

大成中证 500 深市交易型开放式指数
证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	44
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
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.....	44
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权证投资明细.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50

§11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 500 深市 ETF
场内简称	500 深 ETF
基金主代码	159932
交易代码	159932
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 12 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	19,507,615.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 10 月 9 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	本基金标的指数为中证 500 深市价格指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	田国立

2.4 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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	-454,386.59
本期利润	-399,495.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0205
本期加权平均净值利润率	-1.14%
本期基金份额净值增长率	-1.17%
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	11,721,592.21
期末可供分配基金份额利润	0.6009
期末基金资产净值	34,751,079.01
期末基金份额净值	1.781
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	50.87%

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. 所述基金业绩指标不包括持有人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。

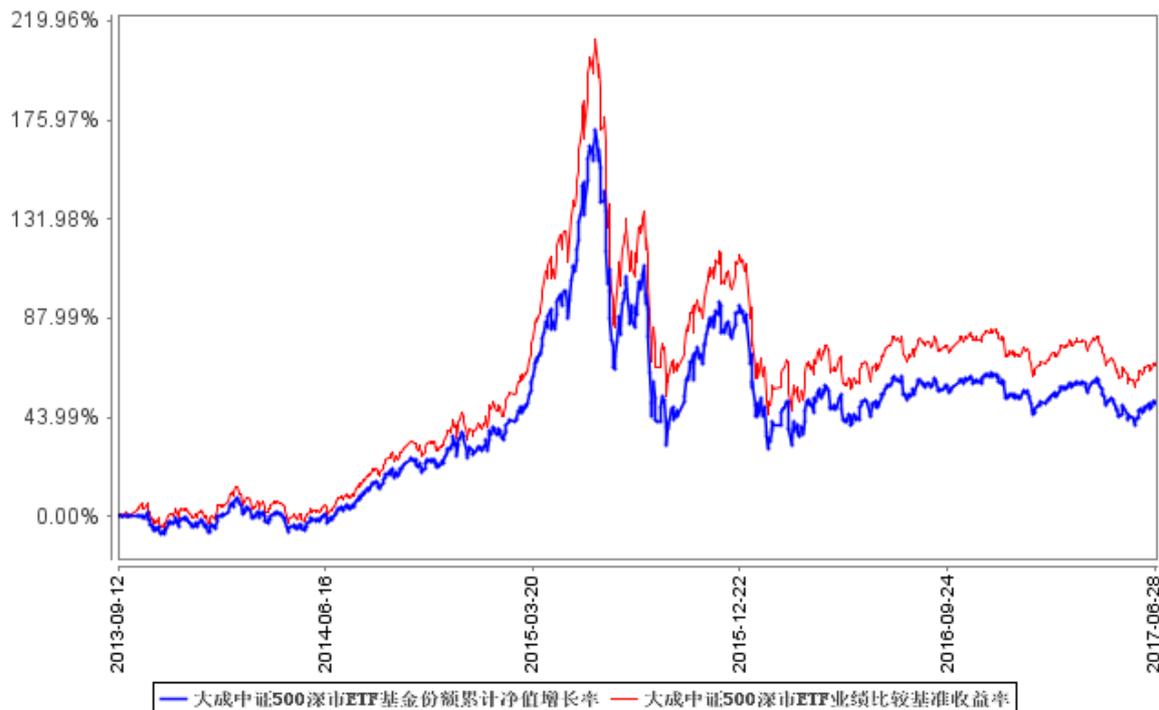
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3.2 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	5.01%	0.95%	5.22%	0.96%	-0.21%	-0.01%
过去三个月	-3.00%	1.01%	-2.97%	1.02%	-0.03%	-0.01%
过去六个月	-1.17%	0.92%	-1.47%	0.93%	0.30%	-0.01%
过去一年	-2.20%	0.92%	-1.55%	0.93%	-0.65%	-0.01%
过去三年	49.54%	2.04%	60.00%	2.03%	-10.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	50.87%	1.89%	68.77%	1.90%	-17.90%	-0.01%

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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

§ 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		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	7 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013 年 3 月 25 日至 2015 年 1 月 14 日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理助理。2015 年 2 月 28 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	8 年	经济学硕士，中国注册会计师。2008 年 1 月至 2008 年 12 月先后任职于中国平安保险（集团）股份有限公司集团资金管理部、集团财务部，从事投资财务工作。2008 年 12 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计师、基金运营部基金核算中心主管、数量投资部数量分析师、数量与指数投资部高级数量分析师兼基金经理助理。2015 年 7 月 20 日至 2017 年 7 月 3 日担任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深

