,262.00	0.16
247	600409	三友化工	238,100	1,845,275.00	0.16
248	000680	山推股份	240,800	1,842,120.00	0.16
249	000049	德赛电池	32,300	1,833,994.00	0.16
250	600481	双良节能	202,380	1,833,562.80	0.16
251	600062	华润双鹤	80,200	1,829,362.00	0.16
252	600428	中远航运	178,088	1,827,182.88	0.16
253	600759	洲际油气	231,580	1,817,903.00	0.16
254	600826	兰生股份	52,600	1,811,544.00	0.16
255	600859	王府井	66,200	1,801,964.00	0.16
256	002190	成飞集成	41,100	1,798,536.00	0.16
257	000897	津滨发展	315,500	1,798,350.00	0.16
258	002254	泰和新材	113,160	1,798,112.40	0.16
259	002384	东山精密	89,800	1,797,796.00	0.16
260	002181	粤传媒	113,280	1,795,488.00	0.16
261	600260	凯乐科技	120,100	1,794,294.00	0.16
262	002390	信邦制药	124,800	1,790,880.00	0.16
263	601717	郑煤机	237,500	1,786,000.00	0.16
264	600572	康恩贝	133,670	1,785,831.20	0.16
265	000652	泰达股份	249,700	1,780,361.00	0.16
266	600006	东风汽车	200,900	1,779,974.00	0.16
267	002373	千方科技	38,900	1,779,675.00	0.16
268	600812	华北制药	205,900	1,772,799.00	0.15

269	002588	史丹利	54,400	1,769,632.00	0.15
270	000090	天健集团	103,863	1,767,748.26	0.15
271	000062	深圳华强	48,111	1,760,862.60	0.15
272	002242	九阳股份	77,500	1,757,700.00	0.15
273	002168	深圳惠程	148,000	1,750,840.00	0.15
274	000088	盐 田 港	202,640	1,746,756.80	0.15
275	603077	和邦生物	259,200	1,744,416.00	0.15
276	000697	炼石有色	62,700	1,744,314.00	0.15
277	000816	智慧农业	208,845	1,741,767.30	0.15
278	600566	济川药业	62,800	1,737,048.00	0.15
279	000830	鲁西化工	250,600	1,736,658.00	0.15
280	600458	时代新材	97,810	1,731,237.00	0.15
281	000931	中 关 村	135,700	1,723,390.00	0.15
282	000563	陕国投 A	113,800	1,720,656.00	0.15
283	300039	上海凯宝	123,800	1,715,868.00	0.15
284	000528	柳 工	206,300	1,710,227.00	0.15
285	000869	张 裕 A	37,200	1,703,016.00	0.15
286	600894	广日股份	85,100	1,701,149.00	0.15
287	600112	天成控股	100,500	1,684,380.00	0.15
288	002025	航天电器	64,550	1,677,654.50	0.15
289	000636	风华高科	146,600	1,672,706.00	0.15
290	601000	唐山港	202,700	1,672,275.00	0.15
291	000969	安泰科技	128,800	1,671,824.00	0.15
292	002221	东华能源	71,442	1,670,313.96	0.15
293	600823	世茂股份	136,173	1,665,395.79	0.15
294	002672	东江环保	81,650	1,646,880.50	0.14
295	600460	士兰微	185,500	1,641,675.00	0.14
296	000550	江铃汽车	54,300	1,627,914.00	0.14
297	002698	博实股份	55,310	1,622,242.30	0.14
298	600993	马应龙	73,642	1,621,596.84	0.14
299	002093	国脉科技	108,900	1,620,432.00	0.14
300	002269	美邦服饰	241,300	1,619,123.00	0.14
301	600292	中电远达	78,270	1,618,623.60	0.14
302	000933	神火股份	324,091	1,613,973.18	0.14
303	603883	老百姓	22,700	1,611,019.00	0.14
304	600970	中材国际	134,800	1,610,860.00	0.14
305	600073	上海梅林	113,752	1,609,590.80	0.14

