

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 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：2017 年 8 月 24 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 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	7
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	35
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.....	36
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	64
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
7.11 投资组合报告附注.....	67
§ 8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§ 9 开放式基金份额变动.....	69
§ 10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	77

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§ 12 备查文件目录.....	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§ 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	168,976,931.05 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追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	罗登攀	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@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 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	8,045,321.67
本期利润	11,078,276.14
加权平均基金份额本期利润	0.0591
本期加权平均净值利润率	3.56%
本期基金份额净值增长率	3.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	72,329,248.82
期末可供分配基金份额利润	0.4280
期末基金资产净值	281,470,370.01
期末基金份额净值	1.666
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	79.97%

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

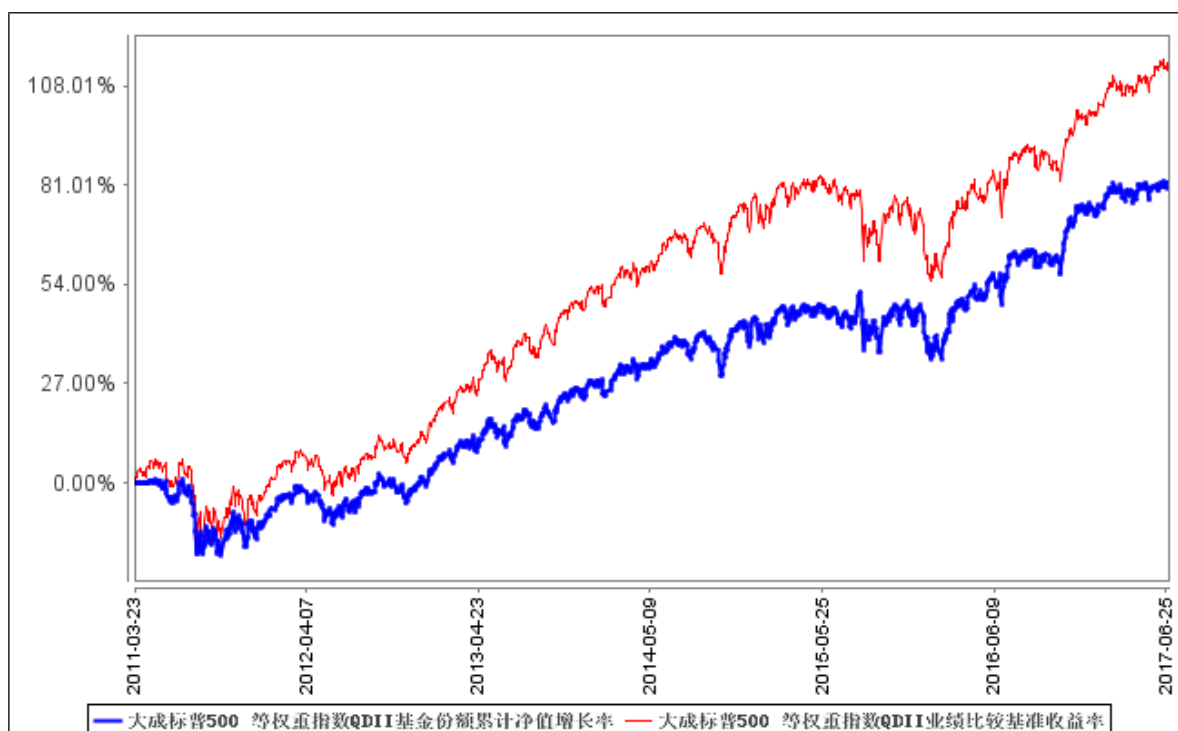
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.24%	0.39%	1.20%	0.49%	-1.44%	-0.10%
过去三个月	0.12%	0.51%	2.50%	0.51%	-2.38%	0.00%
过去六个月	3.97%	0.51%	8.05%	0.50%	-4.08%	0.01%
过去一年	15.80%	0.60%	17.26%	0.60%	-1.46%	0.00%
过去三年	30.30%	0.84%	27.83%	0.88%	2.47%	-0.04%

年						
自基金 合同生 效起至 今	79.97%	0.97%	113.28%	1.03%	-33.31%	-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%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2017 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，4 只 QDII 基金及 74 只开放式证券投资基金。

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	-	14 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。2016 年 12 月 2 日起担任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016 年 12 月 29 日起担任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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。基金管理人运用统计分析方法和工具，对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进行分析。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，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交

易存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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；主动投资组合间债券交易存在 6 笔同日反向交易，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。

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

2017 年上半年，国际宏观经济状况运行较为平稳。从全球经济来看，欧洲、日本及新兴市场国家的宏观经济都有正常的正增长，而美国也仍然处于经济增长周期的进程之中。

6 月末公布的数据表明，美国 1 季度的 GDP 年化季环比增长率为 1.4%，低于 2016 年下半年的增速，但高于 2016 年 1 季度的增速。进入到 2 季度，美国的宏观经济增速比 1 季度有所加快，宏观数据也相对较好，6 月份的制造业 ISM 指数也达到 57.8，创下 2015 年以来的最高值。美国劳动力市场也持续繁荣，失业率在上半年达到了低至 4.3% 的水平，创出了本轮经济周期以来的最低失业率。

美联储也对当前美国经济运行情况总体偏向乐观，认为当前正处于“温和扩张”过程中。预计未来经济将继续保持稳健复苏的态势，劳动力市场的持续改善使得当前的失业率已经接近自然失业率水平，收入改善以及个人财富的增长促进了消费对 GDP 的拉动，而在企业投资方面也有一定的企稳复苏迹象。

而正是由于美国经济运行情况总体偏向乐观，在二季度，美联储采取了一次加息行为，但加息行为并未影响到美股的上涨趋势。

在上半年，特朗普新政推进缓慢，远低于市场之前的预期。资本市场的表现也对之前过于乐观的“特朗普交易”有所修正。

虽然，特朗普的经济政策让人失望，但是，今年上半年美国上市公司企业盈利增速有所加快，因此股票指数在上半年也同样实现了较好的正收益。

4.5.2 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 1.666 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.97%，业绩比较基准收益率为 8.05%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，我们认为国际宏观经济状况有望相对好转，而美国仍然处于经济增长周期的进程之中。

美国仍然处于本轮经济增长的中后期进程中，强劲的技术创新导致其国际经济竞争力增强，同时经济复苏也导致了国内需求强盛。美国经济增长具体表现在以下几个方面：（1）劳动力市场的持续改善使得当前的失业率已经接近自然失业率水平；（2）收入改善以及个人财富的增长促进了消费对 GDP 的拉动；（3）住宅市场发展繁荣；（4）企业投资方面也出现了企稳复苏迹象。

由于经济前景向好，美联储的货币政策逐步收紧。但由于美股是由基本面及企业盈利驱动的，所以逐步收紧的货币政策不会对宏观经济及美股造成较大的负面影响。

美国良好的宏观经济前景将会继续促使企业盈利持续增长，而本基金标的指数的估值水平依然基本位于正常的市盈率区间。因此，企业盈利的增加有望推动指数的增长。

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、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构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、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构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。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

