

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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）	13
6.1 资产负债表	13
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	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录	53
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数增强型证券投资基金
基金简称	建信中证 500 指数增强
基金主代码	000478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	132,497,410.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。 本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率 (税前)}$ 。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	方韡
	联系电话	010-66228888	010-89936330
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fangwei@citicbank.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
邮政编码		100033	100010
法定代表人		许会斌	常振明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-12,613,050.87
本期利润	-8,700,034.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0731
本期加权平均净值利润率	-3.83%

本期基金份额净值增长率	-7.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	95,967,057.65
期末可供分配基金份额利润	0.7243
期末基金资产净值	274,900,207.41
期末基金份额净值	2.0748
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	107.48%

注：1、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；

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、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。

3.2 基金净值表现

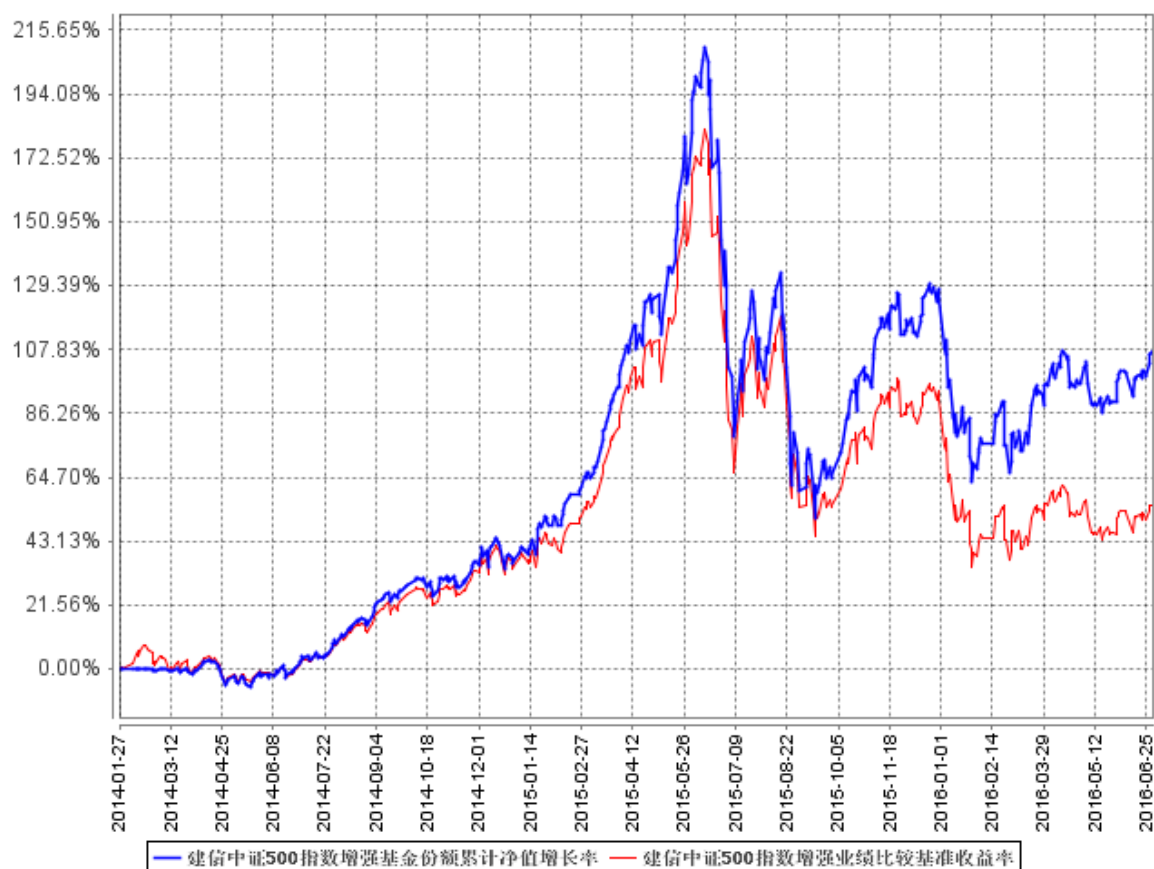
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.27%	1.35%	2.82%	1.47%	2.45%	-0.12%
过去三个月	5.70%	1.53%	-0.46%	1.57%	6.16%	-0.04%
过去六个月	-7.95%	2.44%	-18.57%	2.43%	10.62%	0.01%
过去一年	-14.02%	2.91%	-29.57%	2.77%	15.55%	0.14%
自基金合同 生效起至今	107.48%	2.21%	55.39%	2.16%	52.09%	0.05%

注：本基金业绩比较基准为 95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

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

建信中证500指数增强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：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及

深圳、成都、上海、北京四家分公司和华东、西北两个营销中心，设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益

一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金，共计 68 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 2,453.84 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	8	硕士。曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011 年 9 月加入我公司，担任基金经理助理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任中证 500 指数增强基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与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的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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