					市交易型开放式指数证券投资基金和大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。 国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、杨台山先生已于 2017 年 7 月 3 日离任本基金基金助理职务。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

2、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

3、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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年 A 股行情分化严重，蓝筹股、价值股受到资金追捧，而高估值、小市值股票则大幅下跌，大盘指数上证 50 上涨 11.5%，沪深 300 上涨 10.78%，而创业板指下跌 7.34%。2017 年上半年国内经济延续去年的复苏态势，监管层在经济平稳时期推动金融去杠杆，化解金融泡沫风险。监管持续收紧使上半年流动性一直处于偏紧状态，投资者风险偏好下降，成长与估值匹配的消费和蓝筹股成为市场热点。

报告期内本基金基本保持高仓位运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.781 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.17%，业绩比较基准收益率为-1.47%。

4.5 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，在金融监管和房地产调控的双重压力下，经济复苏放缓趋势明显。我们认为在经济增速下台阶，中长期调整经济增长模式的宏观背景下，更多的投资机会来自在新形势下积极转变发展模式的传统行业，和在经济转型过程中快速成长的新兴产业。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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”）在大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金（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：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

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	504,812.90	329,713.02
结算备付金		214.19	-
存出保证金		547.90	785.61
交易性金融资产	6.4.3.2	34,432,198.78	34,968,716.02
其中：股票投资		34,432,198.78	34,968,716.02
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	87.92	77.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		34,937,861.69	35,299,291.69
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		-	-
应付管理人报酬		13,912.13	15,197.24
应付托管费		2,782.45	3,039.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	6,032.76	10,480.87
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	164,055.34	120,000.00
负债合计		186,782.68	148,717.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	23,029,486.80	23,029,486.80
未分配利润	6.4.3.10	11,721,592.21	12,121,087.31
所有者权益合计		34,751,079.01	35,150,574.11
负债和所有者权益总计		34,937,861.69	35,299,291.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.781 元，基金份额总额 19,507,615.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

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		-68,408.08	-6,660,674.13
1.利息收入		1,725.50	3,634.95
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,725.50	3,632.08
债券利息收入		-	2.87
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）		-125,025.07	-1,684,805.91
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-310,066.86	-1,869,266.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	185,041.79	184,460.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	54,891.49	-4,974,548.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-	-4,954.97
减：二、费用		331,087.02	309,805.95
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	86,853.17	88,511.44
2. 托管费	6.4.6.2.2	17,370.67	17,702.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	12,662.84	22,189.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	214,200.34	181,402.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-399,495.10	-6,970,480.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-399,495.10	-6,970,480.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

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）	23,029,486.80	12,121,087.31	35,150,574.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-399,495.10	-399,495.10
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）	-	-	-

其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	23,029,486.80	11,721,592.21	34,751,079.01
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	23,029,486.80	19,826,023.69	42,855,510.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,970,480.08	-6,970,480.08
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）	1,180,538.31	286,409.76	1,466,948.07
其中：1. 基金申购款	2,361,076.62	847,580.85	3,208,657.47
2. 基金赎回款	-1,180,538.31	-561,171.09	-1,741,709.40
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）	24,210,025.11	13,141,953.37	37,351,978.48

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>崔伟</u>
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 重要会计政策和会计估计

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

6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

6.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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，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；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	504,812.90
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	504,812.90

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	39,367,534.50	34,432,198.78	-4,935,335.72
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	39,367,534.50	34,432,198.78	-4,935,335.72

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	87.65
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	0.09
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	0.18
合计	87.92

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,032.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,032.76

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	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	114,055.34
合计	164,055.34

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	19,507,615.00	23,029,486.80
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	19,507,615.00	23,029,486.80

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,132,045.42	-19,010,958.11	12,121,087.31
本期利润	-454,386.59	54,891.49	-399,495.10
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,677,658.83	-18,956,066.62	11,721,592.21

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	1,635.95
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	85.11
其他	4.44
合计	1,725.50

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-310,066.86
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-310,066.86

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	4,576,269.32
减：卖出股票成本总额	4,886,336.18
买卖股票差价收入	-310,066.86

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未投资资产支持证券。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未投资贵金属。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期未投资衍生工具。

