

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 29 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 2018 年 8 月 28 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 2018 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.....	100
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	101
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.....	102
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.....	102
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.....	102
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.....	102
7.11 投资组合报告附注.....	102
§8 基金份额持有人信息.....	104
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	104
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	104
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.....	104
§9 开放式基金份额变动.....	105
§10 重大事件揭示.....	106
10.1 基金份额持有人大会决议.....	106
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.....	106
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	106
10.4 基金投资策略的改变.....	106
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	106
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.....	106
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	106
10.8 其他重大事件.....	108
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	110

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	110
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	110
§12 备查文件目录.....	111
12.1 备查文件目录.....	111
12.2 存放地点.....	111
12.3 查阅方式.....	111

§ 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
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	139,770,596.75 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	赵冰	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	北京市西城区复兴门内大街 1

	7088 号招商银行大厦 32 层	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	陈四清

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

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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	6,567,652.80
本期利润	1,470,505.56
加权平均基金份额本期利润	0.0103
本期加权平均净值利润率	0.62%
本期基金份额净值增长率	2.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	66,098,822.84
期末可供分配基金份额利润	0.4729
期末基金资产净值	242,508,285.85
期末基金份额净值	1.735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	92.58%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

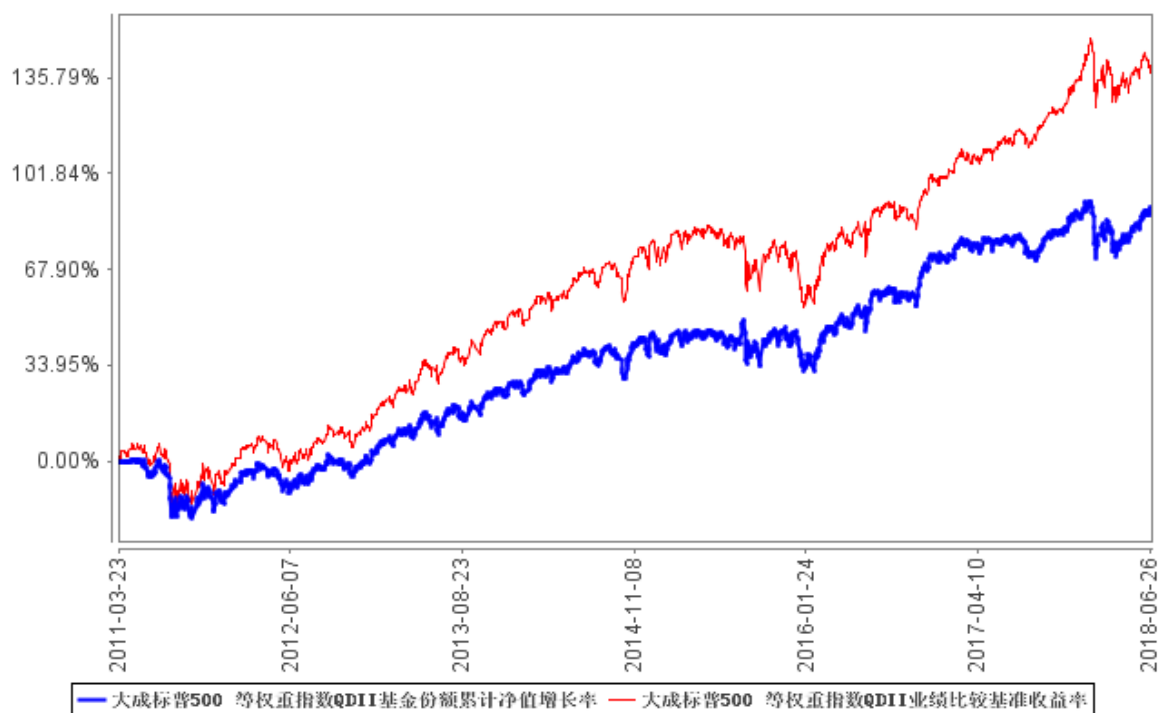
3.2 基金净值表现

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	3.83%	0.49%	0.95%	0.50%	2.88%	-0.01%
过去三个月	7.50%	0.70%	2.80%	0.73%	4.70%	-0.03%
过去六个月	2.04%	0.96%	1.77%	0.96%	0.27%	0.00%
过去一	7.00%	0.75%	11.98%	0.74%	-4.98%	0.01%

年						
过去三年	33.96%	0.84%	34.90%	0.87%	-0.94%	-0.03%
自基金合同生效起至今	92.58%	0.94%	138.83%	0.99%	-46.25%	-0.05%

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 2018 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，5 只 QDII 基金及 75 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	-	15 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。2017 年 8 月 10 日起担任大成恒生指数证券投资基金 (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

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变动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变动导致个别组合间的成交价格存在一定差异，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 1 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 2 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

2018 年上半年，全球主要发达经济体的宏观经济保持了稳定增长，美国宏观经济也保持了稳定增长的势头，美国股票市场也保持了在震荡中略微上涨的趋势。

美国的宏观经济数据表明美国仍然处于经济增长周期内，而且经济增长速度保持在较快水平。美国 2018 年 1 季度年化季环比 GDP 增长率为 2.0%，与历史历年的平均增速相比较，保持在较佳的水平区间。进入到 2 季度后，各种宏观经济指标均创出极佳水平，例如，6 月份的制造业 PMI 指数保持在 58.2 的较高水平上；失业率为 3.8%，继续创出金融海啸以来的最低水平，同时个人收入增长状况良好，因此密歇根大学消费者信心指数也持续保持在高位；反映房地产市场状况的全美建筑商协会市场指数也保持在历史高位。根据彭博的数据，当前经济学家对美国 2 季度的年化季环比 GDP 增长率的一致预期为 4.2%，创出 2015 年以来的新高。为了缩小美国对外贸易逆差，特朗普政府与多国产生了贸易纠纷，这也造成了股票市场的短期波动。由于宏观经济表现较好，美联储于 3 月份及 6 月份各加息一次，当前联邦基金目标利率上限为 2.00%。

在上述宏观条件下，美股主要指数在 1 季度呈现大幅震荡，在 2 季度呈现小幅上升的势头，从而使得在今年上半年期间，主要美股指数也取得了小幅的正收益。

从汇率方面来看，在 1 季度，美元汇率出现了小幅下跌，而在 2 季度，美元汇率又出现了明显上升，从而使得在今年上半年期间，美元汇率也取得了小幅升值，这利好于本基金净值表现。

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 1.735 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.04%，业绩比较基准收益率为 1.77%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年，预计美国宏观经济将继续快速增长。

首先，美国仍然处于本轮经济增长的中后期进程中，美国宏观经济有望会继续保持快速增长的势头。

其次，在非常有利的宏观经济环境下，美国主要指数成份公司的盈利会继续保持快速增加，而这正是决定美股指数上涨的最重要因素。

另外，从 2018 年开始实施的减税政策，将进一步直接增加上市公司盈利水平，降低美股的估值水平，对美股指数上涨起到额外支持作用。

2018 年下半年美联储预计还会继续采取加息及缩表的行动。但是，由于美股是基本面市场，资金面的变动不会对宏观经济及股票市场产生较大的负面影响。

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、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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验，估值委员会成员中包括三名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理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 7,341,073.02 元（每十份基金份额分红 0.4740 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遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	16,906,566.55	19,639,900.00
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	229,791,944.52	242,240,870.71
其中：股票投资		229,791,944.52	242,240,870.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	3,099.01	1,873.38
应收股利		244,103.38	296,914.38
应收申购款		954,446.45	2,189,484.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	109,959.72	314,640.55
资产总计		248,010,119.63	264,683,683.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		5,077,356.47	3,971,308.85
应付管理人报酬		189,434.53	216,369.14
应付托管费		47,358.62	54,092.28
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	187,684.16	220,160.79
负债合计		5,501,833.78	4,461,931.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	139,770,596.75	148,919,838.60
未分配利润	6.4.3.10	102,737,689.10	111,301,913.96
所有者权益合计		242,508,285.85	260,221,752.56
负债和所有者权益总计		248,010,119.63	264,683,683.62