报告期间，本基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理，在上半年市场波动较大的情况下，坚持量化增强策略，并获得了较为显著且稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-7.95%，波动率 2.44%，业绩比较基准收益率-18.57%，波动率 2.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票价格由上市公司赢利水平及估值水平这两方面决定。从上半年公布的宏观经济数据及上市公司的财报来看，上市公司赢利水平并没有明显的变化，宏观经济总体还处在“L”型走势的底部。从估值水平方面来看，流动性支撑了估值水平的下限，风险偏好制约了估值水平的上限。因此总体来说，今年下半年预计指数仍将维持震荡的走势。在这种行情下，精选个股尤为重要，需密切关注上市公司的半年报以及所在行业的成长性。

本基金管理人将坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，努力克服市场的波动，持续获取稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。自 2015 年 3 月 26 日起，公司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》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的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）进行估值。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司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》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种（可转换债券、资产支持证

券和私募债券除外)进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

自 2014 年 1 月 27 日建信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“建信中证 500 指数基金”或“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期无分红。

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

由建信中证 500 指数基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	36,654,349.23	28,587,056.44
结算备付金		2,397,815.81	2,388,844.00

存出保证金		4,707,003.07	4,518,357.45
交易性金融资产	6.4.7.2	233,134,967.08	178,642,255.39
其中：股票投资		233,134,967.08	178,642,255.39
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		6,979,004.48	5,807,621.08
应收利息	6.4.7.5	7,666.80	7,279.17
应收股利		-	-
应收申购款		1,845,973.30	337,341.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		285,726,779.77	220,288,754.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,077,534.46	1,247,775.41
应付管理人报酬		220,218.89	180,277.16
应付托管费		44,043.79	36,055.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,019,179.31	608,185.87
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	465,595.91	307,485.36
负债合计		10,826,572.36	2,379,779.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	132,497,410.41	96,671,968.72
未分配利润	6.4.7.10	142,402,797.00	121,237,006.62
所有者权益合计		274,900,207.41	217,908,975.34
负债和所有者权益总计		285,726,779.77	220,288,754.58

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0748 元，基金份额总额 132,497,410.41 份。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-5,555,856.07	69,210,166.42
1.利息收入		127,504.96	51,221.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	127,504.96	51,221.21
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）		-9,782,920.20	82,743,711.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,718,782.78	82,041,778.72
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	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-2,065,880.00	-
股利收益	6.4.7.16	1,001,742.58	701,932.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,913,016.10	-14,081,397.06
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	186,543.07	496,631.06
减：二、费用		3,144,178.70	2,541,577.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,125,429.60	852,539.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	225,085.87	170,507.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,502,582.26	1,233,186.19
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	291,080.97	285,343.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,700,034.77	66,668,589.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,700,034.77	66,668,589.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	96,671,968.72	121,237,006.62	217,908,975.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,700,034.77	-8,700,034.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,825,441.69	29,865,825.15	65,691,266.84
其中：1.基金申购款	113,922,958.48	102,277,538.03	216,200,496.51
2.基金赎回款	-78,097,516.79	-72,411,712.88	-150,509,229.67
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）	132,497,410.41	142,402,797.00	274,900,207.41
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	65,861,621.20	24,431,819.02	90,293,440.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,668,589.25	66,668,589.25
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）	36,835,863.52	54,020,602.32	90,856,465.84
其中：1.基金申购款	219,827,977.75	271,857,436.74	491,685,414.49
2.基金赎回款	-182,992,114.23	-217,836,834.42	-400,828,948.65
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）	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	102,697,484.72	145,121,010.59	247,818,495.31

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：

_____ 孙志晨	_____ 赵乐峰	_____ 丁颖
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

建信中证 500 指数增强型证券投资基金(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[2013]第 615 号《关于核准建信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2014 年 1 月 2 日至 2014 年 1 月 23 日止。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 308,106,805.84 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(2014)第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额,其中认购资金利息折合 58,537.07 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为不低于 90%,其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货以套期保值为目的,股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准为 95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税前)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日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

本报告期所采用的会计政策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

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 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。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	36,654,349.23
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	36,654,349.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	229,739,804.21	233,134,967.08	3,395,162.87
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		229,739,804.21	233,134,967.08	3,395,162.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	20,919,720.00	-	-	
其中股指期货投资	20,919,720.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	20,919,720.00	-	-	

注：股指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）

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值 (单位：人民币元)	公允价值变动 (单位：人民币元)
IC1607	中证500指数期货IC1607合约	16	19,338,880.00	594,440.00
IC1612	中证500指数期货IC1612合约	2	2,262,480.00	87,200.00
总额合计				681,640.00
减：可抵销期货暂收款				681,640.00
期货投资净额				-

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

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,859.63
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	730.37
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	76.80
合计	7,666.80

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,019,179.31
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,019,179.31

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	33,705.82
预提费用	331,890.09
应付指数使用费	100,000.00
合计	465,595.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,671,968.72	96,671,968.72
本期申购	113,922,958.48	113,922,958.48
本期赎回(以“-”号填列)	-78,097,516.79	-78,097,516.79
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	132,497,410.41	132,497,410.41

