

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	30
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	30
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	31
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	57
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	58
7.7 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	58
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
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金融衍生品投资明细	58
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	58

7.11 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.3 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.....	60
§ 9 开放式基金份额变动.....	60
§ 10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金
基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,715,505.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效跟踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道	北京市西城区复兴门内大街 1

	7088 号招商银行大厦 32 层	号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	525,426.54
本期利润	3,408,986.77
加权平均基金份额本期利润	0.0931
本期加权平均净值利润率	6.63%
本期基金份额净值增长率	6.08%
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	18,494,606.42
期末可供分配基金份额利润	0.4231
期末基金资产净值	64,561,554.74
期末基金份额净值	1.477
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	55.42%

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，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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

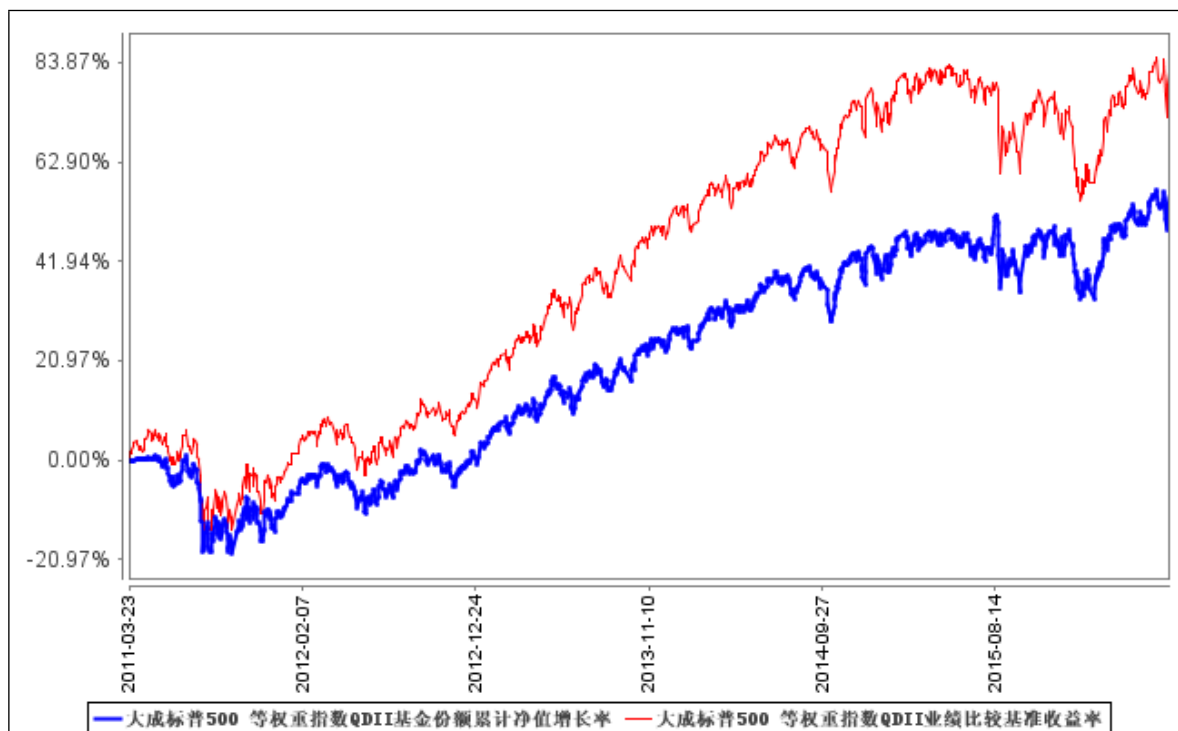
3.2 基金净值表现

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	0.14%	1.27%	-0.06%	1.48%	0.20%	-0.21%
过去三个月	4.16%	0.92%	2.66%	1.03%	1.50%	-0.11%
过去六个月	6.08%	1.10%	5.79%	1.15%	0.29%	-0.05%
过去一年	8.11%	1.13%	2.73%	1.19%	5.38%	-0.06%
过去三年	37.91%	0.87%	38.83%	0.90%	-0.92%	-0.03%
自基金合同生效起至今	55.42%	1.03%	81.88%	1.09%	-26.46%	-0.06%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 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

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合

型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	13 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员；2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起担任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起担任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 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《证券法》、《证券投资基金法》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成标普 500 等权重指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与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股当日成交量 5% 的情形；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，全球金融市场出现大幅震荡。

1 月份，从发达国家市场到新兴市场，从股票市场到大宗商品市场，都出现了快速且大幅的下跌。下跌的原因在于对全球需求增长放缓的担忧以及随之引发的对欧洲银行体系稳定性的担忧。同时，市场担心新兴国家及欧洲与日本的需求都放缓，将会影响到美国企业，因此美国股市也出现了明显下跌。

2 月份开始，恐慌情绪逐渐消散，市场开始向正常水平恢复。大宗商品出现了较为强烈的反弹，这提振了市场对于以原材料出口为主的新兴市场国家的信心，从而导致全球股市都出现了反弹。

6 月底，英国举行公投，其结果为“脱离欧盟”。公投结果公布后，对全球金融市场造成了较大的动荡，各大股票市场都出现了明显的短期下跌。对于全球经济而言，由于英国脱欧的过程较为漫长和复杂，因此其确切的影响较难准确估算，但总体上来说英国脱欧这一政治事件会对英国和欧盟的经济产生负面影响。

从美国自身来看，年初海外市场的动荡引发了对美国经济增长的担忧，但是，其后公布的各种美国宏观经济数据表明，美国受海外经济波动的影响并不大，宏观经济依然保持了正增长。进入到 2 季度，美国宏观经济表现虽然较为平淡，但仍保持在正增长的轨迹上。

具体来看，美国的企业投资、居民消费、营建支出和商品贸易都保持增长。同时，因就业率维持高位，居民收入大幅上升，而通胀维持低位，消费支出低于收入增速，美国储蓄率上升至近年来最高水平。即使在英国退出欧盟过程中，美国经济受到的影响也相对较小。

由于英国“脱欧”事件，美联储对于加息表现更为审慎，当前预计 2016 年仅还有一次加息机会。虽然加息预期降低，但由于欧洲不稳定性增强，因此美元预计仍会保持强势。

上半年，美元相对于人民币继续保持升值的趋势，这有利于本基金净值的表现。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨 5.79%，美元兑人民币中间价上涨 2.12%，本基金净值上涨 6.08%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 1.54%，日均偏差绝对值为 0.0159%，均显著低于本基金合同中的目标值。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.477 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.08%，同期业绩比较基准收益率为 5.79%，高于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年下半年，全球宏观波动性有望减少，但经济增速有可能进一步下降。从欧洲来看，虽然有英国退欧事件的影响，但欧元区仍然有望保持正增长，虽然经济增长速度会非常低，如欧元区二季度 GDP 季环比增速的初值为 0.3%。

受全球需求放缓的影响，美国的宏观经济增速也在低位徘徊，但仍然保持正增长。美国二季度 GDP 增长率初值为 1.2%，其中私人消费增长 4.2%，保持稳健，而由于去库存周期，投资出现下降，成为 GDP 主要拖累。