306	600004	白云机场	112,600	1,602,298.00	0.14
307	002233	塔牌集团	108,700	1,592,455.00	0.14
308	600757	长江传媒	144,572	1,587,400.56	0.14
309	002345	潮宏基	94,000	1,586,720.00	0.14
310	002029	七 匹 狼	115,100	1,573,417.00	0.14
311	000861	海印股份	203,240	1,571,045.20	0.14
312	000900	现代投资	186,512	1,564,835.68	0.14
313	600825	新华传媒	130,700	1,560,558.00	0.14
314	002249	大洋电机	117,600	1,559,376.00	0.14
315	600022	山东钢铁	500,300	1,555,933.00	0.14
316	601777	力帆股份	89,400	1,550,196.00	0.14
317	002431	棕榈园林	57,752	1,550,063.68	0.14
318	000099	中信海直	104,500	1,544,510.00	0.13
319	600831	广电网络	97,600	1,543,056.00	0.13
320	002028	思源电气	97,013	1,541,536.57	0.13
321	002041	登海种业	91,350	1,539,247.50	0.13
322	000426	兴业矿业	217,800	1,537,668.00	0.13
323	601139	深圳燃气	168,351	1,531,994.10	0.13
324	600750	江中药业	43,400	1,531,586.00	0.13
325	002078	太阳纸业	271,900	1,530,797.00	0.13
326	600736	苏州高新	138,400	1,522,400.00	0.13
327	002251	步 步 高	93,110	1,517,693.00	0.13
328	000631	顺发恒业	152,700	1,514,784.00	0.13
329	600563	法拉电子	36,400	1,514,604.00	0.13
330	601880	大连港	254,100	1,514,436.00	0.13
331	000417	合肥百货	138,200	1,510,526.00	0.13
332	002237	恒邦股份	151,000	1,506,980.00	0.13
333	002396	星网锐捷	62,150	1,500,922.50	0.13
334	002477	雏鹰农牧	88,710	1,500,086.10	0.13
335	000600	建投能源	140,700	1,499,862.00	0.13
336	002056	横店东磁	53,300	1,498,263.00	0.13
337	600545	新疆城建	135,300	1,497,771.00	0.13
338	000726	鲁 泰 A	110,600	1,495,312.00	0.13
339	600337	美克家居	95,700	1,494,834.00	0.13
340	000519	江南红箭	87,860	1,491,862.80	0.13
341	600809	山西汾酒	77,355	1,490,630.85	0.13
342	600586	金晶科技	243,500	1,487,785.00	0.13

343	000401	冀东水泥	136,200	1,484,580.00	0.13
344	002317	众生药业	112,100	1,484,204.00	0.13
345	600645	中源协和	22,700	1,475,727.00	0.13
346	600298	安琪酵母	48,500	1,475,370.00	0.13
347	002122	天马股份	177,100	1,475,243.00	0.13
348	600366	宁波韵升	67,400	1,472,016.00	0.13
349	601369	陕鼓动力	168,300	1,470,942.00	0.13
350	000620	新华联	144,500	1,460,895.00	0.13
351	600180	瑞茂通	66,100	1,459,488.00	0.13
352	000501	鄂武商 A	68,200	1,459,480.00	0.13
353	000975	银泰资源	116,565	1,459,393.80	0.13
354	600575	皖江物流	235,500	1,457,745.00	0.13
355	600748	上实发展	108,200	1,452,044.00	0.13
356	601678	滨化股份	180,700	1,449,214.00	0.13
357	002503	搜于特	91,100	1,443,024.00	0.13
358	601666	平煤股份	306,874	1,430,032.84	0.12
359	601886	江河创建	113,206	1,427,527.66	0.12
360	000612	焦作万方	187,000	1,426,810.00	0.12
361	600761	安徽合力	106,603	1,423,150.05	0.12
362	600720	祁连山	160,600	1,418,098.00	0.12
363	601801	皖新传媒	43,139	1,409,782.52	0.12
364	600639	浦东金桥	62,900	1,408,331.00	0.12
365	600300	维维股份	195,200	1,399,584.00	0.12
366	600596	新安股份	137,100	1,398,420.00	0.12
367	000961	中南建设	90,310	1,396,192.60	0.12
368	601908	京运通	169,600	1,394,112.00	0.12
369	002663	普邦园林	173,505	1,377,629.70	0.12
370	002342	巨力索具	179,600	1,366,756.00	0.12
371	002064	华峰氨纶	210,300	1,364,847.00	0.12
372	002277	友阿股份	98,200	1,363,998.00	0.12
373	002155	湖南黄金	151,500	1,361,985.00	0.12
374	000030	富奥股份	132,400	1,350,480.00	0.12
375	600496	精工钢构	224,360	1,348,403.60	0.12
376	601126	四方股份	101,100	1,342,608.00	0.12
377	600509	天富能源	136,700	1,341,027.00	0.12
378	002332	仙琚制药	88,400	1,339,260.00	0.12
379	600872	中炬高新	85,500	1,338,075.00	0.12

