嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2013 年年度报告

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2014 年 3 月 26 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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2014年3月20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。

本报告期自2013年2月6日(本基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 5
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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 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遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 审计报告 14
§7 年度财务报表 15
7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
7.4 报表附注 18
§8 投资组合报告 39
8.1 期末基金资产组合情况 39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 62
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 62
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 62
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 62

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 63
8.12 投资组合报告附注 63
§9 基金份额持有人信息 64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末上市基金前十名持有人 64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 65
§10 开放式基金份额变动 65
§11 重大事件揭示 65
11.1 基金份额持有人大会决议 65
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 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
11.4 基金投资策略的改变 65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
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 66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 66
11.8 其他重大事件 68
§12 备查文件目录 68
12.1 备查文件目录 68
12.2 存放地点 69
12.3 查阅方式 69

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF（场内简称：500ETF）
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
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	65,231,868.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	（010）65215588	（010）67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	（010）67595096
传真		（010）65182266	（010）66275853
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号	北京市西城区闹市口大街 1 号

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	华润大厦8层	院1号楼
邮政编码	100005	100033
法定代表人	安奎	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

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)	上海市黄浦区湖滨路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

§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	2013年2月6日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	24,454,195.20
本期利润	34,027,425.03
加权平均基金份额本期利润	0.0806
本期加权平均净值利润率	3.55%
本期基金份额净值增长率	7.58%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末
期末可供分配利润	17,633,620.55
期末可供分配基金份额利润	0.2703
期末基金资产净值	250,287,144.92
期末基金份额净值	3.8369
3.1.3 累计期末指标	2013年末
基金份额累计净值增长率	7.58%

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)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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

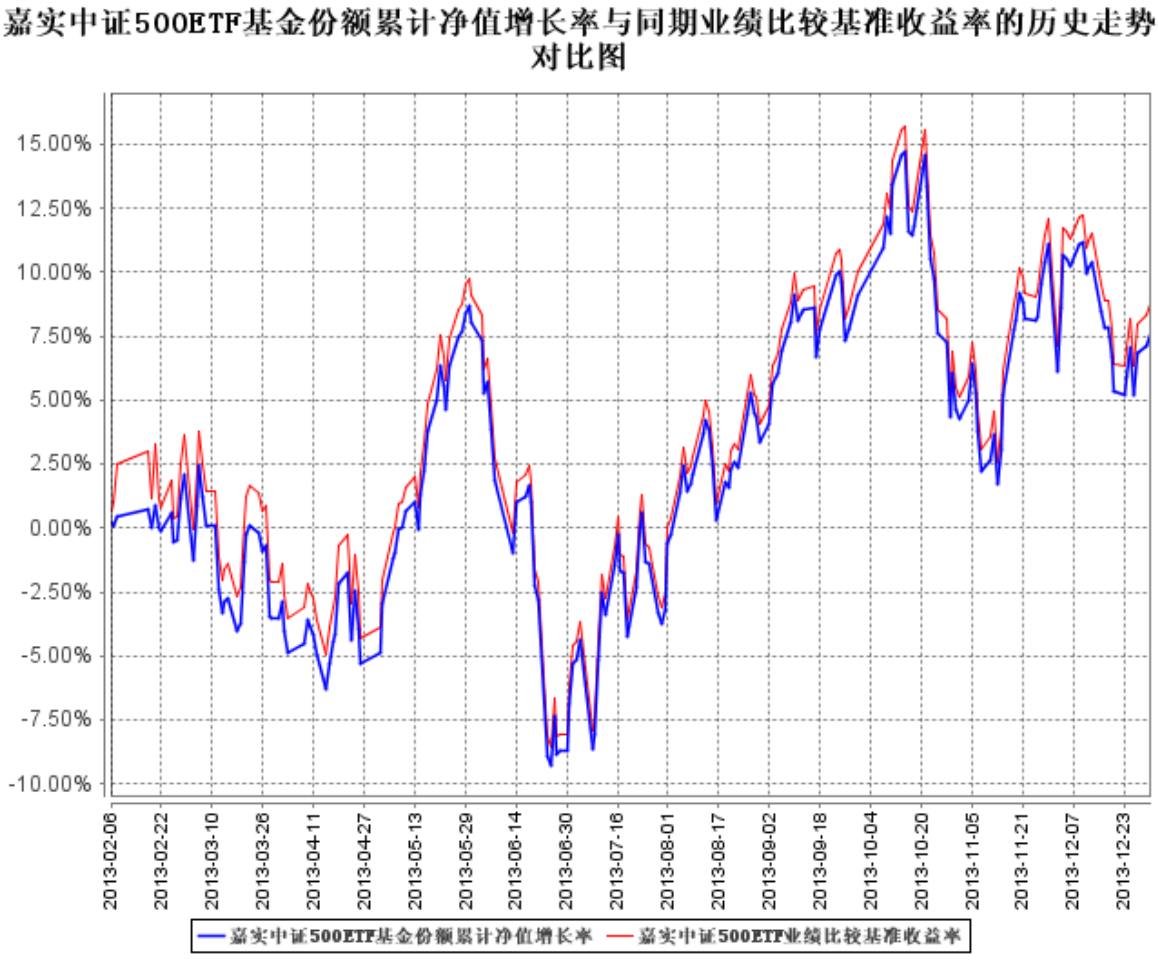
（4）本基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，本报告期自 2013 年 2 月 6 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

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	-1.42%	1.40%	-1.13%	1.40%	-0.29%	0.00%
过去六个月	17.89%	1.39%	18.33%	1.40%	-0.44%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.58%	1.41%	8.76%	1.45%	-1.18%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



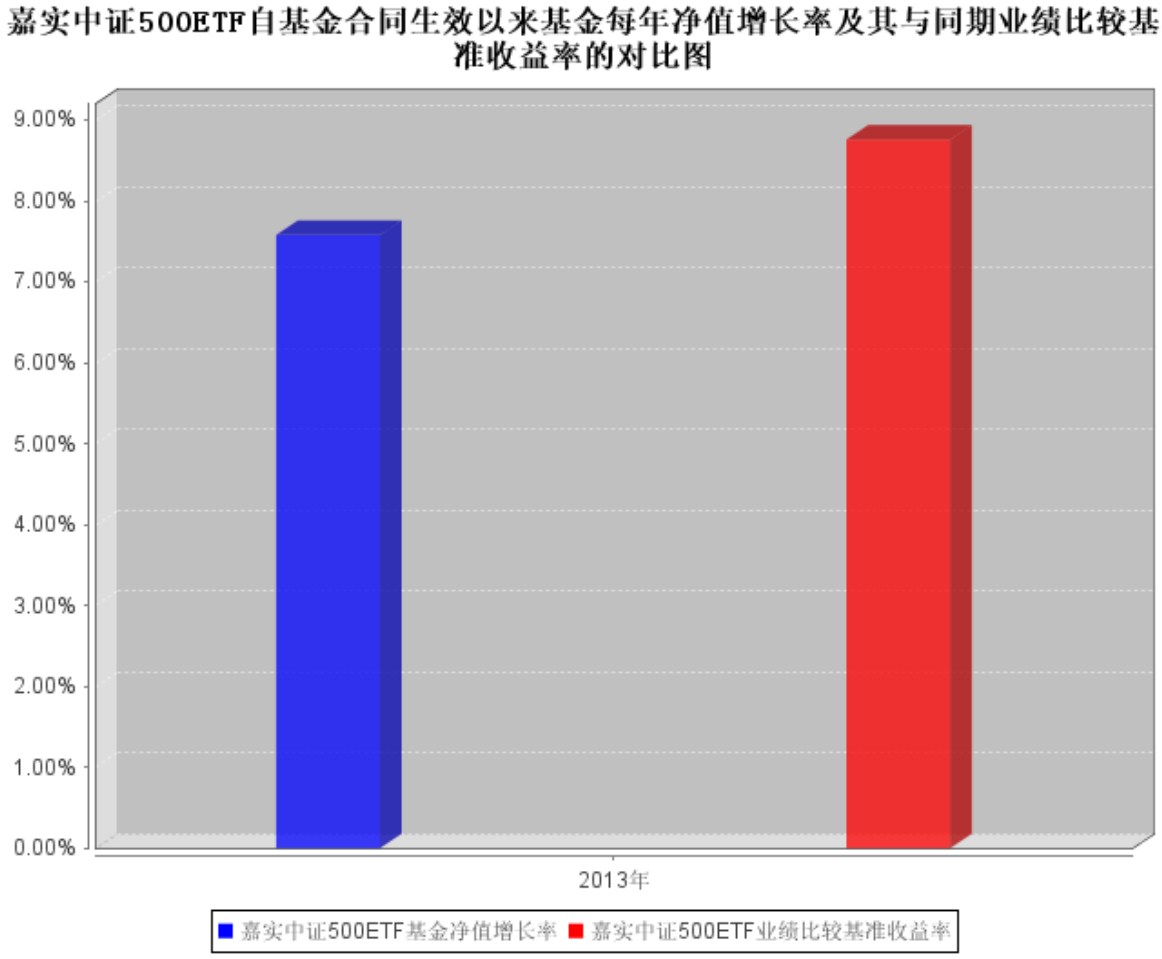
图：嘉实中证 500ETF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日）