目前来看美国生产企业已经连续 5 个季度去库存，这已经明显长于以往的去库存周期，并且 2 季度企业去库存出现进一步加速。近期零售商则已开始补库存，同时企业产能利用率近期也开始有所回升，这都意味着接下来若消费增长得以维持，企业去库存接近尾声转而进入补库存的概率似乎正在逐渐上升，而这可能会推动未来企业部门出现阶段性的改善。

经历了几个季度的企业盈利下降之后，标普 500 指数的企业盈利有望在下半年恢复增长，从而对本基金标的指数产生正面支持作用。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一

致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 1,513,752.48 元（每十份基金份额分红 0.440 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾于 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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	6.4.3.1	7,686,616.61	3,474,764.33
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	60,659,111.51	46,407,281.66
其中：股票投资		60,659,111.51	46,407,281.66
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	489.55	103.07
应收股利		61,200.27	63,306.30
应收申购款		2,939,713.97	75,726.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	115,096.26	-
资产总计		71,462,228.17	50,021,182.16
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,816,810.13	-
应付赎回款		844,752.39	485,477.48
应付管理人报酬		46,581.52	42,137.38
应付托管费		11,645.41	10,534.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	180,883.98	140,632.36
负债合计		6,900,673.43	678,781.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	43,715,505.59	34,272,035.33
未分配利润	6.4.3.10	20,846,049.15	15,070,365.27
所有者权益合计		64,561,554.74	49,342,400.60
负债和所有者权益总计		71,462,228.17	50,021,182.16

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.477 元，基金份额总额 43,715,505.59 份。

6.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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		3,980,053.36	1,970,502.17
1. 利息收入		7,697.14	12,294.63
其中：存款利息收入	6.4.3.11	7,697.14	12,294.63
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）		1,079,381.54	11,054,446.23
其中：股票投资收益	6.4.3.12	214,861.58	9,947,494.50
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	864,519.96	1,106,951.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	2,883,560.23	-9,753,296.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-560.83	605,818.12
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	9,975.28	51,239.46
减：二、费用		571,066.59	824,662.52
1. 管理人报酬	6.4.6.1.1	254,726.32	430,178.38
2. 托管费	6.4.6.1.2	63,681.68	107,544.58
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.3.20	6,299.44	15,827.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.21	246,359.15	271,112.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,408,986.77	1,145,839.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,408,986.77	1,145,839.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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）	34,272,035.33	15,070,365.27	49,342,400.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,408,986.77	3,408,986.77
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）	9,443,470.26	3,880,449.59	13,323,919.85
其中：1. 基金申购款	20,035,340.09	8,345,610.15	28,380,950.24
2. 基金赎回款	-10,591,869.83	-4,465,160.56	-15,057,030.39
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）	-	-1,513,752.48	-1,513,752.48
五、期末所有者权益（基金净值）	43,715,505.59	20,846,049.15	64,561,554.74
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)	75,142,701.26	32,020,034.62	107,162,735.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,145,839.65	1,145,839.65
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)	-32,491,707.50	-14,217,817.28	-46,709,524.78
其中：1. 基金申购款	14,546,060.11	6,180,551.05	20,726,611.16
2. 基金赎回款	-47,037,767.61	-20,398,368.33	-67,436,135.94
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)	-	-1,347,678.32	-1,347,678.32
五、期末所有者权益 (基金净值)	42,650,993.76	17,600,378.67	60,251,372.43

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：

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《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。对证券投资基金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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 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	7,686,616.61
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,686,616.61

6.4.3.2 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	50,024,802.42	60,659,111.51	10,634,309.09
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	50,024,802.42	60,659,111.51	10,634,309.09

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.3.5 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	489.55
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	489.55

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	115,096.26
合计	115,096.26

6.4.3.7 应付交易费用

本基金于本期末无应付交易费用。

6.4.3.8 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	1,648.52
预提费用	179,235.46

合计	180,883.98
----	------------

6.4.3.9 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	34,272,035.33	34,272,035.33
本期申购	20,035,340.09	20,035,340.09
本期赎回（以“-”号填列）	-10,591,869.83	-10,591,869.83
本期末	43,715,505.59	43,715,505.59

6.4.3.10 未分配利润

金额单位：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	15,524,517.97	-454,152.70	15,070,365.27
本期利润	525,426.54	2,883,560.23	3,408,986.77
本期基金份额交易产生的变动数	3,958,414.39	-77,964.80	3,880,449.59
其中：基金申购款	8,370,092.98	-24,482.83	8,345,610.15
基金赎回款	-4,411,678.59	-53,481.97	-4,465,160.56
本期已分配利润	-1,513,752.48	-	-1,513,752.48
本期末	18,494,606.42	2,351,442.73	20,846,049.15

6.4.3.11 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	7,697.14
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	-
其他	-
合计	7,697.14

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 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	4,459,663.19
减：卖出股票成本总额	4,244,801.61
买卖股票差价收入	214,861.58

6.4.3.13 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

6.4.3.14 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.3.15 贵金属投资收益

本报告期内本基金无金属投资收益。

6.4.3.16 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.17 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	864,519.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	864,519.96

6.4.3.18 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	2,883,560.23
——股票投资	2,883,560.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,883,560.23

6.4.3.19 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	9,975.28

其他	
合计	9,975.28

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.3.20 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	6,299.44
银行间市场交易费用	-
合计	6,299.44

6.4.3.21 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	19,890.78
信息披露费	119,344.68
银行汇划费	5,789.45
指数使用费	101,334.24
合计	246,359.15

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2% 股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

6.4.5.2 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
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)股份有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东(2016年4月25日前)
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.1 关联方报酬

6.4.6.1.1 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 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管理费	254,726.32	430,178.38
其中：支付销售机构的客户维护费	93,916.01	157,489.68

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

6.4.6.1.2 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	63,681.68	107,544.58

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 0.25% / 当年天数。

6.4.6.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)

交易。

6.4.6.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.6.3.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.6.4 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
	中银香港	3,666,563.95	-	750,118.18
中国银行	4,020,052.66	7,697.14	5,026,448.87	12,244.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2016年1月21日	2016年1月20日	0.4400	719,098.30	794,654.18	1,513,752.48	
合计	-	-	0.4400	719,098.30	794,654.18	1,513,752.48	

6.4.8 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互

控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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

6.4.9.2 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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国银行及境外次托管行中银香港，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2015 年 12 月 31 日：同）

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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等。

6.4.9.4.1.1 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	7,686,616.61	-	-	-	7,686,616.61
交易性金融资产	-	-	-	60,659,111.51	60,659,111.51
应收利息	-	-	-	489.55	489.55
应收股利	-	-	-	61,200.27	61,200.27
应收申购款	1,596,573.12	-	-	1,343,140.85	2,939,713.97
其他资产	-	-	-	115,096.26	115,096.26
资产总计	9,283,189.73	-	-	62,179,038.44	71,462,228.17
负债					