380	600282	南钢股份	416,100	1,319,037.00	0.12
381	002315	焦点科技	13,700	1,315,337.00	0.11
382	002463	沪电股份	203,500	1,314,610.00	0.11
383	002392	北京利尔	168,700	1,312,486.00	0.11
384	603699	纽威股份	60,000	1,309,200.00	0.11
385	002174	游族网络	14,600	1,307,138.00	0.11
386	600059	古越龙山	118,500	1,302,315.00	0.11
387	601002	晋亿实业	112,800	1,300,584.00	0.11
388	002293	罗莱生活	71,100	1,296,864.00	0.11
389	000919	金陵药业	75,300	1,295,160.00	0.11
390	002281	光迅科技	19,900	1,290,117.00	0.11
391	600483	福能股份	74,600	1,282,374.00	0.11
392	600251	冠农股份	112,400	1,270,120.00	0.11
393	002140	东华科技	59,332	1,263,771.60	0.11
394	603567	珍宝岛	24,200	1,253,560.00	0.11
395	000877	天山股份	155,800	1,251,074.00	0.11
396	600729	重庆百货	38,600	1,250,254.00	0.11
397	002479	富春环保	93,100	1,247,540.00	0.11
398	601233	桐昆股份	94,700	1,245,305.00	0.11
399	002408	齐翔腾达	93,127	1,239,520.37	0.11
400	000860	顺鑫农业	57,200	1,218,360.00	0.11
401	600773	西藏城投	66,900	1,217,580.00	0.11
402	600803	新奥股份	76,700	1,216,462.00	0.11
403	002118	紫鑫药业	62,100	1,211,571.00	0.11
404	600088	中视传媒	40,200	1,210,422.00	0.11
405	600141	兴发集团	82,500	1,206,150.00	0.11
406	000418	小天鹅 A	50,000	1,200,000.00	0.10
407	601001	大同煤业	215,600	1,196,580.00	0.10
408	600392	盛和资源	97,175	1,196,224.25	0.10
409	600850	华东电脑	23,127	1,194,509.55	0.10
410	000693	华泽钴镍	63,300	1,179,279.00	0.10
411	600120	浙江东方	59,300	1,177,698.00	0.10
412	600880	博瑞传播	154,600	1,159,500.00	0.10
413	600259	广晟有色	29,200	1,156,320.00	0.10
414	603555	贵人鸟	32,600	1,155,018.00	0.10
415	600551	时代出版	50,376	1,146,054.00	0.10
416	600874	创业环保	107,900	1,138,345.00	0.10

417	600776	东方通信	99,300	1,135,992.00	0.10
418	600456	宝钛股份	55,500	1,126,650.00	0.10
419	600335	国机汽车	59,800	1,120,652.00	0.10
420	600329	中新药业	52,900	1,120,422.00	0.10
421	002493	荣盛石化	72,000	1,116,000.00	0.10
422	002267	陕天然气	88,400	1,113,840.00	0.10
423	600657	信达地产	159,400	1,107,830.00	0.10
424	600395	盘江股份	134,800	1,106,708.00	0.10
425	002309	中利科技	58,826	1,104,752.28	0.10
426	002238	天威视讯	49,610	1,101,342.00	0.10
427	600640	号百控股	51,900	1,100,799.00	0.10
428	600546	山煤国际	246,300	1,091,109.00	0.10
429	002635	安洁科技	39,200	1,089,760.00	0.10
430	600537	亿晶光电	72,500	1,086,050.00	0.09
431	603806	福斯特	21,500	1,074,785.00	0.09
432	600790	轻纺城	131,670	1,070,477.10	0.09
433	603001	奥康国际	30,400	1,022,048.00	0.09
434	002327	富安娜	84,900	1,021,347.00	0.09
435	000596	古井贡酒	27,700	1,011,050.00	0.09
436	002646	青青稞酒	43,700	997,234.00	0.09
437	603188	亚邦股份	44,200	989,196.00	0.09
438	601101	昊华能源	123,790	972,989.40	0.08
439	002678	珠江钢琴	56,300	968,923.00	0.08
440	600617	国新能源	63,040	966,403.20	0.08
441	600132	重庆啤酒	60,300	964,197.00	0.08
442	601515	东风股份	58,000	961,640.00	0.08
443	002204	大连重工	94,924	949,240.00	0.08
444	600510	黑牡丹	78,800	947,964.00	0.08
445	000703	恒逸石化	85,200	946,572.00	0.08
446	000603	盛达矿业	51,998	938,563.90	0.08
447	002216	三全食品	81,677	930,301.03	0.08
448	000525	红 太 阳	54,800	928,312.00	0.08
449	603589	口子窖	21,500	923,210.00	0.08
450	601005	重庆钢铁	278,400	915,936.00	0.08
451	600618	氯碱化工	56,500	911,910.00	0.08
452	600751	天海投资	94,600	910,052.00	0.08
453	600997	开滦股份	161,300	900,054.00	0.08