注：本基金基金合同生效日 2013 年 2 月 6 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（二）投资范围和(七)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



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，2013 年度的相关数据根据当年实际存续期（2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日）计算。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地在上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2013 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、54 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金、嘉实中创 400ETF 及其联接基金、嘉实沪深 300ETF、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证中期国债 ETF 及其联接基金基金经理、公司指数投资部总监	2013 年 2 月 6 日	-	15 年	曾先后担任平安保险投资管理中心基金交易室主任及天同基金管理有限公司投资部总经理、万家（天同）180 指数基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金。南开大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日；(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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计10次，均为旗下指数基金或ETF因被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，但不存在利益输送行为。

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

本基金2013年2月6日基金合同生效,2013年3月15日在深圳交易所上市及开放日常申购、赎回业务。

报告期内，本基金日均跟踪误差为0.18%，年度化拟合偏离度为2.83%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。本基金的跟踪误差主要来源于本基金建仓、申购赎回、样本股分红以及样本股调整的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为3.8369元；本报告期基金份额净值增长率为7.58%，业绩比较基准收益率为8.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来中国经济发展必然更加倚重机制创新、技术创新，政府资源，市场资源也会更多地偏向

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。

本基金作为一只投资于中证500指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证500指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

（1）风险管理：重新识别评估主要业务风险，明确风险源头，建立健全风控指标动态监控机制，采用先进的风险管理方法和手段加强监控，在风险可控、可测、可承受前提下开展各项业务。

（2）重点支持创新业务和新产品拓展：公司继续加大创新力度，在创新产品方面，迅速研发了多个产品，特别是绝对收益、债券方面的创新产品以及子公司专项资产管理计划；在创新业务方面，主要是互联网金融、子公司新业务等。特别安排关键骨干全程参与，在投资品种、业务规则、法律架构等方面法律、合规难点，提供了较好的解决方案。

（3）法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、代销协议审查（公募、年金、专户、RQFII 以及一般行政管理）。主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患。报告期内未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（4）合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。报告期内公司各项业务审慎开展、运作管理合法合规。

（5）内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，手机、电话录音、录像、MSN、邮件定期检查，公平交易及反洗钱定期稽核以及重点业务专项稽核，每日差错管理，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续开展公司GIPS第三方验证 、ISAE3402国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

此外，我们还积极配合基金部、北京证监局、社保基金理事会的检查、调查、统计工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。根据本基金基金合同十八基金收益与分配的约定，报告期内未实施利润分配符合基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§6 审计报告

普华永道中天审字(2014)第 21033 号

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 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。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司 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”)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。

二、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。

三、 审计意见

我们认为，上述嘉实中证 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，公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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　　注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)　　许　康　玮

中国 · 上海市　　洪　　磊

2014 年 3 月 14 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日： 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	2,473,175.57
结算备付金		10,056.95
存出保证金		7,109.69
交易性金融资产	7.4.7.2	248,408,858.24
其中：股票投资		248,408,858.24
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		-
应收利息	7.4.7.5	556.34
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		250,899,756.79

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		108,396.79
应付托管费		21,679.36
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	70,922.92
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	411,612.80
负债合计		612,611.87
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	232,653,524.37
未分配利润	7.4.7.10	17,633,620.55
所有者权益合计		250,287,144.92
负债和所有者权益总计		250,899,756.79

注：本基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，本报告期自基金合同生效日 2013 年 2 月 6 日起至 2013 年 12 月 31 日止，报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.8369 元，基金份额总额 65,231,868.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		44,871,510.73
1.利息收入		2,706,225.02

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

其中：存款利息收入	7.4.7.11	452,830.96
债券利息收入		88.56
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,253,305.50
其他利息收入		-
2.投资收益		32,602,343.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,912,097.59
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	4,573.44
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	6,685,672.33
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	9,573,229.83
4. 汇兑收益		-
5.其他收入	7.4.7.17	-10,287.48
减：二、费用		10,844,085.70
1. 管理人报酬		4,414,218.42
2. 托管费		882,843.69
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,804,547.37
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	742,476.22
三、利润总额		34,027,425.03
减：所得税费用		-
四、净利润		34,027,425.03

注：本基金合同生效日为 2013 年 2 月 6 日，本期是指 2013 年 2 月 6 日至 2013 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

一、期初所有者权益（基金净值）	3,108,729,402.00	-	3,108,729,402.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,027,425.03	34,027,425.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,876,075,877.63	-16,393,804.48	-2,892,469,682.11
其中：1.基金申购款	105,926,901.77	1,332,503.57	107,259,405.34
2.基金赎回款	-2,982,002,779.40	-17,726,308.05	-2,999,729,087.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	232,653,524.37	17,633,620.55	250,287,144.92

注：本基金合同生效日为2013年2月6日，本期是指2013年2月6日至2013年12月31日，无上年度可比期间数据。

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：

赵学军	李松林	王红
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

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1588号《关于核准嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,108,591,728.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第047号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,108,729,402.00份基金份额，其中认购资金利息折合137,674.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上 [2013] 83 号文审核同意，本基金 871,631,868.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在深交所挂牌交易。

根据《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《嘉实基金管理有限公司关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》(以下简称“份额折算公告”)的有关规定，本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司确定 2013 年 3 月 5 日为本基金的基金折算处理日。当日基金资产净值为 3,136,108,366.93 元，折算前基金份额总额为 3,108,729,402.00 份，折算前基金份额净值为 1.0088 元。根据份额折算公告中的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.28038605，折算后基金份额总额为 871,631,868.00 份，折算后基金份额净值为 3.5980 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于 2013 年 3 月 6 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业版及其他中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 联接基金”)。嘉实中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 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。本期财务报表的实际编制期间为 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资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。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其他各类应收款项等。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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

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，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。对于支付的价款中包含的债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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

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和债券投资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，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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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/(累计亏损)。

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或者发行价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。

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；于处置时，其处置价格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。

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则按直线法计算。

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则按直线法计算。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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。基金管理人定期对本基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上，方可进行收益分配。本基金收益分配比例的确定原则为，使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，且本基金的收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，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。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。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。

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 2013年12月31日
活期存款	2,473,175.57
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	2,473,175.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	238,835,628.41	248,408,858.24	9,573,229.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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		238,835,628.41	248,408,858.24	9,573,229.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2013年12月31日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

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

本期末（2013年12月31日），本基金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

本期末（2013年12月31日），本基金无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 2013年12月31日
应收活期存款利息	509.70
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	43.12
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	3.52
合计	556.34

7.4.7.6 其他资产

本期末（2013年12月31日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	70,922.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	70,922.92

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 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	9,286.30
应付替代款	2,326.50
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	350,000.00
合计	411,612.80

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,108,729,402.00	3,108,729,402.00
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
2013 年 3 月 5 日 基金拆分/份额折算前	3,108,729,402.00	3,108,729,402.00
基金拆分/份额折算变动份额	-2,237,097,534.00	-
本期申购	29,700,000.00	105,926,901.77
本期赎回	-836,100,000.00	-2,982,002,779.40
本期末	65,231,868.00	232,653,524.37

注：(1)本基金于 2013 年 1 月 7 日至 2013 年 1 月 31 日向社会公开募集，截至 2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,108,591,728.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 137,674.00 元，以上实收基金合计 3,108,729,402.00 元，折合为 3,108,729,402.00 份嘉实中证 500ETF 基金份额。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（2）根据《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》(以下简称“份额折算公告”)的有关规定，本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司确定 2013 年 3 月 5 日为本基金的基金折算处理日。当日基金资产净值为 3,136,108,366.93 元，折算前基金份额总额为 3,108,729,402.00 份，折算前基金份额净值为 1.0088 元。根据份额折算公告中的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.28038605，折算后基金份额总额为 871,631,868.00 份，折算后基金份额净值为 3.5980 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于 2013 年 3 月 6 日进行了变更登记。

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	24,454,195.20	9,573,229.83	34,027,425.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,903,428.90	-18,297,233.38	-16,393,804.48
其中：基金申购款	2,097,827.44	-765,323.87	1,332,503.57
基金赎回款	-194,398.54	-17,531,909.51	-17,726,308.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,357,624.10	-8,724,003.55	17,633,620.55

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	383,839.30
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	63,959.51
其他	5,032.15
合计	452,830.96

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	22,432,723.54
股票投资收益——赎回差价收入	3,479,374.05
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	25,912,097.59

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 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
卖出股票成交总额	913,714,701.82
减：卖出股票成本总额	891,281,978.28
买卖股票差价收入	22,432,723.54

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 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
赎回基金份额对价总额	2,999,729,087.45
减：现金支付赎回款总额	27,585,196.45
减：赎回股票成本总额	2,968,664,516.95
赎回差价收入	3,479,374.05