应付证券清算款	-	-	-	5,816,810.13	5,816,810.13
应付赎回款	-	-	-	844,752.39	844,752.39
应付管理人报酬	-	-	-	46,581.52	46,581.52
应付托管费	-	-	-	11,645.41	11,645.41
其他负债	-	-	-	180,883.98	180,883.98
负债总计	-	-	-	6,900,673.43	6,900,673.43
利率敏感度缺口	9,283,189.73	-	-	55,278,365.01	64,561,554.74
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	3,474,764.33	-	-	-	3,474,764.33
交易性金融资产	-	-	-	46,407,281.66	46,407,281.66
应收利息	-	-	-	103.07	103.07
应收股利	-	-	-	63,306.30	63,306.30
应收申购款	4,220.97	-	-	71,505.83	75,726.80
资产总计	3,478,985.30	-	-	46,542,196.86	50,021,182.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	485,477.48	485,477.48
应付管理人报酬	-	-	-	42,137.38	42,137.38
应付托管费	-	-	-	10,534.34	10,534.34
其他负债	-	-	-	140,632.36	140,632.36
负债总计	-	-	-	678,781.56	678,781.56
利率敏感度缺口	3,478,985.30	-	-	45,863,415.30	49,342,400.60

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者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 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（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
银行存款	6,982,199.49	-	-	6,982,199.49
交易性金融资产	60,659,111.51	-	-	60,659,111.51
应收股利	61,200.27	-	-	61,200.27
应收利息	9.42	-	-	9.42
资产合计	67,702,520.69	-	-	67,702,520.69
以外币计价的负债				
应付证券清算款	5,816,810.13	-	-	5,816,810.13
负债合计	5,816,810.13	-	-	5,816,810.13
资产负债表外汇风险敞口净额	61,885,710.56	-	-	61,885,710.56
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	2,990,272.73	-	-	2,990,272.73
交易性金融资产	46,407,281.66	-	-	46,407,281.66
应收股利	63,306.30	-	-	63,306.30
应收利息	0.45	-	-	0.45
资产合计	49,460,861.14	-	-	49,460,861.14
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	49,460,861.14	-	-	49,460,861.14

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	美元相对人民币升值 5%	3,094,000.00	2,470,000.00
	美元相对人民币贬值 5%	-3,094,000.00	-2,470,000.00

6.4.9.4.3 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通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、

备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 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	60,659,111.51	93.96	46,407,281.66	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产—债券投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产—权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	60,659,111.51	93.96	46,407,281.66	94.05

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%		3,050,000.00
业绩比较基准下降 5%		-3,050,000.00	-2,310,000.00

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	60,659,111.51	84.88
	其中: 普通股	60,659,111.51	84.88
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中: 债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中: 远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	7,686,616.61	10.76
8	其他各项资产	3,116,500.05	4.36
9	合计	71,462,228.17	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	60,659,111.51	93.96
合计	60,659,111.51	93.96

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
金融	11,078,090.49	17.16
消费者非必需品	9,988,158.09	15.47
工业	8,116,097.98	12.57
信息技术	8,090,021.44	12.53

医疗保健	6,763,055.49	10.48
能源	4,698,926.10	7.28
消费者常用品	4,524,572.71	7.01
公用事业	3,682,993.41	5.70
基础材料	3,086,623.79	4.78
电信服务	630,572.01	0.98
合计	60,659,111.51	93.96

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,066	145,194.37	0.22
2	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	美国	191	143,741.80	0.22
3	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	1,519	138,601.63	0.21
4	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	美国	975	137,196.21	0.21
5	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	美国	1,374	136,760.14	0.21
6	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	美国	1,647	136,301.40	0.21
7	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	462	135,350.48	0.21
8	Transocean Inc	Transocean 公司	RIG UN	纽约交易所	美国	1,716	135,297.97	0.21
9	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	美国	304	134,640.95	0.21
10	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	美国	552	134,081.27	0.21

11	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约交易所	美国	546	133,673.85	0.21
12	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	美国	515	133,597.46	0.21
13	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK UN	纽约交易所	美国	238	133,375.85	0.21
14	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	美国	282	133,368.29	0.21
15	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	美国	338	133,360.06	0.21
16	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	纽约交易所	美国	88	133,100.92	0.21
17	GenenalGrowthPropertiesIn	通用增长物业公司	GGP UN	纽约交易所	美国	671	132,685.14	0.21
18	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交易所	美国	234	132,499.73	0.21
19	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	美国	220	132,391.91	0.21
20	Simon Property Group	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约交易所	美国	92	132,324.27	0.20
21	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	美国	451	132,068.04	0.20
22	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	美国	627	132,008.96	0.20
23	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	美国	196	131,830.11	0.20
24	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	美国	120	131,616.06	0.20
25	CenturyLink Inc	世纪电信公司	CTL UN	纽约交易所	美国	684	131,581.84	0.20
26	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	美国	487	131,565.53	0.20
27	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约交易所	美国	286	131,542.85	0.20
28	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克默伦股份有限公司	FCX UN	纽约交易所	美国	1,780	131,491.39	0.20
29	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约交易所	美国	630	131,094.85	0.20

30	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	美国	496	131,003.87	0.20
31	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约交易所	美国	457	130,946.11	0.20
32	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	美国	1,053	130,715.28	0.20
33	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	美国	286	130,632.52	0.20
34	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交易所	美国	184	130,152.42	0.20
35	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	美国	740	130,135.97	0.20
36	Lilly Eli & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	美国	249	130,029.54	0.20
37	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽约交易所	美国	184	129,908.39	0.20
38	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	美国	251	129,709.12	0.20
39	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	美国	294	129,705.08	0.20
40	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克交易所	美国	261	129,615.36	0.20
41	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	美国	350	129,600.17	0.20
42	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	美国	349	129,438.17	0.20
43	TEGNA Inc	TEGNA 股份有限公司	TGNA UN	纽约交易所	美国	842	129,369.01	0.20
44	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	美国	344	129,317.42	0.20
45	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	美国	425	129,245.40	0.20
46	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	美国	294	129,198.19	0.20
47	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	美国	476	129,193.55	0.20
48	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	美国	108	129,189.83	0.20
49	Duke Energy	杜克能源	DUK UN	纽约交易	美国	227	129,138.18	0.20

	Corp			所				
50	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约交易所	美国	325	129,092.89	0.20
51	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	美国	240	129,006.02	0.20
52	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	美国	257	128,941.16	0.20
53	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	美国	196	128,827.77	0.20
54	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约交易所	美国	76	128,810.00	0.20
55	Health Care REIT Inc	Welltower 股份有限公司	HCN UN	纽约交易所	美国	255	128,800.12	0.20
56	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	美国	1,198	128,775.12	0.20
57	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	美国	797	128,744.22	0.20
58	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	美国	360	128,743.42	0.20
59	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	美国	530	128,632.02	0.20
60	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	美国	331	128,622.73	0.20
61	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	美国	362	128,618.49	0.20
62	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件公司	AAP UN	纽约交易所	美国	120	128,616.10	0.20
63	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	美国	211	128,542.96	0.20
64	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	美国	533	128,511.86	0.20
65	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics	DGX UN	纽约交易所	美国	238	128,483.35	0.20
66	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	美国	140	128,476.85	0.20
67	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	美国	272	128,476.58	0.20
68	Federal Realty Invt Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	纽约交易所	美国	117	128,442.03	0.20

