

大成深证成份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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	62

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>64</b>
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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成深证 ETF
场内简称	深证 ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	35,035,342.00 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	2015 年 7 月 8 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	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。 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。
业绩比较基准	深证成份指数
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599

传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

#### 2.4 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	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
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	北京市西城区金融大街 27 号投资广 场 23 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-18,798,371.70
本期利润	15,356,142.17
加权平均基金份额本期利润	0.4087
本期加权平均净值利润率	3.80%
本期基金份额净值增长率	3.87%
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	-176,604,907.64
期末可供分配基金份额利润	-5.0408
期末基金资产净值	388,714,320.02
期末基金份额净值	11.095
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	-27.16%

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。

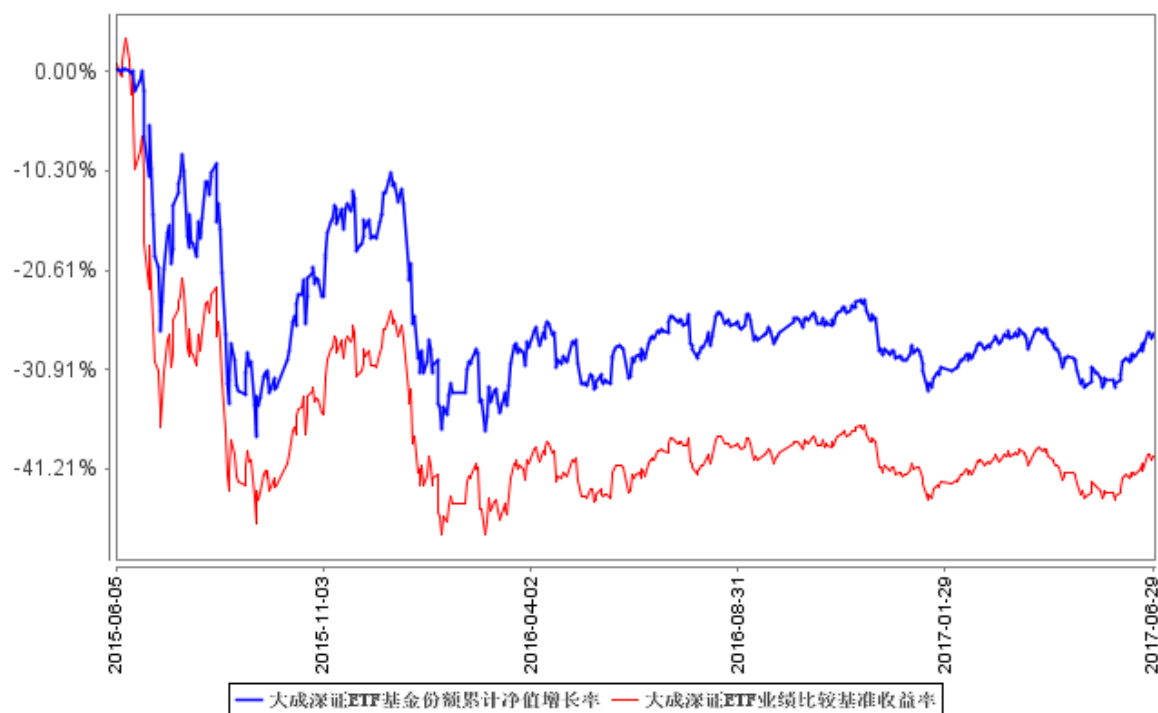
## 3.2 基金净值表现

## 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	6.98%	0.82%	6.74%	0.83%	0.24%	-0.01%
过去三个月	1.58%	0.87%	0.97%	0.88%	0.61%	-0.01%
过去六个月	3.87%	0.83%	3.46%	0.84%	0.41%	-0.01%
过去一年	0.50%	0.87%	0.38%	0.89%	0.12%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-27.16%	1.99%	-39.83%	2.09%	12.67%	-0.10%



### 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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 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		
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	7 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 日担任大成中证 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
苏秉毅	本基金	2015 年 6 月 5 日	-	13 年	经济学硕士。2004 年 9 月至

先生	基金经 理、数 量与指 数投资 部副总 监			<p>2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深300指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
----	--------------------------------------	--	--	---

注：1、杨台山先生已于2017年7月3日离任本基金基金经理助理职务。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和工具，对旗下所有投资组合连续 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，在投资的拉动下，宏观经济保持相对稳健的状态。供给侧改革相配合，大宗商品价格保持稳定，CPI、PPI 有所回暖。金融去杠杆政策初见成效，M2 增速开始放缓。海外方面，整体环境也趋于良好。马克龙当选法国总统，减轻了市场对于欧元区瓦解的担忧；而川普新政不达预期，令美元持续走弱，也在一定程度上缓解了人民币贬值的压力。

相对于宏观经济基本面，监管政策对流动性以及资本市场的影响更为直接。为了应对春节现金需求的流动性的冲击，央行创设了临时流动性便利工具，春节前流动性冲击低于市场预期，但之后 MLF 利率、公开市场操作、SLF 利率相继上调，形成结构性加息，表明货币政策依然中性偏紧，央行既希望避免流动性遭受冲击，也希望继续推动金融市场去杠杆。春节后，虽然 TLF 并未

续作，其它节前央行投放的流动性也在逐步回收，但对市场流动性冲击不大，市场随之反弹。雄安新区消息出台后，股票市场到达短期高点，之后监管政策陆续出台，着力在金融领域去杠杆，引发了权益市场和固定收益市场在四、五月份的调整。进入六月份，为了避免出现系统性风险，监管政策有所缓和，央行也及时释放流动性，市场随之企稳走强。上半年市场基准沪深 300 指数上涨 10.78%。市场风格分化非常大，ROE 因子表现优异，家电、金融、消费等价值型板块领涨大市。

本基金标的指数深成指上涨 3.46%，涨幅低于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，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。上半年各项操作与指标均符合基金合同的要求。

#### 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 11.095 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.87%，业绩比较基准收益率为 3.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济有望继续维持稳定。政策取向预计没有太大的变化，仍将总体维持中性的货币政策以及积极的财政政策，以求在经济稳增长、促进结构性改革、控制金融风险等多个目标之间维持平衡。财政发力、PPP 项目落地，宏观经济可以依靠投资完成托底的任务；另一方面，货币政策空间有限，且边际效应递减，新经济周期难以展开，经济增速也不会太高。

对于股票市场，监管政策是目前最重要的影响因素。虽然金融市场去杠杆的基调没有争议，但最终的目标以及中间的路径存在非常高的不确定性。总体来说，在去杠杆的大背景下，股票市场不可能有系统性的牛市行情；而出于下半年重大政治事件的维稳考虑，发生系统性金融风险的可能性也几乎为零。预计市场仍将在一定区间内震荡，除非市场借维稳之机过度炒作，市场才可能在维稳需求消失后发生较大下行风险。市场风格受现行新股发行制度影响，将相对有利于价值型风格。一方面，打新无风险收益吸引资金入场，低估值、高分红的股票具有较高安全边际，表现稳健，适合作为低风险偏好资金的底仓配置。另一方面，新股加速发行，加大股票供给，降低了上市壳资源估值，对缺乏基本面支持的小票构成打击。

