

大成纳斯达克 100 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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
3.3 其他指标.....	9
§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.....	12
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.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
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.....	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.11 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53

§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金
基金简称	大成纳斯达克 100 指数 QDII
基金主代码	000834
交易代码	000834
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 13 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	149,431,506.03 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。 本基金可能将一定比例的基金资产投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金以及股指期货等金融衍生品，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	纳斯达克 100 价格指数
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

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	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		One Wall Street New York, NY10286
办公地址		One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		NY10286

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	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东 座 F9 中国农业银行托管业务部

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	-461,753.76
本期利润	5,662,308.37
加权平均基金份额本期利润	0.0646
本期加权平均净值利润率	4.65%
本期基金份额净值增长率	11.20%
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	24,013,704.84
期末可供分配基金份额利润	0.1607
期末基金资产净值	207,725,477.89
期末基金份额净值	1.390
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	39.00%

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

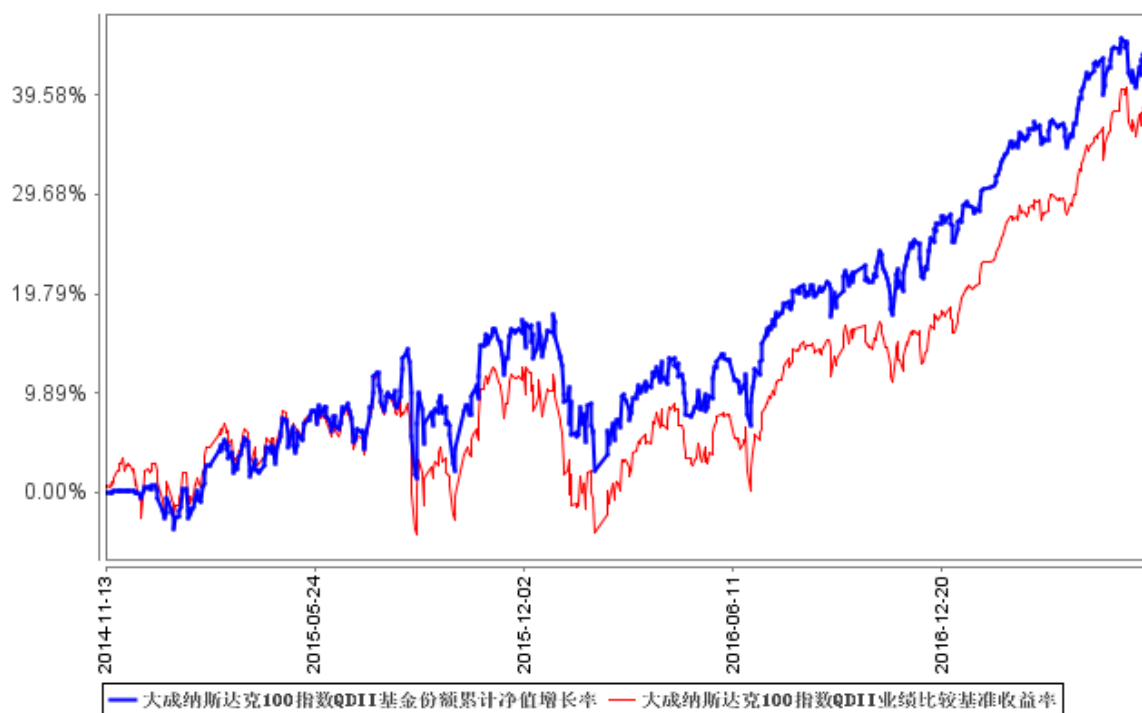
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.61%	0.93%	-2.45%	1.02%	-1.16%	-0.09%
过去三个月	1.46%	0.77%	3.88%	0.80%	-2.42%	-0.03%
过去六个月	11.20%	0.63%	16.11%	0.64%	-4.91%	-0.01%
过去一年	24.66%	0.67%	27.82%	0.69%	-3.16%	-0.02%
自基金合同生	39.00%	0.96%	34.60%	1.02%	4.40%	-0.06%