69	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	美国	408	128,377.38	0.20
70	Smucker J.M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	美国	127	128,353.97	0.20
71	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	美国	415	128,268.30	0.20
72	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约交易所	美国	271	128,255.83	0.20
73	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	美国	249	128,246.28	0.20
74	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克交易所	美国	488	128,243.69	0.20
75	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	美国	191	128,239.12	0.20
76	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	美国	614	128,172.61	0.20
77	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	美国	200	128,154.57	0.20
78	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	美国	173	128,038.72	0.20
79	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	美国	360	128,027.25	0.20
80	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	美国	431	127,983.35	0.20
81	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	美国	148	127,976.86	0.20
82	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	美国	161	127,933.29	0.20
83	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers	TRV UN	纽约交易所	美国	162	127,879.24	0.20
84	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	美国	275	127,814.72	0.20
85	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	美国	236	127,779.25	0.20
86	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	美国	267	127,761.47	0.20
87	Wisconsin Energy Corp	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	纽约交易所	美国	295	127,740.12	0.20
88	Urban	Urban	URBN	纳斯达克	美国	700	127,650.60	0.20

	Outfitters	Outfitters 公司	UQ	交易所				
89	Extra Space Storage Inc	Extra Space Storage 公司	EXR UN	纽约交易所	美国	208	127,639.46	0.20
90	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约交易所	美国	140	127,632.03	0.20
91	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	美国	239	127,485.88	0.20
92	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	美国	192	127,471.82	0.20
93	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	美国	205	127,429.78	0.20
94	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	美国	506	127,370.50	0.20
95	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	美国	169	127,319.64	0.20
96	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	美国	336	127,268.11	0.20
97	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	美国	378	127,184.56	0.20
98	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	美国	278	127,125.94	0.20
99	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	美国	184	127,041.06	0.20
100	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	美国	626	127,024.61	0.20
101	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	美国	168	127,023.02	0.20
102	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	美国	344	126,990.66	0.20
103	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	美国	159	126,902.87	0.20
104	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	美国	195	126,890.33	0.20
105	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	美国	241	126,762.81	0.20
106	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	美国	293	126,660.36	0.20
107	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	美国	273	126,631.72	0.20
108	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	美国	547	126,627.87	0.20

109	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	美国	160	126,597.57	0.20
110	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	美国	109	126,576.88	0.20
111	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	美国	372	126,571.84	0.20
112	Chubb Corp	丘博集团有限公司	CB UN	纽约交易所	美国	146	126,547.57	0.20
113	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约交易所	美国	284	126,423.30	0.20
114	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	美国	24	126,338.68	0.20
115	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	美国	157	126,285.24	0.20
116	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	美国	234	126,230.86	0.20
117	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	美国	525	126,200.03	0.20
118	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	美国	463	126,156.39	0.20
119	Martin Marietta	Martin Marietta 材料股份有限	MLM UN	纽约交易所	美国	99	126,045.85	0.20
120	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	美国	349	125,989.88	0.20
121	Equinix Inc	Equinix 公司	EQIX UQ	纳斯达克交易所	美国	49	125,984.64	0.20
122	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	美国	501	125,979.01	0.20
123	OReilly Automotive	OReilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	美国	70	125,840.28	0.19
124	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	Verisk 分析公司	VRSK UQ	纳斯达克交易所	美国	234	125,811.90	0.19
125	Digital Realty Trust	数字房地产信托有限公司	DLR UN	纽约交易所	美国	174	125,755.80	0.19
126	United Parcel Service Inc B	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约交易所	美国	176	125,719.06	0.19
127	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	美国	227	125,600.76	0.19
128	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易	美国	260	125,549.84	0.19

				所				
129	Church & Dwight Co	切迟杜威股份有限公司	CHD UN	纽约交易所	美国	184	125,540.29	0.19
130	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	美国	535	125,517.34	0.19
131	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约交易所	美国	271	125,470.39	0.19
132	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	美国	306	125,441.88	0.19
133	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	美国	259	125,410.45	0.19
134	FORTUNE BRANDS HOME SECURITY, INC	Fortune Brands 家庭与安全用品	FBHS UN	纽约交易所	美国	326	125,317.88	0.19
135	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	美国	201	125,289.89	0.19
136	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	美国	564	125,289.89	0.19
137	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	美国	244	125,282.73	0.19
138	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约交易所	美国	180	125,126.77	0.19
139	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	美国	480	125,122.79	0.19
140	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	美国	143	125,075.71	0.19
141	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	美国	76	125,070.53	0.19
142	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	美国	575	125,064.43	0.19
143	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	美国	178	125,046.66	0.19
144	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	美国	226	125,017.48	0.19
145	Qorvo, Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克交易所	美国	341	124,956.08	0.19
146	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	美国	130	124,817.09	0.19
147	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约交易所	美国	271	124,769.54	0.19
148	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	美国	173	124,734.80	0.19
149	Chicago	芝加哥商业	CME UQ	纳斯达克	美国	193	124,654.62	0.19

	Mercantile Exchange	交易所控股公司		交易所				
150	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	美国	415	124,635.72	0.19
151	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克交易所	美国	500	124,533.94	0.19
152	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	美国	217	124,413.38	0.19
153	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	美国	722	124,385.13	0.19
154	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	美国	367	124,383.87	0.19
155	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	美国	399	124,381.35	0.19
156	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	美国	414	124,362.85	0.19
157	Lam Research Corp	Lam Research 公司	LRCX UQ	纳斯达克交易所	美国	223	124,304.36	0.19
158	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品	CAG UN	纽约交易所	美国	392	124,278.77	0.19
159	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern	KSU UN	纽约交易所	美国	208	124,260.20	0.19
160	Assurant Inc	艾斯兰公司	AIZ UN	纽约交易所	美国	217	124,197.54	0.19
161	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	美国	414	124,143.23	0.19
162	Mallinckrodt PLC	Mallinckrodt 公司	MNK UN	纽约交易所	美国	308	124,137.66	0.19
163	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	美国	801	124,131.89	0.19
164	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	美国	221	124,083.48	0.19
165	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保健合伙公司	DVA UN	纽约交易所	美国	242	124,079.30	0.19
166	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UQ	纳斯达克交易所	美国	252	124,076.38	0.19
167	Waters Corp	活德	WAT UN	纽约交易所	美国	133	124,046.21	0.19
168	AbbVie Inc	艾伯维有限公司	ABBV UN	纽约交易所	美国	302	123,982.35	0.19