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.735 元，基金份额总额 139,770,596.75 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		3,288,857.40	13,433,617.13
1. 利息收入		40,903.62	35,278.38
其中：存款利息收入	6.4.3.11	40,903.62	35,278.38
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）		8,148,638.99	10,976,820.98
其中：股票投资收益	6.4.3.12	5,555,203.91	7,786,755.39
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	2,593,435.08	3,190,065.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-5,097,147.24	3,032,954.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		33,448.16	-830,279.10
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	163,013.87	218,842.40

减：二、费用		1,818,351.84	2,355,340.99
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,182,830.05	1,538,141.29
2. 托管费	6.4.6.2.2	295,707.53	384,535.34
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	54,969.91	61,729.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	284,844.35	370,934.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,470,505.56	11,078,276.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,470,505.56	11,078,276.14

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	148,919,838.60	111,301,913.96	260,221,752.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,470,505.56	1,470,505.56
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）	-9,149,241.85	-2,693,657.40	-11,842,899.25
其中：1.基金申购款	85,194,106.53	59,040,564.01	144,234,670.54
2.基金赎回款	-94,343,348.38	-61,734,221.41	-156,077,569.79
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）	-	-7,341,073.02	-7,341,073.02
五、期末所有者权益（基金净值）	139,770,596.75	102,737,689.10	242,508,285.85

项目	上年度可比期间 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(基金净值)	168,976,931.05	112,493,438.96	281,470,370.01

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》、

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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6 号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》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) 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。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入和利息收入，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。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	16,906,566.55
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-

合计:	16,906,566.55
-----	---------------

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	207,458,878.61	229,791,944.52	22,333,065.91
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	207,458,878.61	229,791,944.52	22,333,065.91

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

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	3,099.01
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	-

应收资产支持证券利息	-
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	3,099.01

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	109,959.72
合计	109,959.72

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 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,121.45
预提费用	173,562.71
合计	187,684.16

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,919,838.60	148,919,838.60
本期申购	85,194,106.53	85,194,106.53
本期赎回(以“-”号填列)	-94,343,348.38	-94,343,348.38
本期末	139,770,596.75	139,770,596.75

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	70,587,652.75	40,714,261.21	111,301,913.96
本期利润	6,567,652.80	-5,097,147.24	1,470,505.56
本期基金份额交易产生的变动数	-3,715,409.69	1,021,752.29	-2,693,657.40
其中：基金申购款	38,544,209.22	20,496,354.79	59,040,564.01
基金赎回款	-42,259,618.91	-19,474,602.50	-61,734,221.41
本期已分配利润	-7,341,073.02	-	-7,341,073.02
本期末	66,098,822.84	36,638,866.26	102,737,689.10

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	40,903.62
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	40,903.62

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	94,100,188.74
减：卖出股票成本总额	88,544,984.83
买卖股票差价收入	5,555,203.91

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,593,435.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,593,435.08

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,097,147.24
——股票投资	-5,097,147.24
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,097,147.24

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	163,013.87
合计	163,013.87

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	54,969.91
银行间市场交易费用	-
合计	54,969.91

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	7,295.76
其他	-
银行划款手续费	-
指数使用费	103,985.88
合计	284,844.35

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

注：1. 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

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,182,830.05	1,538,141.29
其中：支付销售机构的客户维护费	476,407.00	576,778.43

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	295,707.53	384,535.34
----------------	------------	------------

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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	2,746,447.44	-	17,188,105.37	-
中国银行	14,160,119.11	40,903.62	4,831,750.26	35,278.38

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。

6.4.6.6 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。

6.4.6.7 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

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	2018 年 1 月 18 日	2018 年 1 月 17 日	0.4740	2,852,333.67	4,488,739.35	7,341,073.02	
合计	-	-	0.4740	2,852,333.67	4,488,739.35	7,341,073.02	

6.4.8 期末（2018 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。本基金的活期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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监

控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2018 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	16,906,566.55	-	-	-	16,906,566.55
交易性金融资产	-	-	-	229,791,944.52	229,791,944.52
应收利息	-	-	-	3,099.01	3,099.01
应收股利	-	-	-	244,103.38	244,103.38

应收申购款	-	-	-	954,446.45	954,446.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	109,959.72	109,959.72
资产总计	16,906,566.55	-	-	-231,103,553.08	248,010,119.63
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,077,356.47	5,077,356.47
应付管理人报酬	-	-	-	189,434.53	189,434.53
应付托管费	-	-	-	47,358.62	47,358.62
其他负债	-	-	-	187,684.16	187,684.16
负债总计	-	-	-	5,501,833.78	5,501,833.78
利率敏感度缺口	16,906,566.55	-	-	-225,601,719.30	242,508,285.85
上年度末 2017 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	19,639,900.00	-	-	-	19,639,900.00
交易性金融资产	-	-	-	-242,240,870.71	242,240,870.71
应收利息	-	-	-	1,873.38	1,873.38
应收股利	-	-	-	296,914.38	296,914.38
应收申购款	51,080.68	-	-	2,138,403.92	2,189,484.60
其他	-	-	-	314,640.55	314,640.55
资产总计	19,690,980.68	-	-	-244,992,702.94	264,683,683.62
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,971,308.85	3,971,308.85
应付管理人报酬	-	-	-	216,369.14	216,369.14
应付托管费	-	-	-	54,092.28	54,092.28
其他负债	-	-	-	220,160.79	220,160.79
负债总计	-	-	-	4,461,931.06	4,461,931.06
利率敏感度缺口	19,690,980.68	-	-	-240,530,771.88	260,221,752.56

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 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（2017 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 2018 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	2,746,762.19	-	-	2,746,762.19
交易性金融资产	229,791,944.52	-	-	229,791,944.52
应收股利	244,103.38	-	-	244,103.38
资产合计	232,782,810.09	-	-	232,782,810.09
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	232,782,810.09	-	-	232,782,810.09
项目	上年度末 2017 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	10,132,849.55	-	-	10,132,849.55
交易性金融资产	242,240,870.71	-	-	242,240,870.71
应收股利	296,914.38	-	-	296,914.38
应收利息	314,640.55	-	-	314,640.55
资产合计	252,985,275.19	-	-	252,985,275.19
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	252,985,275.19	-	-	252,985,275.19

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	美元相对人民币升值 5%	12,125,414.29	12,650,000.00
	美元相对人民币贬值	-12,125,414.29	-12,650,000.00

	5%		
--	----	--	--

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	229,791,944.52	94.76	242,240,870.71	93.09
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	229,791,944.52	94.76	242,240,870.71	93.09

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	11,460,000.00	12,440,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-11,460,000.00	-12,440,000.00	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	229,791,944.52	92.65
	其中:普通股票	229,791,944.52	92.65
	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	16,906,566.55	6.82
8	其他各项资产	1,311,608.56	0.53
9	合计	248,010,119.63	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	229,791,944.52	94.76
合计	229,791,944.52	94.76

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	35,215,865.60	14.52
信息技术	31,662,315.33	13.06
工业	30,595,831.43	12.62
金融	29,979,914.99	12.36
医疗保健	29,031,607.92	11.97
消费者常用品	15,944,084.35	6.57
房地产	15,756,956.18	6.50
能源	14,652,622.40	6.04
公用事业	14,541,849.23	6.00
基础材料	10,783,987.89	4.45
电信服务	1,626,909.20	0.67
合计	229,791,944.52	94.76

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	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约交易所	美国	3,071	652,461.67	0.27
2	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	美国	2,096	562,224.68	0.23