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 7,216,098.77 元（每十份基金份额分红 0.429 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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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的真实、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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	22,019,855.63	46,759,665.83
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	266,618,414.22	196,683,439.44
其中：股票投资		266,618,414.22	196,683,439.44
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		7,294,487.08	-
应收利息	6.4.3.5	729.16	3,906.74
应收股利		330,738.68	216,849.79
应收申购款		1,280,608.39	6,588,685.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	115,819.44	-
资产总计		297,660,652.60	250,252,547.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	6,430,627.86
应付赎回款		15,675,930.26	2,741,103.50
应付管理人报酬		249,557.26	152,261.85
应付托管费		62,389.31	38,065.47
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	202,405.76	130,144.24
负债合计		16,190,282.59	9,492,202.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	168,976,931.05	146,373,605.04
未分配利润	6.4.3.10	112,493,438.96	94,386,739.40
所有者权益合计		281,470,370.01	240,760,344.44
负债和所有者权益总计		297,660,652.60	250,252,547.36

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.666 元，基金份额总额 168,976,931.05 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		13,433,617.13	3,980,053.36
1. 利息收入		35,278.38	7,697.14
其中：存款利息收入	6.4.3.11	35,278.38	7,697.14
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）		10,976,820.98	1,079,381.54
其中：股票投资收益	6.4.3.12	7,786,755.39	214,861.58
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	3,190,065.59	864,519.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	3,032,954.47	2,883,560.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-830,279.10	-560.83

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 3. 19	218, 842. 40	9, 975. 28
减：二、费用		2, 355, 340. 99	571, 066. 59
1. 管理人报酬	6. 4. 6. 1. 1	1, 538, 141. 29	254, 726. 32
2. 托管费	6. 4. 6. 1. 2	384, 535. 34	63, 681. 68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 3. 20	61, 729. 67	6, 299. 44
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	370, 934. 69	246, 359. 15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11, 078, 276. 14	3, 408, 986. 77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11, 078, 276. 14	3, 408, 986. 77

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	146, 373, 605. 04	94, 386, 739. 40	240, 760, 344. 44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	11, 078, 276. 14	11, 078, 276. 14
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）	22, 603, 326. 01	14, 244, 522. 19	36, 847, 848. 20
其中：1. 基金申购款	131, 226, 397. 77	85, 940, 257. 24	217, 166, 655. 01
2. 基金赎回款	-108, 623, 071. 76	-71, 695, 735. 05	-180, 318, 806. 81
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）	-	-7, 216, 098. 77	-7, 216, 098. 77
五、期末所有者权益	168, 976, 931. 05	112, 493, 438. 96	281, 470, 370. 01

项目	上年度可比期间 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
	(基金净值)		
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

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 崔伟
 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[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[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政策的补充通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	22,019,855.63
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	22,019,855.63

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	243,634,919.66	266,618,414.22	22,983,494.56
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	243,634,919.66	266,618,414.22	22,983,494.56

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	729.16
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	729.16

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	115,819.44
合计	115,819.44

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 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58,597.64
预提费用	143,808.12
合计	202,405.76

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,373,605.04	146,373,605.04
本期申购	131,226,397.77	131,226,397.77
本期赎回(以“-”号填列)	-108,623,071.76	-108,623,071.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	168,976,931.05	168,976,931.05

注：申购含红利再投份额。

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	62,418,502.74	31,968,236.66	94,386,739.40
本期利润	8,045,321.67	3,032,954.47	11,078,276.14
本期基金份额交易产生的变动数	9,081,523.18	5,162,999.01	14,244,522.19
其中：基金申购款	51,957,080.40	33,983,176.84	85,940,257.24
基金赎回款	-42,875,557.22	-28,820,177.83	-71,695,735.05
本期已分配利润	-7,216,098.77	-	-7,216,098.77
本期末	72,329,248.82	40,164,190.14	112,493,438.96

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,278.38
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	35,278.38

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	71,307,941.76
减：卖出股票成本总额	63,521,186.37
买卖股票差价收入	7,786,755.39

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贵金属投资收益。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	3,190,065.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,190,065.59

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	3,032,954.47
——股票投资	3,032,954.47
——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	3,032,954.47

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	218,842.40
其他	-
合计	218,842.40

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 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	61,729.67
银行间市场交易费用	-
合计	61,729.67

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	119,012.93
银行汇划费	10,578.08
指数使用费	165,745.76
其他	50,802.73
合计	370,934.69

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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
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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,538,141.29	254,726.32
其中：支付销售机构的客户维护费	576,778.43	93,916.01

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	384,535.34	63,681.68

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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	17,188,105.37	-	3,666,563.95	-
中国银行	4,831,750.26	35,278.38	4,020,052.66	7,697.14

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

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	2017 年 1 月 19 日	2017 年 1 月 18 日	0.4290	4,440,150.43	2,775,948.34	7,216,098.77	
合计	-	-	0.4290	4,440,150.43	2,775,948.34	7,216,098.77	

6.4.8 期末（2017 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****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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9 金融工具风险及管理

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(合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2016 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公司的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约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 2017 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	22,019,855.63	-	-	-	22,019,855.63
交易性金融资产	-	-	-	266,618,414.22	266,618,414.22
应收利息	-	-	-	729.16	729.16
应收股利	-	-	-	330,738.68	330,738.68
应收申购款	-	-	-	1,280,608.39	1,280,608.39
应收证券清算款	-	-	-	7,294,487.08	7,294,487.08
其他	-	-	-	115,819.44	115,819.44
资产总计	22,019,855.63	-	-	275,640,796.97	297,660,652.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,675,930.26	15,675,930.26
应付管理人报酬	-	-	-	249,557.26	249,557.26
应付托管费	-	-	-	62,389.31	62,389.31
其他负债	-	-	-	202,405.76	202,405.76
负债总计	-	-	-	16,190,282.59	16,190,282.59
利率敏感度缺口	22,019,855.63	-	-	259,450,514.38	281,470,370.01
上年度末 2016 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	46,759,665.83	-	-	-	46,759,665.83
交易性金融资产	-	-	-	196,683,439.44	196,683,439.44
应收利息	-	-	-	3,906.74	3,906.74
应收股利	-	-	-	216,849.79	216,849.79

应收申购款	545,749.16	-	-	6,042,936.40	6,588,685.56
资产总计	47,305,414.99	-	-	202,947,132.37	250,252,547.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,430,627.86	6,430,627.86
应付赎回款	-	-	-	2,741,103.50	2,741,103.50
应付管理人报酬	-	-	-	152,261.85	152,261.85
应付托管费	-	-	-	38,065.47	38,065.47
其他负债	-	-	-	130,144.24	130,144.24
负债总计	-	-	-	9,492,202.92	9,492,202.92
利率敏感度缺口	47,305,414.99	-	-	193,454,929.45	240,760,344.44

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 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（2016 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 2017 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	17,188,326.89	-	-	17,188,326.89
交易性金融资产	266,618,414.22	-	-	266,618,414.22
应收股利	330,738.68	-	-	330,738.68
应收证券清算款	7,294,487.08	-	-	7,294,487.08
资产合计	291,431,966.87	-	-	291,431,966.87
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	291,431,966.87	-	-	291,431,966.87
项目	上年度末 2016 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	6,978,760.05	-	-	6,978,760.05
交易性金融资产	196,683,439.44	-	-	196,683,439.44
应收股利	216,849.79	-	-	216,849.79
资产合计	203,879,049.28	-	-	203,879,049.28
以外币计价的负债				
应付证券清算款	6,430,627.86	-	-	6,430,627.86
负债合计	6,430,627.86	-	-	6,430,627.86
资产负债表外汇风险敞口净额	197,448,421.42	-	-	197,448,421.42