效起至 今						
----------	--	--	--	--	--	--

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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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	2014 年 11 月 13 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》、《大成纳斯达克 100 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，大成纳斯达克 100 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、信息披露等符合有关法律法规、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 1.390 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.20%，业绩比较基准收益率为 16.11%。

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。本报告期内本基金无收益分配事项。

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遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：大成纳斯达克 100 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	19,041,047.69	3,002,282.26
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	193,444,849.73	33,257,443.17
其中：股票投资		193,444,849.73	33,257,443.17
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		1,486,913.67	-
应收利息	6.4.3.5	2,513.44	203.26
应收股利		57,104.13	9,971.80
应收申购款		3,317,086.51	1,603,054.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		217,349,515.17	37,872,954.51
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		-	-
应付赎回款		9,183,391.74	224,902.40
应付管理人报酬		135,523.46	20,699.82
应付托管费		42,351.07	6,468.68
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	262,771.01	80,845.26
负债合计		9,624,037.28	332,916.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	149,431,506.03	30,022,003.79
未分配利润	6.4.3.10	58,293,971.86	7,518,034.56
所有者权益合计		207,725,477.89	37,540,038.35
负债和所有者权益总计		217,349,515.17	37,872,954.51

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.390 元，基金份额总额 149,431,506.03 份。

6.2 利润表

公告主体：大成纳斯达克 100 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		6,582,277.83	-99,085.62
1. 利息收入		18,873.10	1,357.45
其中：存款利息收入	6.4.3.11	18,873.10	1,357.45
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）		962,026.68	184,343.15
其中：股票投资收益	6.4.3.12	339,430.23	113,935.54
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	622,596.45	70,407.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	6,124,062.13	-303,640.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-600,476.19	13,856.47
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	77,792.11	4,997.68

列)			
减：二、费用		919,969.46	285,916.57
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	469,200.77	44,992.10
2. 托管费	6.4.6.2.2	146,625.16	14,060.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	47,615.48	707.75
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	256,528.05	226,156.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,662,308.37	-385,002.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,662,308.37	-385,002.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成纳斯达克 100 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）	30,022,003.79	7,518,034.56	37,540,038.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	5,662,308.37	5,662,308.37
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）	119,409,502.24	45,113,628.93	164,523,131.17
其中：1.基金申购款	165,298,972.95	62,851,969.63	228,150,942.58
2.基金赎回款	-45,889,470.71	-17,738,340.70	-63,627,811.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	149,431,506.03	58,293,971.86	207,725,477.89

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
一、期初所有者权益 (基金净值)	10,327,107.74	1,610,769.28	11,937,877.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-385,002.19	-385,002.19
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)	39,779.26	-31,623.76	8,155.50
其中：1.基金申购款	4,161,563.76	427,754.52	4,589,318.28
2.基金赎回款	-4,121,784.50	-459,378.28	-4,581,162.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,366,887.00	1,194,143.33	11,561,030.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.1 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	19,041,047.69
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	19,041,047.69

注：于 2017 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 470,976.07 元，折合人民币 3,190,580.29 元。

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	184,542,872.28	193,444,849.73	8,901,977.45
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	184,542,872.28	193,444,849.73	8,901,977.45

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	2,513.44
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	2,513.44

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产

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	34,175.88
预提费用	228,595.13
合计	262,771.01

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	30,022,003.79	30,022,003.79
本期申购	165,298,972.95	165,298,972.95
本期赎回(以“-”号填列)	-45,889,470.71	-45,889,470.71
本期末	149,431,506.03	149,431,506.03

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	5,017,630.32	2,500,404.24	7,518,034.56
本期利润	-461,753.76	6,124,062.13	5,662,308.37
本期基金份额交易产生的变动数	19,457,828.28	25,655,800.65	45,113,628.93
其中：基金申购款	26,884,025.19	35,967,944.44	62,851,969.63
基金赎回款	-7,426,196.91	-10,312,143.79	-17,738,340.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,013,704.84	34,280,267.02	58,293,971.86