				所				
3	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约 交易 所	美国	834	561,426. 19	0.2 3
4	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约 交易 所	美国	780	552,531. 09	0.2 3
5	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约 交易 所	美国	703	540,082. 16	0.2 2
6	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约 交易 所	美国	2,81 5	529,901. 99	0.2 2
7	McCormick & Co Inc-Non Voting Shares	味好美	MKC UN	纽约 交易 所	美国	689	529,235. 43	0.2 2
8	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约 交易 所	美国	3,03 5	527,738. 69	0.2 2
9	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约 交易 所	美国	2,76 8	522,886. 08	0.2 2
10	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约 交易 所	美国	1,69 0	522,761. 02	0.2 2
11	Church & Dwight Co	切迟杜威股份有限公 司	CHD UN	纽约 交	美国	1,48 1	520,924. 65	0.2 1

				易所				
12	Vertex Pharmaceuticals Inc	Vertex 制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	美国	462	519,545.49	0.21
13	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	美国	1,396	519,291.41	0.21
14	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	美国	1,120	517,778.06	0.21
15	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约交易所	美国	3,553	517,663.33	0.21
16	Evergy Inc.	Evergy 公司	EVERG UN	纽约交易所	美国	1,391	516,787.23	0.21
17	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	美国	2,816	516,302.30	0.21
18	Dominion Energy Inc	Dominion 能源公司	D UN	纽约交易所	美国	1,140	514,276.56	0.21
19	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交	美国	225	513,598.69	0.21

				易所				
20	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约 交易 所	美 国	1, 15 4	510, 742. 37	0. 2 1
21	Welltower Inc	Welltower 房地产信托	WELL UN	纽约 交易 所	美 国	1, 23 1	510, 612. 22	0. 2 1
22	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	2, 55 7	510, 266. 37	0. 2 1
23	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	197	510, 217. 34	0. 2 1
24	Concho Resources Inc	康丘资源公司	CXO UN	纽约 交易 所	美 国	556	508, 966. 08	0. 2 1
25	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1, 22 0	507, 098. 87	0. 2 1
26	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约 交易 所	美 国	961	506, 649. 47	0. 2 1
27	Molson Coors Brewing	莫尔森-康胜	TAP	纽 美		1, 12	505, 567.	0. 2

	Co B		UN	约 交 易 所	国	3	26	1
28	Southern Co	南方	SO UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,64 9	505,277. 92	0.2 1
29	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,61 1	503,973. 72	0.2 1
30	Clorox Co	高乐氏公司	CLX UN	纽 约 交 易 所	美 国	563	503,825. 97	0.2 1
31	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,29 9	503,750. 80	0.2 1
32	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽 约 交 易 所	美 国	962	503,357. 58	0.2 1
33	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,97 4	503,116. 21	0.2 1
34	WEC Energy Group Inc	WEC 能源集团股份有限 公司	WEC UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,17 6	503,049. 51	0.2 1
35	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽 约 交 易 所	美 国	455	502,852. 67	0.2 1

36	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约 交易所	美国	1,78 4	502,851. 01	0.2 1
37	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约 交易所	美国	1,09 7	502,644. 91	0.2 1
38	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约 交易所	美国	1,40 2	502,228. 26	0.2 1
39	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	696	501,363. 07	0.2 1
40	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约 交易所	美国	1,24 4	500,859. 42	0.2 1
41	Twitter Inc	推特公司	TWTR UN	纽约 交易所	美国	1,73 2	500,456. 07	0.2 1
42	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT UN	纽约 交易所	美国	1,78 6	500,105. 92	0.2 1
43	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约 交易所	美国	606	498,921. 94	0.2 1
44	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯 斯	美国	960	498,817. 53	0.2 1

				达 克 交 易 所				
45	CenturyLink Inc	世纪电信公司	CTL UN	纽 约 交 易 所	美 国	4,04 4	498,760. 37	0.2 1
46	Charter Communications Inc A	特许通讯	CHTR UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	257	498,593. 69	0.2 1
47	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽 约 交 易 所	美 国	935	498,386. 13	0.2 1
48	Assurant Inc	艾斯兰公司	AIZ UN	纽 约 交 易 所	美 国	727	497,814. 66	0.2 1
49	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,09 4	497,538. 81	0.2 1
50	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽 约 交 易 所	美 国	962	496,355. 89	0.2 0
51	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽 约 交 易 所	美 国	5,59 0	495,992. 91	0.2 0
52	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽 约	美 国	723	495,745. 38	0.2 0

				交易所				
53	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	877	495,439.50	0.20
54	Alliance Data Systems Corp	联合数据系统公司	ADS UN	纽约交易所	美国	321	495,300.15	0.20
55	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	美国	4,236	495,253.30	0.20
56	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,638	495,079.42	0.20
57	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约交易所	美国	4,403	494,967.80	0.20
58	Smucker J.M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	美国	696	494,961.91	0.20
59	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UQ	纳斯达克交易所	美国	453	494,917.45	0.20
60	DISH Network Corp A	DISH 网络公司	DISH UQ	纳斯达克交易所	美国	2,225	494,804.24	0.20

				达 克 交 易 所				
61	Federal Realty Invt Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	纽 约 交 易 所	美 国	590	494,025. 13	0.2 0
62	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽 约 交 易 所	美 国	692	493,674. 05	0.2 0
63	Mid-America Apt Communities	Mid-America Apartment Commun	MAA UN	纽 约 交 易 所	美 国	741	493,575. 00	0.2 0
64	Newell Brands Inc	纽威尔品牌公司	NWL UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,89 2	493,496. 99	0.2 0
65	Regency Centers Corp	Regency Centers 公 司	REG UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,20 0	492,910. 23	0.2 0
66	Take-Two Interactive Software	TAKE-TWO 互动软件	TTWO UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	629	492,595. 55	0.2 0
67	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,69 3	492,435. 69	0.2 0
68	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽 约	美 国	312	491,384. 18	0.2 0

				交易所				
69	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约 交易所	美国	515	491,266. 34	0.2 0
70	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约 交易所	美国	2,87 5	491,166. 76	0.2 0
71	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约 交易所	美国	1,17 2	490,637. 03	0.2 0
72	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约 交易所	美国	1,34 3	490,334. 66	0.2 0
73	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约 交易所	美国	2,73 3	490,234. 68	0.2 0
74	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约 交易所	美国	2,44 9	490,172. 62	0.2 0
75	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,86 1	489,461. 33	0.2 0
76	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UQ	纳斯 达克	美国	172	489,238. 55	0.2 0

				交易所				
77	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	635	488,933.33	0.20
78	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	美国	997	487,631.77	0.20
79	Monster Beverage Corp New	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	美国	1,286	487,562.70	0.20
80	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	美国	1,079	487,543.58	0.20
81	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	美国	966	487,490.05	0.20
82	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	美国	593	487,120.38	0.20
83	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	美国	987	487,050.97	0.20
84	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	美国	1,663	487,010.74	0.20

				交易所				
85	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	美国	1,794	486,677.40	0.20
86	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	美国	307	486,617.32	0.20
87	Michael Kors Holdings Ltd	迈克尔高司控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	美国	1,104	486,494.78	0.20
88	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	美国	1,653	485,613.45	0.20
89	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	美国	863	485,360.69	0.20
90	Simon Property Group A	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约交易所	美国	431	485,340.12	0.20
91	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	NOV UN	纽约交易所	美国	1,690	485,301.14	0.20
92	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约交易所	美国	595	485,062.62	0.20

				交易所				
93	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约 交易所	美国	1,72 2	484,919. 50	0.2 0
94	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约 交易所	美国	323	484,836. 53	0.2 0
95	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公 司	ATVI UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	960	484,779. 76	0.2 0
96	Facebook Inc A	Facebook 公司	FB UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	377	484,723. 12	0.2 0
97	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约 交易所	美国	906	484,306. 93	0.2 0
98	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约 交易所	美国	999	484,181. 28	0.2 0
99	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	350	483,957. 97	0.2 0