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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	美元相对人民币升值5%	14,073,520.00	9,870,000.00
	美元相对人民币贬值5%	-14,073,520.00	-9,870,000.00

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	266,618,414.22	94.72	196,683,439.44	81.69
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	266,618,414.22	94.72	196,683,439.44	81.69

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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	13,310,000.00	11,280,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-13,310,000.00	-11,280,000.00

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	266,618,414.22	89.57
	其中: 普通股票	266,618,414.22	89.57
	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	22,019,855.63	7.40
8	其他各项资产	9,022,382.75	3.03
9	合计	297,660,652.60	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	266,618,414.22	94.72
合计	266,618,414.22	94.72

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 (%)
消费者非必需品	43,396,959.73	15.42
工业	35,999,450.28	12.79
金融	35,393,088.85	12.57
信息技术	35,359,179.79	12.56
医疗保健	33,664,978.65	11.96
消费者常用品	18,410,549.37	6.54
能源	18,049,724.75	6.41
房地产	16,648,652.51	5.91
公用事业	14,426,561.18	5.13
基础材料	13,233,717.99	4.70
电信服务	2,035,551.12	0.72
合计	266,618,414.22	94.72

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	H & R Block Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	美国	3,075	643,894.86	0.23
2	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	美国	2,254	642,998.54	0.23
3	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	美国	764	629,720.31	0.22
4	Acuity Brands Inc	敏锐品牌公司	AYI UN	纽约交易所	美国	454	625,203.41	0.22

5	Envision Healthcare Corp	Envision Healthcare Corp	EVHC UN	纽约交易所	美国	1,434	608,807.06	0.22
6	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	美国	1,788	607,327.13	0.22
7	Mallinckrodt PLC	Mallinckrodt 公司	MNK UN	纽约交易所	美国	1,998	606,514.61	0.22
8	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	美国	3,501	594,826.73	0.21
9	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易所	美国	673	592,099.56	0.21
10	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	美国	762	591,059.63	0.21
11	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	美国	906	587,675.81	0.21
12	Universal Health Services	Universal Health Services 公	UHS UN	纽约交易所	美国	710	587,183.31	0.21
13	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	美国	1,224	586,898.25	0.21
14	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	美国	444	582,707.60	0.21
15	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	美国	1,260	581,625.60	0.21
16	Signet Jewelers Ltd	英国西格尼珠宝有限公司	SIG UN	纽约交易所	美国	1,353	579,642.86	0.21
17	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	美国	1,351	577,138.64	0.21
18	INCYTE CORP	Incyte 有限公司	INCY UQ	纳斯达克交易所	美国	676	576,604.14	0.20
19	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	美国	552	576,401.72	0.20
20	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	美国	1,628	575,258.20	0.20
21	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	美国	1,148	573,943.43	0.20
22	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	美国	2,454	573,042.30	0.20
23	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	美国	1,326	572,926.45	0.20

24	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern	KSU UN	纽约交易所	美国	808	572,824.30	0.20
25	Vertex Pharmaceuticals Inc	Vertex 制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	美国	656	572,699.10	0.20
26	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约交易所	美国	3,649	572,510.23	0.20
27	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	美国	490	571,709.91	0.20
28	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	美国	1,001	571,246.13	0.20
29	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	美国	1,116	570,948.60	0.20
30	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	美国	1,354	569,981.49	0.20
31	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达克交易所	美国	5,052	569,834.08	0.20
32	Staples Inc	史泰博公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	美国	8,335	568,598.76	0.20
33	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公司	VRSK UQ	纳斯达克交易所	美国	994	568,126.79	0.20
34	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	美国	1,455	567,748.92	0.20
35	AbbVie Inc	艾伯维有限公司	ABBV UN	纽约交易所	美国	1,155	567,349.56	0.20
36	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,311	566,978.26	0.20
37	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约交易所	美国	2,806	566,847.38	0.20
38	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	美国	1,204	566,705.12	0.20
39	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	美国	423	566,666.70	0.20
40	Simon Property Group	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约交易所	美国	517	566,542.53	0.20
41	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	美国	914	565,930.67	0.20
42	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	美国	914	565,868.75	0.20
43	AutoNation	AutoNation 公	AN UN	纽约交易所	美国	1,981	565,790.	0.20

	Inc	司					84	0
44	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BYM UN	纽约交易所	美国	1,498	565,449.41	0.20
45	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	美国	560	565,066.25	0.20
46	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	美国	3,213	565,049.18	0.20
47	Cardinal Health Inc	康德乐公司	CAH UN	纽约交易所	美国	1,070	564,811.54	0.20
48	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约交易所	美国	1,008	564,656.54	0.20
49	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	美国	1,271	564,574.91	0.20
50	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	美国	1,673	564,525.18	0.20
51	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	1,475	564,361.72	0.20
52	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	美国	621	564,229.75	0.20
53	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	美国	2,749	563,899.16	0.20
54	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	美国	746	563,538.35	0.20
55	Hunt J.B. Transport Services	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT UQ	纳斯达克交易所	美国	910	563,330.65	0.20
56	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	美国	1,409	563,162.65	0.20
57	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	美国	1,005	562,499.43	0.20
58	Regeneron Pharmaceuticals	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	美国	169	562,293.22	0.20
59	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约交易所	美国	1,039	562,243.50	0.20
60	LyondellBasell Industries	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	美国	983	561,972.86	0.20

	N. V.							
61	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	美国	936	561,798.28	0.20
62	Extra Space Storage Inc	Extra Space 仓储公司	EXR UN	纽约交易所	美国	1,063	561,692.60	0.20
63	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	美国	1,496	561,552.78	0.20
64	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	美国	3,379	561,508.81	0.20
65	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	美国	1,825	561,416.54	0.20
66	CSX Corp	CSX 公司	CSX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,518	561,069.90	0.20
67	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	美国	1,367	560,637.01	0.20
68	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	美国	1,492	560,253.45	0.20
69	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	1,329	559,907.61	0.20
70	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	美国	2,163	559,892.17	0.20
71	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	美国	1,409	559,726.40	0.20
72	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	美国	2,955	559,713.12	0.20
73	Nielsen Holdings Plc	尼尔森控股公开有限公司	NLSN UN	纽约交易所	美国	2,137	559,676.68	0.20
74	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics	DGX UN	纽约交易所	美国	742	558,757.39	0.20
75	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	美国	583	558,613.77	0.20
76	Macy's Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	美国	3,547	558,429.24	0.20
77	Grainger W. W. Inc	固安捷公司	GWV UN	纽约交易所	美国	456	557,679.99	0.20
78	Delphi Automotive PLC	德尔福汽车公司	DLPH UN	纽约交易所	美国	939	557,555.81	0.20
79	United	联合租赁公司	URI UN	纽约交易所	美国	730	557,386.	0.20