6.4.3.16 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	185,041.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	185,041.79

6.4.3.17 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	54,891.49

——股票投资	54,891.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	54,891.49

6.4.3.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.3.19 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	12,662.84
银行间市场交易费用	-
合计	12,662.84

6.4.3.20 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	9,916.99
信息披露费	74,385.57
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行费用	145.00
合计	214,200.34

注：指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 50,000.00 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

截至财务报告批准报出日，本基金并无须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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金申赎代办券商
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

本基金本报告期内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	86,853.17	88,511.44
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	17,370.67	17,702.28

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期末与关联方进行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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2013 年 9 月 12 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期末持有的基金份额	87.1500%	82.9000%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人交易本基金的费率符合法律法规、交易所及本基金法律文件的有关规定。

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
中国银行	504,812.90	1,635.95	821,029.60	3,342.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金于本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000656	金科股份	2017 年 5 月 5 日	重大事项停牌	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	61,300	359,726.63	400,902.00	-

002168	深圳惠程	2017年1月23日	重大事项停牌	16.99	-	-	13,600	160,581.32	231,064.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项停牌	15.75	2017年8月9日	14.50	14,300	163,521.13	225,225.00	-
002133	中航机电	2017年5月12日	重大事项停牌	10.33	2017年8月2日	11.36	15,840	205,952.49	163,627.20	-
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事项停牌	23.36	-	-	6,380	186,339.55	149,036.80	-
002127	南极电商	2017年6月29日	重大事项停牌	12.08	2017年7月6日	12.61	11,000	137,060.00	132,880.00	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事项停牌	20.23	-	-	6,200	111,367.00	125,426.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	24.95	2017年7月4日	22.46	4,610	141,252.57	115,019.50	-
300291	华录百纳	2017年4月	重大	20.02	-	-	5,400	155,719.77	108,108.00	-

		月 19 日	事项停牌								
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	重大事项停牌	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	4,200	140,845.65	105,252.00		-
002358	森源电气	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	6,100	100,220.89	103,822.00		-
002122	天马股份	2017 年 4 月 24 日	重大事项停牌	10.30	2017 年 7 月 24 日	11.15	9,763	82,421.92	100,558.90		-
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事项停牌	3.50	-	-	27,030	99,850.86	94,605.00		-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项停牌	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	10,800	110,963.31	93,960.00		-
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.06	-	-	9,700	87,203.00	87,882.00		-
000099	中信海直	2017 年 5 月 4 日	重大事项	11.26	-	-	7,000	131,285.70	78,820.00		-

			停牌							
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项停牌	12.59	2017年7月3日	12.70	5,920	107,719.00	74,532.80	-
000693	*ST华泽	2016年3月1日	重大事项停牌	12.50	-	-	5,500	99,244.54	68,750.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。本基金以拟

合、跟踪中证 500 深市指数为原则，通过被动式指数化投资方法，力求为投资者提供一个管理透明且成本较低的标的指数投资工具。

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

本基金所持有的证券在证券交易所上市。于本期末，除附注 6.4.8 期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。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不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	504,812.90	-	-	-	504,812.90
结算备付金	214.19	-	-	-	214.19
存出保证金	547.90	-	-	-	547.90
交易性金融资产	-	-	-	34,432,198.78	34,432,198.78
应收利息	-	-	-	87.92	87.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	505,574.99	-	-	34,432,286.70	34,937,861.69

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,912.13	13,912.13
应付托管费	-	-	-	2,782.45	2,782.45
应付交易费用	-	-	-	6,032.76	6,032.76
其他负债	-	-	-	164,055.34	164,055.34
负债总计	-	-	-	186,782.68	186,782.68
利率敏感度缺口	505,574.99	-	-	34,245,504.02	34,751,079.01
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	329,713.02	-	-	-	329,713.02
存出保证金	785.61	-	-	-	785.61
交易性金融资产	-	-	-	34,968,716.02	34,968,716.02
应收利息	-	-	-	77.04	77.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	330,498.63	-	-	34,968,793.06	35,299,291.69
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,197.24	15,197.24
应付托管费	-	-	-	3,039.47	3,039.47
应付交易费用	-	-	-	10,480.87	10,480.87
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	148,717.58	148,717.58
利率敏感度缺口	330,498.63	-	-	34,820,075.48	35,150,574.11

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

本基金为指数型证券投资基金，于本报告期末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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	34,432,198.78	99.08	34,968,716.02	99.48
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	34,432,198.78	99.08	34,968,716.02	99.48