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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	82,422,341.19	38,814,665.43	121,237,006.62
本期利润	-12,613,050.87	3,913,016.10	-8,700,034.77
本期基金份额交易产生的变动数	26,157,767.33	3,708,057.82	29,865,825.15
其中：基金申购款	81,632,589.38	20,644,948.65	102,277,538.03
基金赎回款	-55,474,822.05	-16,936,890.83	-72,411,712.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,967,057.65	46,435,739.35	142,402,797.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	96,992.99
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	29,199.69
其他	1,312.28
合计	127,504.96

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
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	474,022,803.53
减：卖出股票成本总额	482,741,586.31
买卖股票差价收入	-8,718,782.78

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期间无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资-申购差价收入。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-2,065,880.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,001,742.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,001,742.58

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,823,256.10
——股票投资	2,823,256.10
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,089,760.00
——权证投资	-
股指期货投资	1,089,760.00
3. 其他	-
合计	3,913,016.10

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	156,359.43
转换费收入	30,183.64
合计	186,543.07

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,502,582.26
银行间市场交易费用	-
合计	1,502,582.26

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
指数使用费	100,000.00
其他费用	1,700.00
债券托管账户维护费	4,500.00
银行划款手续费	5,867.59
合计	291,080.97

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30
----	--------------------------------	--

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1, 125, 429. 60	852, 539. 45
其中: 支付销售机构的客户维护费	383, 570. 47	276, 141. 80

注: 1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%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 X 1% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用, 该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支, 不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	225, 085. 87	170, 507. 85

注: 支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0. 2%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 X 0. 2%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中信银行	36,654,349.23	96,992.99	26,446,023.03	45,940.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期间及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新发未上市	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新发未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新发未上市	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新发未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	----	-------	----

代码	名称	日期	原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	额	
600654	中安消	2016 年 5 月 19 日	重大资产重组	18.54	2016 年 8 月 8 日	20.39	65,700	2,364,627.96	1,218,078.00	-
300032	金龙机电	2016 年 6 月 28 日	重大事项	20.10	2016 年 7 月 7 日	19.80	55,170	951,941.50	1,108,917.00	-
002190	成飞集成	2016 年 4 月 21 日	重大事项	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	22,900	794,021.06	811,576.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大资产重组	15.36	-	-	51,112	888,184.86	785,080.32	-
002349	精华制药	2016 年 3 月 9 日	重大资产重组	25.73	2016 年 7 月 18 日	23.16	24,150	513,121.84	621,379.50	-
002266	浙富控股	2016 年 5 月 25 日	重大事项	5.35	-	-	109,500	700,998.98	585,825.00	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	重大事项	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	32,200	255,544.81	421,498.00	-
002071	长城影视	2016 年 6 月 16 日	重大资产重组	13.64	-	-	28,800	435,593.09	392,832.00	-
300292	吴通控股	2016 年 1 月 25 日	重大事项	33.26	2016 年 7 月 20 日	36.48	9,900	424,764.48	329,274.00	-
600848	上海临港	2016 年 3 月 16 日	重大事项	15.42	2016 年 7 月 6 日	16.96	18,600	303,948.00	286,812.00	-
000524	岭南控股	2016 年 4 月 5 日	重大资产重组	13.08	-	-	18,700	224,858.00	244,596.00	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大事项	8.92	-	-	23,600	207,657.97	210,512.00	-
300299	富春通信	2016 年 2 月 29 日	重大资产重组	27.51	-	-	6,400	291,253.93	176,064.00	-
002355	兴民钢圈	2016 年 5 月 12 日	重大资产重组	19.35	-	-	7,400	138,760.00	143,190.00	-

注：本基金截至 2016 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

至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年末末

持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

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，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他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，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，其余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现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，本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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	36,654,349.23	-	-	-	36,654,349.23
结算备付金	2,397,815.81	-	-	-	2,397,815.81
存出保证金	4,707,003.07	-	-	-	4,707,003.07
交易性金融资产	-	-	-	233,134,967.08	233,134,967.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	6,979,004.48	6,979,004.48
应收利息	-	-	-	7,666.80	7,666.80
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	13,827.05	-	-	1,832,146.25	1,845,973.30
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	43,772,995.16	-	-	241,953,784.61	285,726,779.77
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,077,534.46	9,077,534.46
应付管理人报酬	-	-	-	220,218.89	220,218.89
应付托管费	-	-	-	44,043.79	44,043.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,019,179.31	1,019,179.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	465,595.91	465,595.91
负债总计	-	-	-	10,826,572.36	10,826,572.36
利率敏感度缺口	43,772,995.16	-	-	-231,127,212.25	274,900,207.41
上年度末 2015 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	28,587,056.44	-	-	-	28,587,056.44
结算备付金	2,388,844.00	-	-	-	2,388,844.00
存出保证金	4,518,357.45	-	-	-	4,518,357.45
交易性金融资产	-	-	-	178,642,255.39	178,642,255.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,807,621.08	5,807,621.08
应收利息	-	-	-	7,279.17	7,279.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	10,628.89	-	-	326,712.16	337,341.05
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,504,886.78	-	-	184,783,867.80	220,288,754.58
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,247,775.41	1,247,775.41
应付管理人报酬	-	-	-	180,277.16	180,277.16
应付托管费	-	-	-	36,055.44	36,055.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	608,185.87	608,185.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	307,485.36	307,485.36
负债总计	-	-	-	2,379,779.24	2,379,779.24
利率敏感度缺口	35,504,886.78	-	-	-182,404,088.56	217,908,975.34