	Rentals Inc						12	0
80	DXC Technology Company	DXC Technology Co	DXC UN	纽约交易所	美国	1,072	557,152.67	0.20
81	AllianceData Systems Corp	联合数据系统公司	ADS UN	纽约交易所	美国	320	556,454.64	0.20
82	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约交易所	美国	1,511	556,230.67	0.20
83	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	美国	877	556,091.53	0.20
84	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	美国	2,148	555,863.91	0.20
85	Welltower Inc	Welltower 股份有限公司	HCN UN	纽约交易所	美国	1,096	555,741.97	0.20
86	CBOE Holdings Inc	CBOE 控股公司	CBOE UQ	纳斯达克交易所	美国	897	555,404.60	0.20
87	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	美国	693	555,096.50	0.20
88	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	美国	988	554,858.59	0.20
89	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	美国	596	554,839.08	0.20
90	Horton D. R. Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约交易所	美国	2,368	554,564.31	0.20
91	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达克交易所	美国	6,558	554,442.91	0.20
92	Scripps Networks Interactive A	斯克利普斯网络互动公司	SNI UQ	纳斯达克交易所	美国	1,198	554,385.60	0.20
93	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,802	553,974.93	0.20
94	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	美国	618	553,968.16	0.20
95	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	美国	814	553,697.05	0.20
96	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	美国	760	553,262.54	0.20

97	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	美国	840	553,173.12	0.20
98	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	美国	1,852	553,161.46	0.20
99	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公司	JWN UN	纽约交易所	美国	1,707	553,101.38	0.20
100	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约交易所	美国	1,519	553,001.45	0.20
101	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	美国	1,511	552,955.12	0.20
102	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	美国	1,393	552,898.55	0.20
103	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	美国	1,723	552,566.27	0.20
104	Global Payments Inc	环汇公司	GPN UN	纽约交易所	美国	903	552,513.02	0.20
105	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	美国	537	552,335.19	0.20
106	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	美国	2,836	551,966.46	0.20
107	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	1,186	551,805.23	0.20
108	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	美国	921	551,796.83	0.20
109	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	美国	667	551,757.06	0.20
110	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	美国	87	551,281.64	0.20
111	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	美国	531	550,948.13	0.20
112	Dentsply Sirona Intl	登士柏西诺德公司	XRAY UQ	纳斯达克交易所	美国	1,254	550,822.13	0.20
113	CSRA Inc	CSRA 股份有限公司	CSRA UN	纽约交易所	美国	2,560	550,623.23	0.20
114	GenenalGrowthPropertiesIn	GGP 股份有限公司	GGP UN	纽约交易所	美国	3,449	550,477.18	0.20

115	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UQ	纳斯达克交易所	美国	541	550,182.35	0.20
116	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	美国	787	550,152.61	0.20
117	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	美国	1,101	550,147.40	0.20
118	Cooper Companies Inc	库柏股份有限公司	COO UN	纽约交易所	美国	339	549,833.20	0.20
119	Newell Brands Inc	纽威尔品牌公司	NWL UN	纽约交易所	美国	1,512	549,223.91	0.20
120	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	美国	373	549,160.57	0.20
121	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	美国	2,462	549,058.62	0.20
122	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	美国	7,236	548,528.86	0.19
123	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	美国	335	548,497.09	0.19
124	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	美国	612	548,465.45	0.19
125	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约交易所	美国	998	548,440.25	0.19
126	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	美国	492	548,412.61	0.19
127	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	美国	916	548,366.81	0.19
128	PayPal Holdings Inc.	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,508	548,281.73	0.19
129	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	美国	806	548,255.31	0.19
130	Bard C. R. Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交易所	美国	256	548,212.63	0.19
131	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约交易所	美国	430	548,021.18	0.19
132	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	美国	4,221	547,875.26	0.19
133	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	美国	1,472	547,857.	0.1

3							11	9
134	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	美国	483	547,705.97	0.19
135	Pentair Ltd.	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约交易所	美国	1,215	547,683.82	0.19
136	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	美国	1,914	547,303.37	0.19
137	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,215	547,107.66	0.19
138	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	美国	3,281	546,779.44	0.19
139	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	美国	607	546,698.48	0.19
140	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	美国	421	546,504.53	0.19
141	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	美国	1,360	546,433.94	0.19
142	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	美国	859	546,423.78	0.19
143	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	美国	2,766	546,399.80	0.19
144	American Airlines Group Inc.	美国航空集团公司	AAL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,602	546,102.27	0.19
145	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	美国	1,214	546,081.67	0.19
146	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	美国	335	546,068.80	0.19
147	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	美国	1,194	545,659.22	0.19
148	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	美国	1,850	545,545.82	0.19
149	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	美国	3,475	545,445.90	0.19
150	Priceline Group Inc	Priceline 集团	PCLN UQ	纳斯达克交易所	美国	43	544,880.98	0.19
151	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	美国	1,508	544,706.20	0.19

15 2	Chicago Mercantile Exchange	芝加哥商业交 易所控股公司	CME UQ	纳斯达克交 易所	美国	642	544,689. 40	0.1 9
15 3	HCA Holdings Inc	HCA 医疗保 健有限公司	HCA UN	纽约交易 所	美国	922	544,650. 92	0.1 9
15 4	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有 限公	RJF UN	纽约交易 所	美国	1,002	544,529. 25	0.1 9
15 5	Schwab Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易 所	美国	1,871	544,513. 81	0.1 9
15 6	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格 鲁曼	NOC UN	纽约交易 所	美国	313	544,324. 60	0.1 9
15 7	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易 所	美国	362	544,172. 65	0.1 9
15 8	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易 所	美国	660	544,043. 93	0.1 9
15 9	Intl Business Machines Corp	国际商业机 器	IBM UN	纽约交易 所	美国	522	543,979. 31	0.1 9
16 0	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	552	543,943. 13	0.1 9
16 1	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公 司	TMO UN	纽约交易 所	美国	460	543,687. 60	0.1 9
16 2	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易 所	美国	951	543,678. 73	0.1 9
16 3	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易 所	美国	2,894	543,453. 75	0.1 9
16 4	Zoetis Inc	硕腾公司	ZTS UN	纽约交易 所	美国	1,286	543,446. 97	0.1 9
16 5	Everest Re Group Ltd	安富来集团有 限公司	RE UN	纽约交易 所	美国	315	543,278. 77	0.1 9
16 6	Digital Realty Trust	数字房地产信 托有限公司	DLR UN	纽约交易 所	美国	710	543,269. 62	0.1 9
16	KeyCorp	KeyCorp 公 司	KEY UN	纽约交易 所	美国	4,279	543,228.	0.1

7							70	9
168	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	美国	1,032	543,074.92	0.19
169	Gartner Inc	高德纳咨询公司	IT UN	纽约交易所	美国	649	543,022.29	0.19
170	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	美国	835	542,922.77	0.19
171	TransDigm Group	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约交易所	美国	298	542,787.01	0.19
172	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交易所	美国	1,380	542,783.90	0.19
173	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	美国	1,120	542,418.08	0.19
174	Royal Caribbean Cruises	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	纽约交易所	美国	733	542,396.33	0.19
175	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	美国	2,389	542,165.39	0.19
176	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	美国	2,663	542,108.83	0.19
177	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	美国	228	542,079.90	0.19
178	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约交易所	美国	548	541,969.07	0.19
179	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	美国	1,196	541,873.96	0.19
180	Allergan Inc	艾尔建有限公司	AGN UN	纽约交易所	美国	329	541,793.55	0.19
181	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约交易所	美国	435	541,751.48	0.19
182	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	美国	1,089	541,126.54	0.19
183	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克交易所	美国	1,387	540,933.06	0.19
184	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	美国	851	540,643.05	0.19
185	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	美国	2,322	540,488.19	0.19
186	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	美国	2,210	540,019.26	0.19
18	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	美国	1,662	539,646.	0.1