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； 2. 用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； 3. Beta 系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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）
	中证 500 深市指数上升 5%	1,714,390.88	1,739,955.34
中证 500 深市指数下降 5%	-1,714,390.88	-1,739,955.34	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基

金资产净值产生的影响。

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	34,432,198.78	98.55
	其中：股票	34,432,198.78	98.55
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	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	银行存款和结算备付金合计	505,027.09	1.45
7	其他各项资产	635.82	0.00
8	合计	34,937,861.69	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	645,016.51	1.86
B	采矿业	1,027,982.02	2.96
C	制造业	21,902,573.66	63.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,087,839.00	3.13
E	建筑业	946,863.98	2.72
F	批发和零售业	1,413,800.58	4.07
G	交通运输、仓储和邮政业	229,355.00	0.66
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服	3,365,837.78	9.69

	务业		
J	金融业	359,881.42	1.04
K	房地产业	1,814,103.80	5.22
L	租赁和商务服务业	806,552.23	2.32
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	434,336.40	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	161,704.40	0.47
R	文化、体育和娱乐业	236,352.00	0.68
S	综合	-	0.00
	合计	34,432,198.78	99.08

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	11,200	448,224.00	1.29
2	000656	金科股份	61,300	400,902.00	1.15
3	002460	赣锋锂业	8,300	383,875.00	1.10
4	002572	索菲亚	8,700	356,700.00	1.03
5	300156	神雾环保	9,600	314,496.00	0.90
6	002271	东方雨虹	8,300	307,930.00	0.89
7	002405	四维图新	14,150	279,604.00	0.80
8	000661	长春高新	2,160	278,877.60	0.80
9	002092	中泰化学	20,200	256,540.00	0.74
10	002340	格林美	41,928	253,664.40	0.73
11	000066	中国长城	27,701	249,586.01	0.72
12	300115	长盈精密	8,520	248,613.60	0.72
13	000050	深天马 A	12,000	246,840.00	0.71
14	300266	兴源环境	8,000	245,760.00	0.71
15	300296	利亚德	12,800	240,640.00	0.69
16	000998	隆平高科	10,738	236,450.76	0.68

17	000997	新大陆	10,326	234,296.94	0.67
18	002168	深圳惠程	13,600	231,064.00	0.66
19	300088	长信科技	14,300	225,225.00	0.65
20	002422	科伦药业	13,600	224,672.00	0.65
21	000786	北新建材	14,100	223,344.00	0.64
22	002050	三花智控	12,800	208,896.00	0.60
23	000581	威孚高科	7,900	204,610.00	0.59
24	002410	广联达	10,600	199,280.00	0.57
25	000970	中科三环	13,400	198,052.00	0.57
26	002407	多氟多	9,000	197,910.00	0.57
27	000999	华润三九	6,200	196,850.00	0.57
28	002179	中航光电	6,291	196,216.29	0.56
29	000039	中集集团	10,800	194,724.00	0.56
30	000028	国药一致	2,400	194,160.00	0.56
31	002366	台海核电	4,100	192,331.00	0.55
32	000778	新兴铸管	28,400	190,280.00	0.55
33	002038	双鹭药业	6,500	189,475.00	0.55
34	002573	清新环境	10,020	188,576.40	0.54
35	002223	鱼跃医疗	7,938	187,971.84	0.54
36	002311	海大集团	10,000	182,700.00	0.53
37	000488	晨鸣纸业	14,000	180,600.00	0.52
38	300113	顺网科技	6,600	177,540.00	0.51
39	000878	云南铜业	13,400	176,746.00	0.51
40	002217	合力泰	17,800	175,864.00	0.51
41	002004	华邦健康	22,400	175,392.00	0.50
42	002030	达安基因	8,026	174,886.54	0.50
43	300055	万邦达	9,500	174,800.00	0.50
44	002273	水晶光电	8,350	172,260.50	0.50
45	000400	许继电气	9,500	170,620.00	0.49
46	300383	光环新网	12,400	168,144.00	0.48
47	002384	东山精密	6,800	167,960.00	0.48
48	000566	海南海药	12,600	167,076.00	0.48
49	002001	新和成	8,600	166,926.00	0.48
50	300324	旋极信息	9,100	165,984.00	0.48
51	000547	航天发展	15,700	164,065.00	0.47
52	000930	中粮生化	15,200	163,856.00	0.47
53	000418	小天鹅A	3,500	163,765.00	0.47
54	002013	中航机电	15,840	163,627.20	0.47
55	000401	冀东水泥	10,600	163,134.00	0.47