#### 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**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成深证成份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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,256,360.92	4,117,850.66
结算备付金		10,653.07	4,794.28
存出保证金		3,007.14	13,736.64
交易性金融资产	6.4.7.2	383,870,785.77	431,449,359.25
其中：股票投资		383,870,785.77	431,449,359.25
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		26,190.14	-
应收利息	6.4.7.5	892.10	842.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		389,167,889.14	435,586,583.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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		156,292.77	190,230.13
应付托管费		31,258.56	38,046.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,266.82	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	260,750.97	205,000.00
负债合计		453,569.12	433,276.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	533,712,434.95	620,543,637.48
未分配利润	6.4.7.10	-144,998,114.93	-185,390,330.30
所有者权益合计		388,714,320.02	435,153,307.18
负债和所有者权益总计		389,167,889.14	435,586,583.33

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 11.095 元，基金份额总额 35,035,342 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成深证成份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
<b>一、收入</b>		17,002,527.12	-121,912,895.07
1.利息收入		13,067.39	27,306.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,067.39	27,268.02
债券利息收入		-	38.60
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）		-17,165,054.14	-23,439,277.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-19,632,102.04	-26,661,936.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	18,862.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,467,047.90	3,203,797.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	34,154,513.87	-98,500,924.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		1,646,384.95	2,222,769.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,001,257.50	1,459,066.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	200,251.56	291,813.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	133,874.92	177,710.85

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	311,000.97	294,178.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,356,142.17	-124,135,664.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,356,142.17	-124,135,664.23

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成深证成份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）	620,543,637.48	-185,390,330.30	435,153,307.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,356,142.17	15,356,142.17
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）	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
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）	533,712,434.95	-144,998,114.93	388,714,320.02
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）	885,607,308.57	-121,887,414.53	763,719,894.04
二、本期经营活动产生的	-	-124,135,664.23	-124,135,664.23

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-105,111,455.76	31,189,839.14	-73,921,616.62
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-105,111,455.76	31,189,839.14	-73,921,616.62
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）	780,495,852.81	-214,833,239.62	565,662,613.19

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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	5,256,360.92
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,256,360.92

#### 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	433,570,492.10	383,870,785.77	-49,699,706.33
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	433,570,492.10	383,870,785.77	-49,699,706.33

**6.4.3.3 衍生金融资产/负债**

无。

**6.4.3.4 买入返售金融资产**

无。

**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	885.34
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	5.50
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	1.26
合计	892.10

**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	5,266.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,266.82

**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
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	210,750.97
合计	260,750.97

**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	40,735,342.00	620,543,637.48
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-5,700,000.00	-86,831,202.53
本期末	35,035,342.00	533,712,434.95

**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	-186,039,686.78	649,356.48	-185,390,330.30
本期利润	-18,798,371.70	34,154,513.87	15,356,142.17
本期基金份额交易产生的变动数	28,233,150.84	-3,197,077.64	25,036,073.20
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	28,233,150.84	-3,197,077.64	25,036,073.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-176,604,907.64	31,606,792.71	-144,998,114.93

**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
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	537.32
其他	45.61
合计	13,067.39

**6.4.3.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-8,410,294.32
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-19,632,102.04

**6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	47,688,696.72
减：卖出股票成本总额	58,910,504.44
买卖股票差价收入	-11,221,807.72

**6.4.3.12.2 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	61,795,129.33
减：现金支付赎回款总额	3,682,124.33
减：赎回股票成本总额	66,523,299.32
赎回差价收入	-8,410,294.32

**6.4.3.13 债券投资收益**

无。

**6.4.3.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.3.15 衍生工具收益**

无。

**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	2,467,047.90
合计	2,467,047.90

**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	34,154,513.87
——股票投资	34,154,513.87
——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	34,154,513.87

#### 6.4.3.18 其他收入

无。

#### 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	133,874.92
银行间市场交易费用	-
合计	133,874.92

#### 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	32,232.48
信息披露费	148,765.71
其他	100.00
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	150.00
指数使用费	100,000.00
合计	311,000.97

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，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

截至财务报表报出日，本基金并无须做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

本基金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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	10,941,368.78	12.48%	119,619,411.35	100.00%

###### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	149,308.00	100.00%

###### 6.4.6.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.6.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
光大证券	9,971.83	12.48%	5,266.82	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
光大证券	109,012.17	100.00%	65,994.23	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,001,257.50
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% ÷ 当年天数。

**6.4.6.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	200,251.56	291,813.27

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% ÷ 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

无。

#### 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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
中国农业银行	5,256,360.92	12,484.46	8,128,371.67	25,254.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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
300104	乐视网	2017年4月17日	重大事项	30.68	-	-	76,000	3,469,590.63	2,331,680.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	537,800	2,709,647.01	1,844,654.00	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事项	6.54	2017年7月5日	5.92	204,300	1,369,191.66	1,336,122.00	-

300088	长信科技	2016年9月12日	重大事件	15.75	2017年8月9日	14.50	83,300	976,666.63	1,311,975.00	-
002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事件	20.24	-	-	58,720	1,355,825.28	1,188,492.80	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事件	8.27	-	-	142,500	2,284,274.96	1,178,475.00	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大事件	24.93	-	-	46,100	2,040,424.80	1,149,273.00	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事件	16.12	-	-	64,600	738,373.56	1,041,352.00	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事件	7.68	-	-	133,900	1,323,124.71	1,028,352.00	-
002168	深圳惠程	2017年1月23日	重大事件	16.99	-	-	57,200	705,693.07	971,828.00	-
000887	中鼎股份	2017年4月27日	重大事件	22.09	2017年7月14日	19.88	40,800	995,532.56	901,272.00	-
002049	紫光国芯	2017年2月20日	重大事件	30.82	2017年7月17日	27.74	27,000	1,126,623.62	832,140.00	-
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事件	23.36	-	-	28,500	860,384.97	665,760.00	-
300367	东方网力	2016年12月15日	重大事件	20.00	2017年7月3日	18.01	32,462	665,097.50	649,240.00	-