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，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（上年末：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，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为不低于 90%，其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	233,134,967.08	84.81	178,642,255.39	81.98
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	233,134,967.08	84.81	178,642,255.39	81.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	14,296,037.21	11,412,357.78
	业绩比较基准下降 5%	-14,296,037.21	-11,412,357.78

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**(1) 公允价值****(a) 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具**(i) 各层次金融工具公允价值**

于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 225,571,668.00 元，属于第二层次的余额为 7,563,299.08 元，无属于第三层次的余额(2015 年 06 月 30 日：第一层次 202,470,436.25 元，第二层次 32,644,539.55 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 6 月 30 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	233,134,967.08	81.59
	其中：股票	233,134,967.08	81.59
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	39,052,165.04	13.67
7	其他各项资产	13,539,647.65	4.74
8	合计	285,726,779.77	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境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,794,123.00	0.65
B	采矿业	3,304,537.00	1.20
C	制造业	115,674,742.72	42.08

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,436,159.55	1.61
E	建筑业	3,496,591.22	1.27
F	批发和零售业	10,210,868.33	3.71
G	交通运输、仓储和邮政业	6,428,248.44	2.34
H	住宿和餐饮业	406,539.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,884,745.14	4.69
J	金融业	2,607,337.00	0.95
K	房地产业	11,303,560.14	4.11
L	租赁和商务服务业	222,830.10	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,471.96	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	765,136.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,770,531.50	0.64
S	综合	94,913.00	0.03
	合计	175,402,334.10	63.81

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	713,678.25	0.26
B	采掘业	-	-
C	制造业	43,086,250.05	15.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,619.00	0.05
E	建筑业	463,434.00	0.17
F	批发和零售业	2,210,555.56	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	244,596.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,912,143.00	1.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,973,368.02	0.72
L	租赁和商务服务业	3,587,031.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.01
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	392,832.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	57,732,632.98	21.00

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002466	天齐锂业	73,620	3,142,837.80	1.14
2	601012	隆基股份	204,240	2,665,332.00	0.97
3	600478	科力远	205,400	2,479,178.00	0.90
4	300115	长盈精密	116,834	2,406,780.40	0.88
5	000031	中粮地产	254,300	2,398,049.00	0.87
6	600487	亨通光电	190,531	2,396,879.98	0.87
7	300182	捷成股份	138,850	2,375,723.50	0.86
8	600240	华业资本	234,107	2,345,752.14	0.85
9	300287	飞利信	174,275	2,335,285.00	0.85
10	000667	美好集团	648,700	2,315,859.00	0.84
11	002250	联化科技	161,200	2,308,384.00	0.84
12	000066	长城电脑	180,138	2,296,759.50	0.84
13	600320	振华重工	536,500	2,280,125.00	0.83
14	600835	上海机电	118,100	2,266,339.00	0.82
15	000563	陕国投 A	407,300	2,236,077.00	0.81
16	000587	金洲慈航	144,790	2,234,109.70	0.81
17	002503	搜于特	171,981	2,136,004.02	0.78
18	600161	天坛生物	76,700	2,131,493.00	0.78
19	002342	巨力索具	362,300	2,101,340.00	0.76
20	600517	置信电气	217,924	2,072,457.24	0.75
21	002332	仙琚制药	183,720	2,057,664.00	0.75
22	000830	鲁西化工	449,100	2,029,932.00	0.74

23	603355	莱克电气	52,100	1,985,010.00	0.72
24	600026	中海发展	322,000	1,899,800.00	0.69
25	000030	富奥股份	263,713	1,890,822.21	0.69
26	002426	胜利精密	190,750	1,878,887.50	0.68
27	600812	华北制药	299,200	1,858,032.00	0.68
28	000748	长城信息	92,600	1,816,812.00	0.66
29	600787	中储股份	240,500	1,786,915.00	0.65
30	000652	泰达股份	383,500	1,764,100.00	0.64
31	600635	大众公用	283,600	1,710,108.00	0.62
32	600079	人福医药	100,346	1,682,802.42	0.61
33	002005	德豪润达	275,900	1,630,569.00	0.59
34	002461	珠江啤酒	140,050	1,627,381.00	0.59
35	600176	中国巨石	169,383	1,620,995.31	0.59
36	000566	海南海药	147,900	1,613,589.00	0.59
37	600498	烽火通信	64,900	1,575,772.00	0.57
38	002624	完美世界	40,386	1,524,571.50	0.55
39	002368	太极股份	42,500	1,510,025.00	0.55
40	002179	中航光电	34,400	1,490,208.00	0.54
41	600601	方正科技	343,600	1,477,480.00	0.54
42	600426	华鲁恒升	167,440	1,475,146.40	0.54
43	002221	东华能源	119,978	1,462,531.82	0.53
44	600409	三友化工	216,500	1,459,210.00	0.53
45	002384	东山精密	73,300	1,455,738.00	0.53
46	600872	中炬高新	117,000	1,443,780.00	0.53
47	300010	立思辰	68,400	1,435,032.00	0.52
48	002093	国脉科技	115,200	1,429,632.00	0.52
49	002714	牧原股份	27,100	1,369,363.00	0.50
50	002131	利欧股份	79,016	1,350,383.44	0.49
51	600808	马钢股份	557,200	1,342,852.00	0.49
52	000417	合肥百货	163,152	1,319,899.68	0.48
53	002308	威创股份	79,900	1,312,757.00	0.48
54	002439	启明星辰	50,600	1,306,998.00	0.48
55	000501	鄂武商 A	82,233	1,290,235.77	0.47
56	002665	首航节能	159,978	1,262,226.42	0.46
57	000877	天山股份	199,300	1,231,674.00	0.45
58	000656	金科股份	315,400	1,204,828.00	0.44
59	002602	世纪华通	64,800	1,200,744.00	0.44
60	002001	新 和 成	56,200	1,187,506.00	0.43
61	600687	刚泰控股	72,100	1,172,346.00	0.43