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	18,873.10
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	18,873.10

6.4.3.12 股票投资收益**6.4.3.12.1 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	2,407,530.24
减：卖出股票成本总额	2,068,100.01
买卖股票差价收入	339,430.23

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	622,596.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	622,596.45

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	6,124,062.13
——股票投资	6,124,062.13
——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	6,124,062.13

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	77,792.11
合计	77,792.11

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	47,615.48
银行间市场交易费用	-
合计	47,615.48

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	19,835.79
信息披露费	74,383.76
银行汇划费	26,031.69
指数授权费	136,276.81
合计	256,528.05

注：指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.06% 的年费率计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 40,000.00 美元。

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
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：以下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**6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易**

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。

6.4.6.2 关联方报酬**6.4.6.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	469,200.77	44,992.10
其中：支付销售机构的客户维护费	192,050.93	17,174.46

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 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，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 0.8% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	146,625.16	14,060.08

注：支付基金托管人中国农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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
纽约梅隆	3,190,160.55	305.73	710,324.53	-
中国农行	15,850,887.14	18,567.37	166,543.05	1,357.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人纽约梅隆保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.7 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

本报告期内本基金无利润分配事项。

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。

6.4.9 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农业银行及境外次托管行纽约梅隆，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。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，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。

6.4.9.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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	19,041,047.69	-	-	-	19,041,047.69
交易性金融资产	-	-	-	193,444,849.73	193,444,849.73
应收利息	-	-	-	2,513.44	2,513.44
应收股利	-	-	-	57,104.13	57,104.13
应收证券清算款	-	-	-	1,486,913.67	1,486,913.67
应收申购款	-	-	-	3,317,086.51	3,317,086.51
资产总计	19,041,047.69	-	-	198,308,467.48	217,349,515.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00
应付赎回费	-	-	-	34,175.88	34,175.88
应付赎回款	-	-	-	9,183,391.74	9,183,391.74
应付管理人报酬	-	-	-	135,523.46	135,523.46
应付托管费	-	-	-	42,351.07	42,351.07
其他负债	-	-	-	228,595.13	228,595.13
负债总计	-	-	-	9,624,037.28	9,624,037.28
利率敏感度缺口	19,041,047.69	-	-	188,684,430.20	207,725,477.89
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	3,002,282.26	-	-	3,002,282.26
交易性金融资产	-	-	33,257,443.17	33,257,443.17
应收利息	-	-	203.26	203.26
应收股利	-	-	9,971.80	9,971.80
应收申购款	187,011.36	-	1,416,042.66	1,603,054.02
资产总计	3,189,293.62	-	34,683,660.89	37,872,954.51
负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	224,902.40	224,902.40
应付管理人报酬	-	-	20,699.82	20,699.82
应付托管费	-	-	6,468.68	6,468.68
其他负债	-	-	80,845.26	80,845.26
负债总计	-	-	332,916.16	332,916.16
利率敏感度缺口	3,189,293.62	-	34,350,744.73	37,540,038.35

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	3,190,580.29	-	-	3,190,580.29
交易性金融资产	193,444,849.73	-	-	193,444,849.73
应收股利	57,104.13	-	-	57,104.13
应收证券清算款	1,486,913.67	-	-	1,486,913.67
资产合计	198,179,447.82	-	-	198,179,447.82
以外币计价的负债				

其它负债	134,375.58	-	-	134,375.58
负债合计	134,375.58	-	-	134,375.58
资产负债表外汇风险敞口净额	198,045,072.24	-	-	198,045,072.24
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	1,611,767.14	-	-	1,611,767.14
交易性金融资产	33,257,443.17	-	-	33,257,443.17
应收股利	9,971.80	-	-	9,971.80
资产合计	34,879,182.11	-	-	34,879,182.11
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	34,879,182.11	-	-	34,879,182.11