002013	中航机电	2017年5月12日	重大事件	10.33	2017年8月2日	11.36	57,375	764,829.41	592,683.75	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事件	24.95	2017年7月4日	22.46	22,670	732,807.36	565,616.50	-
000034	神州数码	2017年3月21日	重大事件	24.45	2017年7月18日	22.01	20,500	453,747.69	501,225.00	-
300271	华宇软件	2017年6月22日	重大事件	16.59	2017年7月4日	16.80	30,031	719,609.36	498,214.29	-
300267	尔康制药	2017年5月10日	重大事件	11.46	-	-	43,400	711,717.72	497,364.00	-
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事件	25.06	2017年7月7日	22.54	19,700	603,577.03	493,682.00	-
300291	华录百纳	2017年4月19日	重大事件	20.02	-	-	24,000	726,701.40	480,480.00	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事件	20.23	-	-	23,180	538,879.39	468,931.40	-
000061	农产品	2017年6月28日	重大事件	9.06	-	-	47,732	744,828.88	432,451.92	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事件	3.50	-	-	118,430	493,544.08	414,505.00	-
002600	江粉磁材	2017年2月27日	重大事件	11.46	2017年8月9日	6.25	35,100	368,277.97	402,246.00	-

300364	中文在线	2017年2月13日	重大事件	37.28	-	-	10,400	544,019.71	387,712.00	-
300098	高新兴	2017年6月22日	重大事件	12.90	2017年7月3日	13.18	29,900	482,826.69	385,710.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事件	8.70	2017年8月14日	9.57	42,900	466,807.94	373,230.00	-
300075	数字政通	2017年6月29日	重大事件	20.94	2017年7月17日	18.86	16,600	506,731.61	347,604.00	-
002358	森源电气	2017年5月12日	重大事件	17.02	2017年7月12日	16.68	20,100	459,384.80	342,102.00	-
000693	*ST华泽	2016年3月1日	重大事件	12.50	-	-	26,800	517,816.87	335,000.00	-
300085	银之杰	2017年6月30日	重大事件	18.50	2017年7月7日	18.88	17,777	727,076.60	328,874.50	-
002625	光启技术	2017年4月13日	重大事件	36.36	-	-	8,700	429,062.86	316,332.00	-
000099	中信海直	2017年5月4日	重大事件	11.26	-	-	27,100	549,055.97	305,146.00	-
300413	快乐购	2017年4月5日	重大事件	20.29	-	-	14,900	487,630.17	302,321.00	-
002143	印纪传媒	2017年4月18日	重大事件	24.93	-	-	12,100	385,776.47	301,653.00	-

002610	爱康科技	2017年5月12日	重大事项	2.44	2017年8月2日	2.44	123,000	403,421.56	300,120.00	-
002010	传化智联	2017年6月30日	重大事项	15.26	2017年7月4日	16.77	18,700	361,608.05	285,362.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项	12.59	2017年7月3日	12.70	22,300	380,732.55	280,757.00	-
002619	巨龙管业	2017年5月24日	重大事项	6.37	-	-	24,120	233,155.56	153,644.40	-

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

本基金本报告期末无从事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

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上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(如流动性不足等)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，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 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、结算备付金、债券投资等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,256,360.92	-	-	-	5,256,360.92
结算备付金	10,653.07	-	-	-	10,653.07
存出保证金	3,007.14	-	-	-	3,007.14
交易性金融资产	-	-	-	383,870,785.77	383,870,785.77
应收证券清算款	-	-	-	26,190.14	26,190.14
应收利息	-	-	-	892.10	892.10
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	5,270,021.13	-	-	383,897,868.01	389,167,889.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	156,292.77	156,292.77
应付托管费	-	-	-	31,258.56	31,258.56
应付交易费用	-	-	-	5,266.82	5,266.82
其他负债	-	-	-	260,750.97	260,750.97
负债总计	-	-	-	453,569.12	453,569.12
利率敏感度缺口	5,270,021.13	-	-	383,444,298.89	388,714,320.02
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2016 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,117,850.66	-	-	-	4,117,850.66
结算备付金	4,794.28	-	-	-	4,794.28
存出保证金	13,736.64	-	-	-	13,736.64
交易性金融资产	-	-	-	431,449,359.25	431,449,359.25
应收利息	-	-	-	842.50	842.50
资产总计	4,136,381.58	-	-	431,450,201.75	435,586,583.33
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	190,230.13	190,230.13
应付托管费	-	-	-	38,046.02	38,046.02
其他负债	-	-	-	205,000.00	205,000.00
负债总计	-	-	-	433,276.15	433,276.15
利率敏感度缺口	4,136,381.58	-	-	431,016,925.60	435,153,307.18

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)，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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	383,870,785.77	98.75	431,449,359.25	99.15
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	383,870,785.77	98.75	431,449,359.25	99.15

## 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：人民币万元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1.业绩比较基准上升5%	增加约 1,921	增加约 2,095
	2.业绩比较基准下降5%	减少约 1,921	减少约 2,095

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管

理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	383,870,785.77	98.64
	其中：股票	383,870,785.77	98.64
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	5,267,013.99	1.35
7	其他各项资产	30,089.38	0.01
8	合计	389,167,889.14	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	9,004,598.76	2.32
B	采矿业	4,897,219.29	1.26
C	制造业	237,521,126.02	61.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,300,532.61	1.36
E	建筑业	7,714,046.02	1.98
F	批发和零售业	9,550,873.20	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,702,608.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,785,616.58	10.49
J	金融业	23,853,006.72	6.14
K	房地产业	19,647,959.33	5.05
L	租赁和商务服务业	5,376,743.65	1.38
M	科学研究和技术服务业	350,028.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	7,359,599.66	1.89
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	3,015,140.12	0.78
R	文化、体育和娱乐业	6,739,012.10	1.73
S	综合	978,566.40	0.25

合计	383,796,676.46	98.73
----	----------------	-------

### 7.2.2 期末积极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	-	0.00
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	66,469.69	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
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	-	0.00
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	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	74,109.31	0.02

### 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	000651	格力电器	299,200	12,318,064.00	3.17
2	000333	美的集团	279,750	12,040,440.00	3.10
3	000725	京东方 A	1,597,900	6,647,264.00	1.71
4	000858	五粮液	116,300	6,473,258.00	1.67
5	000002	万科 A	258,800	6,462,236.00	1.66