169	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	美国	959	123,943.16	0.19
170	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交易所	美国	119	123,922.27	0.19
171	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	美国	153	123,909.87	0.19
172	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	美国	185	123,903.97	0.19
173	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX UQ	纳斯达克交易所	美国	540	123,897.34	0.19
174	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	美国	421	123,897.21	0.19
175	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	美国	298	123,802.51	0.19
176	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	美国	255	123,777.98	0.19
177	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	美国	324	123,775.59	0.19
178	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	美国	292	123,768.96	0.19
179	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	美国	215	123,708.68	0.19
180	Brown-Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交易所	美国	187	123,705.83	0.19
181	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	美国	555	123,695.42	0.19
182	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	美国	219	123,628.58	0.19
183	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	美国	132	123,594.96	0.19
184	Horton D.R. Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约交易所	美国	592	123,580.10	0.19
185	Grainger W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	美国	82	123,569.10	0.19
186	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	美国	118	123,491.25	0.19
187	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	美国	409	123,430.44	0.19
188	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	美国	253	123,394.36	0.19

189	Lowes Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	美国	235	123,373.14	0.19
190	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	美国	393	123,162.47	0.19
191	Walgreens Boots Alliance	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克交易所	美国	223	123,136.15	0.19
192	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品	STJ UN	纽约交易所	美国	238	123,101.60	0.19
193	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	美国	245	123,083.03	0.19
194	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	美国	1,238	123,059.29	0.19
195	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	美国	593	123,041.72	0.19
196	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	美国	253	122,891.06	0.19
197	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	美国	28	122,806.38	0.19
198	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	艾尔塔美发化妆香水商店公司	ULTA UQ	纳斯达克交易所	美国	76	122,787.54	0.19
199	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	美国	753	122,785.09	0.19
200	Philip Morris International	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	美国	182	122,763.67	0.19
201	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	美国	234	122,708.50	0.19
202	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	美国	63	122,685.22	0.19
203	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	美国	223	122,618.58	0.19
204	Walt Disney Co	华特迪士尼	DIS UN	纽约交易所	美国	189	122,597.49	0.19
205	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	美国	126	122,564.07	0.19
206	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	美国	99	122,533.63	0.19
207	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price	TROW UQ	纳斯达克交易所	美国	253	122,421.30	0.19
208	United	联合技术	UTX UN	纽约交易	美国	180	122,405.32	0.19

	Technologies Corp			所				
209	TransDigm Group	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约交易所	美国	70	122,400.68	0.19
210	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	美国	239	122,398.49	0.19
211	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	美国	156	122,305.06	0.19
212	Diamond Offshore Drilling	钻石近海勘探公司	DO UN	纽约交易所	美国	758	122,293.52	0.19
213	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	美国	334	122,258.11	0.19
214	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	美国	244	122,257.05	0.19
215	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	美国	768	122,226.28	0.19
216	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	美国	501	122,224.89	0.19
217	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	美国	144	122,216.73	0.19
218	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	美国	380	122,162.62	0.19
219	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	美国	243	122,142.73	0.19
220	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	595	122,115.21	0.19
221	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	美国	899	122,090.47	0.19
222	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	美国	434	122,082.25	0.19
223	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	美国	277	122,076.55	0.19
224	AGL Resources	AGL 资源公司	GAS UN	纽约交易所	美国	279	122,051.41	0.19
225	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约交易所	美国	140	121,931.85	0.19
226	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK UN	纽约交易所	美国	473	121,917.99	0.19
227	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	美国	250	121,914.61	0.19
228	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	美国	522	121,878.94	0.19

229	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	美国	158	121,871.91	0.19
230	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	美国	426	121,865.81	0.19
231	Hunt J.B. Transport Services	JB 亨特运输服务公司	JBHT UQ	纳斯达克交易所	美国	227	121,822.50	0.19
232	Concho Resources Inc	康丘资源公司	CXO UN	纽约交易所	美国	154	121,799.10	0.19
233	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	美国	121	121,784.51	0.19
234	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	美国	143	121,756.79	0.19
235	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	美国	766	121,755.60	0.19
236	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	美国	135	121,704.07	0.19
237	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	美国	559	121,695.58	0.19
238	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	美国	168	121,686.76	0.19
239	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	美国	242	121,656.13	0.19
240	S&P Global Inc	麦格希	SPGI UN	纽约交易所	美国	171	121,625.89	0.19
241	Expeditors Intl of WA Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UQ	纳斯达克交易所	美国	374	121,622.57	0.19
242	Carmax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	美国	374	121,597.77	0.19
243	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	美国	413	121,570.25	0.19
244	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	美国	414	121,507.72	0.19
245	Monster Beverage Corp	Monster 饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	美国	114	121,489.82	0.19
246	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	美国	342	121,489.82	0.19
247	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	美国	358	121,476.02	0.19
248	Michael Kors Holdings Ltd	迈克高仕控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	美国	370	121,401.36	0.19
249	Estee Lauder	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易	美国	201	121,317.94	0.19

	Cos.			所				
250	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	美国	323	121,315.95	0.19
251	PayPal Holdings Inc.	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克交易所	美国	501	121,294.66	0.19
252	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	美国	172	121,242.21	0.19
253	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath & Beyond	BBBY UQ	纳斯达克交易所	美国	423	121,232.00	0.19
254	Gallagher Arthur J. & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	纽约交易所	美国	384	121,207.73	0.19
255	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易所	美国	123	121,187.43	0.19
256	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	美国	248	121,169.53	0.19
257	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	美国	304	121,154.68	0.19
258	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	美国	513	121,138.30	0.19
259	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	美国	143	121,083.52	0.19
260	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	美国	952	121,081.47	0.19
261	Staples Inc	史泰博公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	美国	2,118	121,066.88	0.19
262	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	美国	590	121,049.90	0.19
263	Cardinal Health Inc	Cardinal Health	CAH UN	纽约交易所	美国	234	121,048.18	0.19
264	Roper Industries Inc	Roper 科技股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	美国	107	121,018.87	0.19
265	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN UQ	纳斯达克交易所	美国	130	121,015.42	0.19
266	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约交易所	美国	230	121,007.46	0.19
267	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳斯达克交易所	美国	206	120,866.09	0.19
268	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	美国	547	120,824.24	0.19
269	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	美国	546	120,820.60	0.19

270	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	635	120,808.20	0.19
271	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	美国	286	120,770.60	0.19
272	Schein Henry Inc	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克交易所	美国	103	120,756.80	0.19
273	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan	MMC UN	纽约交易所	美国	266	120,756.54	0.19
274	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	美国	162	120,735.45	0.19
275	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	美国	439	120,723.18	0.19
276	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	美国	349	120,713.30	0.19
277	CVS Caremark Corp.	CVS 保健公司	CVS UN	纽约交易所	美国	190	120,625.51	0.19
278	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	美国	218	120,592.09	0.19
279	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	美国	140	120,567.15	0.19
280	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	美国	387	120,563.57	0.19
281	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	美国	401	120,537.51	0.19
282	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	美国	394	120,523.52	0.19
283	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	美国	786	120,504.29	0.19
284	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	美国	281	120,503.96	0.19
285	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	美国	342	120,446.60	0.19
286	Foot Locker Inc	富乐客公司	FL UN	纽约交易所	美国	331	120,413.71	0.19
287	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	美国	53	120,383.40	0.19
288	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	美国	158	120,300.31	0.19
289	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯达克交易所	美国	572	120,239.57	0.19
290	Level 3	Level 3 通信	LVLT	纽约交易	美国	352	120,187.05	0.19