7							40	9
18 8	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约交易所	美国	4,341	539,630.75	0.19
18 9	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	720	539,410.25	0.19
19 0	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK UN	纽约交易所	美国	1,405	539,291.69	0.19
19 1	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	1,560	539,182.63	0.19
19 2	CVS Health Corp	CVS 保健公司	CVS UN	纽约交易所	美国	989	539,072.47	0.19
19 3	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UN	纽约交易所	美国	1,270	538,922.49	0.19
19 4	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	美国	1,737	538,699.34	0.19
19 5	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	美国	921	538,694.46	0.19
19 6	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	美国	999	538,567.65	0.19
19 7	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	美国	2,184	538,548.54	0.19
19 8	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	美国	1,404	538,432.29	0.19
19 9	Mettler-Toledo Intl	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	纽约交易所	美国	135	538,245.73	0.19
20 0	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯达克交易所	美国	2,411	538,174.93	0.19
20 1	Johnson Controls Inc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约交易所	美国	1,832	538,127.99	0.19
20 2	Limited Brands Inc	L Brands 股份有限公司	LB UN	纽约交易所	美国	1,474	538,116.74	0.19
20 3	Intercontinental Exchange	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	美国	1,205	538,114.98	0.19
20 4	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	美国	654	538,079.08	0.19

205	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	美国	1,385	537,901.25	0.19
206	FORTUNE BRANDS HOME SECURITY, INC	Fortune Brands 家庭与安全用品	FBHS UN	纽约交易所	美国	1,217	537,867.58	0.19
207	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	美国	2,087	537,674.71	0.19
208	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	美国	413	537,658.45	0.19
209	XL Group Plc	XL Group Ltd	XL UN	纽约交易所	美国	1,811	537,357.60	0.19
210	Accenture plc	埃森哲公司	ACN UN	纽约交易所	美国	641	537,066.84	0.19
211	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	美国	3,125	536,871.20	0.19
212	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	美国	587	536,837.33	0.19
213	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	美国	1,630	536,764.84	0.19
214	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	美国	1,018	536,742.08	0.19
215	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,231	536,382.90	0.19
216	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	美国	882	536,138.62	0.19
217	Mid-America Apartment Communities	Mid-America Apartment Commun	MAA UN	纽约交易所	美国	751	536,128.59	0.19
218	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	美国	853	536,019.52	0.19
219	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	美国	837	536,001.43	0.19
220	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈巴奥米特控股公司	ZBH UN	纽约交易所	美国	616	535,817.10	0.19
221	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	美国	891	535,694.15	0.19
222	Franklin	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	美国	1,765	535,545.	0.19

2	Resources Inc						79	9
223	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	美国	874	535,479.47	0.19
224	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	美国	789	535,462.26	0.19
225	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	美国	2,246	535,426.49	0.19
226	Robert Half Intl Inc	罗致恒富国际公司	RHI UN	纽约交易所	美国	1,649	535,425.34	0.19
227	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	美国	622	535,389.77	0.19
228	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	美国	2,472	535,379.75	0.19
229	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	美国	2,472	535,212.28	0.19
230	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	美国	1,179	535,210.05	0.19
231	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	美国	639	535,001.53	0.19
232	Air Products & Chemicals Inc	空气产品公司	APD UN	纽约交易所	美国	552	534,968.41	0.19
233	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UQ	纳斯达克交易所	美国	489	534,733.06	0.19
234	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	美国	1,354	534,300.32	0.19
235	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	美国	648	534,240.02	0.19
236	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	美国	786	534,118.49	0.19
237	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	美国	1,684	534,012.67	0.19
238	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	美国	1,260	533,654.71	0.19
23	Sealed Air	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	美国	1,758	533,064.	0.1

9	Corp						53	9
240	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	美国	1,496	532,770.79	0.19
241	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	美国	974	532,677.98	0.19
242	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	美国	424	532,590.32	0.19
243	Affiliated Managers Group	联合经理集团股份有限公司	AMG UN	纽约交易所	美国	474	532,587.34	0.19
244	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易所	美国	1,669	532,534.91	0.19
245	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UQ	纳斯达克交易所	美国	646	532,503.61	0.19
246	Assurant Inc	艾斯兰公司	AIZ UN	纽约交易所	美国	758	532,447.65	0.19
247	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	2,631	532,208.11	0.19
248	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UQ	纳斯达克交易所	美国	183	532,036.18	0.19
249	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	美国	623	531,945.67	0.19
250	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	美国	1,245	531,940.45	0.19
251	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	美国	484	531,888.49	0.19
252	Hewlett Packard Enterpris	慧与	HPE UN	纽约交易所	美国	4,732	531,816.68	0.19
253	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	美国	939	531,729.50	0.19
254	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	美国	491	531,598.14	0.19
255	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	美国	1,063	531,591.64	0.19
256	Patterson Cos Inc	帕特森公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,671	531,475.05	0.19
257	PNC Finl Services	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交易所	美国	628	531,237.34	0.19

	Group							
258	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	美国	2,242	530,979.64	0.19
259	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	美国	933	530,860.07	0.19
260	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	美国	1,251	530,775.12	0.19
261	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	美国	1,190	530,690.91	0.19
262	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	美国	591	530,686.51	0.19
263	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约交易所	美国	2,076	530,621.68	0.19
264	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UQ	纳斯达克交易所	美国	1,074	530,617.21	0.19
265	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	美国	718	530,567.21	0.19
266	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	美国	2,331	530,423.94	0.19
267	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	美国	2,765	530,093.41	0.19
268	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	美国	401	530,023.03	0.19
269	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约交易所	美国	1,291	529,730.10	0.19
270	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	美国	3,425	529,708.97	0.19
271	Michael Kors Holdings Ltd	迈克高仕控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	美国	2,157	529,698.80	0.19
272	Alexandria Real Estate Eqty	亚历山大房地产股份有限公司	ARE UN	纽约交易所	美国	649	529,656.67	0.19
273	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	美国	617	529,497.67	0.19
274	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	美国	967	529,439.28	0.19
27	Federal	联邦房地产投	FRT UN	纽约交易所	美国	618	529,141.	0.1