6	002415	海康威视	186,025	6,008,607.50	1.55
7	300498	温氏股份	228,104	5,346,757.76	1.38
8	000001	平安银行	530,200	4,978,578.00	1.28
9	000063	中兴通讯	148,600	3,527,764.00	0.91
10	002450	康得新	150,810	3,396,241.20	0.87
11	000776	广发证券	190,400	3,284,400.00	0.84
12	002304	洋河股份	34,762	3,017,689.22	0.78
13	002024	苏宁云商	241,100	2,712,375.00	0.70
14	001979	招商蛇口	122,701	2,620,893.36	0.67
15	000538	云南白药	27,900	2,618,415.00	0.67
16	002230	科大讯飞	60,250	2,403,975.00	0.62
17	000423	东阿阿胶	32,700	2,350,803.00	0.60
18	300104	乐视网	76,000	2,331,680.00	0.60
19	000166	申万宏源	403,360	2,258,816.00	0.58
20	000568	泸州老窖	44,600	2,255,868.00	0.58
21	002456	欧菲光	121,300	2,204,021.00	0.57
22	002466	天齐锂业	40,480	2,200,088.00	0.57
23	002142	宁波银行	110,860	2,139,598.00	0.55
24	002236	大华股份	93,300	2,128,173.00	0.55
25	000783	长江证券	223,200	2,113,704.00	0.54
26	002241	歌尔股份	109,600	2,113,088.00	0.54
27	000069	华侨城 A	202,600	2,038,156.00	0.52
28	300072	三聚环保	54,267	2,010,592.35	0.52
29	000338	潍柴动力	150,500	1,986,600.00	0.51
30	000413	东旭光电	176,900	1,984,818.00	0.51
31	300059	东方财富	163,056	1,959,933.12	0.50
32	000625	长安汽车	134,688	1,942,200.96	0.50
33	002008	大族激光	53,800	1,863,632.00	0.48
34	000100	TCL 集团	537,800	1,844,654.00	0.47
35	300070	碧水源	98,414	1,835,421.10	0.47
36	300136	信维通信	44,020	1,761,680.40	0.45
37	002594	比亚迪	34,900	1,743,255.00	0.45
38	002673	西部证券	121,866	1,732,934.52	0.45
39	000839	中信国安	169,700	1,695,303.00	0.44
40	300124	汇川技术	65,194	1,665,054.76	0.43
41	002475	立讯精密	56,550	1,653,522.00	0.43
42	002202	金风科技	104,100	1,610,427.00	0.41
43	000768	中航飞机	83,700	1,543,428.00	0.40
44	002736	国信证券	114,800	1,521,100.00	0.39



45	300024	机器人	77,366	1,508,637.00	0.39
46	000895	双汇发展	61,800	1,467,750.00	0.38
47	002460	赣锋锂业	31,700	1,466,125.00	0.38
48	002739	万达电影	28,600	1,457,742.00	0.38
49	300408	三环集团	68,200	1,431,518.00	0.37
50	000728	国元证券	116,800	1,427,296.00	0.37
51	000963	华东医药	28,586	1,420,724.20	0.37
52	002572	索菲亚	33,508	1,373,828.00	0.35
53	000157	中联重科	299,600	1,345,204.00	0.35
54	000656	金科股份	204,300	1,336,122.00	0.34
55	300088	长信科技	83,300	1,311,975.00	0.34
56	002065	东华软件	59,800	1,303,042.00	0.34
57	002508	老板电器	29,690	1,290,921.20	0.33
58	002007	华兰生物	34,900	1,273,850.00	0.33
59	000623	吉林敖东	55,420	1,268,563.80	0.33
60	300003	乐普医疗	56,926	1,258,633.86	0.32
61	002044	美年健康	72,600	1,234,200.00	0.32
62	002271	东方雨虹	32,784	1,216,286.40	0.31
63	002085	万丰奥威	62,456	1,214,769.20	0.31
64	000540	中天金融	173,851	1,208,264.45	0.31
65	002310	东方园林	71,900	1,202,168.00	0.31
66	002252	上海莱士	58,720	1,188,492.80	0.31
67	002129	中环股份	142,500	1,178,475.00	0.30
68	000709	河钢股份	280,400	1,174,876.00	0.30
69	300156	神雾环保	35,800	1,172,808.00	0.30
70	000661	长春高新	9,080	1,172,318.80	0.30
71	000826	启迪桑德	32,978	1,158,187.36	0.30
72	000503	海虹控股	46,100	1,149,273.00	0.30
73	000630	铜陵有色	402,600	1,143,384.00	0.29
74	300017	网宿科技	93,952	1,134,000.64	0.29
75	000060	中金岭南	99,200	1,111,040.00	0.29
76	300315	掌趣科技	135,800	1,108,128.00	0.29
77	000066	中国长城	122,704	1,105,563.04	0.28
78	002340	格林美	181,920	1,100,616.00	0.28
79	002465	海格通信	100,500	1,079,370.00	0.28
80	000876	新希望	130,700	1,074,354.00	0.28
81	000425	徐工机械	279,700	1,048,875.00	0.27
82	002075	沙钢股份	64,600	1,041,352.00	0.27
83	000750	国海证券	188,350	1,035,925.00	0.27

84	002405	四维图新	52,300	1,033,448.00	0.27
85	002426	胜利精密	133,900	1,028,352.00	0.26
86	000559	万向钱潮	93,128	989,019.36	0.25
87	000009	中国宝安	120,960	978,566.40	0.25
88	002168	深圳惠程	57,200	971,828.00	0.25
89	000997	新大陆	42,450	963,190.50	0.25
90	300115	长盈精密	32,780	956,520.40	0.25
91	300266	兴源环境	30,990	952,012.80	0.24
92	000402	金融街	80,800	946,976.00	0.24
93	002081	金螳螂	86,163	946,069.74	0.24
94	000686	东北证券	93,720	941,886.00	0.24
95	000581	威孚高科	36,200	937,580.00	0.24
96	000039	中集集团	52,000	937,560.00	0.24
97	000778	新兴铸管	138,700	929,290.00	0.24
98	000998	隆平高科	41,800	920,436.00	0.24
99	300296	利亚德	48,600	913,680.00	0.24
100	002074	国轩高科	28,900	911,795.00	0.23
101	000887	中鼎股份	40,800	901,272.00	0.23
102	000983	西山煤电	99,800	875,246.00	0.23
103	002092	中泰化学	68,600	871,220.00	0.22
104	002385	大北农	135,750	853,867.50	0.22
105	000786	北新建材	53,600	849,024.00	0.22
106	002050	三花智控	51,700	843,744.00	0.22
107	000970	中科三环	57,000	842,460.00	0.22
108	000917	电广传媒	74,100	837,330.00	0.22
109	002049	紫光国芯	27,000	832,140.00	0.21
110	300144	宋城演艺	39,673	827,975.51	0.21
111	300027	华谊兄弟	101,931	824,621.79	0.21
112	002183	怡亚通	92,800	800,864.00	0.21
113	002027	分众传媒	57,900	796,704.00	0.20
114	000999	华润三九	24,982	793,178.50	0.20
115	000050	深天马A	38,500	791,945.00	0.20
116	002038	双鹭药业	26,967	786,088.05	0.20
117	002311	海大集团	42,680	779,763.60	0.20
118	002407	多氟多	35,400	778,446.00	0.20
119	300033	同花顺	12,500	777,625.00	0.20
120	002500	山西证券	80,900	775,022.00	0.20
121	300142	沃森生物	62,000	766,320.00	0.20
122	002185	华天科技	105,680	765,123.20	0.20