10 0	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约 交易 所	美国	1,28 3	483,454. 12	0.2 0
10 1	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	925	483,446. 84	0.2 0
10 2	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约 交易 所	美国	2,23 4	483,354. 54	0.2 0
10 3	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约 交易 所	美国	1,12 7	483,282. 22	0.2 0
10 4	Comcast Corp A	康卡斯特	CMCS A UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	2,22 5	483,026. 69	0.2 0
10 5	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约 交易 所	美国	1,63 5	482,921. 81	0.2 0
10 6	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约 交易 所	美国	454	482,792. 66	0.2 0
10 7	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约 交易 所	美国	179	482,714. 25	0.2 0

108	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	美国	790	482,514. 89	0.2 0
109	Archer-Daniels-Midl and Co	Archer-Daniels-Midl and 公司	ADM UN	纽约交易所	美国	1,59 1	482,452. 90	0.2 0
110	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	美国	517	482,398. 71	0.2 0
111	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	美国	2,24 9	481,986. 95	0.2 0
112	Salesforce.com	Salesforce.com 股份 有限公司	CRM UN	纽约交易所	美国	534	481,937. 26	0.2 0
113	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	美国	1,04 2	481,442. 74	0.2 0
114	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件公司	AAP UN	纽约交易所	美国	536	481,259. 72	0.2 0
115	Dentsply Sirona Inc.	登士柏西诺德公司	XRAY UQ	纳斯达克交	美国	1,66 1	481,039. 85	0.2 0

				易所				
11 6	Extra Space Storage Inc	Extra Space 仓储公司	EXR UN	纽约交易所	美国	728	480,773. 27	0.2 0
11 7	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMY UN	纽约交易所	美国	1,313	480,771. 55	0.2 0
11 8	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	美国	499	480,626. 05	0.2 0
11 9	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	美国	339	480,613. 48	0.2 0
12 0	Philip Morris International	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	美国	898	479,733. 41	0.2 0
12 1	Coty Inc.	科蒂集团	COTY UN	纽约交易所	美国	5,139	479,438. 17	0.2 0
12 2	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	美国	2,051	478,772. 41	0.2 0
12 3	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	美国	3,087	478,772. 41	0.2 0
12 4	Hershey Co	好时食品	HSY UN	纽约交易所	美国	777	478,430. 60	0.2 0

				交易所				
12 5	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约 交易所	美国	733	478,206. 83	0.2 0
12 6	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约 交易所	美国	2,06 2	477,656. 46	0.2 0
12 7	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	414	477,126. 47	0.2 0
12 8	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约 交易所	美国	1,34 0	476,915. 26	0.2 0
12 9	Cooper Companies Inc	库柏股份有限公司	COO UN	纽约 交易所	美国	306	476,710. 81	0.2 0
13 0	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,27 5	476,390. 24	0.2 0
13 1	Accenture plc A	埃森哲公司	ACN UN	纽约 交易所	美国	440	476,260. 22	0.2 0
13 2	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽 约	美国	716	476,259. 43	0.2 0

				交易所				
13 3	Envision Healthcare Corp	Envision Healthcare Corp	EVHC UN	纽约交易所	美国	1,635	476,106.39	0.20
13 4	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	美国	1,414	476,026.79	0.20
13 5	Walt Disney Co	华特迪士尼	DIS UN	纽约交易所	美国	686	475,731.29	0.20
13 6	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	美国	1,429	475,687.16	0.20
13 7	Duke Realty Corp	杜克房地产公司	DRE UN	纽约交易所	美国	2,475	475,397.75	0.20
13 8	Schein Henry Inc	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克交易所	美国	989	475,342.90	0.20
13 9	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	美国	805	475,164.84	0.20
14 0	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	美国	571	473,846.62	0.20

				所				
14 1	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约 交易 所	美国	1,02 8	473,545. 83	0.2 0
14 2	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,04 7	473,500. 11	0.2 0
14 3	Digital Realty Trust	数字房地产信托有限 公司	DLR UN	纽 约 交 易 所	美国	641	473,237. 63	0.2 0
14 4	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽 约 交 易 所	美国	1,04 6	473,117. 07	0.2 0
14 5	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽 约 交 易 所	美国	751	472,955. 76	0.2 0
14 6	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	900	472,941. 33	0.2 0
14 7	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics 股 份有限公	DGX UN	纽 约 交 易 所	美国	650	472,828. 85	0.1 9
14 8	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽 约 交 易	美国	1,91 9	472,464. 87	0.1 9

				所				
14 9	Cboe Global Markets, Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UQ	纳斯达克 交易所	美国	686	472,372. 44	0.1 9
15 0	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	纽约 交易所	美国	689	472,295. 55	0.1 9
15 1	Qorvo, Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克 交易所	美国	890	472,103. 01	0.1 9
15 2	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约 交易所	美国	564	471,806. 72	0.1 9
15 3	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克 交易所	美国	932	471,688. 68	0.1 9
15 4	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约 交易所	美国	672	471,447. 04	0.1 9
15 5	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约 交易所	美国	1,62 4	471,291. 42	0.1 9
15 6	TripAdvisor Inc. A	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳 斯	美国	1,27 8	471,084. 58	0.1 9

				达 克 交 易 所				
15 7	Abiomed Inc	阿比奥梅德公司	ABMD UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	174	470,934. 52	0.1 9
15 8	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有 限公司	AVB UN	纽 约 交 易 所	美 国	414	470,853. 53	0.1 9
15 9	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,25 2	470,778. 77	0.1 9
16 0	TransDigm Group	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽 约 交 易 所	美 国	206	470,432. 58	0.1 9
16 1	Tapestry, Inc	TPR-DRS-RS	TPR UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,52 2	470,391. 43	0.1 9
16 2	IHS Markit Ltd	IHS Markit 有限公司	INFO UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,37 8	470,380. 84	0.1 9
16 3	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽 约 交 易 所	美 国	540	470,202. 06	0.1 9

164	United Continental Holding Inc	联合大陆控股公司	UAL UN	纽约交易所	美国	1,019	470,141.65	0.19
165	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	美国	517	470,083.89	0.19
166	Perrigo Company plc	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	美国	974	469,873.48	0.19
167	Walmart Inc.	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约交易所	美国	829	469,804.07	0.19
168	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约交易所	美国	429	469,576.60	0.19
169	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约交易所	美国	3,401	469,413.76	0.19
170	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UQ	纳斯达克交易所	美国	254	469,379.35	0.19
171	Expedia Group, Inc.	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交	美国	590	469,197.00	0.19

				易所				
17 2	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约 交易所	美国	1,67 6	469,082. 53	0.1 9
17 3	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约 交易所	美国	673	469,076. 05	0.1 9
17 4	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约 交易所	美国	386	468,660. 39	0.1 9
17 5	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约 交易所	美国	855	468,019. 58	0.1 9
17 6	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约 交易所	美国	548	467,958. 24	0.1 9
17 7	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	527	467,739. 23	0.1 9
17 8	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	346	467,724. 34	0.1 9
17 9	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约 交	美国	829	467,719. 71	0.1 9

				易所				
180	Nielsen Holdings plc	尼尔森控股公开有限公司	NLSN UN	纽约交易所	美国	2,285	467,628.54	0.19
181	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	美国	787	467,247.82	0.19
182	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UQ	纳斯达克交易所	美国	324	467,215.06	0.19
183	Cisco Systems Inc	思科-T	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,641	467,212.88	0.19
184	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约交易所	美国	861	466,974.29	0.19
185	GGP Inc	GGP 股份有限公司	GGP UN	纽约交易所	美国	3,453	466,766.66	0.19
186	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	美国	446	466,701.22	0.19
187	Everest Re Group Ltd	安富来集团有限公司	RE UN	纽约交	美国	306	466,648.15	0.19