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%	10,386,270.00	1,740,000.00
	美元相对人民币贬值 5%	-10,386,270.00	-1,740,000.00

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。纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、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	193,444,849.73	93.13	33,257,443.17	88.59
交易性金融资产-基金投资	-	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	193,444,849.73	93.13	33,257,443.17	88.59

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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	9,740,000.00	1,760,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-9,740,000.00	-1,760,000.00	

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	193,444,849.73	89.00
	其中:普通股票	193,444,849.73	89.00
	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	19,041,047.69	8.76
8	其他各项资产	4,863,617.75	2.24
9	合计	217,349,515.17	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	193,444,849.73	93.13
合计	193,444,849.73	93.13

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 (%)
工业	4,407,205.64	2.12
消费者非必需品	46,879,312.77	22.57
消费者常用品	10,674,894.46	5.14
医疗保健	22,192,125.80	10.68
信息技术	109,291,311.06	52.61
合计	193,444,849.73	93.13

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	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	22,905	22,347,242.36	10.76
2	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	33,737	15,753,809.01	7.58
3	Amazon.com Inc	亚马逊	AMZN UQ	纳斯达克交易所	US	2,083	13,659,520.79	6.58
4	Facebook Inc	FACEBOOK 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	US	10,282	10,516,418.41	5.06
5	Google Inc C	谷歌 C 类股	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	1,514	9,320,336.18	4.49
6	Google Inc A	谷歌 A 类股	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	US	1,329	8,370,074.15	4.03

				所				
7	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克 交易所	US	21,141	5,574,028.62	2.68
8	Intel Corp	英特尔	INTC UQ	纳斯达克 交易所	US	21,031	4,807,018.99	2.31
9	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克 交易所	US	22,331	4,735,036.66	2.28
10	Amgen Inc	安进公司	AMGN UQ	纳斯达克 交易所	US	3,284	3,831,623.13	1.84
11	KRAFT HEINZ CO	卡夫亨氏	KHC UQ	纳斯达克 交易所	US	5,438	3,154,907.99	1.52
12	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克 交易所	US	3,487	3,067,832.36	1.48
13	Avago Technologies Ltd	博通	AVGO UQ	纳斯达克 交易所	US	1,792	2,829,162.86	1.36
14	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克 交易所	US	5,836	2,798,315.50	1.35
15	Priceline.com Inc	普利斯林	PCLN UQ	纳斯达克 交易所	US	219	2,775,091.50	1.34
16	CHARTER COMMUNICATION-A	特许通讯	CHTR UQ	纳斯达克 交易所	US	1,194	2,724,656.23	1.31
17	Nvidia Corp	英伟达	NVDA UQ	纳斯 达克交 易	US	2,657	2,602,019.40	1.25

				所				
18	Walgreens Boots Alliance	沃尔格林联合博姿	WBA UQ	纳斯达克交易所	US	4,827	2,560,739.26	1.23
19	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	6,467	2,554,563.71	1.23
20	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	US	6,598	2,468,195.46	1.19
21	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	4,449	2,318,616.78	1.12
22	Costco Wholesale Corp	好市多	COST UQ	纳斯达克交易所	US	1,960	2,123,522.39	1.02
23	Adobe Systems Inc	奥多比系统	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	2,209	2,116,600.04	1.02
24	Mondelez International Inc	亿滋国际	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	US	6,776	1,982,565.01	0.95
25	PAYPAL HLDGS INC	PAYPAL 公司	PYPL UQ	纳斯达克交易所	US	5,365	1,950,617.69	0.94
26	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	1,924	1,947,401.81	0.94
27	TESLA MOTORS INC	特斯拉	TSLA UQ	纳斯达克交易所	US	733	1,795,623.34	0.86
28	Biogen Idec Inc	生物基因	BIIB UQ	纳斯达克交易	US	911	1,674,692.38	0.81