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
卖出债券成交总额	263,662.00
减：卖出债券成本总额	259,000.00
减：应收利息总额	88.56
债券投资收益	4,573.44

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.7.14 衍生工具收益

本期（2013年2月6日（基金合同生效日）至2013年12月31日），本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,685,672.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,685,672.33

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
1.交易性金融资产	9,573,229.83
——股票投资	9,573,229.83
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	9,573,229.83

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	-21,302.40
募集期利息收入	11,014.92
证管费退还	-
其他	-
合计	-10,287.48

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,804,547.37
银行间市场交易费用	-
合计	4,804,547.37

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00
信息披露费	270,000.00
银行划款手续费	9,918.10
指数使用费	301,658.12
上市年费	80,000.00
红利手续费	-
其他	900.00
合计	742,476.22

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，本基金无重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“嘉实中证 500ETF 联接”)	本基金的联接基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,414,218.42
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注 :支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的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。其计算公式为 : 日管理人报酬 = 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 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	882,843.69

注 : 支付基金托管人中国建设银行的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。其计算公式为 : 日托管费 = 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

本期（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

本期（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
嘉实中证 500ETF 联接	16,915,804.00	25.93%

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 2013 年 2 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,473,175.57	383,839.30

注：本基金的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

本期（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本期（2013 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2013 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

本期末（2013 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/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
000735	罗 牛	2013 年 12 月 31 日	重大事项	6.53	2014 年 1 月 6 日	6.53	120,974	719,623.70	789,960.22	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	山		停牌							
001696	宗申动力	2013年12月9日	重大事项停牌	4.70	2014年1月9日	4.41	94,854	508,561.56	445,813.80	-
002022	科华生物	2013年12月20日	重大事项停牌	16.82	2014年1月27日	18.50	54,052	800,320.47	909,154.64	-
002190	成飞集成	2013年12月23日	重大事项停牌	15.15	未知	未知	23,639	403,589.13	358,130.85	-
002573	国电清新	2013年12月23日	重大事项停牌	22.17	未知	未知	36,550	506,269.02	810,313.50	-
600063	皖维高新	2013年12月18日	重大事项停牌	2.07	未知	未知	143,625	389,290.60	297,303.75	-
600141	兴发集团	2013年12月20日	重大事项停牌	12.48	2014年1月27日	13.28	41,900	718,881.74	522,912.00	-
600572	康 恩贝	2013年11月25日	重大事项停牌	13.51	未知	未知	53,973	635,326.25	729,175.23	-
600639	浦东金桥	2013年12月5日	重大事项停牌	11.76	2014年2月26日	10.58	35,952	316,948.27	422,795.52	-

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

本期末（2013年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2013年12月31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

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

本基金为进行被动化指数投资的股票型证券投资基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证500指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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

7.4.13.2 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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 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投资的公允价值。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,473,175.57	-	-	-	2,473,175.57
结算备付金	10,056.95	-	-	-	10,056.95
存出保证金	7,109.69	-	-	-	7,109.69
交易性金融资产	-	-	-	248,408,858.24	248,408,858.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	556.34	556.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,490,342.21	-	-	248,409,414.58	250,899,756.79
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	108,396.79	108,396.79
应付托管费	-	-	-	21,679.36	21,679.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	70,922.92	70,922.92
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	411,612.80	411,612.80
负债总计	-	-	-	612,611.87	612,611.87
利率敏感度缺口	2,490,342.21	-	-	247,796,802.71	250,287,144.92

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2013 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	248,408,858.24	99.25
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

其他	-	-
合计	248,408,858.24	99.25

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2013年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为243,123,298.73元，属于第二层级的余额为5,285,559.51元，无属于第三层级的余额。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

无。

(2) 基金申购款

于2013年2月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为107,259,405.34元，其中包括以股票支付的申购款104,336,404.14元和以现金支付的申购款2,923,001.20元。

(3) 除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	248,408,858.24	99.01
	其中：股票	248,408,858.24	99.01
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	2,483,232.52	0.99
7	其他各项资产	7,666.03	0.00
	合计	250,899,756.79	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

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,930,809.87	1.57
B	采矿业	5,788,612.97	2.31
C	制造业	151,143,951.23	60.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供	7,563,378.74	3.02

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	应业		
E	建筑业	5,658,872.84	2.26
F	批发和零售业	15,491,868.76	6.19
G	交通运输、仓储和邮政业	8,957,069.64	3.58
H	住宿和餐饮业	793,784.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,734,640.07	5.09
J	金融业	2,362,522.15	0.94
K	房地产业	20,533,803.71	8.20
L	租赁和商务服务业	4,902,568.55	1.96
M	科学研究和技术服务业	918,243.04	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	1,711,728.30	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,913,957.10	1.56
S	综合	2,003,124.27	0.80
	合计	248,408,935.24	99.25

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

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

8.3.1 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	600388	龙净环保	46,910	1,572,423.20	0.63
2	600499	科达机电	74,635	1,499,417.15	0.60
3	600570	恒生电子	67,963	1,417,708.18	0.57
4	002008	大族激光	100,583	1,356,864.67	0.54
5	002400	省广股份	37,100	1,344,875.00	0.54
6	600587	新华医疗	19,100	1,335,281.00	0.53
7	002465	海格通信	64,044	1,330,834.32	0.53
8	600872	中炬高新	109,501	1,245,026.37	0.50
9	000998	隆平高科	45,623	1,244,595.44	0.50
10	600557	康缘药业	39,924	1,214,488.08	0.49
11	600643	爱建股份	106,475	1,208,491.25	0.48

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

12	600594	益佰制药	34,639	1,129,924.18	0.45
13	600418	江淮汽车	123,750	1,080,337.50	0.43
14	600879	航天电子	114,371	1,070,512.56	0.43
15	600675	中华企业	149,858	1,035,518.78	0.41
16	600805	悦达投资	93,617	1,026,978.49	0.41
17	600881	亚泰集团	260,800	1,022,336.00	0.41
18	601929	吉视传媒	121,080	1,015,861.20	0.41
19	600138	中青旅	57,123	1,006,507.26	0.40
20	600635	大众公用	181,045	992,126.60	0.40
21	002063	远光软件	50,779	987,651.55	0.39
22	002152	广电运通	51,366	985,713.54	0.39
23	600717	天津港	115,206	985,011.30	0.39
24	600200	江苏吴中	85,702	976,145.78	0.39
25	000897	津滨发展	177,958	969,871.10	0.39
26	600110	中科英华	158,231	963,626.79	0.39
27	002252	上海莱士	20,160	957,600.00	0.38
28	600880	博瑞传播	56,271	955,481.58	0.38
29	002405	四维图新	76,100	932,225.00	0.37
30	002410	广联达	29,441	927,391.50	0.37
31	600645	中源协和	38,324	918,243.04	0.37
32	600312	平高电气	90,089	909,898.90	0.36
33	002022	科华生物	54,052	909,154.64	0.36
34	002250	联化科技	43,244	907,691.56	0.36
35	600478	科力远	34,587	897,186.78	0.36
36	600770	综艺股份	106,385	894,697.85	0.36
37	000028	国药一致	19,142	886,274.60	0.35
38	600422	昆明制药	37,428	882,926.52	0.35
39	600151	航天机电	103,120	882,707.20	0.35
40	000690	宝新能源	166,289	881,331.70	0.35
41	600521	华海药业	64,675	876,346.25	0.35
42	600500	中化国际	114,655	871,378.00	0.35
43	600704	物产中大	76,032	862,963.20	0.34
44	600387	海越股份	42,397	854,723.52	0.34
45	002440	闰土股份	52,642	845,956.94	0.34
46	600522	中天科技	77,467	845,939.64	0.34
47	600517	置信电气	57,068	844,606.40	0.34
48	600601	方正科技	302,069	839,751.82	0.34

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

49	002292	奥飞动漫	25,283	825,742.78	0.33
50	002049	同方国芯	16,693	824,300.34	0.33
51	002153	石基信息	17,100	811,908.00	0.32
52	002573	国电清新	36,550	810,313.50	0.32
53	000848	承德露露	33,125	809,906.25	0.32
54	600320	振华重工	228,700	809,598.00	0.32
55	000997	新大陆	49,100	807,695.00	0.32
56	000977	浪潮信息	17,800	805,094.00	0.32
57	600765	中航重机	64,107	802,619.64	0.32
58	000049	德赛电池	11,300	793,260.00	0.32
59	002429	兆驰股份	58,696	792,396.00	0.32
60	600596	新安股份	74,683	790,892.97	0.32
61	000735	罗牛山	120,974	789,960.22	0.32
62	600835	上海机电	44,257	781,136.05	0.31
63	000671	阳光城	84,000	780,360.00	0.31
64	000422	湖北宜化	123,600	774,972.00	0.31
65	002005	德豪润达	96,200	761,904.00	0.30
66	600654	飞乐股份	103,800	757,740.00	0.30
67	600161	天坛生物	35,360	751,753.60	0.30
68	600584	长电科技	117,304	750,745.60	0.30
69	600511	国药股份	39,403	743,534.61	0.30
70	002340	格林美	72,430	742,407.50	0.30
71	002219	恒康医疗	30,149	742,268.38	0.30
72	600067	冠城大通	114,500	740,815.00	0.30
73	600572	康恩贝	53,973	729,175.23	0.29
74	600292	中电远达	28,126	728,182.14	0.29
75	600978	宜华木业	126,790	726,506.70	0.29
76	000550	江铃汽车	28,518	724,642.38	0.29
77	600125	铁龙物流	125,800	715,802.00	0.29
78	002428	云南锗业	53,800	712,312.00	0.28
79	600158	中体产业	92,847	710,279.55	0.28
80	002092	中泰化学	133,900	709,670.00	0.28
81	000712	锦龙股份	30,718	704,978.10	0.28
82	600490	鹏欣资源	59,800	703,248.00	0.28
83	600755	厦门国贸	128,069	695,414.67	0.28
84	000762	西藏矿业	65,486	691,532.16	0.28
85	000786	北新建材	39,444	690,270.00	0.28