				易所				
188	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCLUQ	纳斯达克交易所	美国	1,080	466,557.64	0.19
189	Procter & Gamble	宝洁	PGUN	纽约交易所	美国	903	466,392.09	0.19
190	Carmax Inc	CarMax 股份有限公司	KMXUN	纽约交易所	美国	967	466,240.64	0.19
191	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZOUN	纽约交易所	美国	105	466,123.92	0.19
192	PayPal Holdings Inc.	Paypal 控股股份有限公司	PYPLUQ	纳斯达克交易所	美国	846	466,115.78	0.19
193	Baxter Intl Inc	百特	BAXUN	纽约交易所	美国	954	466,095.54	0.19
194	L Brands Inc	L Brands 股份有限公司	LBUN	纽约交易所	美国	1,910	466,078.60	0.19
195	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公司	JWNUN	纽约交	美国	1,360	465,946.27	0.19

				易所				
19 6	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约 交易所	美国	1,67 3	465,807. 58	0.1 9
19 7	Keurig Dr Pepper Inc	澎泉思蓝宝集团公司	KDP UN	纽约 交易所	美国	577	465,768. 94	0.1 9
19 8	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,15 4	465,768. 94	0.1 9
19 9	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约 交易所	美国	1,10 5	465,659. 44	0.1 9
20 0	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公 司	COG UN	纽约 交易所	美国	2,95 7	465,653. 81	0.1 9
20 1	Jefferies Financial Group Inc.	Jefferies Financial 公司	JEF UN	纽约 交易所	美国	3,09 4	465,527. 83	0.1 9
20 2	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	910	464,889. 59	0.1 9
20 3	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公 司	PXD UN	纽约 交	美国	371	464,538. 52	0.1 9

				易所				
204	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约交易所	美国	1,870	464,484.00	0.19
205	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	美国	828	464,306.67	0.19
206	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达克交易所	美国	4,681	464,274.85	0.19
207	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	美国	1,860	464,092.29	0.19
208	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UQ	纳斯达克交易所	美国	205	464,079.72	0.19
209	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,967	463,979.48	0.19
210	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS UQ	纳斯达克	美国	1,619	463,948.65	0.19

				交易所				
21 1	Visa Inc A	维萨公司	V UN	纽约交易所	美国	529	463,599.03	0.19
21 2	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	美国	479	463,454.26	0.19
21 3	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约交易所	美国	822	463,335.22	0.19
21 4	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	美国	945	463,261.58	0.19
21 5	Grainger W.W. Inc	固安捷公司	GWV UN	纽约交易所	美国	227	463,206.99	0.19
21 6	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	美国	1,065	462,896.34	0.19
21 7	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	美国	500	462,765.00	0.19
21 8	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	美国	559	462,741.78	0.19

				所				
21 9	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克 交易所	美国	667	462,687. 46	0.1 9
22 0	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约 交易所	美国	564	462,589. 27	0.1 9
22 1	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约 交易所	美国	835	462,320. 37	0.1 9
22 2	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	2,19 0	462,242. 29	0.1 9
22 3	Allergan plc	艾尔建有限公司	AGN UN	纽 约 交 易 所	美国	419	462,207. 09	0.1 9
22 4	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽 约 交 易 所	美国	493	462,157. 86	0.1 9
22 5	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽 约 交 易 所	美国	673	461,906. 76	0.1 9
22 6	Essex Property Trust	埃塞克斯房地产信托 公司	ESS UN	纽 约 交 易 所	美国	292	461,894. 52	0.1 9

				所				
22 7	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约 交易 所	美国	1,25 9	461,831. 80	0.1 9
22 8	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约 交易 所	美国	3,43 0	461,388. 09	0.1 9
22 9	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约 交易 所	美国	1,92 2	461,376. 58	0.1 9
23 0	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约 交易 所	美国	1,00 4	461,294. 53	0.1 9
23 1	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约 交易 所	美国	462	461,189. 86	0.1 9
23 2	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	41	461,122. 76	0.1 9
23 3	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约 交易 所	美国	284	461,021. 93	0.1 9
23 4	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约 交易 所	美国	234	460,815. 89	0.1 9
23	Lilly Eli & Co	礼来	LLY	纽 美		816	460,709.	0.1

5			UN	约 交 易 所	国		09	9
23 6	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	377	460,452. 04	0.1 9
23 7	CVS Health Corporation	CVS 保健公司	CVS UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,08 1	460,266. 25	0.1 9
23 8	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽 约 交 易 所	美 国	853	460,095. 60	0.1 9
23 9	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	403	459,836. 17	0.1 9
24 0	OReilly Automotive	OReilly 汽车股份有 限公司	ORLY UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	254	459,766. 23	0.1 9
24 1	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,00 9	459,652. 89	0.1 9
24 2	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽 约 交 易 所	美 国	854	459,617. 88	0.1 9

24 3	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	所 纽 约 交 易 所	美 国	677	459,590. 36	0.1 9
24 4	Lennar Corp A	Lennar 公司	LEN UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,32 2	459,225. 12	0.1 9
24 5	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	550	459,149. 03	0.1 9
24 6	XL Group Ltd	XL Group Ltd	XL UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,23 9	458,676. 28	0.1 9
24 7	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	284	458,146. 88	0.1 9
24 8	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽 约 交 易 所	美 国	819	458,013. 49	0.1 9
24 9	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	528	457,971. 41	0.1 9
25 0	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽 约 交 易 所	美 国	754	457,932. 64	0.1 9

				所				
25 1	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约 交易 所	美国	1,14 0	457,855. 49	0.1 9
25 2	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern	KSU UN	纽约 交易 所	美国	653	457,814. 99	0.1 9
25 3	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约 交易 所	美国	1,62 9	457,544. 84	0.1 9
25 4	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	3,34 8	457,446. 58	0.1 9
25 5	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	715	457,238. 49	0.1 9
25 6	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约 交易 所	美国	1,03 2	456,951. 92	0.1 9
25 7	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约 交易 所	美国	569	456,826. 34	0.1 9
25 8	Universal Health Services B	Universal Health Services 公	UHS UN	纽约 交易 所	美国	619	456,422. 07	0.1 9

259	Gartner Inc	高德纳咨询股份有限公司	ITUN	纽约交易所	美国	519	456,380.65	0.19
260	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	美国	973	456,064.51	0.19
261	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	美国	144	455,891.15	0.19
262	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	美国	372	455,526.71	0.19
263	Medtronic plc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	美国	804	455,423.49	0.19
264	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	美国	4,191	455,329.40	0.19
265	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约交易所	美国	904	455,304.66	0.19

266	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,150	454,947.49	0.19
267	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	美国	314	454,727.03	0.19
268	Broadridge Financial Solutions Inc.	布罗德里奇公司	BR UN	纽约交易所	美国	597	454,657.68	0.19
269	Fortive Corp	Fortive Corp	FTV UN	纽约交易所	美国	891	454,593.57	0.19
270	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约交易所	美国	728	454,376.74	0.19
271	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	美国	2,503	454,112.21	0.19
272	Gallagher Arthur J. & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	纽约交易所	美国	1,051	453,960.16	0.19
273	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	美国	1,371	453,749.36	0.19
274	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UQ	纳斯达克	美国	637	453,678.29	0.19

				达 克 交 易 所				
27 5	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽 约 交 易 所	美 国	610	453,297. 31	0.1 9
27 6	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽 约 交 易 所	美 国	336	453,283. 68	0.1 9
27 7	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,20 5	452,786. 84	0.1 9
27 8	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽 约 交 易 所	美 国	381	452,581. 59	0.1 9
27 9	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽 约 交 易 所	美 国	348	452,502. 39	0.1 9
28 0	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,69 2	452,289. 60	0.1 9
28 1	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕集团	CBRE UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,43 1	452,019. 25	0.1 9
28 2	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,40 0	451,860. 85	0.1 9

				所				
28 3	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约 交易 所	美国	350	451,814. 53	0.1 9
28 4	Incyte Corp	Incyte 有限公司	INCY UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,01 9	451,735. 13	0.1 9
28 5	Biogen Inc	百健	BIIB UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	235	451,294. 47	0.1 9
28 6	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约 交易 所	美国	1,01 7	451,050. 38	0.1 9
28 7	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约 交易 所	美国	401	450,920. 96	0.1 9
28 8	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约 交易 所	美国	545	450,864. 06	0.1 9
28 9	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	932	450,783. 66	0.1 9
29 0	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈巴奥米特控股公 司	ZBH UN	纽 约	美国	611	450,523. 24	0.1 9