62	600216	浙江医药	88,200	1,163,358.00	0.42
63	002498	汉缆股份	266,060	1,154,700.40	0.42
64	002004	华邦健康	126,300	1,153,119.00	0.42
65	002118	紫鑫药业	77,800	1,143,660.00	0.42
66	600422	昆药集团	83,000	1,132,120.00	0.41
67	600053	九鼎投资	32,300	1,118,549.00	0.41
68	300032	金龙机电	55,170	1,108,917.00	0.40
69	600171	上海贝岭	63,800	1,108,206.00	0.40
70	600481	双良节能	190,600	1,092,138.00	0.40
71	000488	晨鸣纸业	136,984	1,087,652.96	0.40
72	600809	山西汾酒	48,800	1,082,384.00	0.39
73	600748	上实发展	112,100	1,080,644.00	0.39
74	000088	盐田港	160,200	1,031,688.00	0.38
75	002011	盾安环境	89,100	1,005,048.00	0.37
76	600617	国新能源	84,800	971,808.00	0.35
77	600628	新世界	81,199	958,148.20	0.35
78	000552	靖远煤电	266,000	936,320.00	0.34
79	002640	跨境通	52,400	923,288.00	0.34
80	000703	恒逸石化	91,600	904,092.00	0.33
81	002489	浙江永强	113,000	894,960.00	0.33
82	002013	中航机电	63,300	853,284.00	0.31
83	600978	宜华生活	73,600	819,904.00	0.30
84	002190	成飞集成	22,900	811,576.00	0.30
85	600826	兰生股份	30,487	798,149.66	0.29
86	002310	东方园林	33,300	796,536.00	0.29
87	600884	杉杉股份	46,100	793,381.00	0.29
88	000547	航天发展	51,112	785,080.32	0.29
89	000887	中鼎股份	34,900	771,639.00	0.28
90	300244	迪安诊断	23,200	765,136.00	0.28
91	002233	塔牌集团	91,600	735,548.00	0.27
92	300001	特锐德	33,900	735,291.00	0.27
93	002051	中工国际	37,366	734,989.22	0.27
94	600086	东方金钰	74,900	725,032.00	0.26
95	000550	江铃汽车	28,937	704,905.32	0.26
96	600528	中铁二局	60,000	696,600.00	0.25
97	600039	四川路桥	172,200	678,468.00	0.25
98	600516	方大炭素	73,800	674,532.00	0.25
99	000600	建投能源	76,600	668,718.00	0.24
100	002122	天马股份	106,600	663,052.00	0.24

101	002217	合力泰	43,100	659,430.00	0.24
102	600525	长园集团	47,600	659,260.00	0.24
103	002589	瑞康医药	20,700	635,697.00	0.23
104	600270	外运发展	36,100	631,389.00	0.23
105	600004	白云机场	51,100	626,486.00	0.23
106	002745	木林森	18,400	625,416.00	0.23
107	002463	沪电股份	118,300	624,624.00	0.23
108	600765	中航重机	41,514	605,274.12	0.22
109	600112	天成控股	53,800	600,408.00	0.22
110	002325	洪涛股份	64,200	589,998.00	0.21
111	002266	浙富控股	109,500	585,825.00	0.21
112	000400	许继电气	37,843	584,295.92	0.21
113	000690	宝新能源	85,700	581,046.00	0.21
114	000697	炼石有色	24,800	566,680.00	0.21
115	300199	翰宇药业	27,700	563,695.00	0.21
116	603025	大豪科技	16,700	560,619.00	0.20
117	000816	智慧农业	94,400	557,904.00	0.20
118	600169	太原重工	140,900	549,510.00	0.20
119	600503	华丽家族	59,300	543,781.00	0.20
120	600623	华谊集团	25,700	509,117.00	0.19
121	601908	京运通	66,248	508,122.16	0.18
122	600395	盘江股份	59,800	493,948.00	0.18
123	002242	九阳股份	26,316	478,424.88	0.17
124	300113	顺网科技	12,400	470,704.00	0.17
125	600584	长电科技	22,700	460,583.00	0.17
126	002440	闰土股份	29,717	441,297.45	0.16
127	601369	陕鼓动力	67,900	433,202.00	0.16
128	002299	圣农发展	16,400	424,760.00	0.15
129	300043	互动娱乐	29,500	418,015.00	0.15
130	600754	锦江股份	12,150	406,539.00	0.15
131	600366	宁波韵升	17,000	405,790.00	0.15
132	000930	中粮生化	36,900	405,162.00	0.15
133	600651	飞乐音响	31,400	397,524.00	0.14
134	002085	万丰奥威	23,100	397,089.00	0.14
135	600755	厦门国贸	49,700	395,115.00	0.14
136	600483	福能股份	34,433	390,814.55	0.14
137	000426	兴业矿业	51,700	388,784.00	0.14
138	600348	阳泉煤业	60,800	387,296.00	0.14
139	000810	创维数字	20,700	374,049.00	0.14