5	Realty Invt Trust	资信托公司					75	9
27 6	Coty Inc.	科蒂集团	COTY UN	纽约交易所	美国	4,163	529,066. 28	0.1 9
27 7	T Rowe Price Group Inc	普信集团公司	TROW UQ	纳斯达克交易所	美国	1,052	528,870. 09	0.1 9
27 8	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约交易所	美国	2,002	528,524. 73	0.1 9
27 9	Mylan Nv	迈兰公司	MYL UQ	纳斯达克交易所	美国	2,008	528,068. 27	0.1 9
28 0	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克交易所	美国	1,075	527,615. 68	0.1 9
28 1	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	美国	760	527,519. 82	0.1 9
28 2	L-3 Technologies Inc	L3 科技股份有限公司	LLL UN	纽约交易所	美国	466	527,449. 91	0.1 9
28 3	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	美国	3,616	527,403. 84	0.1 9
28 4	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	美国	1,152	527,401. 67	0.1 9
28 5	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	美国	2,882	527,338. 40	0.1 9
28 6	Travelers Cos Inc	旅行者集团	TRV UN	纽约交易所	美国	615	527,156. 37	0.1 9
28 7	CHARTER COMMUNICATION-A	特许通讯	CHTR UQ	纳斯达克交易所	美国	231	527,131. 98	0.1 9
28 8	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	美国	1,120	527,091. 68	0.1 9
28 9	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	美国	911	527,044. 26	0.1 9
29 0	Roper Industries Inc	Roper 科技股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	美国	336	527,008. 22	0.1 9
29 1	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	美国	538	526,867. 31	0.1 9

29 2	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交 易所	美国	515	526, 741. 44	0.1 9
29 3	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	美国	2, 972	526, 692. 80	0.1 9
29 4	BlackRock Inc	贝莱德有限公 司	BLK UN	纽约交易所	美国	184	526, 529. 67	0.1 9
29 5	Zions Bancorp (UT)	齐昂银行	ZION UQ	纳斯达克交 易所	美国	1, 770	526, 511. 11	0.1 9
29 6	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	美国	1, 061	526, 422. 64	0.1 9
29 7	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地 产信托公司	ESS UN	纽约交易所	美国	302	526, 340. 67	0.1 9
29 8	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	美国	1, 212	526, 215. 61	0.1 9
29 9	Torchmark Corp	Torchmark 公 司	TMK UN	纽约交易所	美国	1, 015	526, 015. 22	0.1 9
30 0	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交易所	美国	656	525, 992. 60	0.1 9
30 1	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	美国	1, 478	525, 959. 94	0.1 9
30 2	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交 易所	美国	835	525, 839. 77	0.1 9
30 3	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	美国	491	525, 544. 40	0.1 9
30 4	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空 集团公司	ALK UN	纽约交易所	美国	864	525, 372. 60	0.1 9
30 5	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	894	525, 324. 64	0.1 9
30 6	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	NOV UN	纽约交易所	美国	2, 354	525, 292. 12	0.1 9
30 7	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交 易所	美国	1, 174	525, 225. 74	0.1 9
30 8	Lilly Eli & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	美国	942	525, 196. 20	0.1 9
30 9	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	美国	1, 040	524, 669. 15	0.1 9
31 0	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	美国	372	524, 654. 79	0.1 9
31	Prudential	保德信金融集	PRU UN	纽约交易所	美国	716	524, 529.	0.1

1	Financial Inc	团					87	9
31 2	Fortive Corp	Fortive 公司	FTV UN	纽约交易所	美国	1,222	524,431.37	0.19
31 3	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	美国	478	524,420.53	0.19
31 4	Stanley Black & Decker	史丹利百得公司	SWK UN	纽约交易所	美国	550	524,348.72	0.19
31 5	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	美国	479	523,992.52	0.19
31 6	Biogen Idec Inc	百健	BIIB UQ	纳斯达克交易所	美国	285	523,915.84	0.19
31 7	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	美国	2,267	523,846.54	0.19
31 8	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	美国	504	523,753.25	0.19
31 9	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,514	523,386.21	0.19
32 0	Freeport McMoRan	自由港迈克默伦股份有限公司	FCX UN	纽约交易所	美国	6,428	522,985.58	0.19
32 1	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	美国	278	522,818.25	0.19
32 2	Rockwell Collins	洛克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	美国	734	522,500.80	0.19
32 3	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	美国	701	522,184.03	0.19
32 4	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	美国	729	522,102.20	0.19
32 5	eBay Inc.	eBay 公司	EBAY UQ	纳斯达克交易所	美国	2,206	521,855.88	0.19
32 6	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	美国	1,472	521,830.41	0.19
32 7	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	美国	4,042	521,629.48	0.19
32 8	Baker Hughes Inc	贝克休斯(GE 石油天然气集团)有	BHI UN	纽约交易所	美国	1,412	521,412.83	0.19
32 9	Public Service Enterprise	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	美国	1,789	521,255.46	0.19

	Grp							
330	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约交易所	美国	5,255	521,176.27	0.19
331	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	美国	549	521,163.87	0.19
332	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	美国	475	521,161.37	0.19
333	Avago Technologies Ltd	Broadcom 有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	美国	330	520,995.39	0.19
334	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	美国	454	520,910.58	0.19
335	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约交易所	美国	1,243	520,812.82	0.19
336	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽约交易所	美国	726	520,347.08	0.18
337	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	美国	665	520,279.68	0.18
338	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	美国	1,205	520,237.68	0.18
339	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约交易所	美国	985	520,210.24	0.18
340	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	美国	1,051	520,108.29	0.18
341	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	美国	576	520,104.83	0.18
342	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	美国	1,180	519,916.23	0.18
343	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	美国	15,441	519,879.45	0.18
344	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	美国	1,014	519,864.20	0.18
345	FMC Technologies Inc	TechnipFMC PLC	FTI UN	纽约交易所	美国	2,821	519,807.84	0.18
346	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	美国	627	519,645.12	0.18

347	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN UQ	纳斯达克交易所	美国	442	519,568.30	0.18
348	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	美国	2,992	519,494.59	0.18
349	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	美国	1,795	519,355.65	0.18
350	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	美国	4,452	519,348.81	0.18
351	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST UN	纽约交易所	美国	4,195	519,207.97	0.18
352	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	美国	1,409	519,159.60	0.18
353	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	美国	760	519,076.21	0.18
354	Clorox Co	高乐氏公司	CLX UN	纽约交易所	美国	575	519,007.11	0.18
355	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约交易所	美国	593	518,663.17	0.18
356	Level 3 Communications	Level 3 通信股份有限公司	LVLT UN	纽约交易所	美国	1,291	518,623.00	0.18
357	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,412	518,543.20	0.18
358	IHS Markit Ltd	IHS Markit 有限公司	INFO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,738	518,522.87	0.18
359	SunTrust Banks Inc (GA)	太阳信托银行	STI UN	纽约交易所	美国	1,349	518,345.11	0.18
360	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	美国	1,540	518,290.38	0.18
361	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	美国	601	518,250.34	0.18
362	Chubb Corp	丘博集团有限公司	CB UN	纽约交易所	美国	526	518,037.56	0.18
363	Salesforce .com	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	美国	883	518,023.46	0.18
364	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	美国	386	518,015.34	0.18
36	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交易所	美国	576	517,997.	0.1

5							72	8
366	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	美国	702	517,935.53	0.18
367	Dr Pepper Snapple Group	澎泉思蓝宝集团公司	DPS UN	纽约交易所	美国	839	517,843.87	0.18
368	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约交易所	美国	1,385	517,728.78	0.18
369	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	美国	814	517,633.12	0.18
370	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	美国	2,275	517,372.78	0.18
371	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	美国	1,701	516,817.96	0.18
372	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	2,437	516,738.36	0.18
373	Gallagher Arthur J. & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	纽约交易所	美国	1,332	516,595.42	0.18
374	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	2,679	516,509.66	0.18
375	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	美国	574	516,432.43	0.18
376	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	美国	532	516,270.25	0.18
377	Brown-Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交易所	美国	1,568	516,241.80	0.18
378	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	美国	3,141	516,213.75	0.18
379	Concho Resources Inc	康丘资源公司	CXO UN	纽约交易所	美国	627	516,204.61	0.18
380	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	美国	1,710	516,193.02	0.18
381	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	美国	968	515,953.48	0.18
382	Martin Marietta	Martin Marietta 材料	MLM UN	纽约交易所	美国	342	515,683.32	0.18