				交易所				
29 1	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约 交易所	美国	746	450,507. 22	0.1 9
29 2	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	3,23 1	450,439. 40	0.1 9
29 3	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约 交易所	美国	880	450,436. 95	0.1 9
29 4	Huntington Ingalls Industries Inc.	亨廷顿英戈尔斯工业 公司	HII UN	纽约 交易所	美国	314	450,405. 59	0.1 9
29 5	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约 交易所	美国	712	450,232. 10	0.1 9
29 6	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约 交易所	美国	924	449,665. 46	0.1 9
29 7	Baker Hughes, a GE company	Baker Hughes a GE Co	BHGE UN	纽约 交易所	美国	2,05 7	449,549. 73	0.1 9
29 8	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约 交易所	美国	4,99 1	449,449. 16	0.1 9
29	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY	纽 美		3,47	449,277.	0.1

9			UN	约 交 易 所	国	5	06	9
30 0	Global Payments Inc	环汇公司	GPN UN	纽 约 交 易 所	美 国	609	449,250. 00	0.1 9
30 1	Martin Marietta Materials	Martin Marietta 材 料股份有限	MLM UN	纽 约 交 易 所	美 国	304	449,216. 32	0.1 9
30 2	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽 约 交 易 所	美 国	504	449,126. 34	0.1 9
30 3	CSX Corporation	CSX 公司	CSX UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,06 4	449,015. 18	0.1 9
30 4	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	688	448,894. 49	0.1 9
30 5	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,02 9	448,747. 01	0.1 9
30 6	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽 约 交 易 所	美 国	692	448,711. 35	0.1 9
30	Helmerich & Payne	Helmerich & Payne	HP	纽 美	美	1,06	448,452.	0.1

7	Inc	Inc	UN	约 交 易 所	国	3	50	8
30 8	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,27 8	448,337. 90	0.1 8
30 9	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽 约 交 易 所	美 国	157	448,109. 83	0.1 8
31 0	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽 约 交 易 所	美 国	398	448,074. 17	0.1 8
31 1	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	706	448,072. 98	0.1 8
31 2	DowDuPont Inc.	陶氏杜邦	DWDP UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,02 7	447,942. 76	0.1 8
31 3	Mettler-Toledo Intl	梅特勒-托利多国际股 份有限公	MTD UN	纽 约 交 易 所	美 国	117	447,941. 90	0.1 8
31 4	Loews Corp	罗斯	L UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,40 1	447,548. 68	0.1 8
31 5	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空集团公 司	ALK UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,12 0	447,525. 65	0.1 8

				易所				
31 6	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	808	447,264. 16	0.1 8
31 7	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,10 8	447,129. 45	0.1 8
31 8	Walgreens Boots Alliance Inc	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯 达克 交易 所	美 国	1,12 6	447,129. 25	0.1 8
31 9	TechnipFMC Ltd	TechnipFMC PLC	FTI UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,12 9	447,113. 17	0.1 8
32 0	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽 约 交 易 所	美 国	652	446,846. 52	0.1 8
32 1	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽 约 交 易 所	美 国	481	446,612. 10	0.1 8
32 2	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,89 8	446,447. 81	0.1 8
32 3	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克默伦股份 有限公司	FCX UN	纽 约 交 易 所	美 国	3,90 6	446,075. 03	0.1 8

				易所				
324	Robert Half Intl Inc	罗致恒富国际公司	RHI UN	纽约交易所	美国	1,035	445,816.58	0.18
325	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,296	445,648.65	0.18
326	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	美国	491	445,631.12	0.18
327	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	554	445,553.24	0.18
328	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约交易所	美国	2,319	445,433.28	0.18
329	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	美国	1,316	445,211.69	0.18
330	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	美国	398	444,677.07	0.18
331	Progressive Corp	前进保险公司	PGR UN	纽约交	美国	1,136	444,598.47	0.18

				易所				
33 2	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克 交易所	美国	653	444,550. 63	0.1 8
33 3	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约 交易所	美国	347	444,474. 94	0.1 8
33 4	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公 司	NDAQ UQ	纳斯 达克交 易所	美国	736	444,468. 25	0.1 8
33 5	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽 约交 易所	美国	1,79 5	444,429. 74	0.1 8
33 6	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	443	444,362. 92	0.1 8
33 7	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽 约交 易所	美国	1,08 6	444,359. 21	0.1 8
33 8	L3 Technologies, Inc	L3 科技股份有限公司	LLL UN	纽 约交 易所	美国	349	444,104. 07	0.1 8
33	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL	纽 美	美	1,17	444,040.	0.1

9			UN	约 交 易 所	国	1	09	8
34 0	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,43 9	443,953. 28	0.1 8
34 1	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽 约 交 易 所	美 国	824	443,853. 70	0.1 8
34 2	Roper Technologies, Inc	Roper 科技股份有限 公司	ROP UN	纽 约 交 易 所	美 国	243	443,617. 42	0.1 8
34 3	CME Group Inc A	芝加哥商业交易所集 团股份有限	CME UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	409	443,598. 57	0.1 8
34 4	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,95 4	443,485. 95	0.1 8
34 5	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	362	443,377. 18	0.1 8
34 6	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,79 0	443,310. 22	0.1 8
34	Broadcom Inc	博通有限公司	AVGO	纳	美	276	443,104.	0.1

7			UQ	斯达克交易所	国		70	8
348	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,026	443,026.10	0.18
349	Chubb Limited	安达保险有限公司	CB UN	纽约交易所	美国	527	442,912.16	0.18
350	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	美国	400	442,888.74	0.18
351	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	美国	918	442,797.43	0.18
352	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	美国	483	442,748.60	0.18
353	Booking Holdings Inc	Booking Holding 公司	BKNG UQ	纳斯达克交易所	美国	33	442,610.64	0.18
354	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约	美国	340	442,549.97	0.18

				交易所				
355	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	美国	767	442,280. 34	0.1 8
356	WestRock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约交易所	美国	1,171	441,793. 16	0.1 8
357	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,091	441,496. 34	0.1 8
358	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	美国	911	441,410. 13	0.1 8
359	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	美国	676	441,378. 04	0.1 8
360	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	美国	391	441,254. 17	0.1 8
361	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	美国	1,829	441,230. 22	0.1 8
362	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	美国	401	441,050. 84	0.1 8

				所				
363	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	美国	586	440,929.69	0.18
364	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	美国	357	440,890.86	0.18
365	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	美国	461	440,883.51	0.18
366	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	美国	604	440,606.01	0.18
367	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	美国	909	440,441.06	0.18
368	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	美国	1,048	440,252.15	0.18
369	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	美国	724	440,239.45	0.18
370	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克	美国	995	440,173.95	0.18

				交易所				
37 1	Estee Lauder Cos. A	雅诗兰黛	EL UN	纽约 交易所	美国	466	439,961. 16	0.1 8
37 2	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约 交易所	美国	1,58 0	439,913. 91	0.1 8
37 3	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	3,67 2	439,517. 45	0.1 8
37 4	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约 交易所	美国	2,36 7	439,304. 86	0.1 8
37 5	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约 交易所	美国	475	439,061. 03	0.1 8
37 6	DXC Technology Company	DXC Technology Co	DXC UN	纽约 交易所	美国	823	438,958. 68	0.1 8
37 7	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公 司	AME UN	纽约 交易所	美国	919	438,780. 09	0.1 8
37 8	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公 司	JCI UN	纽约 交 易 所	美国	1,98 2	438,666. 69	0.1 8