140	600643	爱建集团	38,000	371,260.00	0.14
141	002074	国轩高科	9,200	363,124.00	0.13
142	600120	浙江东方	16,100	349,531.00	0.13
143	600673	东阳光科	55,400	346,250.00	0.13
144	600316	洪都航空	17,500	341,425.00	0.12
145	600380	健康元	36,200	332,316.00	0.12
146	600017	日照港	80,800	327,240.00	0.12
147	601717	郑煤机	56,100	319,770.00	0.12
148	600743	华远地产	62,600	296,098.00	0.11
149	600160	巨化股份	27,100	288,073.00	0.10
150	600850	华东电脑	9,880	283,457.20	0.10
151	000988	华工科技	14,000	280,700.00	0.10
152	002428	云南锗业	15,900	273,162.00	0.10
153	600456	宝钛股份	13,400	269,608.00	0.10
154	000541	佛山照明	26,200	269,598.00	0.10
155	601002	晋亿实业	29,300	254,910.00	0.09
156	002410	广联达	17,700	253,110.00	0.09
157	000681	视觉中国	10,400	245,960.00	0.09
158	601001	大同煤业	45,100	242,187.00	0.09
159	600881	亚泰集团	49,300	237,626.00	0.09
160	600776	东方通信	28,200	236,598.00	0.09
161	002400	省广股份	15,770	222,830.10	0.08
162	002701	奥瑞金	23,600	208,388.00	0.08
163	600151	航天机电	18,300	206,790.00	0.08
164	600282	南钢股份	87,800	206,330.00	0.08
165	000762	西藏矿业	8,000	197,760.00	0.07
166	601965	中国汽研	20,100	193,161.00	0.07
167	300072	三聚环保	6,856	189,499.84	0.07
168	600433	冠豪高新	19,800	171,072.00	0.06
169	603169	兰石重装	13,000	161,980.00	0.06
170	002588	史丹利	13,100	161,785.00	0.06
171	601010	文峰股份	30,000	155,700.00	0.06
172	000012	南玻A	12,600	144,396.00	0.05
173	000612	焦作万方	18,100	129,234.00	0.05
174	000900	现代投资	18,506	124,730.44	0.05
175	603077	和邦生物	24,300	119,556.00	0.04
176	000939	凯迪生态	12,700	113,665.00	0.04
177	600618	氯碱化工	8,000	105,040.00	0.04
178	601777	力帆股份	8,600	101,222.00	0.04

179	603589	口子窖	2,700	97,767.00	0.04
180	600180	瑞茂通	6,400	96,704.00	0.04
181	600200	江苏吴中	4,900	94,913.00	0.03
182	002261	拓维信息	5,300	73,299.00	0.03
183	600073	上海梅林	5,700	65,265.00	0.02
184	600586	金晶科技	15,000	64,500.00	0.02
185	002354	天神娱乐	700	61,096.00	0.02
186	600682	南京新百	2,100	59,787.00	0.02
187	000983	西山煤电	6,600	53,790.00	0.02
188	002078	太阳纸业	9,900	48,312.00	0.02
189	002028	思源电气	4,300	47,085.00	0.02
190	600594	益佰制药	2,900	46,342.00	0.02
191	600425	青松建化	10,500	44,625.00	0.02
192	000021	深科技	3,962	43,621.62	0.02
193	600507	方大特钢	8,600	41,280.00	0.02
194	000937	冀中能源	7,100	37,772.00	0.01
195	600201	生物股份	1,361	37,196.13	0.01
196	001696	宗申动力	1,000	10,920.00	0.00
197	002366	台海核电	160	8,529.60	0.00
198	600859	王府井	130	1,981.20	0.00
199	002573	清新环境	84	1,421.28	0.00
200	002390	信邦制药	100	924.00	0.00
201	002293	罗莱生活	43	589.10	0.00
202	600292	远达环保	4	50.68	0.00

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	000967	盈峰环境	86,159	1,911,868.21	0.70
2	002236	大华股份	142,000	1,860,200.00	0.68
3	000413	东旭光电	215,800	1,853,722.00	0.67
4	002493	荣盛石化	150,600	1,825,272.00	0.66
5	300324	旋极信息	84,850	1,820,881.00	0.66
6	002581	未名医药	66,400	1,809,400.00	0.66
7	002721	金一文化	88,600	1,712,638.00	0.62
8	002501	利源精制	157,039	1,696,021.20	0.62
9	002188	巴士在线	53,100	1,536,183.00	0.56