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

86	002317	众生药业	34,580	681,226.00	0.27
87	600037	歌华有线	87,431	681,087.49	0.27
88	600366	宁波韵升	49,467	680,665.92	0.27
89	002073	软控股份	81,706	679,793.92	0.27
90	600198	大唐电信	51,012	677,439.36	0.27
91	600435	北方导航	51,155	674,222.90	0.27
92	002041	登海种业	19,311	671,829.69	0.27
93	600325	华发股份	89,900	669,755.00	0.27
94	600171	上海贝岭	74,139	669,475.17	0.27
95	600759	正和股份	83,927	668,898.19	0.27
96	002223	鱼跃医疗	29,196	666,836.64	0.27
97	600038	哈飞股份	24,157	664,075.93	0.27
98	000616	亿城股份	189,880	660,782.40	0.26
99	600787	中储股份	63,890	656,789.20	0.26
100	002273	水晶光电	41,300	656,670.00	0.26
101	002271	东方雨虹	24,829	654,740.73	0.26
102	000652	泰达股份	142,074	653,540.40	0.26
103	600503	华丽家族	156,664	653,288.88	0.26
104	002663	普邦园林	38,434	651,840.64	0.26
105	000726	鲁泰A	61,802	650,775.06	0.26
106	002437	誉衡药业	15,421	649,224.10	0.26
107	600820	隧道股份	71,320	646,872.40	0.26
108	000088	盐田港	106,840	646,382.00	0.26
109	600132	重庆啤酒	39,900	645,981.00	0.26
110	000979	中弘股份	185,280	644,774.40	0.26
111	000006	深振业A	129,886	640,337.98	0.26
112	000939	凯迪电力	103,700	639,829.00	0.26
113	600797	浙大网新	114,458	638,675.64	0.26
114	600825	新华传媒	71,734	638,432.60	0.26
115	002368	太极股份	19,600	638,176.00	0.25
116	000788	北大医药	49,300	634,984.00	0.25
117	000511	烯碳新材	158,800	633,612.00	0.25
118	600112	天成控股	49,000	628,180.00	0.25
119	600816	安信信托	43,662	622,183.50	0.25
120	600426	华鲁恒升	91,801	621,492.77	0.25
121	600525	长园集团	70,130	620,650.50	0.25
122	002216	三全食品	27,544	619,464.56	0.25

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

123	000540	中天城投	106,300	616,540.00	0.25
124	600261	阳光照明	44,292	615,215.88	0.25
125	601216	内蒙君正	52,735	614,890.10	0.25
126	002470	金正大	28,781	613,035.30	0.24
127	002191	劲嘉股份	44,109	609,586.38	0.24
128	000566	海南海药	54,424	608,460.32	0.24
129	002477	雏鹰农牧	58,727	607,237.18	0.24
130	600284	浦东建设	57,133	603,895.81	0.24
131	002004	华邦颖泰	39,799	603,750.83	0.24
132	600761	安徽合力	49,422	597,511.98	0.24
133	600073	上海梅林	67,875	595,942.50	0.24
134	000982	中银绒业	69,200	594,428.00	0.24
135	000887	中鼎股份	73,725	593,486.25	0.24
136	600409	三友化工	127,254	591,731.10	0.24
137	000988	华工科技	85,770	590,955.30	0.24
138	002161	远望谷	71,156	590,594.80	0.24
139	601588	北辰实业	219,474	590,385.06	0.24
140	601718	际华集团	212,400	588,348.00	0.24
141	000513	丽珠集团	15,067	582,942.23	0.23
142	000830	鲁西化工	141,095	582,722.35	0.23
143	000559	万向钱潮	109,516	581,529.96	0.23
144	600651	飞乐音响	101,631	580,313.01	0.23
145	600183	生益科技	117,431	580,109.14	0.23
146	000488	晨鸣纸业	122,539	575,933.30	0.23
147	000587	金叶珠宝	45,919	574,905.88	0.23
148	000921	海信科龙	49,300	574,838.00	0.23
149	002690	美亚光电	14,314	573,848.26	0.23
150	600851	海欣股份	81,123	571,105.92	0.23
151	600720	祁连山	85,350	570,991.50	0.23
152	600812	华北制药	113,687	569,571.87	0.23
153	002414	高德红外	24,678	562,658.40	0.22
154	600289	亿阳信通	62,785	562,553.60	0.22
155	000413	东旭光电	33,200	562,076.00	0.22
156	000926	福星股份	78,281	557,360.72	0.22
157	002508	老板电器	14,100	556,668.00	0.22
158	600702	沱牌舍得	36,992	556,359.68	0.22
159	000860	顺鑫农业	36,147	555,217.92	0.22

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

160	002064	华峰氨纶	60,900	554,799.00	0.22
161	600747	大连控股	146,327	554,579.33	0.22
162	002309	中利科技	33,036	551,701.20	0.22
163	000829	天音控股	78,045	550,997.70	0.22
164	002482	广田股份	28,073	550,230.80	0.22
165	600300	维维股份	115,100	550,178.00	0.22
166	600056	中国医药	25,092	547,256.52	0.22
167	600064	南京高科	49,660	547,253.20	0.22
168	600458	时代新材	54,512	544,574.88	0.22
169	600199	金种子酒	53,500	542,490.00	0.22
170	002028	思源电气	36,179	539,067.10	0.22
171	000415	渤海租赁	68,000	537,880.00	0.21
172	600017	日照港	211,520	537,260.80	0.21
173	002277	友阿股份	46,040	532,222.40	0.21
174	000563	陕国投A	66,815	531,847.40	0.21
175	000078	海王生物	70,404	531,550.20	0.21
176	600611	大众交通	86,005	531,510.90	0.21
177	000759	中百集团	74,900	530,292.00	0.21
178	000969	安泰科技	71,200	529,016.00	0.21
179	002011	盾安环境	57,571	526,774.65	0.21
180	600640	号百控股	29,500	526,575.00	0.21
181	000816	江淮动力	119,811	524,772.18	0.21
182	000900	现代投资	74,959	524,713.00	0.21
183	600120	浙江东方	41,800	524,590.00	0.21
184	600141	兴发集团	41,900	522,912.00	0.21
185	600894	广日股份	43,430	522,028.60	0.21
186	002416	爱施德	27,500	519,750.00	0.21
187	002167	东方锆业	45,425	517,390.75	0.21
188	000572	海马汽车	135,658	515,500.40	0.21
189	000877	天山股份	84,720	515,097.60	0.21
190	002396	星网锐捷	24,000	514,080.00	0.21
191	601311	骆驼股份	46,800	510,120.00	0.20
192	000975	银泰资源	59,726	508,865.52	0.20
193	600685	广船国际	30,055	508,230.05	0.20
194	600481	双良节能	44,485	507,573.85	0.20
195	002262	恩华药业	18,000	507,060.00	0.20
196	600270	外运发展	49,744	506,891.36	0.20