454	600743	华远地产	132,300	896,994.00	0.08
455	603568	伟明环保	17,600	892,320.00	0.08
456	600280	中央商场	79,500	888,015.00	0.08
457	600184	光电股份	30,300	875,973.00	0.08
458	002419	天虹商场	63,509	857,371.50	0.07
459	603366	日出东方	80,600	854,360.00	0.07
460	002194	武汉凡谷	50,200	853,400.00	0.07
461	000921	海信科龙	89,100	849,123.00	0.07
462	600195	中牧股份	39,700	848,786.00	0.07
463	002461	珠江啤酒	55,247	843,621.69	0.07
464	002371	七星电子	43,650	841,572.00	0.07
465	600780	通宝能源	118,300	838,747.00	0.07
466	603169	兰石重装	45,200	824,900.00	0.07
467	600971	恒源煤电	128,600	808,894.00	0.07
468	600507	方大特钢	131,400	801,540.00	0.07
469	600468	百利电气	45,200	800,944.00	0.07
470	600425	青松建化	137,000	800,080.00	0.07
471	000852	石化机械	37,418	799,248.48	0.07
472	601010	文峰股份	108,500	788,795.00	0.07
473	000951	中国重汽	42,800	774,680.00	0.07
474	601226	华电重工	60,176	761,226.40	0.07
475	603328	依顿电子	25,500	752,505.00	0.07
476	600864	哈投股份	68,500	745,280.00	0.07
477	603005	晶方科技	14,600	734,380.00	0.06
478	603355	莱克电气	15,700	733,190.00	0.06
479	002128	露天煤业	86,300	729,235.00	0.06
480	603025	大豪科技	17,600	720,016.00	0.06
481	002430	杭氧股份	62,600	719,900.00	0.06
482	002745	木林森	17,200	703,996.00	0.06
483	603698	航天工程	19,400	679,970.00	0.06
484	600429	三元股份	91,800	669,222.00	0.06
485	600917	重庆燃气	43,600	662,284.00	0.06
486	002648	卫星石化	60,700	656,167.00	0.06
487	000719	大地传媒	31,800	648,720.00	0.06
488	601965	中国汽研	66,750	626,782.50	0.05
489	000552	靖远煤电	58,100	585,648.00	0.05
490	603899	晨光文具	13,700	576,222.00	0.05

491	600397	安源煤业	90,000	525,600.00	0.05
492	000582	北部湾港	22,200	499,722.00	0.04
493	603369	今世缘	13,600	456,008.00	0.04
494	600801	华新水泥	51,000	415,650.00	0.04
495	600869	智慧能源	38,300	365,765.00	0.03
496	000669	金鸿能源	8,900	198,737.00	0.02
497	002727	一心堂	2,900	167,707.00	0.01
498	000786	北新建材	13,200	157,080.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	45,150,254.56	3.94
2	002183	怡亚通	20,774,695.75	1.81
3	300168	万达信息	18,618,164.93	1.62
4	601099	太平洋	16,902,654.90	1.47
5	300253	卫宁健康	13,450,740.03	1.17
6	600446	金证股份	12,696,979.00	1.11
7	000540	中天城投	12,091,157.49	1.05
8	600601	方正科技	12,072,638.26	1.05
9	002030	达安基因	11,826,645.44	1.03
10	600219	南山铝业	11,822,077.00	1.03
11	000012	南玻 A	11,732,293.84	1.02
12	600410	华胜天成	11,683,670.51	1.02
13	000998	隆平高科	11,644,541.08	1.02
14	002405	四维图新	11,499,332.38	1.00
15	300033	同花顺	11,339,129.00	0.99
16	000566	海南海药	11,265,000.03	0.98
17	300144	宋城演艺	11,211,370.41	0.98
18	000592	平潭发展	10,951,598.90	0.96
19	600037	歌华有线	10,752,338.06	0.94
20	002400	省广股份	10,691,282.57	0.93