	Communications	股份有限公司	UN	所				
291	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约交易所	美国	45	120,185.20	0.19
292	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	美国	393	120,139.44	0.19
293	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	美国	505	120,119.88	0.19
294	Bard C.R. Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交易所	美国	77	120,073.26	0.19
295	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	美国	119	120,063.51	0.19
296	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	美国	837	120,053.30	0.19
297	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	美国	130	120,032.68	0.19
298	Acuity Brands Inc	敏锐品牌公司	AYI UN	纽约交易所	美国	73	120,031.88	0.19
299	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交易所	美国	401	120,005.69	0.19
300	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	美国	427	119,999.92	0.19
301	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	美国	294	119,879.23	0.19
302	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	美国	250	119,842.36	0.19
303	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	美国	298	119,830.56	0.19
304	Pentair Ltd.	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约交易所	美国	310	119,825.12	0.19
305	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	美国	665	119,812.85	0.19
306	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔品牌公司	NWL UN	纽约交易所	美国	372	119,812.79	0.19
307	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	美国	424	119,775.39	0.19
308	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	美国	207	119,764.45	0.19
309	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	美国	803	119,755.96	0.19
310	Limited	L Brands 股	LB UN	纽约交易	美国	269	119,746.01	0.19

	Brands Inc	份有限公司		所				
311	Facebook Inc	Facebook 公 司	FB UQ	纳斯达克 交易所	美国	158	119,734.54	0.19
312	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克 交易所	美国	388	119,717.30	0.19
313	Tractor Supply Co	拖拉机供应 公司	TSCO UQ	纳斯达克 交易所	美国	198	119,717.30	0.19
314	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifescience s 公司	EW UN	纽约交易 所	美国	181	119,700.65	0.19
315	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易 所	美国	150	119,699.79	0.19
316	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易 所	美国	414	119,695.81	0.19
317	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易 所	美国	474	119,598.33	0.19
318	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易 所	美国	365	119,591.37	0.19
319	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易 所	美国	381	119,578.64	0.19
320	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易 所	美国	143	119,547.34	0.19
321	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬睿惠 悦公共有限 公司	WLTW UQ	纳斯达克 交易所	美国	145	119,527.05	0.19
322	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易 所	美国	1,94 4	119,500.06	0.19
323	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解 决方案股份 有限公司	MSI UN	纽约交易 所	美国	273	119,426.65	0.18
324	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易 所	美国	221	119,423.20	0.18
325	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克 交易所	美国	191	119,360.54	0.18
326	Dentsply Intl	登士柏西诺 德公司	XRAY UQ	纳斯达克 交易所	美国	290	119,305.90	0.18
327	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易 所	美国	343	119,229.37	0.18
328	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克 交易所	美国	214	119,188.26	0.18
329	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油 天然气公司	COG UN	纽约交易 所	美国	698	119,139.59	0.18
330	Weyerhaeuser	惠好	WY UN	纽约交易	美国	603	119,038.73	0.18

	Co			所				
331	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	美国	688	118,983.89	0.18
332	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	美国	634	118,978.32	0.18
333	Scripps Networks Interactive	斯科利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	美国	288	118,922.35	0.18
334	eBay Inc.	eBay 公司	EBAY UQ	纳斯达克交易所	美国	766	118,911.08	0.18
335	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	美国	196	118,897.95	0.18
336	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	美国	353	118,819.70	0.18
337	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	美国	684	118,745.69	0.18
338	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	美国	401	118,729.32	0.18
339	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	美国	190	118,723.02	0.18
340	Mylan Inc.	迈兰公司	MYL UQ	纳斯达克交易所	美国	414	118,707.50	0.18
341	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交易所	美国	126	118,678.85	0.18
342	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	美国	288	118,674.08	0.18
343	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	美国	671	118,669.10	0.18
344	Biogen Idec Inc	百健	BIIB UQ	纳斯达克交易所	美国	74	118,663.20	0.18
345	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	美国	336	118,645.43	0.18
346	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	美国	25	118,635.48	0.18
347	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	美国	121	118,558.96	0.18
348	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	美国	159	118,552.33	0.18

349	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	美国	239	118,468.05	0.18
350	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	美国	4,174	118,464.53	0.18
351	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	美国	299	118,428.39	0.18
352	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	美国	434	118,312.15	0.18
353	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	美国	94	118,283.63	0.18
354	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	美国	250	118,267.45	0.18
355	Frontier Communications Corp	Frontier 通信公司	FTR UQ	纳斯达克交易所	美国	3,610	118,256.84	0.18
356	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	美国	238	118,240.66	0.18
357	CSRA Inc	CSRA 股份有限公司	CSRA UN	纽约交易所	美国	760	118,080.45	0.18
358	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	美国	420	118,060.56	0.18
359	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	美国	415	118,031.05	0.18
360	HCA Holdings Inc	HCA 控股公司	HCA UN	纽约交易所	美国	231	117,964.47	0.18
361	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	美国	146	117,960.03	0.18
362	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	美国	80	117,918.65	0.18
363	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	美国	357	117,917.13	0.18
364	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯达克交易所	美国	281	117,913.88	0.18
365	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	美国	186	117,913.35	0.18
366	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	美国	310	117,851.68	0.18
367	Patterson Cos	帕特森公司	PDCO	纳斯达克	美国	371	117,817.79	0.18

	Inc		UQ	交易所				
368	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	美国	216	117,781.25	0.18
369	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	美国	328	117,756.32	0.18
370	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	美国	335	117,492.60	0.18
371	Avago Technologies Ltd	Broadcom 有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	美国	114	117,475.69	0.18
372	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	美国	170	117,419.98	0.18
373	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	美国	439	117,404.53	0.18
374	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	美国	469	117,403.74	0.18
375	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	美国	1,334	117,386.70	0.18
376	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	NOV UN	纽约交易所	美国	526	117,371.58	0.18
377	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	美国	1,408	117,362.69	0.18
378	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦	DD UN	纽约交易所	美国	273	117,308.58	0.18
379	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	美国	993	117,209.11	0.18
380	Starwood Hotel & Resort World	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	美国	239	117,200.16	0.18
381	Zoetis Inc When Issued	硕腾公司	ZTS UN	纽约交易所	美国	372	117,074.63	0.18
382	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易所	美国	179	117,072.31	0.18
383	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	美国	360	117,069.86	0.18
384	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	美国	1,403	117,038.96	0.18
385	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	美国	104	116,956.86	0.18
386	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易	美国	98	116,896.39	0.18