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

197	600801	华新水泥	41,750	506,845.00	0.20
198	600122	宏图高科	125,649	505,108.98	0.20
199	600086	东方金钰	29,003	504,652.20	0.20
200	000541	佛山照明	72,455	499,214.95	0.20
201	601519	大智慧	74,572	498,140.96	0.20
202	600059	古越龙山	52,361	496,905.89	0.20
203	002646	青青稞酒	24,800	496,000.00	0.20
204	600628	新世界	58,449	495,063.03	0.20
205	002048	宁波华翔	58,286	491,933.84	0.20
206	002393	力生制药	12,428	489,663.20	0.20
207	002424	贵州百灵	19,300	489,255.00	0.20
208	600885	宏发股份	26,300	488,128.00	0.20
209	600874	创业环保	59,725	487,953.25	0.19
210	002698	博实股份	16,500	487,575.00	0.19
211	600884	杉杉股份	39,487	486,479.84	0.19
212	000685	中山公用	42,761	485,764.96	0.19
213	600373	中文传媒	27,160	485,620.80	0.19
214	600729	重庆百货	22,211	483,755.58	0.19
215	002029	七匹狼	62,280	483,292.80	0.19
216	002701	奥瑞金	12,600	482,202.00	0.19
217	000809	铁岭新城	45,300	481,992.00	0.19
218	600410	华胜天成	70,986	479,155.50	0.19
219	002648	卫星石化	16,481	477,619.38	0.19
220	600844	丹化科技	64,218	477,139.74	0.19
221	600240	华业地产	117,481	476,972.86	0.19
222	600580	卧龙电气	76,302	475,361.46	0.19
223	600220	江苏阳光	196,260	474,949.20	0.19
224	600351	亚宝药业	76,100	474,864.00	0.19
225	600545	新疆城建	74,310	473,354.70	0.19
226	600993	马应龙	27,327	473,303.64	0.19
227	000417	合肥百货	75,100	470,877.00	0.19
228	600269	赣粤高速	160,600	468,952.00	0.19
229	600298	安琪酵母	27,100	468,017.00	0.19
230	000518	四环生物	141,585	467,230.50	0.19
231	600311	荣华实业	91,502	465,745.18	0.19
232	002325	洪涛股份	48,315	463,340.85	0.19
233	002140	东华科技	24,552	463,050.72	0.19

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

234	000031	中粮地产	124,699	462,633.29	0.18
235	002050	三花股份	40,883	461,977.90	0.18
236	002332	仙琚制药	32,800	461,168.00	0.18
237	002013	中航机电	29,480	460,772.40	0.18
238	600439	瑞贝卡	90,800	455,816.00	0.18
239	002308	威创股份	57,405	454,647.60	0.18
240	600551	时代出版	27,800	453,418.00	0.18
241	002251	步步高	32,900	453,362.00	0.18
242	000930	中粮生化	106,091	453,008.57	0.18
243	000612	焦作万方	77,311	450,723.13	0.18
244	600251	冠农股份	29,822	450,312.20	0.18
245	600748	上实发展	59,542	449,542.10	0.18
246	600482	风帆股份	43,839	448,911.36	0.18
247	000667	名流置业	246,501	448,631.82	0.18
248	600864	哈投股份	45,035	446,747.20	0.18
249	000510	金路集团	83,800	446,654.00	0.18
250	002588	史丹利	12,100	446,369.00	0.18
251	001696	宗申动力	94,854	445,813.80	0.18
252	000050	深天马A	39,392	444,735.68	0.18
253	000501	鄂武商A	34,799	444,035.24	0.18
254	600826	兰生股份	28,881	443,612.16	0.18
255	000650	仁和药业	81,750	442,267.50	0.18
256	600260	凯乐科技	58,018	442,097.16	0.18
257	000799	酒鬼酒	31,300	441,956.00	0.18
258	002083	孚日股份	103,200	440,664.00	0.18
259	600004	白云机场	63,200	439,240.00	0.18
260	002408	齐翔腾达	30,714	439,210.20	0.18
261	002056	横店东磁	28,183	438,809.31	0.18
262	600509	天富热电	49,790	438,649.90	0.18
263	600983	合肥三洋	29,174	438,485.22	0.18
264	002384	东山精密	21,000	438,480.00	0.18
265	600595	中孚实业	119,700	438,102.00	0.18
266	600277	亿利能源	57,474	434,503.44	0.17
267	000680	山推股份	136,450	433,911.00	0.17
268	000886	海南高速	108,802	433,031.96	0.17
269	600586	金晶科技	136,931	432,701.96	0.17
270	000931	中关村	74,203	430,377.40	0.17

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

271	002237	恒邦股份	31,146	427,946.04	0.17
272	000021	长城开发	80,839	426,829.92	0.17
273	600239	云南城投	79,248	425,561.76	0.17
274	002179	中航光电	25,452	423,775.80	0.17
275	600026	中海发展	86,943	423,412.41	0.17
276	600639	浦东金桥	35,952	422,795.52	0.17
277	600830	香溢融通	43,664	421,357.60	0.17
278	600790	轻纺城	66,431	421,172.54	0.17
279	000683	远兴能源	105,505	420,964.95	0.17
280	600575	芜湖港	129,700	420,228.00	0.17
281	002371	七星电子	19,400	417,294.00	0.17
282	600636	三爱富	36,665	417,247.70	0.17
283	000525	红太阳	27,811	417,165.00	0.17
284	000636	风华高科	73,825	411,943.50	0.16
285	002249	大洋电机	39,302	411,491.94	0.16
286	600380	健康元	85,003	409,714.46	0.16
287	600021	上海电力	88,197	409,234.08	0.16
288	600428	中远航运	116,281	408,146.31	0.16
289	600392	盛和资源	20,700	406,962.00	0.16
290	600612	老凤祥	17,443	406,770.76	0.16
291	600750	江中药业	25,586	405,793.96	0.16
292	000973	佛塑科技	101,064	405,266.64	0.16
293	600699	均胜电子	26,250	404,512.50	0.16
294	002638	勤上光电	35,981	404,426.44	0.16
295	600831	广电网络	54,211	404,414.06	0.16
296	600322	天房发展	121,558	403,572.56	0.16
297	002181	粤传媒	38,025	402,684.75	0.16
298	600139	西部资源	54,560	402,652.80	0.16
299	600416	湘电股份	58,566	402,348.42	0.16
300	600438	通威股份	44,880	401,676.00	0.16
301	002572	索菲亚	18,200	398,944.00	0.16
302	002306	湘鄂情	77,000	398,090.00	0.16
303	600429	三元股份	48,600	396,576.00	0.16
304	600754	锦江股份	24,700	395,694.00	0.16
305	600460	士兰微	65,943	395,658.00	0.16
306	600496	精工钢构	56,392	394,744.00	0.16
307	000099	中信海直	46,590	394,617.30	0.16

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

308	600508	上海能源	39,700	393,427.00	0.16
309	600236	桂冠电力	125,500	392,815.00	0.16
310	601515	东风股份	15,170	391,537.70	0.16
311	000627	天茂集团	148,981	390,330.22	0.16
312	000732	泰禾集团	41,901	387,165.24	0.15
313	601608	中信重工	113,049	380,975.13	0.15
314	002281	光迅科技	10,224	380,537.28	0.15
315	002168	深圳惠程	51,989	378,999.81	0.15
316	002254	泰和新材	49,023	378,947.79	0.15
317	000738	中航动控	31,424	378,659.20	0.15
318	600757	长江传媒	50,016	378,621.12	0.15
319	600858	银座股份	50,015	378,113.40	0.15
320	000852	江钻股份	21,881	374,165.10	0.15
321	601002	晋亿实业	43,557	373,719.06	0.15
322	600106	重庆路桥	99,874	373,528.76	0.15
323	600329	中新药业	29,564	373,097.68	0.15
324	600456	宝钛股份	29,470	372,795.50	0.15
325	600470	六国化工	57,338	372,697.00	0.15
326	002183	怡亚通	54,200	372,354.00	0.15
327	002480	新筑股份	22,991	371,994.38	0.15
328	002275	桂林三金	24,254	370,843.66	0.15
329	600195	中牧股份	23,481	369,356.13	0.15
330	601880	大连港	138,855	369,354.30	0.15
331	000850	华茂股份	77,790	368,724.60	0.15
332	600479	千金药业	29,227	367,967.93	0.15
333	002285	世联行	23,238	366,230.88	0.15
334	002293	罗莱家纺	15,348	365,435.88	0.15
335	002203	海亮股份	31,833	365,124.51	0.15
336	600425	青松建化	94,791	363,997.44	0.15
337	600537	亿晶光电	33,400	363,392.00	0.15
338	600616	金枫酒业	42,201	363,350.61	0.15
339	600176	中国玻纤	47,876	362,421.32	0.14
340	000962	东方钽业	36,291	361,458.36	0.14
341	600487	亨通光电	17,047	360,203.11	0.14
342	002190	成飞集成	23,639	358,130.85	0.14
343	000090	深天健	53,102	356,845.44	0.14
344	002025	航天电器	27,118	356,601.70	0.14