10	002594	比亚迪	23,800	1,452,038.00	0.53
11	002124	天邦股份	127,360	1,356,384.00	0.49
12	000627	天茂集团	174,500	1,348,885.00	0.49
13	300267	尔康制药	87,700	1,255,864.00	0.46
14	600415	小商品城	200,300	1,237,854.00	0.45
15	000657	中钨高新	81,100	1,228,665.00	0.45
16	600654	中安消	65,700	1,218,078.00	0.44
17	601238	广汽集团	50,700	1,190,943.00	0.43
18	603366	日出东方	127,300	1,069,320.00	0.39
19	002036	联创电子	45,100	1,055,791.00	0.38
20	300272	开能环保	67,820	1,046,462.60	0.38
21	600327	大东方	113,600	1,013,312.00	0.37
22	000036	华联控股	119,699	982,728.79	0.36
23	002019	亿帆鑫富	62,650	963,557.00	0.35
24	600406	国电南瑞	71,600	957,292.00	0.35
25	600495	晋西车轴	127,900	937,507.00	0.34
26	002286	保龄宝	61,400	919,772.00	0.33
27	002137	麦达数字	53,669	910,226.24	0.33
28	000599	青岛双星	127,800	879,264.00	0.32
29	002536	西泵股份	55,700	840,513.00	0.31
30	600399	抚顺特钢	128,300	830,101.00	0.30
31	300063	天龙集团	27,300	812,994.00	0.30
32	002176	江特电机	50,400	776,160.00	0.28
33	600031	三一重工	147,400	739,948.00	0.27
34	000768	中航飞机	36,497	718,625.93	0.26
35	300498	温氏股份	18,440	667,896.80	0.24
36	600685	中船防务	25,900	656,824.00	0.24
37	002349	精华制药	24,150	621,379.50	0.23
38	600626	申达股份	55,000	567,600.00	0.21
39	002502	骅威文化	21,300	523,980.00	0.19
40	002743	富煌钢构	35,300	509,026.00	0.19
41	002376	新北洋	36,600	488,976.00	0.18
42	601216	君正集团	65,000	485,550.00	0.18
43	002166	莱茵生物	41,200	470,916.00	0.17
44	300074	华平股份	36,900	442,800.00	0.16
45	300156	神雾环保	21,150	435,267.00	0.16
46	002597	金禾实业	32,100	432,387.00	0.16
47	000718	苏宁环球	32,200	421,498.00	0.15
48	300155	安居宝	27,600	405,168.00	0.15

49	002071	长城影视	28,800	392,832.00	0.14
50	600093	禾嘉股份	30,300	376,023.00	0.14
51	000032	深桑达 A	23,800	363,902.00	0.13
52	600217	秦岭水泥	47,800	362,324.00	0.13
53	002562	兄弟科技	12,500	332,000.00	0.12
54	002660	茂硕电源	21,900	330,033.00	0.12
55	300292	吴通控股	9,900	329,274.00	0.12
56	300086	康芝药业	28,600	328,900.00	0.12
57	002487	大金重工	35,500	314,175.00	0.11
58	002661	克明面业	17,871	293,263.11	0.11
59	600848	上海临港	18,600	286,812.00	0.10
60	600658	电子城	27,331	282,329.23	0.10
61	300230	永利股份	9,300	270,444.00	0.10
62	600693	东百集团	39,536	265,681.92	0.10
63	000709	河钢股份	94,700	262,319.00	0.10
64	000524	岭南控股	18,700	244,596.00	0.09
65	601390	中国中铁	34,200	238,374.00	0.09
66	002504	弘高创意	9,300	225,060.00	0.08
67	000511	*ST 烯碳	23,600	210,512.00	0.08
68	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.08
69	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.07
70	002322	理工环科	9,500	179,930.00	0.07
71	300299	富春通信	6,400	176,064.00	0.06
72	600595	中孚实业	28,300	159,612.00	0.06
73	300171	东富龙	8,000	151,040.00	0.05
74	002355	兴民钢圈	7,400	143,190.00	0.05
75	000952	广济药业	8,100	136,566.00	0.05
76	002333	罗普斯金	13,900	135,386.00	0.05
77	300315	掌趣科技	12,700	133,223.00	0.05
78	000722	湖南发展	9,300	128,619.00	0.05
79	002329	皇氏集团	8,300	124,417.00	0.05
80	000678	襄阳轴承	15,700	124,030.00	0.05
81	002247	帝龙新材	6,700	99,629.00	0.04
82	002752	昇兴股份	5,900	99,356.00	0.04
83	002626	金达威	5,600	94,360.00	0.03
84	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.03
85	002312	三泰控股	4,000	75,800.00	0.03
86	300209	天泽信息	3,000	75,750.00	0.03
87	000422	湖北宜化	10,700	65,377.00	0.02