				所				
387	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	美国	207	116,868.14	0.18
388	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	美国	1,857	116,861.17	0.18
389	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	美国	274	116,829.81	0.18
390	Nielsen Holdings NV	尼尔森控股公开有限公司	NLSN UN	纽约交易所	美国	339	116,827.35	0.18
391	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约交易所	美国	381	116,799.50	0.18
392	Hewlett Packard Enterpris	慧与	HPE UN	纽约交易所	美国	964	116,790.55	0.18
393	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	美国	163	116,789.69	0.18
394	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	美国	383	116,752.29	0.18
395	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	美国	345	116,675.96	0.18
396	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际	RHI UN	纽约交易所	美国	461	116,654.48	0.18
397	Zimmer Biomet Holdings In	捷迈巴奥米特控股公司	ZBH UN	纽约交易所	美国	146	116,546.52	0.18
398	Allergan Inc	艾尔建有限公司	AGN UN	纽约交易所	美国	76	116,462.70	0.18
399	Global Payments Inc	环汇公司	GPN UN	纽约交易所	美国	246	116,440.42	0.18
400	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	美国	154	116,253.95	0.18
401	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	美国	306	116,148.39	0.18
402	Block H & R Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	美国	761	116,065.89	0.18
403	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	美国	995	116,059.59	0.18
404	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	美国	168	116,027.43	0.18
405	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	美国	134	115,755.42	0.18

406	Endo International	Endo 制药控股有限公司	ENDP UQ	纳斯达克交易所	美国	1,119	115,682.68	0.18
407	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	美国	354	115,682.08	0.18
408	Universal Health Services	Universal Health Services 公	UHS UN	纽约交易所	美国	130	115,601.71	0.18
409	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	美国	336	115,570.68	0.18
410	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	美国	215	115,539.38	0.18
411	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公	LUK UN	纽约交易所	美国	1,004	115,378.37	0.18
412	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	美国	115	115,310.93	0.18
413	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交易所	美国	168	115,203.04	0.18
414	The Bank of New York Mellon Corp	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约交易所	美国	447	115,157.09	0.18
415	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	美国	239	115,060.60	0.18
416	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	美国	181	114,971.68	0.18
417	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	美国	185	114,960.80	0.18
418	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交易所	美国	146	114,823.21	0.18
419	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约交易所	美国	258	114,798.01	0.18
420	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	美国	114	114,739.12	0.18
421	Vertex Pharmaceuticals Inc	维特制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	美国	201	114,653.58	0.18
422	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	美国	391	114,601.72	0.18
423	PNC Financial Services Group	PNC 金融服务	PNC UN	纽约交易所	美国	212	114,419.23	0.18
424	Goodyear Tire	固特异轮胎	GT UQ	纳斯达克交易所	美国	672	114,345.23	0.18

	& Rubber Co	橡胶		交易所				
425	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约交易所	美国	686	114,316.45	0.18
426	Stanley Black & Decker	史丹利百得公司	SWK UN	纽约交易所	美国	155	114,315.92	0.18
427	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	美国	240	114,300.67	0.18
428	Salesforce.com	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	美国	217	114,268.64	0.18
429	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	美国	272	114,245.50	0.18
430	Peoples United Financial Inc	Peoples United Financial 股	PBCT UQ	纳斯达克交易所	美国	1,175	114,225.74	0.18
431	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	美国	192	114,103.32	0.18
432	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	美国	283	114,024.01	0.18
433	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	美国	537	114,021.76	0.18
434	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	美国	248	113,999.35	0.18
435	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	美国	371	113,930.71	0.18
436	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	美国	253	113,915.40	0.18
437	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	美国	103	113,817.39	0.18
438	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	美国	259	113,800.28	0.18
439	Delphi Automotive PLC	德尔福汽车公司	DLPH UN	纽约交易所	美国	274	113,740.99	0.18
440	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	美国	345	113,724.75	0.18
441	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	美国	214	113,653.86	0.18
442	TE Connectivity	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	美国	300	113,612.35	0.18

	Ltd.							
443	Ryder System Inc	Ryder 系统	R UN	纽约交易所	美国	280	113,520.84	0.18
444	Regeneron Pharmaceuticals	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	美国	49	113,474.88	0.18
445	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	美国	949	113,337.09	0.18
446	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	美国	428	113,043.66	0.18
447	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	美国	229	113,010.10	0.18
448	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	美国	384	112,957.45	0.17
449	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达克交易所	美国	1,424	112,841.80	0.17
450	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	美国	414	112,777.61	0.17
451	COLUMBIA PIPELINE GROUP	哥伦比亚管道集团股份有限公司	CPGX UN	纽约交易所	美国	667	112,742.54	0.17
452	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	美国	193	112,701.09	0.17
453	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	美国	168	112,663.03	0.17
454	Signet Jewelers Ltd	英国西格尼珠宝有限公司	SIG UN	纽约交易所	美国	206	112,574.30	0.17
455	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	美国	187	112,433.92	0.17
456	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	316	112,295.66	0.17
457	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	美国	732	112,128.29	0.17
458	Legg Mason Inc	美盛集团	LM UN	纽约交易所	美国	573	112,052.49	0.17
459	IntercontinentalExchange	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	美国	66	112,023.25	0.17
460	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	美国	531	111,937.91	0.17

				所				
461	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有 限公司	ETFC UQ	纳斯达克 交易所	美国	714	111,217.56	0.17
462	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易 所	美国	311	111,199.39	0.17
463	Comerica Inc (MI)	Comerica 公 司	CMA UN	纽约交易 所	美国	407	111,005.69	0.17
464	Royal Caribbean Cruises	皇家加勒比 海游轮有限 公司	RCL UN	纽约交易 所	美国	249	110,875.98	0.17
465	Capital One Financial	第一资本金 融	COF UN	纽约交易 所	美国	263	110,761.80	0.17
466	Accenture plc	埃森哲公司	ACN UN	纽约交易 所	美国	147	110,433.55	0.17
467	AllianceData Systems Corp	联合数据系 统公司	ADS UN	纽约交易 所	美国	85	110,430.70	0.17
468	KeyCorp	KeyCorp 公 司	KEY UN	纽约交易 所	美国	1,50 6	110,351.79	0.17
469	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯 金融公司	AMP UN	纽约交易 所	美国	185	110,225.46	0.17
470	TECO Energy Inc	TECO 能源	TE UN	纽约交易 所	美国	601	110,155.11	0.17
471	Teradata Corp	美商天睿信 息系统有限 公司	TDC UN	纽约交易 所	美国	662	110,053.65	0.17
472	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易 所	美国	428	110,035.22	0.17
473	Invesco Ltd	景顺有限公 司	IVZ UN	纽约交易 所	美国	649	109,915.19	0.17
474	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克 交易所	美国	1,85 4	109,910.55	0.17
475	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克 交易所	美国	659	109,817.11	0.17
476	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易 所	美国	422	109,723.95	0.17
477	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易 所	美国	452	109,581.38	0.17
478	United Continental Holding Inc	联合大陆控 股公司	UAL UN	纽约交易 所	美国	400	108,857.78	0.17
479	Citizens Financial	公民金融集 团	CFG UN	纽约交易 所	美国	821	108,775.42	0.17