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

345	601965	中国汽研	26,500	355,100.00	0.14
346	002635	安洁科技	9,881	353,739.80	0.14
347	600736	苏州高新	87,235	352,429.40	0.14
348	600088	中视传媒	22,668	351,807.36	0.14
349	600563	法拉电子	15,470	351,323.70	0.14
350	601678	滨化股份	45,331	350,408.63	0.14
351	002123	荣信股份	48,398	350,401.52	0.14
352	000823	超声电子	42,400	348,528.00	0.14
353	600039	四川路桥	57,574	347,746.96	0.14
354	603077	和邦股份	24,730	346,220.00	0.14
355	002118	紫鑫药业	35,200	344,960.00	0.14
356	002122	天马股份	81,739	344,938.58	0.14
357	000066	长城电脑	90,700	343,753.00	0.14
358	600180	瑞茂通	35,945	343,274.75	0.14
359	000669	金鸿能源	11,100	342,990.00	0.14
360	601000	唐山港	111,700	341,802.00	0.14
361	002444	巨星科技	41,775	340,048.50	0.14
362	000409	山东地矿	26,100	336,429.00	0.13
363	600467	好当家	60,213	335,988.54	0.13
364	002221	东华能源	32,200	335,846.00	0.13
365	000042	深长城	13,103	335,436.80	0.13
366	600401	海润光伏	42,690	334,689.60	0.13
367	002479	富春环保	40,447	334,496.69	0.13
368	002557	洽洽食品	13,800	333,132.00	0.13
369	600197	伊力特	30,266	330,202.06	0.13
370	600673	东阳光铝	34,090	325,218.60	0.13
371	600069	银鸽投资	79,355	324,561.95	0.13
372	600963	岳阳林纸	100,458	324,479.34	0.13
373	600776	东方通信	52,499	323,393.84	0.13
374	601126	四方股份	16,776	322,938.00	0.13
375	600780	通宝能源	63,023	322,677.76	0.13
376	600337	美克股份	53,395	320,370.00	0.13
377	600006	东风汽车	110,016	320,146.56	0.13
378	600614	鼎立股份	30,639	319,564.77	0.13
379	000919	金陵药业	34,658	318,853.60	0.13
380	600308	华泰股份	112,400	318,092.00	0.13
381	000608	阳光股份	61,854	317,929.56	0.13

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

382	600078	澄星股份	54,600	317,226.00	0.13
383	002233	塔牌集团	49,151	316,040.93	0.13
384	600740	山西焦化	52,625	315,750.00	0.13
385	601100	恒立油缸	25,981	314,110.29	0.13
386	600815	厦工股份	79,064	313,884.08	0.13
387	600888	新疆众和	52,823	312,712.16	0.12
388	601339	百隆东方	30,810	312,105.30	0.12
389	601801	皖新传媒	25,000	311,750.00	0.12
390	603766	隆鑫通用	33,100	311,471.00	0.12
391	603366	日出东方	21,880	310,039.60	0.12
392	002226	江南化工	21,861	309,770.37	0.12
393	000543	皖能电力	43,374	309,690.36	0.12
394	000655	金岭矿业	40,903	308,817.65	0.12
395	600449	宁夏建材	39,332	306,396.28	0.12
396	002342	巨力索具	52,755	304,923.90	0.12
397	000418	小天鹅A	30,249	304,909.92	0.12
398	600280	中央商场	23,700	303,834.00	0.12
399	601616	广电电气	76,920	303,064.80	0.12
400	601566	九牧王	23,800	302,974.00	0.12
401	000777	中核科技	17,574	302,624.28	0.12
402	000697	炼石有色	33,100	301,872.00	0.12
403	600773	西藏城投	31,584	301,311.36	0.12
404	600737	中粮屯河	56,300	300,079.00	0.12
405	600335	国机汽车	22,955	298,185.45	0.12
406	000552	靖远煤电	29,700	297,594.00	0.12
407	600063	皖维高新	143,625	297,303.75	0.12
408	000426	兴业矿业	39,653	297,000.97	0.12
409	600723	首商股份	45,217	294,814.84	0.12
410	600162	香江控股	52,717	292,579.35	0.12
411	600333	长春燃气	36,370	292,414.80	0.12
412	600869	远东电缆	40,821	291,870.15	0.12
413	600589	广东榕泰	57,863	291,050.89	0.12
414	000861	海印股份	27,000	290,520.00	0.12
415	601908	京运通	35,395	290,239.00	0.12
416	600533	栖霞建设	86,618	290,170.30	0.12
417	002305	南国置业	39,457	289,219.81	0.12
418	002091	江苏国泰	24,671	286,677.02	0.11

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

419	002315	焦点科技	6,370	286,013.00	0.11
420	002267	陕天然气	27,850	285,741.00	0.11
421	002463	沪电股份	76,760	283,244.40	0.11
422	002078	太阳纸业	47,395	282,474.20	0.11
423	002447	壹桥苗业	14,585	281,198.80	0.11
424	600488	天药股份	66,109	278,979.98	0.11
425	600491	龙元建设	78,128	276,573.12	0.11
426	600850	华东电脑	13,200	276,408.00	0.11
427	000688	建新矿业	46,900	271,082.00	0.11
428	600657	信达地产	83,800	270,674.00	0.11
429	601777	力帆股份	41,659	267,034.19	0.11
430	002461	珠江啤酒	28,000	266,280.00	0.11
431	600510	黑牡丹	43,715	266,224.35	0.11
432	002283	天润曲轴	46,076	264,937.00	0.11
433	600507	方大特钢	72,064	264,474.88	0.11
434	002327	富安娜	17,674	264,226.30	0.11
435	000951	中国重汽	22,996	263,074.24	0.11
436	600408	安泰集团	96,900	261,630.00	0.10
437	002345	潮宏基	23,170	261,357.60	0.10
438	002574	明牌珠宝	13,090	256,956.70	0.10
439	002493	荣盛石化	30,600	255,204.00	0.10
440	000780	平庄能源	55,800	254,448.00	0.10
441	600469	风神股份	30,866	250,014.60	0.10
442	600724	宁波富达	59,625	249,828.75	0.10
443	002430	杭氧股份	33,480	247,752.00	0.10
444	603001	奥康国际	16,545	245,858.70	0.10
445	000822	山东海化	73,825	245,837.25	0.10
446	002093	国脉科技	47,500	242,725.00	0.10
447	600841	上柴股份	21,390	242,348.70	0.10
448	002276	万马电缆	51,551	241,774.19	0.10
449	002672	东江环保	6,970	241,719.60	0.10
450	000620	新华联	43,910	241,505.00	0.10
451	600468	百利电气	25,034	239,825.72	0.10
452	002154	报喜鸟	40,148	238,880.60	0.10
453	601233	桐昆股份	39,673	238,434.73	0.10
454	000927	一汽夏利	65,843	235,717.94	0.09
455	002490	山东墨龙	22,270	235,171.20	0.09

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

456	000987	广州友谊	24,619	235,111.45	0.09
457	601208	东材科技	33,800	234,910.00	0.09
458	000506	中润资源	51,096	234,019.68	0.09
459	002238	天威视讯	17,574	232,152.54	0.09
460	600397	安源煤业	54,420	231,285.00	0.09
461	002612	朗姿股份	8,182	228,932.36	0.09
462	601636	旗滨集团	28,598	227,926.06	0.09
463	002601	佰利联	13,051	227,478.93	0.09
464	002392	北京利尔	33,000	227,040.00	0.09
465	002419	天虹商场	21,881	224,936.68	0.09
466	600531	豫光金铅	24,229	224,845.12	0.09
467	600683	京投银泰	51,000	223,890.00	0.09
468	600117	西宁特钢	61,110	223,051.50	0.09
469	600268	国电南自	43,609	221,097.63	0.09
470	002498	汉缆股份	29,473	220,458.04	0.09
471	600581	八一钢铁	52,625	217,341.25	0.09
472	002320	海峡股份	23,300	213,428.00	0.09
473	600223	鲁商置业	55,000	212,850.00	0.09
474	601011	宝泰隆	21,195	212,373.90	0.08
475	000030	富奥股份	34,696	210,951.68	0.08
476	600121	郑州煤电	41,827	210,808.08	0.08
477	002378	章源钨业	11,800	208,270.00	0.08
478	601010	文峰股份	30,408	207,686.64	0.08
479	600618	氯碱化工	30,846	206,359.74	0.08
480	601388	怡球资源	22,416	206,003.04	0.08
481	002075	沙钢股份	64,958	200,720.22	0.08
482	002489	浙江永强	19,640	200,328.00	0.08
483	601999	出版传媒	30,166	199,397.26	0.08
484	002194	武汉凡谷	22,858	197,264.54	0.08
485	600743	华远地产	74,945	191,109.75	0.08
486	000631	顺发恒业	43,081	189,987.21	0.08
487	002678	珠江钢琴	26,200	185,234.00	0.07
488	600184	光电股份	8,608	184,211.20	0.07
489	600094	大名城	36,028	181,941.40	0.07
490	002662	京威股份	24,735	181,802.25	0.07
491	002503	搜于特	17,800	177,822.00	0.07
492	600054	黄山旅游	17,320	177,703.20	0.07

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

493	000603	盛达矿业	13,749	177,224.61	0.07
494	002225	濮耐股份	32,699	175,593.63	0.07
495	600829	三精制药	23,842	158,072.46	0.06
496	000517	荣安地产	29,069	142,147.41	0.06
497	000935	四川双马	25,346	141,177.22	0.06
498	000719	大地传媒	11,999	139,428.38	0.06
499	002534	杭锅股份	10,985	129,293.45	0.05

注：2013年12月2日，中证指数有限公司发布《关于调整沪深300和中证香港100等指数样本股的公告》，于2013 年 12 月 16 日调整沪深300等指数样本股，其中中证500指数更换50只股票。调入名单包括中国汽研等50只股票、调出名单包括人民网等50只股票。

8.3.2 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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