				所				
29	Regeneron Pharmaceuticals	再生元制药	REGN UQ	纳斯达克交易所	US	466	1,550,465.33	0.75
30	T-MOBILE UQ INC	T-MOBILE US 公司	TMUS UQ	纳斯达克交易所	US	3,710	1,523,563.91	0.73
31	CSX Corporation	CSX	CSX UQ	纳斯达克交易所	US	4,120	1,522,798.41	0.73
32	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU UQ	纳斯达克交易所	US	1,233	1,493,988.10	0.72
33	Automatic Data Processing	自动数据处理	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	1,998	1,386,821.84	0.67
34	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	4,799	1,343,002.38	0.65
35	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪	ATVI UQ	纳斯达克交易所	US	3,366	1,312,747.43	0.63
36	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	2,561	1,151,989.43	0.55
37	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	US	1,692	1,149,781.79	0.55
38	eBay Inc.	EBAY 公司	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	4,833	1,143,304.38	0.55
39	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	US	2,557	1,105,845.47	0.53

				所				
40	JD.COM INC-ADR	京东	JD UQ	纳斯达克交易所	US	4,096	1,088,274.30	0.52
41	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	163	1,032,861.00	0.50
42	Intuit Inc	财捷公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	1,144	1,029,266.03	0.50
43	Micron Technology Inc	美光科技	MU UQ	纳斯达克交易所	US	4,941	999,483.19	0.48
44	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	US	1,384	991,206.36	0.48
45	Vertex Pharmaceuticals In	维特制药	VRTX UQ	纳斯达克交易所	US	1,112	970,794.82	0.47
46	21st Century Fox	21 世纪福克斯-A 类股	FOXA UQ	纳斯达克交易所	US	4,699	902,144.54	0.43
47	Analog Devices Inc	亚德诺	ADI UQ	纳斯达克交易所	US	1,639	863,832.20	0.42
48	Monster Beverage Corp	怪物饮料	MNST UQ	纳斯达克交易所	US	2,535	853,159.81	0.41
49	Alexion Pharmaceuticals Inc	亚力兄制药	ALXN UQ	纳斯达克交易所	US	1,002	825,889.73	0.40
50	Fiserv Inc	费哲金融服务	FISV UQ	纳斯达克交易	US	948	785,683.53	0.38

				所				
51	Western Digital Corp	西部数据	WDC UQ	纳斯达克交易所	US	1,300	780,275.39	0.38
52	INCYTE CORP	因塞特医疗	INCY UQ	纳斯达克交易所	US	914	779,609.74	0.38
53	SIRIUS XM HOLDINGS INC	SIRIUS XM HOLDINGS 公司	SIRI UQ	纳斯达克交易所	US	20,835	772,061.09	0.37
54	ILLUMINA INC	ILLUMINA	ILMN UQ	纳斯达克交易所	US	652	766,422.01	0.37
55	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空	AAL UQ	纳斯达克交易所	US	2,200	749,953.18	0.36
56	CTRP.COM INTERNATIONAL-ADR	携程网	CTRP UQ	纳斯达克交易所	US	1,990	726,089.68	0.35
57	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	1,568	701,494.00	0.34
58	NETEASE INC-ADR	网易	NTES UQ	纳斯达克交易所	US	340	692,439.88	0.33
59	Ross Stores Inc	罗斯服饰零售	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	1,750	684,400.70	0.33
60	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	21 世纪福克斯 -B 类股	FOX UQ	纳斯达克交易所	US	3,566	673,269.81	0.32
61	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易	US	984	672,067.09	0.32