56	300002	神州泰岳	19,500	162,630.00	0.47
57	300244	迪安诊断	5,140	161,704.40	0.47
58	002583	海能达	10,000	160,900.00	0.46
59	002491	通鼎互联	11,900	159,936.00	0.46
60	002078	太阳纸业	21,600	158,760.00	0.46
61	002439	启明星辰	8,500	158,100.00	0.45
62	000598	兴蓉环境	28,100	157,922.00	0.45
63	000960	锡业股份	11,600	157,876.00	0.45
64	002019	亿帆医药	9,400	156,792.00	0.45
65	000825	太钢不锈	35,800	155,730.00	0.45
66	002408	齐翔腾达	13,994	155,053.52	0.45
67	300159	新研股份	11,700	154,908.00	0.45
68	002400	省广股份	19,141	153,702.23	0.44
69	002244	滨江集团	22,100	152,932.00	0.44
70	000513	丽珠集团	2,214	150,773.40	0.43
71	000078	海王生物	25,000	150,750.00	0.43
72	000089	深圳机场	16,100	150,535.00	0.43
73	300134	大富科技	6,380	149,036.80	0.43
74	000979	中弘股份	56,420	147,820.40	0.43
75	002176	江特电机	16,900	147,368.00	0.42
76	002051	中工国际	7,016	145,441.68	0.42
77	000697	炼石有色	7,100	145,337.00	0.42
78	300122	智飞生物	7,600	145,236.00	0.42
79	002640	跨境通	6,800	144,500.00	0.42
80	300146	汤臣倍健	10,500	144,270.00	0.42
81	002431	棕榈股份	13,000	143,260.00	0.41
82	300058	蓝色光标	18,300	143,106.00	0.41
83	000988	华工科技	9,800	142,982.00	0.41
84	002601	龙鳞佰利	8,700	142,506.00	0.41
85	002701	奥瑞金	22,192	141,806.88	0.41
86	000806	银河生物	10,400	140,400.00	0.40
87	002048	宁波华翔	6,700	139,762.00	0.40
88	002221	东华能源	12,800	139,648.00	0.40
89	000600	建投能源	11,300	138,651.00	0.40
90	002354	天神娱乐	6,400	137,600.00	0.40
91	000685	中山公用	12,560	137,532.00	0.40
92	300253	卫宁健康	17,598	137,440.38	0.40
93	000012	南玻A	14,500	135,285.00	0.39
94	002191	劲嘉股份	14,400	134,784.00	0.39

95	000729	燕京啤酒	20,000	134,400.00	0.39
96	002635	安洁科技	3,700	134,014.00	0.39
97	300026	红日药业	28,400	133,764.00	0.38
98	002665	首航节能	18,550	133,560.00	0.38
99	002028	思源电气	8,365	133,338.10	0.38
100	000667	美好置业	40,200	133,062.00	0.38
101	002127	南极电商	11,000	132,880.00	0.38
102	002603	以岭药业	7,600	132,696.00	0.38
103	000816	智慧农业	17,800	132,432.00	0.38
104	002444	巨星科技	8,500	132,430.00	0.38
105	000926	福星股份	10,796	131,711.20	0.38
106	000006	深振业 A	14,900	131,269.00	0.38
107	000758	中色股份	18,600	130,386.00	0.38
108	000690	宝新能源	21,700	129,766.00	0.37
109	000975	银泰资源	10,202	128,851.26	0.37
110	000031	中粮地产	17,100	128,763.00	0.37
111	002672	东江环保	7,600	128,364.00	0.37
112	002373	千方科技	9,400	128,216.00	0.37
113	002390	信邦制药	14,600	127,166.00	0.37
114	000158	常山股份	8,000	126,400.00	0.36
115	002512	达华智能	7,800	125,970.00	0.36
116	000860	顺鑫农业	6,280	125,662.80	0.36
117	000939	凯迪生态	24,634	125,633.40	0.36
118	002399	海普瑞	6,200	125,426.00	0.36
119	002250	联化科技	8,744	125,039.20	0.36
120	000877	天山股份	9,740	123,405.80	0.36
121	300274	阳光电源	11,120	123,320.80	0.35
122	002261	拓维信息	10,500	122,955.00	0.35
123	000592	平潭发展	22,000	121,440.00	0.35
124	000727	华东科技	42,700	120,841.00	0.35
125	300166	东方国信	8,960	120,332.80	0.35
126	002353	杰瑞股份	7,600	120,232.00	0.35
127	002002	鸿达兴业	15,236	119,297.88	0.34
128	300001	特锐德	7,100	118,996.00	0.34
129	000732	泰禾集团	7,100	118,428.00	0.34
130	002477	雏鹰农牧	26,700	118,281.00	0.34
131	002025	航天电器	4,610	115,019.50	0.33
132	000563	陕国投 A	22,026	113,874.42	0.33
133	300257	开山股份	5,400	113,832.00	0.33