88	300006	莱美药业	7,500	64,950.00	0.02
89	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.02
90	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.02
91	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
92	002458	益生股份	1,045	45,781.45	0.02
93	300319	麦捷科技	1,400	40,348.00	0.01
94	002243	通产丽星	2,900	36,975.00	0.01
95	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
96	002531	天顺风能	4,600	29,486.00	0.01
97	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
98	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
99	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
100	000910	大亚科技	800	12,360.00	0.00
101	300059	东方财富	448	9,945.60	0.00
102	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
103	002519	银河电子	400	8,968.00	0.00
104	300017	网宿科技	100	6,720.00	0.00
105	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
106	600873	梅花生物	400	2,484.00	0.00
107	002123	荣信股份	91	1,891.89	0.00
108	300085	银之杰	30	897.00	0.00
109	002067	景兴纸业	100	821.00	0.00
110	603101	汇嘉时代	2	59.64	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	3,926,705.80	1.80
2	300182	捷成股份	3,552,174.73	1.63
3	000830	鲁西化工	3,386,413.00	1.55
4	600478	科力远	3,346,115.00	1.54
5	002005	德豪润达	3,296,855.00	1.51
6	000667	美好集团	3,141,950.00	1.44
7	000650	仁和药业	3,031,179.50	1.39

8	300115	长盈精密	3,016,084.97	1.38
9	600651	飞乐音响	2,858,119.00	1.31
10	601012	隆基股份	2,852,202.00	1.31
11	000587	金洲慈航	2,847,421.76	1.31
12	000062	深圳华强	2,833,167.00	1.30
13	002092	中泰化学	2,791,212.00	1.28
14	600074	保千里	2,777,408.00	1.27
15	002217	合力泰	2,773,094.00	1.27
16	000930	中粮生化	2,761,856.00	1.27
17	603366	日出东方	2,668,249.00	1.22
18	002493	荣盛石化	2,609,045.89	1.20
19	600415	小商品城	2,558,043.00	1.17
20	002004	华邦健康	2,541,530.00	1.17

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	600074	保千里	3,868,825.15	1.78
2	000758	中色股份	3,865,679.72	1.77
3	600651	飞乐音响	3,814,962.99	1.75
4	000650	仁和药业	3,743,093.95	1.72
5	002092	中泰化学	3,296,360.60	1.51
6	000062	深圳华强	3,182,627.87	1.46
7	600557	康缘药业	3,007,373.00	1.38
8	600458	时代新材	2,781,137.63	1.28
9	002217	合力泰	2,685,033.00	1.23
10	600094	大名城	2,641,747.00	1.21
11	000667	美好集团	2,585,262.00	1.19
12	600757	长江传媒	2,497,648.46	1.15
13	000616	海航投资	2,405,032.00	1.10
14	002025	航天电器	2,394,186.92	1.10
15	000078	海王生物	2,391,895.60	1.10
16	002221	东华能源	2,390,177.00	1.10
17	600499	科达洁能	2,374,505.96	1.09
18	600478	科力远	2,353,600.00	1.08

19	002428	云南锗业	2,344,692.83	1.08
20	603019	中科曙光	2,330,437.00	1.07

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	534,411,041.90
卖出股票收入（成交）总额	474,022,803.53

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)(手)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1607	IC1607	16	19,338,880.00	594,440.00	-
IC1612	IC1612	2	2,262,480.00	87,200.00	-
公允价值变动总额合计(元)					681,640.00
股指期货投资本期收益(元)					-2,065,880.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,089,760.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

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	4,707,003.07
2	应收证券清算款	6,979,004.48
3	应收股利	—
4	应收利息	7,666.80
5	应收申购款	1,845,973.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	13,539,647.65

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**

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末前五名积极投资股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
28,802	4,600.29	1,518,761.39	1.15%	130,978,649.02	98.85%

8.2 期末上市基金前十名持有人

无

8.3 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	664,661.83	0.50%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 1 月 27 日）基金份额总额	308,165,342.91
本报告期期初基金份额总额	96,671,968.72
本报告期基金总申购份额	113,922,958.48
减:本报告期基金总赎回份额	78,097,516.79
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	132,497,410.41

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所

处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
宏信证券	1	285,902,276.65	28.40%	266,262.21	28.65%	-
中投证券	1	182,472,225.41	18.12%	166,286.87	17.89%	-
光大证券	2	156,835,890.53	15.58%	144,882.96	15.59%	-
中信建投	1	118,419,668.23	11.76%	107,915.74	11.61%	-
东兴证券	1	67,954,866.23	6.75%	63,286.45	6.81%	-
方正证券	1	56,200,620.09	5.58%	52,339.84	5.63%	-
民生证券	1	49,341,685.34	4.90%	45,951.91	4.94%	-
渤海证券	1	47,793,392.66	4.75%	43,554.33	4.69%	-
华创证券	1	40,956,740.63	4.07%	38,142.91	4.10%	-
国金证券	1	941,068.34	0.09%	857.66	0.09%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、

行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本期新增方正证券、华创证券、国金证券各一个交易单元，未剔除交易单元。

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

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

本基金本报告期内未使用租用的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	关于新增平安证券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 6 月 3 日
2	关于新增上海长量为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 5 月 25 日
3	建信基金管理有限责任公司关于北京汇成基金销售有限公司为旗下代销机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 5 月 25 日
4	建信基金管理有限责任公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 4 月 15 日
5	关于新增中信期货为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 2 月 5 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；

- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2016 年 8 月 27 日