				所				
62	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克 交易所	US	1,475	664,184.19	0.32
63	Lam Research Corp	拉姆研究	LRCX UQ	纳斯达克 交易所	US	687	658,217.03	0.32
64	Mylan Inc.	迈兰实验室	MYL UQ	纳斯达克 交易所	US	2,393	629,316.42	0.30
65	Expedia	EXPEDIA 公司	EXPE UQ	纳斯达克 交易所	US	616	621,572.88	0.30
66	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX UQ	纳斯达克 交易所	US	1,604	618,717.87	0.30
67	OReilly Automotive	奥莱利汽车	ORLY UQ	纳斯达克 交易所	US	406	601,623.90	0.29
68	LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	自由全球	LBTYK UQ	纳斯达克 交易所	US	2,590	547,074.80	0.26
69	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	艾尔塔美发化 妆香水商店	ULTA UQ	纳斯达克 交易所	US	277	539,196.04	0.26
70	SKYWORKS SOLUTIONS	思佳讯解决方 案	SWKS UQ	纳斯达克 交易所	US	824	535,603.03	0.26
71	Microchip Technology Inc	微芯科技	MCHP UQ	纳斯达克 交易所	US	1,024	535,396.55	0.26
72	CHECK POINT SOFTWARE TECH	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	CHKP UQ	纳斯 达克交 易	US	704	520,221.89	0.25

		LTD 公司		所				
73	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克 交易所	US	2,716	519,779.39	0.25
74	Dollar Tree Inc	美元树	DLTR UQ	纳斯达克 交易所	US	1,057	500,665.01	0.24
75	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克 交易所	US	1,107	482,352.45	0.23
76	BIOMARIN PHARMAC	拜玛林制药	BMRN UQ	纳斯达克 交易所	US	779	479,280.54	0.23
77	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩	HSIC UQ	纳斯达克 交易所	US	354	438,907.14	0.21
78	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克 交易所	US	1,866	435,736.32	0.21
79	KLA-Tencor Corporation	科天半导体	KLAC UQ	纳斯达克 交易所	US	700	433,947.74	0.21
80	DISH NETWORK CORP- A	DISH NETWORK 公司	DISH UQ	纳斯达克 交易所	US	1,015	431,538.76	0.21
81	IDEXX Laboratories Inc	IDEXX 实验室	IDXX UQ	纳斯达克 交易所	US	393	429,754.79	0.21
82	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克 交易所	US	558	421,520.65	0.20
83	Dentsply Intl	登士柏西诺德	XRAY UQ	纳斯 达克交 易	US	948	416,410.99	0.20

				所				
84	Wynn Resorts Ltd	永利度假	WYNN UQ	纳斯达克 交易所	US	457	415,222.22	0.20
85	Cintas Corp	信达思	CTAS UQ	纳斯达克 交易所	US	470	401,307.33	0.19
86	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	VERISK ANALYTICS 公 司	VRSK UQ	纳斯 达克 交易 所	US	683	390,372.84	0.19
87	SHIRE PLC-ADR	沙尔制药	SHPG UQ	纳斯 达克 交易 所	US	337	377,306.91	0.18
88	Viacom Inc B	维亚康姆	VIAB UQ	纳斯 达克 交易 所	US	1,573	357,726.32	0.17
89	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信集成产品	MXIM UQ	纳斯 达克 交易 所	US	1,161	353,142.02	0.17
90	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	挪威游轮控股	NCLH UQ	纳斯 达克 交易 所	US	959	352,703.11	0.17
91	Hologic Inc	豪洛捷	HOLX UQ	纳斯 达克 交易 所	US	1,147	352,613.35	0.17
92	Fastenal Co	快扣	FAST UQ	纳斯 达克 交易 所	US	1,188	350,328.88	0.17
93	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	沃达丰	VOD UQ	纳斯 达克 交易 所	US	1,787	347,801.15	0.17
94	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯 达克 交易	US	642	346,106.53	0.17