	Materials Inc	股份有限						
383	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	2,196	515,622.35	0.18
384	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约交易所	美国	6,422	515,536.58	0.18
385	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	美国	989	515,421.89	0.18
386	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	美国	873	515,409.56	0.18
387	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	美国	1,678	515,399.87	0.18
388	Walt Disney Co	华特迪士尼	DIS UN	纽约交易所	美国	716	515,362.48	0.18
389	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	美国	1,187	515,200.50	0.18
390	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	美国	509	515,191.02	0.18
391	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	美国	1,155	515,160.60	0.18
392	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	美国	1,967	515,153.96	0.18
393	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	美国	1,270	515,090.83	0.18
394	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	美国	1,794	514,812.67	0.18
395	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	美国	1,965	514,763.28	0.18
396	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	美国	1,629	514,585.25	0.18
397	Schein Henry Inc	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克交易所	美国	415	514,538.04	0.18
398	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	美国	1,641	514,151.56	0.18
399	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	美国	1,311	513,957.27	0.18
400	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	美国	838	513,877.26	0.18
401	Hershey Co	好时食品	HSY UN	纽约交易所	美国	706	513,521.33	0.18
40	Pioneer	Pioneer 自然	PXD UN	纽约交易所	美国	475	513,502.	0.1

2	Natural Resources	资源公司					91	8
403	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	美国	806	513,310.24	0.18
404	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	972	513,278.67	0.18
405	Huntington Bancshares Inc	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	美国	5,604	513,269.73	0.18
406	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	美国	1,270	512,939.95	0.18
407	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约交易所	美国	4,331	512,861.91	0.18
408	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	美国	1,630	512,692.69	0.18
409	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	美国	1,720	512,220.51	0.18
410	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	美国	1,096	511,787.49	0.18
411	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	美国	670	511,755.11	0.18
412	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	美国	1,886	511,699.56	0.18
413	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	美国	974	511,563.53	0.18
414	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,295	511,544.77	0.18
415	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	美国	78	511,494.30	0.18
416	O'Reilly Automotive	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	美国	345	511,232.13	0.18
417	Church & Dwight Co	切迟杜威股份有限公司	CHD UN	纽约交易所	美国	1,454	511,016.84	0.18
418	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	美国	2,159	510,883.72	0.18
419	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	美国	1,017	510,723.44	0.18
420	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	美国	543	510,502.12	0.18
421	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团	CFG UN	纽约交易所	美国	2,112	510,492.77	0.18

42 2	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	美国	132	510,117. 20	0.1 8
42 3	Philip Morris Internatio nal	菲利普莫里斯 国际集团公司	PM UN	纽约交易所	美国	641	510,013. 75	0.1 8
42 4	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约交易所	美国	361	509,972. 29	0.1 8
42 5	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交 易所	美国	967	509,655. 73	0.1 8
42 6	Transocean Inc	Transocean 公 司	RIG UN	纽约交易所	美国	9,141	509,641. 02	0.1 8
42 7	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	美国	2,695	509,005. 38	0.1 8
42 8	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	美国	1,447	508,948. 75	0.1 8
42 9	DaVita Inc	DaVita 股份有 限公司	DVA UN	纽约交易所	美国	1,160	508,903. 77	0.1 8
43 0	Eversource Energy	Eversource 能 源公司	ES UN	纽约交易所	美国	1,237	508,745. 72	0.1 8
43 1	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦	DD UN	纽约交易所	美国	930	508,488. 50	0.1 8
43 2	Alliant Energy Corp	Alliant 能源 公司	LNT UN	纽约交易所	美国	1,868	508,334. 45	0.1 8
43 3	Ross Stores Inc	Ross 商店有限 公司	ROST UQ	纳斯达克交 易所	美国	1,299	508,020. 86	0.1 8
43 4	Wec Energy Group Inc	WEC 能源集团 股份有限公司	WEC UN	纽约交易所	美国	1,221	507,707. 27	0.1 8
43 5	Boston Properties Inc	波士顿地产公 司	BXP UN	纽约交易所	美国	609	507,532. 49	0.1 8
43 6	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约交易所	美国	718	507,463. 12	0.1 8
43 7	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交 易所	美国	1,356	507,255. 69	0.1 8
43 8	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	美国	1,369	507,017. 98	0.1 8
43 9	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交 易所	美国	2,648	506,765. 77	0.1 8
44 0	PG&E Corporatio	太平洋煤气电 力	PCG UN	纽约交易所	美国	1,127	506,718. 28	0.1 8

	n							
44 1	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	美国	707	506,681.29	0.18
44 2	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	美国	2,730	506,368.79	0.18
44 3	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	美国	2,214	506,050.12	0.18
44 4	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	美国	1,628	505,997.82	0.18
44 5	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	美国	1,738	505,924.79	0.18
44 6	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	美国	972	505,508.71	0.18
44 7	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	美国	876	505,371.32	0.18
44 8	Dominion Resources Inc	Dominion 能源公司	D UN	纽约交易所	美国	972	504,586.85	0.18
44 9	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	美国	517	504,410.58	0.18
45 0	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	美国	928	504,314.52	0.18
45 1	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	美国	964	504,025.66	0.18
45 2	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	美国	1,071	503,958.86	0.18
45 3	DISH NETWORK CORP-A	DISH 网络公司	DISH UQ	纳斯达克交易所	美国	1,185	503,816.19	0.18
45 4	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	美国	1,800	503,730.84	0.18
45 5	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳斯达克交易所	美国	868	503,578.55	0.18
45 6	Peoples United Financial Inc	人民联合金融股份有限公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	美国	4,198	502,231.52	0.18

457	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	美国	948	502,146.44	0.18
458	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	美国	971	502,028.56	0.18
459	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,059	501,612.34	0.18
460	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	美国	1,025	500,575.66	0.18
461	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,895	499,635.03	0.18
462	CenturyLink Inc	世纪电信公司	CTL UN	纽约交易所	美国	3,084	498,906.92	0.18
463	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,900	498,765.20	0.18
464	United Continental Holding Inc	联合大陆控股公司	UAL UN	纽约交易所	美国	978	498,558.58	0.18
465	Albemarle Corp	雅宝公司	ALB UN	纽约交易所	美国	697	498,334.21	0.18
466	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约交易所	美国	1,676	498,095.35	0.18
467	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	美国	1,017	497,219.89	0.18
468	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件公司	AAP UN	纽约交易所	美国	627	495,221.71	0.18
469	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	美国	6,579	495,159.12	0.18
470	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	美国	1,765	494,773.05	0.18
471	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	美国	1,690	494,470.91	0.18
472	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	美国	1,521	493,348.93	0.18
473	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	美国	2,248	493,262.49	0.18
474	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	美国	1,312	492,395.91	0.17
475	Walgreens Boots	Walgreens Boots	WBA UQ	纳斯达克交易所	美国	928	492,307.03	0.17