134	000027	深圳能源	16,900	113,737.00	0.33
135	002375	亚厦股份	12,700	113,157.00	0.33
136	300287	飞利信	12,300	112,914.00	0.32
137	002022	科华生物	6,500	112,905.00	0.32
138	002268	卫士通	6,680	112,357.60	0.32
139	000501	鄂武商 A	6,078	112,199.88	0.32
140	002468	申通快递	4,400	111,804.00	0.32
141	300116	坚瑞沃能	10,400	111,800.00	0.32
142	002544	杰赛科技	4,900	111,720.00	0.32
143	002440	闰土股份	7,300	111,398.00	0.32
144	002266	浙富控股	22,820	111,361.60	0.32
145	000519	中兵红箭	8,833	111,295.80	0.32
146	002281	光迅科技	5,000	111,100.00	0.32
147	000830	鲁西化工	16,100	111,090.00	0.32
148	002308	威创股份	8,500	110,925.00	0.32
149	300199	翰宇药业	7,200	110,448.00	0.32
150	000703	恒逸石化	7,700	109,648.00	0.32
151	002489	浙江永强	17,130	109,289.40	0.31
152	002589	瑞康医药	7,090	109,186.00	0.31
153	002517	恺英网络	3,100	109,089.00	0.31
154	002155	湖南黄金	11,300	108,141.00	0.31
155	300291	华录百纳	5,400	108,108.00	0.31
156	000528	柳工	12,400	107,136.00	0.31
157	002342	巨力索具	10,600	106,742.00	0.31
158	300273	和佳股份	8,740	106,278.40	0.31
159	000612	焦作万方	13,140	105,777.00	0.30
160	000090	天健集团	9,500	105,450.00	0.30
161	002642	荣之联	4,200	105,252.00	0.30
162	000712	锦龙股份	6,400	104,768.00	0.30
163	002396	星网锐捷	5,400	104,490.00	0.30
164	002358	森源电气	6,100	103,822.00	0.30
165	000049	德赛电池	2,000	103,620.00	0.30
166	002503	搜于特	14,688	103,256.64	0.30
167	002285	世联行	12,860	103,137.20	0.30
168	002670	国盛金控	6,440	102,396.00	0.29
169	000937	冀中能源	16,700	102,204.00	0.29
170	002122	天马股份	9,763	100,558.90	0.29
171	002437	誉衡药业	13,800	100,464.00	0.29
172	002325	洪涛股份	13,711	100,090.30	0.29