123	002366	台海核电	16,300	764,633.00	0.20
124	000415	渤海金控	113,400	763,182.00	0.20
125	002410	广联达	40,400	759,520.00	0.20
126	002179	中航光电	24,270	756,981.30	0.19
127	002294	信立泰	21,100	752,426.00	0.19
128	002573	清新环境	39,800	749,036.00	0.19
129	002146	荣盛发展	75,700	747,159.00	0.19
130	300015	爱尔眼科	31,950	743,157.00	0.19
131	000400	许继电气	40,600	729,176.00	0.19
132	000488	晨鸣纸业	56,500	728,850.00	0.19
133	002422	科伦药业	43,500	718,620.00	0.18
134	002195	二三四五	100,170	716,215.50	0.18
135	300055	万邦达	38,390	706,376.00	0.18
136	002470	金正大	93,356	702,970.68	0.18
137	000566	海南海药	52,926	701,798.76	0.18
138	000878	云南铜业	53,200	701,708.00	0.18
139	002030	达安基因	32,138	700,287.02	0.18
140	000960	锡业股份	51,221	697,117.81	0.18
141	002223	鱼跃医疗	29,430	696,902.40	0.18
142	300168	万达信息	46,900	682,395.00	0.18
143	002273	水晶光电	33,050	681,821.50	0.18
144	000028	国药一致	8,400	679,560.00	0.17
145	000598	兴蓉环境	120,900	679,458.00	0.17
146	300058	蓝色光标	86,719	678,142.58	0.17
147	300159	新研股份	50,700	671,268.00	0.17
148	000977	浪潮信息	38,700	670,284.00	0.17
149	300383	光环新网	49,400	669,864.00	0.17
150	300134	大富科技	28,500	665,760.00	0.17
151	002583	海能达	41,120	661,620.80	0.17
152	300418	昆仑万维	28,900	660,943.00	0.17
153	000547	航天发展	63,200	660,440.00	0.17
154	002384	东山精密	26,600	657,020.00	0.17
155	002051	中工国际	31,656	656,228.88	0.17
156	002400	省广股份	81,385	653,521.55	0.17
157	300146	汤臣倍健	47,400	651,276.00	0.17
158	300367	东方网力	32,462	649,240.00	0.17
159	000046	泛海控股	74,300	648,639.00	0.17
160	000883	湖北能源	128,700	646,074.00	0.17
161	002138	顺络电子	34,600	642,868.00	0.17

162	000671	阳光城	109,400	636,708.00	0.16
163	002217	合力泰	64,200	634,296.00	0.16
164	300113	顺网科技	23,370	628,653.00	0.16
165	000825	太钢不锈	144,400	628,140.00	0.16
166	002439	启明星辰	33,700	626,820.00	0.16
167	300355	蒙草生态	58,360	626,786.40	0.16
168	000792	盐湖股份	59,787	624,774.15	0.16
169	002108	沧州明珠	46,292	617,998.20	0.16
170	002001	新和成	31,750	616,267.50	0.16
171	002004	华邦健康	78,400	613,872.00	0.16
172	000930	中粮生化	56,600	610,148.00	0.16
173	300244	迪安诊断	19,372	609,443.12	0.16
174	002019	亿帆医药	36,300	605,484.00	0.16
175	000988	华工科技	41,300	602,567.00	0.16
176	000697	炼石有色	29,300	599,771.00	0.15
177	000513	丽珠集团	8,750	595,875.00	0.15
178	002013	中航机电	57,375	592,683.75	0.15
179	002491	通鼎互联	44,000	591,360.00	0.15
180	300197	铁汉生态	44,330	588,702.40	0.15
181	000078	海王生物	97,450	587,623.50	0.15
182	002343	慈文传媒	15,500	586,830.00	0.15
183	000059	华锦股份	58,400	584,584.00	0.15
184	000938	紫光股份	9,500	580,640.00	0.15
185	002640	跨境通	27,300	580,125.00	0.15
186	000627	天茂集团	71,700	579,336.00	0.15
187	000089	深圳机场	61,800	577,830.00	0.15
188	002635	安洁科技	15,950	577,709.00	0.15
189	002714	牧原股份	21,200	577,064.00	0.15
190	000758	中色股份	81,200	569,212.00	0.15
191	002431	棕榈股份	51,450	566,979.00	0.15
192	002221	东华能源	51,900	566,229.00	0.15
193	002025	航天电器	22,670	565,616.50	0.15
194	002078	太阳纸业	76,700	563,745.00	0.15
195	000738	航发控制	28,800	563,616.00	0.14
196	002555	三七互娱	22,000	562,540.00	0.14
197	002152	广电运通	67,350	559,678.50	0.14
198	000732	泰禾集团	33,500	558,780.00	0.14
199	000729	燕京啤酒	83,000	557,760.00	0.14
200	300002	神州泰岳	66,718	556,428.12	0.14

201	002176	江特电机	63,620	554,766.40	0.14
202	000979	中弘股份	211,600	554,392.00	0.14
203	000516	国际医学	99,200	552,544.00	0.14
204	300122	智飞生物	28,900	552,279.00	0.14
205	002250	联化科技	38,500	550,550.00	0.14
206	000939	凯迪生态	107,788	549,718.80	0.14
207	002131	利欧股份	166,950	549,265.50	0.14
208	300324	旋极信息	30,000	547,200.00	0.14
209	002048	宁波华翔	26,200	546,532.00	0.14
210	000006	深振业 A	62,027	546,457.87	0.14
211	000008	神州高铁	74,900	545,272.00	0.14
212	300014	亿纬锂能	30,036	545,153.40	0.14
213	000806	银河生物	40,358	544,833.00	0.14
214	002292	奥飞娱乐	32,200	544,180.00	0.14
215	300253	卫宁健康	69,252	540,858.12	0.14
216	002701	奥瑞金	84,400	539,316.00	0.14
217	000800	一汽轿车	52,700	535,959.00	0.14
218	002191	劲嘉股份	57,100	534,456.00	0.14
219	300203	聚光科技	19,000	534,280.00	0.14
220	002424	贵州百灵	28,200	531,852.00	0.14
221	000592	平潭发展	96,300	531,576.00	0.14
222	002373	千方科技	38,900	530,596.00	0.14
223	002501	利源精制	46,400	527,568.00	0.14
224	002665	首航节能	73,110	526,392.00	0.14
225	002624	完美世界	15,200	521,360.00	0.13
226	000031	中粮地产	68,700	517,311.00	0.13
227	300077	国民技术	37,700	516,113.00	0.13
228	000012	南玻 A	55,100	514,083.00	0.13
229	002589	瑞康医药	32,880	506,352.00	0.13
230	300166	东方国信	37,639	505,491.77	0.13
231	002353	杰瑞股份	31,900	504,658.00	0.13
232	300274	阳光电源	45,480	504,373.20	0.13
233	000712	锦龙股份	30,800	504,196.00	0.13
234	000898	鞍钢股份	88,955	503,485.30	0.13
235	000027	深圳能源	74,700	502,731.00	0.13
236	300433	蓝思科技	17,240	501,511.60	0.13
237	000034	神州数码	20,500	501,225.00	0.13
238	000860	顺鑫农业	25,000	500,250.00	0.13
239	000690	宝新能源	83,500	499,330.00	0.13