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%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	000826	桑德环境	21,080,918.74	8.42
2	600079	人福医药	19,991,923.23	7.99
3	002230	科大讯飞	19,874,974.17	7.94
4	000661	长春高新	17,543,285.24	7.01
5	000503	海虹控股	17,270,995.86	6.90
6	600805	悦达投资	16,906,898.16	6.76
7	002450	康得新	16,355,920.58	6.53
8	000400	许继电气	16,180,646.67	6.46
9	002008	大族激光	15,746,212.12	6.29
10	600557	康缘药业	15,563,526.65	6.22
11	600199	金种子酒	15,457,760.07	6.18
12	000598	兴蓉投资	15,298,106.55	6.11
13	002250	联化科技	15,194,963.97	6.07
14	000522	白云山A	15,187,263.17	6.07

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

15	000793	华闻传媒	15,131,908.44	6.05
16	600436	片仔癀	15,082,687.99	6.03
17	000917	电广传媒	14,878,099.10	5.94
18	600418	江淮汽车	14,469,139.23	5.78
19	000998	隆平高科	13,708,255.79	5.48
20	002294	信立泰	13,109,397.16	5.24
21	600867	通化东宝	12,954,222.73	5.18
22	600594	益佰制药	12,893,305.30	5.15
23	002065	东华软件	12,502,142.87	5.00
24	600570	恒生电子	12,408,120.22	4.96
25	600643	爱建股份	12,349,815.37	4.93
26	600645	中源协和	12,154,931.31	4.86
27	600138	中青旅	12,136,425.52	4.85
28	600702	沱牌舍得	11,893,267.36	4.75
29	600499	科达机电	11,766,715.37	4.70
30	600879	航天电子	11,499,398.48	4.59
31	600110	中科英华	11,423,500.93	4.56
32	600388	龙净环保	11,322,644.67	4.52
33	600312	平高电气	11,281,129.91	4.51
34	600300	维维股份	11,228,663.26	4.49
35	002004	华邦颖泰	11,205,628.04	4.48
36	600596	新安股份	11,137,061.01	4.45
37	600511	国药股份	11,028,243.97	4.41
38	600366	宁波韵升	11,008,721.38	4.40
39	600765	中航重机	10,997,318.30	4.39
40	600478	科力远	10,846,955.63	4.33
41	600426	华鲁恒升	10,784,520.91	4.31
42	002022	科华生物	10,601,431.11	4.24
43	000786	北新建材	10,570,430.80	4.22
44	000877	天山股份	10,490,185.34	4.19
45	002152	广电运通	10,204,533.33	4.08
46	002456	欧菲光	10,046,865.84	4.01
47	600141	兴发集团	10,033,140.51	4.01
48	000690	宝新能源	10,016,246.33	4.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

49	000028	国药一致	9,848,504.57	3.93
50	600200	江苏吴中	9,771,961.49	3.90
51	600720	祁连山	9,664,615.47	3.86
52	600635	大众公用	9,577,967.50	3.83
53	002129	中环股份	9,379,481.40	3.75
54	000975	银泰资源	9,369,397.01	3.74
55	600422	昆明制药	9,363,085.27	3.74
56	002063	远光软件	9,360,763.15	3.74
57	600717	天津港	9,307,739.55	3.72
58	002477	雏鹰农牧	9,298,302.80	3.72
59	600521	华海药业	9,270,541.96	3.70
60	600844	丹化科技	9,264,537.13	3.70
61	002140	东华科技	9,248,137.87	3.70
62	000513	丽珠集团	9,218,865.08	3.68
63	600458	时代新材	9,125,082.90	3.65
64	600872	中炬高新	9,119,329.17	3.64
65	600008	首创股份	8,993,178.89	3.59
66	000006	深振业A	8,949,465.72	3.58
67	000735	罗 牛 山	8,915,999.77	3.56
68	000926	福星股份	8,886,324.35	3.55
69	000988	华工科技	8,883,528.42	3.55
70	000540	中天城投	8,812,894.21	3.52
71	600880	博瑞传播	8,758,567.09	3.50
72	600978	宜华木业	8,747,106.69	3.49
73	600522	中天科技	8,704,340.94	3.48
74	000616	亿城股份	8,655,817.88	3.46
75	600750	江中药业	8,593,454.60	3.43
76	600816	安信信托	8,582,250.20	3.43
77	600311	荣华实业	8,544,513.00	3.41
78	000830	鲁西化工	8,525,243.75	3.41
79	600517	置信电气	8,505,354.03	3.40
80	600086	东方金钰	8,501,851.04	3.40
81	600601	方正科技	8,382,795.02	3.35
82	600572	康恩贝	8,381,411.06	3.35

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

83	002029	七 匹 狼	8,371,679.44	3.34
84	600072	中船股份	8,346,854.67	3.33
85	002429	兆驰股份	8,303,065.50	3.32
86	600820	隧道股份	8,299,189.45	3.32
87	600064	南京高科	8,001,199.52	3.20
88	000939	凯迪电力	7,984,776.90	3.19
89	600239	云南城投	7,982,129.71	3.19
90	002428	云南锗业	7,980,126.33	3.19
91	600747	大连控股	7,950,610.68	3.18
92	000848	承德露露	7,943,654.88	3.17
93	600067	冠城大通	7,928,056.72	3.17
94	000566	海南海药	7,900,530.76	3.16
95	002482	广田股份	7,846,246.95	3.13
96	600729	重庆百货	7,825,504.47	3.13
97	600500	中化国际	7,807,545.25	3.12
98	600801	华新水泥	7,774,449.13	3.11
99	000860	顺鑫农业	7,721,515.21	3.09
100	002168	深圳惠程	7,720,120.63	3.08
101	002223	鱼跃医疗	7,719,096.83	3.08
102	000816	江淮动力	7,663,332.78	3.06
103	600038	哈飞股份	7,649,104.91	3.06
104	000685	中山公用	7,634,754.12	3.05
105	600435	北方导航	7,611,933.05	3.04
106	603000	人民网	7,611,811.67	3.04
107	002408	齐翔腾达	7,593,130.47	3.03
108	002161	远 望 谷	7,578,832.13	3.03
109	600112	天成控股	7,531,843.26	3.01
110	601886	江河创建	7,521,241.96	3.01
111	600597	光明乳业	7,503,188.95	3.00
112	000563	陕国投A	7,481,219.87	2.99
113	600059	古越龙山	7,470,093.53	2.98
114	000683	远兴能源	7,460,999.64	2.98
115	600387	海越股份	7,459,690.45	2.98
116	600755	厦门国贸	7,426,711.52	2.97

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

117	600503	华丽家族	7,337,653.61	2.93
118	600161	天坛生物	7,327,778.67	2.93
119	600017	日照港	7,310,743.18	2.92
120	002011	盾安环境	7,291,289.96	2.91
121	601002	晋亿实业	7,269,819.85	2.90
122	600704	物产中大	7,256,384.35	2.90
123	000518	四环生物	7,246,701.29	2.90
124	002041	登海种业	7,216,627.61	2.88
125	600260	凯乐科技	7,208,293.74	2.88
126	600470	六国化工	7,161,462.41	2.86
127	600298	安琪酵母	7,145,985.62	2.86
128	002028	思源电气	7,103,709.60	2.84
129	600636	三爱富	7,094,678.96	2.83
130	000078	海王生物	7,073,705.57	2.83
131	600183	生益科技	7,063,019.65	2.82
132	002325	洪涛股份	6,946,470.25	2.78
133	000887	中鼎股份	6,935,087.39	2.77
134	600815	厦工股份	6,843,049.48	2.73
135	002393	力生制药	6,817,601.14	2.72
136	600284	浦东建设	6,794,036.11	2.71
137	600198	大唐电信	6,735,143.71	2.69
138	000680	山推股份	6,720,481.86	2.69
139	600858	银座股份	6,714,436.84	2.68
140	000962	东方钽业	6,712,998.42	2.68
141	600251	冠农股份	6,701,836.51	2.68
142	001696	宗申动力	6,694,814.91	2.67
143	600158	中体产业	6,693,218.76	2.67
144	000417	合肥百货	6,654,483.78	2.66
145	600269	赣粤高速	6,632,246.97	2.65
146	002470	金正大	6,618,588.93	2.64
147	600409	三友化工	6,561,064.45	2.62
148	600078	澄星股份	6,557,349.86	2.62
149	000655	金岭矿业	6,542,689.08	2.61
150	600851	海欣股份	6,535,834.25	2.61