				所				
379	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,070	438,662.05	0.18
380	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	美国	320	438,580.01	0.18
381	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股份有限公司	IQV UN	纽约交易所	美国	664	438,551.42	0.18
382	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	美国	2,495	438,463.56	0.18
383	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	美国	649	438,435.10	0.18
384	Horton D.R. Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约交易所	美国	1,615	438,118.17	0.18
385	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	美国	728	437,951.17	0.18
386	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团	CFG UN	纽约交易所	美国	1,700	437,555.76	0.18
38	Conagra Brands, Inc	康尼格拉品牌股份有	CAG	纽	美	1,85	437,360.	0.1

7		限公司	UN	约 交 易 所	国	0	57	8
38 8	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽 约 交 易 所	美 国	596	437,057. 40	0.1 8
38 9	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	4,47 5	437,033. 05	0.1 8
39 0	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽 约 交 易 所	美 国	458	436,529. 52	0.1 8
39 1	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,97 6	436,423. 53	0.1 8
39 2	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽 约 交 易 所	美 国	633	436,421. 67	0.1 8
39 3	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,78 3	436,385. 74	0.1 8
39 4	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽 约 交 易 所	美 国	299	436,367. 62	0.1 8
39 5	Arconic Inc	Arconic Inc	ARNC UN	纽 约 交 易 所	美 国	3,87 6	436,237. 47	0.1 8

				易所				
39 6	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约 交易所	美国	953	435,970. 55	0.1 8
39 7	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	832	435,776. 69	0.1 8
39 8	Ulta Beauty, Inc	Ulta Beauty Inc	ULTA UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	282	435,608. 62	0.1 8
39 9	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约 交易所	美国	977	435,572. 50	0.1 8
40 0	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers	TRV UN	纽约 交易所	美国	538	435,497. 47	0.1 8
40 1	NRG Energy	NRG 能源股份有限公 司	NRG UN	纽约 交易所	美国	2,14 3	435,306. 78	0.1 8
40 2	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约 交易所	美国	5,94 3	435,299. 56	0.1 8
40 3	AbbVie Inc.	艾伯维生物制药公司	ABBV UN	纽约 交易所	美国	710	435,249. 87	0.1 8

40 4	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约 交易 所	美国	2,33 3	435,155. 72	0.1 8
40 5	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,24 8	435,088. 56	0.1 8
40 6	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	849	434,850. 16	0.1 8
40 7	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	768	434,828. 13	0.1 8
40 8	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约 交易 所	美国	1,45 7	434,395. 80	0.1 8
40 9	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约 交易 所	美国	2,04 8	434,303. 04	0.1 8
41 0	SunTrust Banks Inc (GA)	太阳信托银行	STI UN	纽约 交易 所	美国	994	434,206. 96	0.1 8
41 1	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约 交	美国	1,52 5	434,085. 35	0.1 8

				易所				
41 2	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约 交易所	美国	838	433,707. 28	0.1 8
41 3	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约 交易所	美国	418	433,363. 61	0.1 8
41 4	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,16 7	433,334. 63	0.1 8
41 5	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约 交易所	美国	3,68 2	433,162. 07	0.1 8
41 6	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约 交易所	美国	351	432,923. 54	0.1 8
41 7	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约 交易所	美国	699	432,484. 07	0.1 8
41 8	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约 交易所	美国	1,31 9	432,350. 21	0.1 8
41 9	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约 交易所	美国	221	431,998. 01	0.1 8

420	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	美国	701	431,773. 45	0.1 8
421	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	美国	1,481	431,752. 07	0.1 8
422	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	1,209	431,411. 38	0.1 8
423	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	926	431,400. 07	0.1 8
424	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	美国	515	431,395. 70	0.1 8
425	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	美国	1,292	431,193. 76	0.1 8
426	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH UN	纽约交易所	美国	1,379	431,122. 77	0.1 8
427	Principal Financial Group	信安金融	PFG UQ	纳斯达克交易所	美国	1,229	430,578. 88	0.1 8

428	Smith A.O. Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约交易所	美国	1,100	430,509.08	0.18
429	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约交易所	美国	582	430,487.77	0.18
430	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	美国	592	430,285.44	0.18
431	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	美国	1,351	430,235.35	0.18
432	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	612	430,163.43	0.18
433	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	美国	1,040	430,079.00	0.18
434	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	美国	887	429,605.25	0.18
435	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	美国	211	429,580.77	0.18
436	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	美国	867	428,752.90	0.18

				交易所				
437	Brown-Forman Corp CL B(Non Voting Shares)	布朗福曼	BF/BU UN	纽约交易所	美国	1,322	428,697.59	0.18
438	Andeavor	Andeavor	ANDV UN	纽约交易所	美国	493	427,907.03	0.18
439	Air Products & Chemicals Inc	空气产品公司	APD UN	纽约交易所	美国	415	427,617.29	0.18
440	Fortune Brands Home & Security Inc	Fortune Brands 家庭与安全用品	FBHS UN	纽约交易所	美国	1,203	427,360.04	0.18
441	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	美国	2,773	427,321.00	0.18
442	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与	HPE UN	纽约交易所	美国	4,419	427,178.22	0.18
443	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	美国	485	426,803.78	0.18
444	Lam Research Corp	科林研发股份有限公司	LRCX UQ	纳斯达克	美国	373	426,592.38	0.18

				交易所				
44 5	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约 交易所	美国	1,35 9	426,218. 88	0.1 8
44 6	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约 交易所	美国	715	426,062. 06	0.1 8
44 7	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约 交易所	美国	332	424,360. 67	0.1 7
44 8	T Rowe Price Group Inc	普信集团公司	TROW UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	552	424,002. 84	0.1 7
44 9	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约 交易所	美国	1,46 9	423,782. 64	0.1 7
45 0	PNC Finl Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约 交易所	美国	474	423,709. 86	0.1 7
45 1	Stanley Black & Decker	史丹利百得公司	SWK UN	纽约 交易所	美国	482	423,557. 81	0.1 7
45 2	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯 达克	美国	2,23 0	423,469. 02	0.1 7

				交易所				
45 3	Affiliated Managers Grp	联合经理集团股份有 限公司	AMG UN	纽约 交易 所	美 国	430	422,986. 67	0.1 7
45 4	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约 交易 所	美 国	479	422,791. 48	0.1 7
45 5	Foot Locker Inc	富乐客公司	FL UN	纽约 交易 所	美 国	1,21 1	421,868. 79	0.1 7
45 6	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约 交易 所	美 国	637	421,308. 83	0.1 7
45 7	Cardinal Health Inc	康德乐公司	CAH UN	纽约 交易 所	美 国	1,30 3	420,984. 42	0.1 7
45 8	Nektar Therapeutics	内克塔治疗	NKTR UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,30 2	420,661. 33	0.1 7
45 9	General Motors Company	通用汽车公司	GM UN	纽约 交易 所	美 国	1,61 3	420,499. 49	0.1 7
46 0	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公 司	MCHP UQ	纳 斯 达 克	美 国	698	420,042. 28	0.1 7

				交易所				
46 1	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约 交易所	美国	424	420,030. 24	0.1 7
46 2	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约 交易所	美国	127	419,347. 40	0.1 7
46 3	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约 交易所	美国	903	419,191. 25	0.1 7
46 4	Applied Materials Inc	应用材料—T	AMAT UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,37 1	419,006. 05	0.1 7
46 5	Aptiv plc	Aptiv 公共有限公司	APTV UN	纽约 交易所	美国	691	418,938. 83	0.1 7
46 6	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限 公司	PWR UN	纽约 交易所	美国	1,89 4	418,563. 47	0.1 7
46 7	SVB Financial Group	硅谷银行	SIVB UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	219	418,423. 46	0.1 7
46 8	Intel Corp	英特尔	INTC UQ	纳斯 美国	美国	1,27 2	418,375. 03	0.1 7