240	300271	华宇软件	30,031	498,214.29	0.13
241	300182	捷成股份	52,034	497,445.04	0.13
242	002411	必康股份	17,200	497,424.00	0.13
243	300267	尔康制药	43,400	497,364.00	0.13
244	300090	盛运环保	52,500	497,175.00	0.13
245	300251	光线传媒	60,380	494,512.20	0.13
246	002642	荣之联	19,700	493,682.00	0.13
247	000600	建投能源	40,100	492,027.00	0.13
248	300133	华策影视	43,684	489,260.80	0.13
249	000518	四环生物	63,500	485,775.00	0.12
250	000807	云铝股份	67,200	485,184.00	0.12
251	002368	太极股份	17,508	484,796.52	0.12
252	002444	巨星科技	31,100	484,538.00	0.12
253	002477	雏鹰农牧	109,300	484,199.00	0.12
254	002002	鸿达兴业	61,561	482,022.63	0.12
255	000727	华东科技	170,000	481,100.00	0.12
256	300291	华录百纳	24,000	480,480.00	0.12
257	002153	石基信息	20,992	477,148.16	0.12
258	000519	中兵红箭	37,779	476,015.40	0.12
259	300026	红日药业	101,000	475,710.00	0.12
260	300068	南都电源	28,200	474,888.00	0.12
261	002544	杰赛科技	20,823	474,764.40	0.12
262	300257	开山股份	22,400	472,192.00	0.12
263	300079	数码视讯	80,400	470,340.00	0.12
264	002174	游族网络	14,800	470,048.00	0.12
265	002399	海普瑞	23,180	468,931.40	0.12
266	002522	浙江众成	28,600	467,610.00	0.12
267	002570	贝因美	34,200	465,120.00	0.12
268	002022	科华生物	26,700	463,779.00	0.12
269	002266	浙富控股	94,940	463,307.20	0.12
270	000088	盐田港	44,000	462,440.00	0.12
271	300001	特锐德	27,500	460,900.00	0.12
272	000156	华数传媒	30,800	459,228.00	0.12
273	002630	华西能源	39,300	455,487.00	0.12
274	000158	常山股份	28,500	450,300.00	0.12
275	002043	兔宝宝	32,450	449,108.00	0.12
276	000926	福星股份	36,800	448,960.00	0.12
277	002390	信邦制药	51,500	448,565.00	0.12
278	002603	以岭药业	25,603	447,028.38	0.12

279	002672	东江环保	26,450	446,740.50	0.11
280	000667	美好置业	134,400	444,864.00	0.11
281	300207	欣旺达	37,700	444,483.00	0.11
282	300199	翰宇药业	28,900	443,326.00	0.11
283	002244	滨江集团	63,900	442,188.00	0.11
284	002643	万润股份	29,900	441,324.00	0.11
285	002104	恒宝股份	46,700	438,513.00	0.11
286	300020	银江股份	31,672	438,340.48	0.11
287	000685	中山公用	40,000	438,000.00	0.11
288	002281	光迅科技	19,700	437,734.00	0.11
289	002261	拓维信息	37,300	436,783.00	0.11
290	002602	世纪华通	12,039	436,534.14	0.11
291	000829	天音控股	40,300	435,240.00	0.11
292	002155	湖南黄金	45,400	434,478.00	0.11
293	002285	世联行	54,140	434,202.80	0.11
294	000061	农产品	47,732	432,451.92	0.11
295	002440	闰土股份	28,300	431,858.00	0.11
296	300287	飞利信	47,000	431,460.00	0.11
297	000687	华讯方舟	28,400	429,976.00	0.11
298	002018	华信国际	62,610	428,878.50	0.11
299	002421	达实智能	70,070	428,828.40	0.11
300	300347	泰格医药	17,700	428,340.00	0.11
301	300294	博雅生物	10,350	426,834.00	0.11
302	000021	深科技	49,666	426,134.28	0.11
303	002268	卫士通	25,260	424,873.20	0.11
304	300170	汉得信息	40,900	421,679.00	0.11
305	002036	联创电子	25,500	420,750.00	0.11
306	002595	豪迈科技	18,900	420,147.00	0.11
307	000601	韶能股份	58,700	418,531.00	0.11
308	000937	冀中能源	68,190	417,322.80	0.11
309	002023	海特高新	40,400	414,908.00	0.11
310	002489	浙江永强	65,000	414,700.00	0.11
311	002505	大康农业	118,430	414,505.00	0.11
312	000766	通化金马	25,900	413,882.00	0.11
313	002299	圣农发展	27,800	413,386.00	0.11
314	300516	久之洋	6,500	412,685.00	0.11
315	000718	苏宁环球	70,209	411,424.74	0.11
316	300216	千山药机	16,800	410,760.00	0.11
317	002280	联络互动	37,750	410,720.00	0.11

318	000961	中南建设	62,950	410,434.00	0.11
319	000975	银泰资源	32,401	409,224.63	0.11
320	000587	金洲慈航	27,400	408,260.00	0.11
321	300118	东方日升	28,900	406,045.00	0.10
322	300009	安科生物	24,660	404,670.60	0.10
323	002047	宝鹰股份	46,700	403,488.00	0.10
324	002709	天赐材料	9,800	403,466.00	0.10
325	002600	江粉磁材	35,100	402,246.00	0.10
326	000959	首钢股份	57,400	401,226.00	0.10
327	000543	皖能电力	68,650	400,229.50	0.10
328	002089	新海宜	59,100	400,107.00	0.10
329	000901	航天科技	14,700	399,252.00	0.10
330	000049	德赛电池	7,700	398,937.00	0.10
331	300273	和佳股份	32,800	398,848.00	0.10
332	000848	承德露露	39,700	396,206.00	0.10
333	300185	通裕重工	151,700	395,937.00	0.10
334	300053	欧比特	29,400	395,430.00	0.10
335	000882	华联股份	109,400	394,934.00	0.10
336	002517	恺英网络	11,200	394,128.00	0.10
337	300073	当升科技	15,800	394,052.00	0.10
338	002375	亚厦股份	43,700	389,367.00	0.10
339	002396	星网锐捷	20,100	388,935.00	0.10
340	300364	中文在线	10,400	387,712.00	0.10
341	000973	佛塑科技	50,200	387,544.00	0.10
342	002326	永太科技	27,900	386,694.00	0.10
343	300431	暴风集团	16,221	386,546.43	0.10
344	300098	高新兴	29,900	385,710.00	0.10
345	002145	中核钛白	63,400	385,472.00	0.10
346	002276	万马股份	38,000	383,420.00	0.10
347	002056	横店东磁	51,000	382,500.00	0.10
348	002055	得润电子	16,800	381,864.00	0.10
349	000777	中核科技	19,100	381,236.00	0.10
350	000090	天健集团	34,320	380,952.00	0.10
351	002716	金贵银业	19,800	379,962.00	0.10
352	002123	梦网荣信	34,000	377,740.00	0.10
353	002308	威创股份	28,900	377,145.00	0.10
354	002354	天神娱乐	17,520	376,680.00	0.10
355	000762	西藏矿业	26,558	376,326.86	0.10
356	002325	洪涛股份	51,400	375,220.00	0.10