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

151	002475	立讯精密	6,535,049.98	2.61
152	600993	马应龙	6,532,515.59	2.61
153	600236	桂冠电力	6,486,440.48	2.59
154	002277	友阿股份	6,467,370.49	2.58
155	600787	中储股份	6,460,347.35	2.58
156	000667	名流置业	6,457,317.93	2.58
157	600122	宏图高科	6,445,606.46	2.58
158	600578	京能电力	6,418,241.40	2.56
159	600210	紫江企业	6,386,948.72	2.55
160	000511	银基发展	6,362,692.05	2.54
161	000550	江铃汽车	6,326,972.37	2.53
162	600584	长电科技	6,318,852.53	2.52
163	601608	中信重工	6,266,965.20	2.50
164	002672	东江环保	6,250,790.95	2.50
165	000759	中百集团	6,241,225.47	2.49
166	600835	上海机电	6,217,321.96	2.48
167	600509	天富热电	6,180,738.42	2.47
168	600740	山西焦化	6,175,062.41	2.47
169	002005	德豪润达	6,151,706.83	2.46
170	600380	健康元	6,139,691.75	2.45
171	002663	普邦园林	6,137,046.54	2.45
172	600586	金晶科技	6,116,031.00	2.44
173	002340	格林美	6,110,446.21	2.44
174	600176	中国玻纤	6,103,999.01	2.44
175	000823	超声电子	6,096,160.05	2.44
176	000930	中粮生化	6,091,418.67	2.43
177	000601	韶能股份	6,086,847.58	2.43
178	000650	仁和药业	6,068,602.41	2.42
179	600004	白云机场	6,050,603.76	2.42
180	600373	中文传媒	6,050,512.92	2.42
181	000031	中粮地产	6,034,260.95	2.41
182	000050	深天马A	6,014,377.93	2.40
183	600761	安徽合力	6,009,820.50	2.40
184	600410	华胜天成	6,005,367.47	2.40

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

185	000426	兴业矿业	6,001,405.98	2.40
186	600428	中远航运	5,997,433.66	2.40
187	002154	报 喜 鸟	5,996,992.57	2.40
188	000510	金路集团	5,991,659.83	2.39
189	600651	飞乐音响	5,973,810.76	2.39
190	000636	风华高科	5,950,001.70	2.38
191	600139	西部资源	5,949,051.13	2.38
192	600197	伊力特	5,935,878.12	2.37
193	600884	杉杉股份	5,905,541.45	2.36
194	600326	西藏天路	5,891,563.46	2.35
195	000541	佛山照明	5,857,474.23	2.34
196	002465	海格通信	5,847,825.44	2.34
197	600491	龙元建设	5,843,074.26	2.33
198	600612	老凤祥	5,841,545.31	2.33
199	600292	中电远达	5,808,340.43	2.32
200	002219	独 一 味	5,805,762.71	2.32
201	000726	鲁 泰A	5,794,559.46	2.32
202	600322	天房发展	5,780,165.91	2.31
203	600329	中新药业	5,777,215.37	2.31
204	600056	中国医药	5,766,521.92	2.30
205	600525	长园集团	5,739,288.71	2.29
206	002237	恒邦股份	5,716,901.18	2.28
207	600496	精工钢构	5,631,280.55	2.25
208	600874	创业环保	5,613,223.00	2.24
209	600063	皖维高新	5,610,699.30	2.24
210	600737	中粮屯河	5,608,832.83	2.24
211	600611	大众交通	5,596,335.97	2.24
212	000088	盐 田 港	5,587,797.87	2.23
213	002123	荣信股份	5,568,838.13	2.22
214	601311	骆驼股份	5,550,231.46	2.22
215	600351	亚宝药业	5,537,765.91	2.21
216	600162	香江控股	5,534,143.60	2.21
217	002653	海思科	5,490,185.02	2.19
218	600790	轻纺城	5,465,293.67	2.18

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

219	002050	三花股份	5,464,737.72	2.18
220	002308	威创股份	5,438,469.50	2.17
221	600757	长江传媒	5,413,661.41	2.16
222	600654	飞乐股份	5,400,236.75	2.16
223	002430	杭氧股份	5,384,897.06	2.15
224	600121	郑州煤电	5,369,836.73	2.15
225	600439	瑞贝卡	5,359,697.12	2.14
226	002190	成飞集成	5,329,914.18	2.13
227	002440	闰土股份	5,327,330.99	2.13
228	600628	新世界	5,323,642.97	2.13
229	002292	奥飞动漫	5,320,751.37	2.13
230	600467	好当家	5,318,262.05	2.12
231	600759	正和股份	5,260,582.70	2.10
232	002252	上海莱士	5,234,770.43	2.09
233	002254	泰和新材	5,206,261.91	2.08
234	600622	嘉宝集团	5,196,437.22	2.08
235	002179	中航光电	5,193,361.80	2.07
236	600195	中牧股份	5,183,113.43	2.07
237	002437	誉衡药业	5,176,894.49	2.07
238	600408	安泰集团	5,156,274.87	2.06
239	000525	红 太 阳	5,145,596.05	2.06
240	000572	海马汽车	5,141,527.63	2.05
241	600425	青松建化	5,135,606.88	2.05
242	600487	亨通光电	5,117,679.82	2.04
243	600171	上海贝岭	5,047,160.96	2.02
244	600831	广电网络	5,025,136.72	2.01
245	600531	豫光金铅	5,006,592.79	2.00

8.4.2 累计卖出金额前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	002646	青青稞酒	195,694,011.42	78.19
2	600268	国电南自	100,216,559.76	40.04
3	600054	黄山旅游	97,386,593.67	38.91

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

4	600810	神马股份	66,616,085.99	26.62
5	600475	华光股份	65,138,138.01	26.03
6	601801	皖新传媒	49,945,802.46	19.96
7	002332	仙琚制药	43,024,477.97	17.19
8	000410	沈阳机床	27,529,522.11	11.00
9	002050	三花股份	27,333,733.36	10.92
10	600332	白云山	20,865,592.27	8.34
11	600428	中远航运	15,609,123.56	6.24
12	002498	汉缆股份	10,767,792.80	4.30
13	600067	冠城大通	8,336,210.66	3.33
14	600436	片仔癀	6,692,117.10	2.67
15	601519	大智慧	6,087,923.29	2.43
16	601678	滨化股份	4,626,468.24	1.85
17	002450	康得新	4,453,582.06	1.78
18	000826	桑德环境	4,334,516.09	1.73
19	600079	人福医药	3,506,801.77	1.40
20	000415	渤海租赁	3,169,291.33	1.27

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	2,955,615,991.50
卖出股票收入（成交）总额	913,714,701.82

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

报告期末，本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	7,109.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	556.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,666.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

§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

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,138	20,787.72	26,333,689.00	40.37%	38,898,179.00	59.63%

9.1.2 目标基金期末持有本基金情况

项目	持有份额（份）	占总份额比例
嘉实中证 500ETF 联接	16,915,804.00	25.93%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	南宁市宁泰资产管理有限公司	4,005,190.00	6.14%
2	中信证券股份有限公司	1,890,680.00	2.90%
3	娄宁伟	841,256.00	1.29%
4	中信证券股份有限公司	615,437.00	0.94%
5	中信建投证券股份有限公司约定购回专用账户	560,000.00	0.86%
6	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	500,000.00	0.77%
7	丁向东	485,782.00	0.74%
8	吴远强	417,758.00	0.64%
9	杨碧茹	411,424.00	0.63%
10	丁胜男	332,834.00	0.51%
	中国建设银行－嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基	16,915,804.00	25.93%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	金		

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	3,108,729,402.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,700,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	836,100,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-2,237,097,534.00
本报告期期末基金份额总额	65,231,868.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

（1）基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为2013年2月6日，报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费80,000.00元，该审计机构第1年提供审计服务。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
申银万国证券股份有限公司	2	1,866,799,642.02	48.75%	1,699,543.94	49.33%	新增
中信建投证券股份有限公司	2	1,597,072,751.42	41.71%	1,413,259.90	41.02%	新增
招商证券股份有限公司	1	187,529,317.07	4.90%	170,733.54	4.96%	新增
广发证券股份有限公司	1	177,687,511.42	4.64%	161,862.04	4.70%	新增
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增

注1:本表"佣金"指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注2:交易单元的选择标准和程序

(1)经营行为规范,在近一年内无重大违规行为;

(2)公司财务状况良好;

(3)有良好的内控制度,在业内有良好的声誉;

(4)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;

(5)建立了广泛的信息网络,能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议,并通知基金托管人。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	-	-	1,800,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券股份有限公司	263,662.00	100.00%	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额上网发售提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 1 月 7 日
2	关于增加安信证券等为嘉实中证 500ETF 网下股票发售代理机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 1 月 11 日
3	关于增加中信证券（浙江）、中信万通证券为嘉实中证 500ETF 网下股票发售代理机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 1 月 16 日
4	关于增加中航证券等为嘉实中证 500ETF 网下股票发售代理机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 1 月 29 日
5	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 2 月 7 日
6	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 1 日
7	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额折算结果的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 7 日
8	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 12 日
9	关于嘉实中证 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	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 12 日
10	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 3 月 15 日
11	关于嘉实定制账户费率优惠以及新增定制账户“避风港”策略的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 9 月 12 日
12	嘉实基金管理有限公司关于新增定制账户“避风港”策略的补充公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2013 年 9 月 13 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1） 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

（2）《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（4）《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（5） 基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6） 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

（1）北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

（2）北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

12.3 查阅方式

（1）书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2014 年 3 月 26 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站