173	000587	金洲慈航	6,700	99,830.00	0.29
174	000021	深科技	11,600	99,528.00	0.29
175	000810	创维数字	8,200	99,466.00	0.29
176	002709	天赐材料	2,400	98,808.00	0.28
177	002011	盾安环境	8,700	98,745.00	0.28
178	002368	太极股份	3,560	98,576.40	0.28
179	002657	中科金财	3,400	98,566.00	0.28
180	000543	皖能电力	16,870	98,352.10	0.28
181	000829	天音控股	9,072	97,977.60	0.28
182	002018	华信国际	14,300	97,955.00	0.28
183	000777	中核科技	4,900	97,804.00	0.28
184	002056	横店东磁	12,940	97,050.00	0.28
185	000669	金鸿能源	5,350	96,995.50	0.28
186	000596	古井贡酒	1,900	96,805.00	0.28
187	002242	九阳股份	4,900	96,383.00	0.28
188	002317	众生药业	7,700	95,634.00	0.28
189	000897	津滨发展	20,300	95,410.00	0.27
190	002505	大康农业	27,030	94,605.00	0.27
191	002128	露天煤业	10,800	93,960.00	0.27
192	000572	海马汽车	18,100	93,577.00	0.27
193	000762	西藏矿业	6,600	93,522.00	0.27
194	000848	承德露露	9,254	92,354.92	0.27
195	000062	深圳华强	3,400	90,202.00	0.26
196	002106	莱宝高科	8,900	90,157.00	0.26
197	002254	泰和新材	6,740	89,642.00	0.26
198	002276	万马股份	8,880	89,599.20	0.26
199	300010	立思辰	6,900	89,355.00	0.26
200	002479	富春环保	7,500	89,250.00	0.26
201	300376	易事特	9,800	88,886.00	0.26
202	002249	大洋电机	13,448	88,487.84	0.25
203	002482	广田集团	9,800	88,102.00	0.25
204	002707	众信旅游	6,700	87,971.00	0.25
205	000766	通化金马	5,500	87,890.00	0.25
206	000061	农产品	9,700	87,882.00	0.25
207	000636	风华高科	10,300	87,653.00	0.25
208	002073	软控股份	10,300	87,344.00	0.25
209	000652	泰达股份	16,239	86,066.70	0.25
210	000680	山推股份	15,600	85,020.00	0.24
211	000620	新华联	11,900	84,609.00	0.24

212	000541	佛山照明	9,260	84,358.60	0.24
213	000726	鲁泰 A	7,100	84,206.00	0.24
214	002463	沪电股份	18,378	83,619.90	0.24
215	002690	美亚光电	4,300	82,474.00	0.24
216	002123	梦网荣信	7,400	82,214.00	0.24
217	001696	宗申动力	10,800	81,756.00	0.24
218	002428	云南锗业	7,602	81,189.36	0.23
219	300297	蓝盾股份	7,400	81,030.00	0.23
220	002064	华峰氨纶	16,700	80,494.00	0.23
221	000426	兴业矿业	8,838	79,718.76	0.23
222	002063	远光软件	7,573	78,910.66	0.23
223	002332	仙琚制药	9,175	78,905.00	0.23
224	000099	中信海直	7,000	78,820.00	0.23
225	000616	海航投资	18,000	77,400.00	0.22
226	000552	靖远煤电	21,600	77,112.00	0.22
227	000969	安泰科技	8,800	76,824.00	0.22
228	002663	普邦股份	14,100	76,563.00	0.22
229	002727	一心堂	4,100	75,440.00	0.22
230	300147	香雪制药	7,340	75,381.80	0.22
231	002681	奋达科技	5,920	74,532.80	0.21
232	002041	登海种业	5,603	74,239.75	0.21
233	300039	上海凯宝	10,112	73,514.24	0.21
234	002269	美邦服饰	19,700	73,481.00	0.21
235	002005	德豪润达	15,400	73,458.00	0.21
236	300043	星辉娱乐	8,900	73,069.00	0.21
237	002345	潮宏基	6,700	72,829.00	0.21
238	300202	聚龙股份	4,400	72,688.00	0.21
239	002190	成飞集成	2,700	72,360.00	0.21
240	002277	友阿股份	11,100	71,595.00	0.21
241	300032	金龙机电	5,100	71,145.00	0.20
242	000417	合肥百货	8,600	70,950.00	0.20
243	002233	塔牌集团	5,700	69,369.00	0.20
244	002371	北方华创	2,900	69,368.00	0.20
245	000681	视觉中国	4,400	68,904.00	0.20
246	000693	*ST 华泽	5,500	68,750.00	0.20
247	002344	海宁皮城	8,100	67,392.00	0.19
248	002120	韵达股份	1,300	67,080.00	0.19
249	002588	史丹利	8,300	63,827.00	0.18
250	002309	中利集团	5,040	63,050.40	0.18

251	002147	新光圆成	4,000	62,160.00	0.18
252	002699	美盛文化	4,300	59,340.00	0.17
253	002551	尚荣医疗	3,540	57,100.20	0.16
254	000025	特力A	1,100	56,914.00	0.16
255	002093	国脉科技	6,400	56,320.00	0.16
256	002392	北京利尔	9,400	55,742.00	0.16
257	002118	紫鑫药业	8,100	55,323.00	0.16
258	002414	高德红外	3,000	54,900.00	0.16
259	002416	爱施德	4,900	52,871.00	0.15
260	002251	步步高	4,160	51,542.40	0.15
261	002646	青青稞酒	2,900	50,634.00	0.15
262	000517	荣安地产	10,000	46,500.00	0.13
263	000536	华映科技	7,900	45,899.00	0.13
264	002818	富森美	1,100	43,417.00	0.12
265	002807	江阴银行	3,100	38,843.00	0.11
266	002315	焦点科技	1,500	37,410.00	0.11
267	002815	崇达技术	1,100	36,344.00	0.10
268	002194	武汉凡谷	3,600	31,860.00	0.09
269	000761	本钢板材	4,800	25,104.00	0.07