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	46,768,168.68	4.08
2	300168	万达信息	22,559,043.81	1.97
3	601099	太平洋	15,942,364.42	1.39
4	002183	怡亚通	15,753,596.66	1.37
5	300144	宋城演艺	11,320,499.98	0.99
6	600820	隧道股份	11,260,235.60	0.98
7	000540	中天城投	10,947,744.73	0.96
8	000977	浪潮信息	9,483,874.14	0.83
9	601519	大智慧	9,012,374.99	0.79
10	000712	锦龙股份	8,882,308.75	0.77
11	300033	同花顺	8,458,646.30	0.74
12	002424	贵州百灵	8,271,615.27	0.72
13	600895	张江高科	7,827,056.00	0.68
14	601718	际华集团	7,504,122.57	0.65
15	000415	渤海租赁	7,182,367.96	0.63
16	601872	招商轮船	7,100,579.14	0.62
17	300253	卫宁健康	6,743,344.91	0.59
18	600490	鹏欣资源	6,607,186.62	0.58
19	002030	达安基因	6,507,597.46	0.57
20	002690	美亚光电	6,452,346.55	0.56

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,805,669,559.25
卖出股票收入（成交）总额	1,128,555,369.39

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)(单 位: 手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1601	中证 500 股指期货 IC1601 合约	50	73,990,000.00	355,720.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理。
公允价值变动总额合计					355,720.00
股指期货投资本期收益					5,451,280.00
股指期货投资本期公允价值变动					355,720.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,126,165.65
2	应收证券清算款	3,232,295.65
3	应收股利	-
4	应收利息	35,951.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,394,412.63

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000748	长城信息	8,109,600.00	0.71	重大事项
2	002018	华信国际	7,634,656.00	0.67	重大事项
3	600978	宜华木业	6,815,116.00	0.59	重大事项

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,826	54,241.12	13,475,655.00	4.26%	74,535,716.00	23.59%	227,997,423.00	72.15%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例
1	百年人寿保险股份有限公司一分红保险产品	7,391,500	2.34%
2	北京安瑞祥和资产管理有限公司	2,218,035	0.70%
3	姚文波	970,568	0.31%
4	杨晓丹	818,389	0.26%
5	吕爱平	700,000	0.22%
6	姜海利	656,676	0.21%
7	倪光新	582,546	0.18%
8	平安证券有限责任公司客户信用交易担保证券账户	541,375	0.17%
9	袁园	525,341	0.17%
10	梁鹏飞	474,048	0.15%
11	中国建设银行股份有限公司—华夏中证 500 交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	227,997,423	72.15%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理 0- 人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015年5月5日) 基金份额总额	2,134,473,505
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	201,586,620
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	352,786,620
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-1,667,264,711
本报告期期末基金份额总额	316,008,794

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2015 年 3 月 5 日发布公告，刘义先生任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于 2015 年 5 月 9 日发布公告，阳琨先生、李一梅女士任华夏基金管理有限公司副总经理，林浩先生、吴志军先生不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于 2015 年 8 月 1 日发布公告，汤晓东先生任华夏基金管理有限公司总经理，周璇女士任华夏基金管理有限公司督察长。

本基金托管人于 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人于 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人于 2015 年 3 月 19 日发布公告，对国家工商行政管理总局商标评审委员会作出的商标驳回复审决定向北京知识产权法院提起行政诉讼。该案件已于 2015 年 7 月 20 日获得胜诉判决。

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 70,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称“北京证监局”）《关于对华夏基金管理有限公司采取责令整改及暂不受理行政

许可的行政监管措施的决定》：决定自责令整改行政监管措施生效之日起六个月内，暂不受理公司出具的公募基金产品注册申请，已受理的公募基金产品注册申请中止审查，对相关责任人采取行政监管措施。公司已在规定时间内完成整改，并通过北京证监局的现场整改验收，2015 年 8 月 12 日整改期结束。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
申万宏源证券	2	1,563,525,255.26	39.74%	176,374.14	39.37%	-
国泰君安证券	2	1,556,459,660.67	39.56%	174,974.32	39.06%	-
中信建投证券	3	814,240,012.71	20.70%	96,619.01	21.57%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，除本表列示外，本基金还选择了光大证券、海通证券、中国银河证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-05-06
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-05-09
3	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-05-20
4	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-05-26
5	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-05-26
6	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2015-05-26
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加场外申购赎回方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-07-14
8	华夏基金管理有限公司关于新增中证 500 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-07-24
9	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-08-01
10	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-08-22
11	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-09-11
12	华夏基金管理有限公司关于成都分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-11-20
13	华夏基金管理有限公司关于南京分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-11-24
14	华夏基金管理有限公司关于华夏资本管理有限公司变更相关事项的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-12-01
15	华夏基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金业务配套工作安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-12-31

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

12.1.2 《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一六年三月二十九日