357	002128	露天煤业	42,900	373,230.00	0.10
358	002151	北斗星通	13,350	373,132.50	0.10
359	300116	坚瑞沃能	34,700	373,025.00	0.10
360	000875	吉电股份	73,700	372,185.00	0.10
361	300083	劲胜精密	40,100	370,524.00	0.10
362	002067	景兴纸业	63,099	370,391.13	0.10
363	300352	北信源	63,875	368,558.75	0.09
364	002437	誉衡药业	50,600	368,368.00	0.09
365	002512	达华智能	22,800	368,220.00	0.09
366	002130	沃尔核材	57,100	367,153.00	0.09
367	000751	锌业股份	74,700	366,777.00	0.09
368	000620	新华联	51,401	365,461.11	0.09
369	000902	新洋丰	40,402	363,618.00	0.09
370	300010	立思辰	27,961	362,094.95	0.09
371	001696	宗申动力	47,600	360,332.00	0.09
372	000801	四川九洲	37,600	359,832.00	0.09
373	002237	恒邦股份	34,100	357,709.00	0.09
374	002245	澳洋顺昌	39,600	357,192.00	0.09
375	300222	科大智能	15,700	356,233.00	0.09
376	300496	中科创达	12,500	353,750.00	0.09
377	000541	佛山照明	38,750	353,012.50	0.09
378	002106	莱宝高科	34,725	351,764.25	0.09
379	300012	华测检测	75,600	350,028.00	0.09
380	002121	科陆电子	40,700	350,020.00	0.09
381	300075	数字政通	16,600	347,604.00	0.09
382	300096	易联众	25,400	347,472.00	0.09
383	002663	普邦股份	63,400	344,262.00	0.09
384	002463	沪电股份	75,400	343,070.00	0.09
385	002031	巨轮智能	110,300	343,033.00	0.09
386	002073	软控股份	40,400	342,592.00	0.09
387	002358	森源电气	20,100	342,102.00	0.09
388	000650	仁和药业	56,500	337,870.00	0.09
389	002482	广田集团	37,300	335,327.00	0.09
390	000693	*ST 华泽	26,800	335,000.00	0.09
391	002773	康弘药业	6,400	334,720.00	0.09
392	300238	冠昊生物	13,200	334,620.00	0.09
393	000733	振华科技	21,000	333,900.00	0.09
394	000563	陕国投 A	64,500	333,465.00	0.09
395	002657	中科金财	11,500	333,385.00	0.09

396	300078	思创医惠	30,920	331,771.60	0.09
397	300212	易华录	13,100	330,513.00	0.09
398	002481	双塔食品	49,400	329,498.00	0.08
399	300101	振芯科技	23,500	329,000.00	0.08
400	300085	银之杰	17,777	328,874.50	0.08
401	002668	奥马电器	16,620	327,414.00	0.08
402	002428	云南锗业	30,600	326,808.00	0.08
403	002156	通富微电	32,100	326,778.00	0.08
404	002303	美盈森	42,200	325,784.00	0.08
405	002099	海翔药业	48,800	325,008.00	0.08
406	300036	超图软件	19,800	323,730.00	0.08
407	002413	雷科防务	28,600	320,320.00	0.08
408	002224	三力士	28,800	319,680.00	0.08
409	000426	兴业矿业	35,300	318,406.00	0.08
410	002429	兆驰股份	103,700	318,359.00	0.08
411	000558	莱茵体育	41,700	316,920.00	0.08
412	002041	登海种业	23,900	316,675.00	0.08
413	002625	光启技术	8,700	316,332.00	0.08
414	002242	九阳股份	16,000	314,720.00	0.08
415	002474	榕基软件	28,900	313,565.00	0.08
416	002005	德豪润达	65,700	313,389.00	0.08
417	300310	宜通世纪	23,660	312,785.20	0.08
418	000969	安泰科技	35,600	310,788.00	0.08
419	000062	深圳华强	11,700	310,401.00	0.08
420	300147	香雪制药	30,060	308,716.20	0.08
421	002190	成飞集成	11,500	308,200.00	0.08
422	000099	中信海直	27,100	305,146.00	0.08
423	002690	美亚光电	15,800	303,044.00	0.08
424	300413	快乐购	14,900	302,321.00	0.08
425	000539	粤电力 A	56,707	302,248.31	0.08
426	002143	印纪传媒	12,100	301,653.00	0.08
427	002550	千红制药	50,600	300,564.00	0.08
428	002610	爱康科技	123,000	300,120.00	0.08
429	300228	富瑞特装	26,640	299,966.40	0.08
430	002063	远光软件	28,774	299,825.08	0.08
431	002284	亚太股份	27,000	299,700.00	0.08
432	002180	纳思达	12,300	297,168.00	0.08
433	002329	皇氏集团	30,700	295,027.00	0.08
434	300377	赢时胜	25,850	294,431.50	0.08

435	002467	二六三	36,800	291,456.00	0.07
436	000957	中通客车	24,900	291,330.00	0.07
437	000851	高鸿股份	32,000	290,880.00	0.07
438	002161	远望谷	35,900	290,790.00	0.07
439	300292	吴通控股	42,900	290,433.00	0.07
440	300043	星辉娱乐	35,200	288,992.00	0.07
441	002563	森马服饰	33,800	286,624.00	0.07
442	002318	久立特材	34,950	285,891.00	0.07
443	002010	传化智联	18,700	285,362.00	0.07
444	300011	鼎汉技术	17,700	283,200.00	0.07
445	002498	汉缆股份	77,300	282,918.00	0.07
446	300037	新宙邦	12,300	282,654.00	0.07
447	002681	奋达科技	22,300	280,757.00	0.07
448	300032	金龙机电	20,100	280,395.00	0.07
449	000869	张裕 A	7,400	275,280.00	0.07
450	000869	张裕 A	7,400	275,280.00	0.07
451	002471	中超控股	55,900	273,351.00	0.07
452	002371	北方华创	11,400	272,688.00	0.07
453	002695	煌上煌	12,700	271,272.00	0.07
454	300336	新文化	17,530	271,013.80	0.07
455	002052	同洲电子	42,710	270,781.40	0.07
456	002249	大洋电机	40,900	269,122.00	0.07
457	300202	聚龙股份	16,200	267,624.00	0.07
458	300458	全志科技	9,923	261,371.82	0.07
459	002095	生意宝	7,540	260,582.40	0.07
460	300188	美亚柏科	14,883	257,327.07	0.07
461	002721	金一文化	17,100	255,303.00	0.07
462	000555	神州信息	15,200	253,840.00	0.07
463	300339	润和软件	19,600	246,960.00	0.06
464	300178	腾邦国际	19,132	244,889.60	0.06
465	002751	易尚展示	6,500	240,825.00	0.06
466	002699	美盛文化	17,420	240,396.00	0.06
467	002445	中南文化	18,600	239,010.00	0.06
468	002588	史丹利	31,000	238,390.00	0.06
469	300359	全通教育	18,200	237,874.00	0.06
470	002631	德尔未来	16,000	235,680.00	0.06
471	002414	高德红外	12,839	234,953.70	0.06
472	300221	银禧科技	16,800	233,520.00	0.06
473	002298	中电鑫龙	21,300	231,531.00	0.06