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000778	新兴铸管	206,184.00	0.59
2	000039	中集集团	182,196.00	0.52
3	300002	神州泰岳	161,282.00	0.46
4	300383	光环新网	152,763.00	0.43
5	002583	海能达	148,500.00	0.42
6	300058	蓝色光标	145,185.00	0.41
7	002127	南极电商	137,060.00	0.39
8	000729	燕京啤酒	134,200.00	0.38
9	002601	龙蟠佰利	133,279.00	0.38

10	300146	汤臣倍健	124,530.00	0.35
11	000732	泰禾集团	116,048.00	0.33
12	000027	深圳能源	114,561.00	0.33
13	300116	坚瑞沃能	109,200.00	0.31
14	002670	国盛金控	109,038.00	0.31
15	002517	恺英网络	108,190.00	0.31
16	002468	申通快递	107,932.00	0.31
17	000712	锦龙股份	104,050.47	0.30
18	000766	通化金马	95,040.72	0.27
19	002709	天赐材料	88,732.00	0.25
20	000061	农产品	87,203.00	0.25

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002508	老板电器	354,630.00	1.01
2	000887	中鼎股份	249,741.00	0.71
3	002602	世纪华通	183,037.00	0.52
4	000959	首钢股份	177,649.00	0.51
5	002595	豪迈科技	145,613.27	0.41
6	000961	中南建设	122,695.50	0.35
7	000973	佛塑科技	94,565.00	0.27
8	002581	未名医药	94,424.00	0.27
9	000869	张裕 A	84,249.00	0.24
10	002498	汉缆股份	79,264.00	0.23
11	000931	中关村	73,819.00	0.21
12	002029	七匹狼	72,375.00	0.21
13	000861	海印股份	69,543.20	0.20
14	002161	远望谷	67,914.00	0.19
15	002327	富安娜	61,398.20	0.17
16	002698	博实股份	54,189.40	0.15
17	000919	金陵药业	53,826.86	0.15
18	000631	顺发恒业	52,287.89	0.15
19	300026	红日药业	49,810.00	0.14

20	002745	木林森	48,199.00	0.14
----	--------	-----	-----------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,294,927.45
卖出股票收入（成交）总额	4,576,269.32

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	547.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	87.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	635.82

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000656	金科股份	400,902.00	1.15	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 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
223	87,478.09	17,020,600.00	87.25%	2,487,015.00	12.75%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	87.15%
2	刘秀媛	250,000.00	1.28%
3	邢秋珍	163,387.00	0.84%
4	何凤珍	155,400.00	0.80%
5	黄连财	101,666.00	0.52%
6	王捷飞	84,728.00	0.43%
7	金挺	70,000.00	0.36%
8	罗昭义	64,301.00	0.33%
9	肖卫中	57,942.00	0.30%
10	李滨	57,604.00	0.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 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（2013 年 9 月 12 日）基金份额总额	333,508,962.00
本报告期期初基金份额总额	19,507,615.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	19,507,615.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

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安永华明会计师事务所（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、本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	
申万宏源	1	8,329,493.96	100.00%	7,591.05	100.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-

中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：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。

本报告期内本基金新增席位: 无。本报告期内本基金退租席位: 无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成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
2	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
3	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月21日
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月27日
10	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
11	大成基金管理有限公司关于总经	中国证监会指定报	2017年5月17日

	理继续代为履行督察长职务的公告	刊及本公司网站	
12	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
13	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书-摘要 (2017 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
20	中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2017 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
21	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
22	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
23	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
24	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 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
25	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
26	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
27	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日

	公司为销售机构的公告		
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
29	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
30	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
31	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 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
32	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
40	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
41	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
42	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
43	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金 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
44	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
45	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日

	公司为销售机构的公告		
46	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
47	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
48	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
49	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
50	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

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	17,000,000.00	-	-	17,000,000.00	87.15%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 500 深市交易型开放式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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日