	Alliance	Alliance 公司						
476	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,274	491,425.54	0.17
477	Foot Locker Inc	富乐客公司	FL UN	纽约交易所	美国	1,470	490,748.38	0.17
478	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约交易所	美国	174	490,476.04	0.17
479	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	美国	789	489,121.10	0.17
480	Lam Research Corp	科林研发股份有限公司	LRCX UQ	纳斯达克交易所	美国	510	488,632.73	0.17
481	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	美国	3,276	488,022.63	0.17
482	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交易所	美国	738	487,501.95	0.17
483	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	美国	1,611	487,399.52	0.17
484	ULTA Beauty Inc	Ulta 美妆	ULTA UQ	纳斯达克交易所	美国	250	486,639.02	0.17
485	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约交易所	美国	1,355	479,986.22	0.17
486	Smucker J.M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	美国	598	479,365.62	0.17
487	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	美国	1,397	476,314.91	0.17
488	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	美国	1,343	474,461.70	0.17
489	Conagra Brands Inc	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	纽约交易所	美国	1,943	470,696.69	0.17
490	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯达克交易所	美国	720	468,002.65	0.17
491	Bed Bath & Beyond Inc	3B 家居	BBBY UQ	纳斯达克交易所	美国	2,259	465,222.44	0.17
492	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交易所	美国	427	462,624.52	0.16
493	Qorvo, Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,069	458,552.90	0.16
49	Arconic Inc	Arconic 公司	ARNC UN	纽约交易所	美国	2,818	432,394.	0.1

4							37	5
495	News Corporation	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	美国	4,455	413,465.34	0.15
496	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	美国	2,505	395,737.42	0.14
497	21st Century Fox	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,883	361,510.57	0.13
498	Discovery CommunicationsC	探索传播公司	DISCK UQ	纳斯达克交易所	美国	1,809	308,945.77	0.11
499	Under Armour-A equity	安德玛公司	UAA UN	纽约交易所	美国	1,910	281,554.90	0.10
500	Google Inc C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	美国	41	252,400.12	0.09
501	Google Inc A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	美国	40	251,920.97	0.09
502	Under Armour Inc Class A	安德玛公司	UA UN	纽约交易所	美国	1,835	250,609.44	0.09
503	Discovery CommunicationsA	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,186	207,529.54	0.07
504	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	新闻集团	FOX UQ	纳斯达克交易所	美国	870	164,258.20	0.06
505	News Corp B	新闻集团	NWS UQ	纳斯达克交易所	美国	1,338	128,257.68	0.05

7.4.2 积极投资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益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

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	Advanced Micro Devices	AMD UQ	724,162.25	0.30
2	Incyte Corp	INCY UQ	709,389.19	0.29
3	Regency Centers Corp	REG UN	664,570.54	0.28
4	DISH Network Corp A	DISH UQ	640,257.28	0.27
5	Alexandria Real Estate Eqty	ARE UN	637,120.43	0.26
6	Synopsys Inc	SNPS UQ	625,772.46	0.26
7	CBOE Holdings Inc	CBOE UQ	619,316.27	0.26
8	Raymond James Financial Inc	RJF UN	618,243.19	0.26
9	Gartner Inc	IT UN	614,087.01	0.26
10	IDEXX Laboratories Inc	IDXX UQ	592,339.75	0.25
11	IHS Markit Ltd	INFO UQ	574,948.53	0.24
12	Everest Re Group Ltd	RE UN	553,007.36	0.23
13	Align Technology Inc	ALGN UQ	552,894.36	0.23
14	Hilton Worldwide Holdings Inc	HLT UN	552,520.98	0.23
15	ANSYS Inc	ANSS UQ	540,114.85	0.22
16	DXC Technology Company	DXC UN	497,062.84	0.21
17	Transocean Ltd	RIG UN	481,732.31	0.20
18	Range Resources Corp	RRC UN	463,876.81	0.19
19	Macys Inc	M UN	461,849.16	0.19
20	Signet Jewelers Ltd	SIG UN	455,177.56	0.19

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	ALTABA INC	AABA UQ	776,334.16	0.32
2	Mead Johnson Nutrition Co	MJN UN	738,714.89	0.31
3	Dun & Bradstreet Corp	DNB UN	639,862.16	0.27
4	Southwestern Energy Co	SWN UN	637,451.77	0.26
5	Harman Intl Industries Inc	HAR UN	611,951.16	0.25
6	Teradata Corp	TDC UN	607,433.53	0.25
7	Enbridge Inc	ENB UN	568,591.21	0.24
8	Ryder System Inc	R UN	551,276.08	0.23
9	First Solar Inc	FSLR UQ	542,974.10	0.23

10	Pitney Bowes Inc	PBI UN	503,086.90	0.21
11	Nvidia Corp	NVDA UQ	438,006.78	0.18
12	Urban Outfitters	URBN UQ	417,893.91	0.17
13	Frontier Communications Corp	FTR UQ	406,184.19	0.17
14	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UQ	388,985.51	0.16
15	TEGNA Inc	TGNA UN	386,682.24	0.16
16	Endo International plc	ENDP UQ	386,549.01	0.16
17	Activision Blizzard Inc	ATVI UQ	381,931.95	0.16
18	Micron Technology Inc	MU UQ	342,140.99	0.14
19	Analog Devices Inc	ADI UQ	331,185.42	0.14
20	Lam Research Corp	LRCX UQ	325,160.20	0.14

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	130,421,853.06
卖出收入（成交）总额	71,307,941.76

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融衍生品。

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	7,294,487.08
3	应收股利	330,738.68
4	应收利息	729.16
5	应收申购款	1,280,608.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	115,819.44
8	其他	-
9	合计	9,022,382.75

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
44,055	3,835.59	6,238,940.13	3.69%	162,737,990.92	96.31%

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	182,689.14	0.1081%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 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	146,373,605.04
本报告期基金总申购份额	131,226,397.77
减：本报告期基金总赎回份额	108,623,071.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	168,976,931.05

§ 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

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	-	201,877,459.90	100.00%	60,190.95	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、东方财富证券、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、本报告期内本基金无新增或退租境内交易单元, 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	关于大成标普 500 等权重指数证	中国证监会指定报	2017 年 4 月 14 日

	券投资基金增加江西银行股份有限公司为销售机构的公告	刊及本公司网站	
2	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	2017 年 1 月 12 日
3	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	2017 年 2 月 16 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	2017 年 4 月 12 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	2017 年 6 月 30 日
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2017 年第 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 8 日
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2017 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 8 日
8	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	2017 年 1 月 18 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
11	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 21 日
13	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售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	2017 年 3 月 25 日
14	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
15	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 7 日
16	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
17	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日

	有限公司为销售机构的公告		
18	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 28 日
19	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日
20	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
21	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 14 日
22	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
23	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 17 日
24	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
25	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
26	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
27	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
29	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
30	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
31	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	2017 年 1 月 3 日
32	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
33	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日

34	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
35	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
36	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 27 日
37	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
38	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
39	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
40	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
41	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
42	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
43	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 24 日
44	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
45	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
46	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
47	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
48	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
49	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
50	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
51	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
52	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日

	指引》实施的风险提示公告		
53	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
54	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 16 日
55	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 21 日
56	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 6 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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

2017 年 8 月 24 日