	Group Inc							
480	Schwab Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	美国	648	108,757.52	0.17
481	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	美国	619	108,692.79	0.17
482	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	美国	362	108,430.33	0.17
483	Priceline.com Inc	Priceline 集团	PCLN UQ	纳斯达克交易所	美国	13	107,619.93	0.17
484	Affiliated Managers Group	联合经理集团股份有限公司	AMG UN	纽约交易所	美国	115	107,349.51	0.17
485	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	美国	548	107,272.66	0.17
486	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	美国	1,287	107,106.15	0.17
487	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	美国	178	106,987.25	0.17
488	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	美国	217	106,728.43	0.17
489	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空集团公司	ALK UN	纽约交易所	美国	275	106,296.48	0.16
490	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约交易所	美国	438	105,809.68	0.16
491	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	美国	136	105,299.21	0.16
492	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	美国	1,861	105,019.04	0.16
493	American Airlines Group Inc.	美国航空集团公司	AAL UQ	纳斯达克交易所	美国	556	104,377.48	0.16
494	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	美国	631	100,841.32	0.16
495	Synchrony Financial	Synchrony 金融	SYF UN	纽约交易所	美国	599	100,414.40	0.16
496	News Corporation	美国新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,240	93,327.51	0.14
497	21st Century Fox	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	美国	460	82,512.02	0.13
498	Discovery Communicatio	探索传播公司	DISCK UQ	纳斯达克交易所	美国	398	62,945.34	0.10

	nsC							
499	Under Armour Inc Class A	安德玛公司	UA UN	纽约交易所	美国	224	59,608.65	0.09
500	Google Inc A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	美国	12	55,982.98	0.09
501	Google Inc C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	美国	12	55,073.44	0.09
502	Under Armour Inc-C	安德玛公司	UA/C UN	纽约交易所	美国	225	54,309.53	0.08
503	Discovery CommunicationsA	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	美国	251	41,993.60	0.07
504	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	新闻集团	FOX UQ	纳斯达克交易所	美国	177	31,983.94	0.05
505	News Corp B	美国新闻集团	NWS UQ	纳斯达克交易所	美国	279	21,590.72	0.03

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CSX Corp	CSX UN	186,984.29	0.38
2	Ralph Lauren Corp A	RL UN	143,063.29	0.29
3	Hologic Inc	HOLX UQ	135,602.11	0.27
4	UDR Inc	UDR UN	131,606.64	0.27
5	Ulta Salon Cosmetics & Fragr	ULTA UQ	129,553.58	0.26
6	Foot Locker Inc	FL UN	127,419.52	0.26
7	Fortune Brands Home & Security Inc	FBHS UN	122,438.95	0.25
8	TransDigm Group	TDG UN	120,735.04	0.24
9	Endo International plc	ENDP UQ	120,418.20	0.24
10	LKQ Corp	LKQ UQ	119,266.95	0.24
11	Gallagher Arthur J. & Co	AJG UN	118,526.13	0.24
12	Concho Resources Inc	CXO UN	116,331.75	0.24
13	Alaska Air Group Inc	ALK UN	116,273.64	0.24
14	Federal Realty Invt Trust	FRT UN	116,201.37	0.24
15	Global Payments Inc	GPN UN	116,074.19	0.24
16	Acuity Brands Inc	AYI UN	115,151.02	0.23

17	Extra Space Storage Inc	EXR UN	113,577.26	0.23
18	Willis Towers Watson PLC	WLTW UQ	112,051.98	0.23
19	Centene Corp	CNC UN	112,022.27	0.23
20	Digital Realty Trust	DLR UN	106,993.99	0.22

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CSX Corp	CSX UN	184,431.61	0.37
2	CONSOL Energy Inc	CNX UN	154,980.70	0.31
3	Ralph Lauren Corp A	RL UN	111,594.73	0.23
4	Tenet Healthcare	THC UN	111,165.14	0.23
5	GameStop Corp A	GME UN	98,334.68	0.20
6	Weyerhaeuser Co	WY UN	91,409.73	0.19
7	Southwestern Energy Co	SWN UN	89,022.26	0.18
8	ONEOK Inc	OKE UN	88,709.37	0.18
9	Ensco PLC - CL A	ESV UN	88,374.51	0.18
10	Schlumberger Ltd	SLB UN	85,683.11	0.17
11	Fossil Group Inc	FOSL UQ	77,259.26	0.16
12	Coca-Cola Enterprises	CCE UN	69,264.83	0.14
13	SHIRE PLC-ADR	SHPG UQ	67,174.24	0.14
14	Range Resources Corp	RRC UN	65,797.65	0.13
15	Newmont Mining Corp	NEM UN	60,870.06	0.12
16	CHARTER COMMUNICATION-A	CHTR UQ	54,001.18	0.11
17	Chubb Limited	CB UN	51,881.35	0.11
18	Equinix Inc	EQIX UQ	47,306.95	0.10
19	PerkinElmer Inc	PKI UN	46,660.59	0.09
20	Urban Outfitters	URBN UQ	39,783.91	0.08

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	16,181,827.91
卖出收入（成交）总额	4,459,663.19

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	61,200.27
4	应收利息	489.55
5	应收申购款	2,939,713.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	115,096.26
8	其他	-
9	合计	3,116,500.05

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.11.5.1 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股票中无流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
6,294	6,945.58	1,716,627.58	3.93%	41,998,878.01	96.07%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 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	113,682.26	0.2601%

8.3 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	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月23日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	34,272,035.33
本报告期基金总申购份额	20,035,340.09
减：本报告期基金总赎回份额	10,591,869.83
本报告期期末基金份额总额	43,715,505.59

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2016 年 6 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内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

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
摩根士丹利	1	20,641,491.10	100.00%	6,197.31	100.00%	-

注：1、根据中国证监会颁布的《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）的有关规定，本公司制定了租用境内证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

（一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

- (二) 经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- (三) 研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- (四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- (五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- (一) 具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- (二) 资历雄厚，信誉良好；
- (三) 财务状况良好，经营行为规范；
- (四) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；
- (五) 证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。
- (七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。
- (八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。
- (九) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括：中信证券、东海证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、渤海证券、广发证券、西南证券、华福证

券、中泰证券、华鑫证券、银河证券、招商证券、恒泰证券、方正证券、华泰证券、申万宏源、华宝证券、中银国际、中航证券、国泰君安、东莞证券、国信证券、财富证券、国都证券、天源证券、英大证券、国海证券、民生证券、万联证券、东吴证券、华林证券、民族证券、东兴证券、长城证券、平安证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金新增的境内交易单元：恒泰证券、方正证券、平安证券，无新增或退租境外交易单元。

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

无。

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	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 16 日
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 5 日
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 23 日
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2016 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 6 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2016 年第 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 6 日
11	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 27 日
12	大成基金管理有限公司关于因指	中国证监会指定报	2016 年 1 月 5 日

	数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	刊及本公司网站	
13	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 6 日
14	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 8 日
15	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 18 日
16	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 30 日
17	大成基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 18 日
18	大成基金关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 27 日
19	大成基金管理有限公司关于增加北京蕙次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
20	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 12 日
21	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 17 日
22	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 18 日
23	大成基金管理有限公司关于增加万和证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
24	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 29 日
25	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 18 日
26	大成基金管理来有限公司关于股	中国证监会指定报	2016 年 4 月 27 日

	权变更及修改《公司章程》的公告	刊及本公司网站	
27	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 30 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
29	大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
30	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 7 日
31	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 10 日
32	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 17 日
33	大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 22 日
34	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于

2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成标普 500 等权重指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日