				所				
95	MERCADOLIBRE INC	MERCADOLIBRE 公司	MELI UQ	纳斯达克交易所	US	197	334,813.61	0.16
96	Seagate Technology	希捷科技	STX UQ	纳斯达克交易所	US	1,212	318,159.70	0.15
97	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	自由互动媒体	QVCA UQ	纳斯达克交易所	US	1,795	298,407.58	0.14
98	Hunt J.B. Transport Services	JB 亨特运输服务	JBHT UQ	纳斯达克交易所	US	470	290,951.00	0.14
99	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	731	246,663.42	0.12
100	LIBERTY GLOBAL PLC-A	自由全球	LBTYA UQ	纳斯达克交易所	US	995	216,505.76	0.10
101	Mattel Inc	美泰公司	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	1,317	192,088.18	0.09
102	Tractor Supply Co	拖拉机供应	TSCO UQ	纳斯达克交易所	US	502	184,354.59	0.09
103	Discovery CommunicationsC	探索传播	DISCK UQ	纳斯达克交易所	US	883	150,801.06	0.07
104	LIBERTY VENTURES - SER A	LIBERTY INTERACTIVE-A 公司	LVNTA UQ	纳斯达克交易所	US	342	121,147.81	0.06
105	Discovery CommunicationsA	探索传播	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	626	109,539.20	0.05

				所				
106	LIBERTY LILAC GROUP-C	LIBERTY GLOBAL PLC LILAC-C 公司	LILAK UQ	纳斯达克交易所	US	424	61,496.92	0.03
107	LIBERTY LILAC GROUP-A	LIBERTY GLOBAL PLC LILAC-A 公司	LILA UQ	纳斯达克交易所	US	197	29,053.30	0.01

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	Apple Inc.	AAPL UQ	18,016,745.92	47.99
2	Microsoft Corp	MSFT UQ	12,400,214.76	33.03
3	Amazon.com Inc	AMZN UQ	10,391,599.08	27.68
4	Facebook Inc A	FB UQ	8,084,480.05	21.54
5	Alphabet Inc C	GOOG UQ	7,363,817.00	19.62
6	Alphabet Inc A	GOOGL UQ	6,678,257.34	17.79
7	Comcast Corp A	CMCSA UQ	4,505,634.45	12.00
8	Intel Corp	INTC UQ	4,193,864.77	11.17
9	Cisco Systems Inc	CSCO UQ	4,075,958.51	10.86
10	Amgen Inc	AMGN UQ	3,011,797.12	8.02
11	The Kraft Heinz Company	KHC UQ	2,742,983.33	7.31
12	Celgene Corp	CELG UQ	2,347,926.21	6.25
13	Walgreens Boots Alliance Inc	WBA UQ	2,237,762.08	5.96
14	Broadcom Limited	AVGO UQ	2,227,813.34	5.93
15	Gilead Sciences Inc	GILD UQ	2,201,744.56	5.87
16	Charter Communications Inc A	CHTR UQ	2,154,002.64	5.74
17	The Priceline Group Inc	PCLN UQ	2,140,361.49	5.70
18	Starbucks Corp	SBUX UQ	2,110,193.75	5.62
19	QUALCOMM Inc	QCOM UQ	2,081,092.73	5.54
20	Texas Instruments Inc	TXN UQ	1,953,903.22	5.20

21	Costco Wholesale Corp	COST UQ	1,869,249.95	4.98
22	Nvidia Corp	NVDA UQ	1,821,308.09	4.85
23	Mondelez International Inc	MDLZ UQ	1,684,558.15	4.49
24	NetFlix Inc	NFLX UQ	1,634,823.95	4.35
25	Adobe Systems Inc	ADBE UQ	1,607,383.64	4.28
26	PayPal Holdings Inc.	PYPL UQ	1,466,523.53	3.91
27	Biogen Inc	BIIB UQ	1,431,502.03	3.81
28	T-MOBILE UQ INC	TMUS UQ	1,320,611.94	3.52
29	AL TABA INC	AABA UQ	1,276,147.82	3.40
30	TESLA MOTORS INC	TSLA UQ	1,261,322.48	3.36
31	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU UQ	1,243,571.22	3.31
32	CSX Corporation	CSX UQ	1,126,958.40	3.00
33	Automatic Data Processing	ADP UQ	1,114,411.10	2.97
34	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN UQ	1,080,708.34	2.88
35	Applied Materials Inc	AMAT UQ	1,066,792.81	2.84
36	Yahoo Inc	YHOO UQ	1,046,629.04	2.79
37	Activision Blizzard Inc	ATVI UQ	958,572.08	2.55
38	Express Scripts Holding Co.	ESRX UQ	911,722.25	2.43
39	eBay Inc.	EBAY UQ	898,897.60	2.39
40	Marriott Intl A	MAR UQ	886,418.67	2.36
41	Cognizant Tech Solutions Corp	CTSH UQ	857,503.81	2.28
42	Intuit Inc	INTU UQ	801,631.23	2.14
43	JD.COM INC-ADR	JD UQ	800,634.18	2.13
44	Electronic Arts	EA UQ	760,650.91	2.03
45	Micron Technology Inc	MU UQ	760,196.89	2.03
46	Twenty-First Century Fox Inc A	FOXA UQ	759,864.94	2.02
47	Analog Devices Inc	ADI UQ	757,381.24	2.02