				达 克 交 易 所				
46 9	HollyFrontier Corporation	Hollyfrontier 公司	HFC UN	纽 约 交 易 所	美 国	924	418,363. 12	0.1 7
47 0	Boeing Co	波音	BA UN	纽 约 交 易 所	美 国	188	417,347. 87	0.1 7
47 1	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽 约 交 易 所	美 国	427	417,069. 04	0.1 7
47 2	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,19 2	416,978. 13	0.1 7
47 3	Ralph Lauren Corp A	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽 约 交 易 所	美 国	501	416,751. 31	0.1 7
47 4	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	614	416,537. 60	0.1 7
47 5	IPG Photonics Corp	IPG 光电	IPGP UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	285	416,048. 83	0.1 7

47 6	American Airlines Group Inc.	美国航空集团公司	AAL UQ	纳斯达克 交易所	美国	1,65 5	415,679. 96	0.1 7
47 7	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约 交易所	美国	1,00 9	415,590. 30	0.1 7
47 8	Twenty-First Century Fox Inc A	新闻集团	FOXA UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,26 4	415,576. 47	0.1 7
47 9	Nvidia Corp	英伟达	NVDA UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	265	415,380. 22	0.1 7
48 0	eBay Inc.	eBay 公司	EBAY UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,72 5	413,858. 41	0.1 7
48 1	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融 股份有限公	RJF UN	纽约 交易 所	美国	700	413,835. 25	0.1 7
48 2	Mylan NV	迈兰公司	MYL UQ	纳斯 达克 交易 所	美国	1,72 6	412,727. 89	0.1 7

				所				
48 3	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	美国	400	412,478. 84	0.1 7
48 4	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	美国	459	412,032. 42	0.1 7
48 5	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	美国	274	411,648. 06	0.1 7
48 6	Schwab Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	美国	1,21 7	411,477. 75	0.1 7
48 7	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	美国	1,18 9	409,720. 52	0.1 7
48 8	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	美国	442	408,850. 30	0.1 7
48 9	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	美国	1,42 0	405,512. 89	0.1 7
49 0	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	1,16 8	405,266. 22	0.1 7
49	Brighthouse	Brighthouse 金融股份	BHF	纳	美	1,52	405,114.	0.1

1	Financial Inc	有限公司	UQ	斯达克交易所	美国	8	30	7
49 2	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	美国	2,516	399,536.77	0.16
49 3	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,235	399,177.82	0.16
49 4	Discovery, Inc C	探索传播公司	DISC K UQ	纳斯达克交易所	美国	2,207	372,372.32	0.15
49 5	Block H & R Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	美国	2,449	369,128.34	0.15
49 6	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	美国	410	364,519.74	0.15
49 7	News Corp A	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	美国	3,406	349,310.16	0.14
49 8	Alphabet Inc A	Alphabet 公司	GOOG L UQ	纳斯	美国	31	231,613.36	0.10

				达 克 交 易 所				
49 9	Alphabet Inc C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	31	228,836. 10	0.0 9
50 0	Under Armour Inc A	安德玛公司	UAA UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,53 2	227,871. 47	0.0 9
50 1	Under Armour Inc-C	安德玛公司	UA UN	纽 约 交 易 所	美 国	1,52 4	212,564. 36	0.0 9
50 2	Discovery, Inc A	探索传播公司	DISC A UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,01 0	183,776. 07	0.0 8
50 3	Twenty-First Century Fox Inc B	21 世纪福克斯	FOX UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	526	171,475. 94	0.0 7
50 4	News Corp B	新闻集团	NWS UQ	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,08 3	113,577. 58	0.0 5

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	Huntington Ingalls Industries Inc.	HII UN	688,637.07	0.26
2	Nektar Therapeutics	NKTR UQ	673,810.06	0.26
3	Twitter Inc	TWTR UN	508,288.02	0.20
4	Abiomed Inc	ABMD UQ	487,896.41	0.19
5	Eergy Inc.	EVRG UN	464,033.58	0.18
6	IPG Photonics Corp	IPGP UQ	460,008.13	0.18
7	MSCI Inc	MSCI UN	445,772.76	0.17
8	Broadridge Financial Solutions Inc.	BR UN	443,661.00	0.17
9	HollyFrontier Corporation	HFC UN	439,767.58	0.17
10	Take-Two Interactive Software	TTWO UQ	435,836.59	0.17
11	SVB Financial Group	SIVB UQ	393,955.54	0.15
12	News Corp B	NWS UQ	357,655.50	0.14
13	Twenty-First Century Fox Inc B	FOX UQ	355,775.19	0.14
14	Discovery, Inc A	DISCA UQ	340,055.86	0.13
15	Dentsply Sirona Inc.	XRAY UQ	307,454.79	0.12
16	LKQ Corp	LKQ UQ	300,151.46	0.12
17	DISH Network Corp A	DISH UQ	279,514.02	0.11
18	Alphabet Inc C	GOOG UQ	277,307.48	0.11
19	Cimarex Energy Co	XEC UN	271,204.74	0.10
20	L Brands Inc	LB UN	268,872.31	0.10

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	Range Resources Corp	RRC UN	590,822.58	0.23
2	Navient Corp	NAVI UQ	585,049.64	0.22
3	Acuity Brands Inc	AYI UN	552,653.31	0.21
4	NetFlix Inc	NFLX UQ	508,795.63	0.20
5	Chesapeake Energy Corp	CHK UN	470,208.91	0.18
6	Discovery, Inc A	DISCA UQ	463,138.35	0.18
7	Signet Jewelers Ltd	SIG UN	403,081.74	0.15
8	Twenty-First Century Fox Inc B	FOX UQ	391,692.40	0.15
9	Seagate Technology	STX UQ	387,058.80	0.15
10	Patterson Cos Inc	PDCO UQ	373,508.77	0.14
11	XL Group Ltd	XL UN	366,705.89	0.14
12	News Corp B	NWS UQ	352,530.81	0.14
13	TripAdvisor Inc. A	TRIP UQ	351,252.99	0.13
14	Discovery, Inc C	DISCK UQ	342,274.45	0.13
15	Wyndham Destinations Inc	WYND UN	336,745.71	0.13
16	Kohls Corp	KSS UN	335,806.97	0.13
17	Amazon.com Inc	AMZN UQ	321,841.82	0.12
18	Under Armour Inc-C	UA UN	317,463.50	0.12
19	Advanced Micro Devices	AMD UQ	315,717.69	0.12
20	Akamai Technologies Inc	AKAM UQ	310,955.82	0.12

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	82,015,086.20
卖出收入(成交)总额	94,100,188.74

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	-
3	应收股利	244,103.38
4	应收利息	3,099.01
5	应收申购款	954,446.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	109,959.72
8	其他	-
9	合计	1,311,608.56

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
35,641	3,921.62	1,381,957.25	0.99%	138,388,639.50	99.01%

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	193,672.85	0.1387%

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	148,919,838.60
本报告期基金总申购份额	85,194,106.53
减：本报告期基金总赎回份额	94,343,348.38
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	139,770,596.75

§ 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

本报告期内，基金管理人、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

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，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	-	176,115,274.94	100.00%	52,835.97	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：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、湘财证券、银河证券、招商证券、申银万国、中银国际、东莞证券、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、中泰证券、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、太平洋证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金新增的境内交易单元：太平洋证券，无新增或退租境外交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月22日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏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	2018年6月16日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财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	2018年6月9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	2018年5月25日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府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	2018年5月17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(2018年第1期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年5月8日
8	大成标普500等权重指数证券投资基金更新的招募说明书-摘要(2018年第1期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年5月8日

9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海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	2018 年 5 月 4 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 20 日
11	关于大成基金管理有限公司南京分公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 3 日
12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2017 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 31 日
13	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	2018 年 3 月 28 日
14	《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
15	大成标普 500 等权重指数 QDII 基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
16	大成标普 500 等权重指数 QDII 托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
17	关于调整公司旗下证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
18	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开通直销平台基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 10 日
20	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 20 日
21	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购(含定期定额申购)业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 19 日
22	大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2017 年度第 1 次分红的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 16 日
23	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	2018 年 1 月 11 日
24	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购(含定期定额申购)业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 10 日
25	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 5 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

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

§ 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

2018 年 8 月 29 日