474	300432	富临精工	9,600	229,440.00	0.06
475	002493	荣盛石化	23,500	229,360.00	0.06
476	002157	正邦科技	50,100	227,955.00	0.06
477	002717	岭南园林	8,500	227,800.00	0.06
478	002797	第一创业	24,620	226,750.20	0.06
479	300474	景嘉微	6,400	226,560.00	0.06
480	002488	金固股份	19,200	222,144.00	0.06
481	000810	创维数字	18,300	221,979.00	0.06
482	000681	视觉中国	14,000	219,240.00	0.06
483	002197	证通电子	17,400	218,544.00	0.06
484	000795	英洛华	34,800	216,108.00	0.06
485	002229	鸿博股份	18,800	210,560.00	0.05
486	002416	爱施德	19,500	210,405.00	0.05
487	000987	越秀金控	17,650	205,269.50	0.05
488	002568	百润股份	12,000	199,440.00	0.05
489	300191	潜能恒信	7,100	189,002.00	0.05
490	300506	名家汇	6,400	180,672.00	0.05
491	300369	绿盟科技	15,999	176,948.94	0.05
492	002703	浙江世宝	6,400	175,296.00	0.05
493	300386	飞天诚信	9,700	172,563.00	0.04
494	002432	九安医疗	14,900	171,797.00	0.04
495	002577	雷柏科技	7,300	167,681.00	0.04
496	300368	汇金股份	10,700	153,866.00	0.04
497	002619	巨龙管业	24,120	153,644.40	0.04
498	002782	可立克	7,300	152,935.00	0.04
499	002653	海思科	11,416	148,522.16	0.04
500	300512	中亚股份	6,500	131,820.00	0.03
501	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
502	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00

## 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

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	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
2	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
3	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
4	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
5	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00

## 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	300498	温氏股份	6,950,064.60	1.60
2	300516	久之洋	1,685,766.00	0.39
3	000333	美的集团	1,211,506.00	0.28
4	002044	美年健康	1,116,060.98	0.26
5	300296	利亚德	949,505.00	0.22
6	000008	神州高铁	810,474.97	0.19
7	000059	华锦股份	808,377.00	0.19
8	300458	全志科技	730,768.00	0.17
9	000413	东旭光电	690,719.00	0.16
10	002797	第一创业	626,803.00	0.14
11	300185	通裕重工	550,342.00	0.13
12	300118	东方日升	547,352.00	0.13
13	002716	金贵银业	546,285.98	0.13
14	000766	通化金马	531,566.00	0.12
15	002411	必康股份	527,898.00	0.12
16	002624	完美世界	525,402.00	0.12
17	002643	万润股份	514,340.00	0.12
18	002366	台海核电	513,797.00	0.12
19	000034	神州数码	498,015.78	0.11
20	002709	天赐材料	495,686.00	0.11

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 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	000002	万科A	3,305,476.00	0.76
2	300516	久之洋	833,618.00	0.19
3	000538	云南白药	626,327.00	0.14
4	000410	*ST 沈机	617,774.00	0.14
5	002312	*ST 三泰	570,575.00	0.13

6	000816	智慧农业	558,537.00	0.13
7	000651	格力电器	539,523.00	0.12
8	000401	冀东水泥	538,502.32	0.12
9	002028	思源电气	532,618.22	0.12
10	000666	经纬纺机	527,425.00	0.12
11	000616	海航投资	517,866.00	0.12
12	000100	TCL 集团	513,508.00	0.12
13	000572	海马汽车	495,720.00	0.11
14	000830	鲁西化工	474,687.00	0.11
15	000652	泰达股份	474,591.00	0.11
16	000735	罗牛山	458,831.80	0.11
17	000897	津滨发展	458,114.00	0.11
18	000528	柳工	452,025.00	0.10
19	002071	长城影视	450,000.00	0.10
20	002450	康得新	449,732.00	0.10

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	43,700,716.41
卖出股票收入（成交）总额	47,688,696.72

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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未超出基金合同规定的备选股票库。**

**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	3,007.14
2	应收证券清算款	26,190.14
3	应收股利	-
4	应收利息	892.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,089.38

**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**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**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**

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	002879	长缆科技	23,660.26	0.01	新股未流通
2	002882	金龙羽	18,389.20	0.00	新股未流通
3	300670	大烨智能	13,760.87	0.00	新股未流通
4	300672	国科微	10,659.36	0.00	新股未流通
5	300671	富满电子	7,639.62	0.00	新股未流通

**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
9,535	3,674.39	362,712.00	1.04%	34,672,630.00	98.96%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 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	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.57%
2	林莹	197,096.00	0.56%
3	戴济民	196,967.00	0.56%
4	贺雅宁	196,965.00	0.56%
5	寇胜利	196,694.00	0.56%
6	张小丽	183,386.00	0.52%
7	吕君	180,000.00	0.51%
8	靳艳华	140,369.00	0.40%
9	谢元禄	131,444.00	0.38%
10	刘小彦	131,310.00	0.37%

## 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（2015年6月5日）基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	40,735,342.00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	5,700,000.00
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	35,035,342.00

## § 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

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。代为履职职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	76,701,374.71	88.80%	69,899.39	88.80%	-
光大证券	2	10,941,368.78	11.20%	9,971.83	11.20%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-

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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：西藏东财、天风证券、瑞银证券。

本报告期内本基金退租交易单元：长城证券。

### 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理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月17日
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股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月28日

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	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
20	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
21	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
22	大成深证成份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
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18日
24	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
25	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月11日
26	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
27	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
28	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
29	大成深证成份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
30	大成深证成份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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加	中国证监会指定报	2017年2月15日

	汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	刊及本公司网站	
40	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月11日
41	大成深证成份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
42	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2016年2期)-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月20日
43	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2016年2期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月20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公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月17日
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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成深证成份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

备查文件存放于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