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	AL TABA INC	AABA UQ	1,487,394.31	3.96
2	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI UQ	291,274.22	0.78

3	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBAC UQ	231,091.45	0.62
4	TripAdvisor Inc. A	TRIP UQ	103,016.61	0.27
5	PayPal Holdings Inc.	PYPL UQ	92,621.54	0.25
6	Biogen Inc	BIIB UQ	85,236.18	0.23
7	BIOVERATIV INC	BIVV UQ	36,475.98	0.10
8	NetFlix Inc	NFLX UQ	30,041.26	0.08
9	Adobe Systems Inc	ADBE UQ	29,815.04	0.08
10	LOGMEIN INC	LOGM UQ	20,563.66	0.05

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	156,131,444.44
卖出收入（成交）总额	2,407,530.24

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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、处罚的情形。

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	1,486,913.67
3	应收股利	57,104.13
4	应收利息	2,513.44
5	应收申购款	3,317,086.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,863,617.75

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。

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
25,243	5,919.72	12,680,995.29	8.49%	136,750,510.74	91.51%

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	85,426.82	0.0572%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 11 月 13 日）基金份额总额	474,326,755.60
本报告期期初基金份额总额	30,022,003.79
本报告期基金总申购份额	165,298,972.95
减：本报告期基金总赎回份额	45,889,470.71
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	149,431,506.03

§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

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。

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

本报告期内，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	158,538,974.68	100.00%	47,615.48	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 个工作日内，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：长江证券、中信证券、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、银河证券、招商证券、申银万国、中银国际、东莞证券、渤海证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券、天源证券、广发证券、西南证券、华福证券、齐鲁证券、民生证券、万联证券、东海证券、万和证券、华鑫证券、东吴证券、国海证券、华林证券、英大证券、民族证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无退租或新增的境内交易单元，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	大成纳斯达克 100 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
2	大成纳斯达克 100 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
3	大成纳斯达克 100 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
4	大成纳斯达克 100 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
5	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年 1 期）摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 28 日
6	大成纳斯达克 100 指数证券投资	中国证监会指定报	2017 年 6 月 28 日

	基金更新招募说明书（2017 年 1 期）	刊及本公司网站	
7	大成纳斯达克 100 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
8	大成纳斯达克 100 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
9	大成纳斯达克 100 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
10	大成纳斯达克 100 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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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 3 月 31 日
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日

	交易实施费率优惠活动的公告		
23	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
24	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
25	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
26	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 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公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 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公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
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 3 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 4 月 18 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 4 月 22 日
40	大成基金管理有限公司关于公司	中国证监会指定报	2017 年 5 月 12 日

	旗下部分基金估值调整的公告	刊及本公司网站	
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 5 月 24 日
42	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
43	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
44	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹏）	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（陈翔凯）	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
47	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
48	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
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 28 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 29 日
51	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
52	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
53	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富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
54	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

注：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纳斯达克 100 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成纳斯达克 100 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

本期报告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